

Relazione semestrale (non certificata)

Franklin Templeton
Global Funds Plc

Un fondo multicomparto con separazione
patrimoniale tra i comparti

Per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023

Indice

Informazioni di carattere generale	3
Lettera agli azionisti	16
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	17
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	18
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	28
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	45
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	48
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset US High Yield Fund	53
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset Global High Yield Fund	57
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	60
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	62
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	66
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	71
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	75
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	83
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	92
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	96
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	104
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund	107
Prospetto degli investimenti – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	113
Prospetto degli investimenti – FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	118
Prospetto degli investimenti – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	120
Prospetto degli investimenti – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	124
Prospetto degli investimenti – FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	127
Prospetto degli investimenti – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	129
Prospetto degli investimenti – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	132
Prospetto degli investimenti – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	136
Prospetto degli investimenti – FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	138
Prospetto degli investimenti – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	140
Prospetto degli investimenti – FTGF ClearBridge Value Fund	142
Prospetto degli investimenti – FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	144
Prospetto degli investimenti – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	146
Prospetto degli investimenti – FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	148
Prospetto degli investimenti – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	150
Prospetto degli investimenti – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	152
Prospetto degli investimenti – FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	154
Prospetto degli investimenti – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	155
Prospetto degli investimenti – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	157
Prospetto degli investimenti – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	159
Prospetto degli investimenti – FTGF Royce US Smaller Companies Fund	163
Prospetto degli investimenti – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	165
Prospetto degli investimenti – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	166
Prospetto degli investimenti – Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]	167
Prospetto degli investimenti – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	168
Prospetto degli investimenti – FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	169
Prospetto degli investimenti – FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	170
Prospetto degli investimenti – FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	171
Prospetto degli investimenti – FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	172
Prospetto degli investimenti – FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	173
Prospetto degli investimenti – Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	174
Stato patrimoniale – Franklin Templeton Global Funds Plc	176
Conto economico – Franklin Templeton Global Funds Plc	196
Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – Franklin Templeton Global Funds Plc	206
Nota integrativa al bilancio – Franklin Templeton Global Funds Plc	232
Informazioni supplementari – Total Expense Ratio (TER) – Franklin Templeton Global Funds Plc	251
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	258
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	258
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	258
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	259
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	259
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset US High Yield Fund	260
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset Global High Yield Fund	260
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	260
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	261
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	261
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	261
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	262
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	262
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	262
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	263
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	263
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund	264
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	264
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	264
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	265
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	265

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

Indice – (segue)

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	265
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	266
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	266
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	267
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	267
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	268
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	268
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	268
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF ClearBridge Value Fund	269
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	269
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	270
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	270
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	270
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	271
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	271
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	272
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	272
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	273
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Royce US Smaller Companies Fund	273
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	273
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	274
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	274
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	275
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	275
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	275
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	276
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	276
Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	276
Appendice: Securities Financing Transactions Regulation (SFTR)	278

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

Informazioni di carattere generale

Consiglio di Amministrazione

Joseph Carrier (Stati Uniti)
 Fionnuala Doris (Irlanda) (indipendente)
 William Jackson (Regno Unito)¹
 Joseph Keane (Irlanda) (indipendente)
 Joseph LaRocque (Stati Uniti)
 Jaspal Saggar (Regno Unito)
 Jane Trust (Stati Uniti)
 Craig Tyle (Stati Uniti)²

¹ Dimessosi il 17 luglio 2023.

² Nominato il 27 luglio 2023.

Sede legale

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

Segretario

Bradwell Limited
 Ten Earlsfort Terrace, Dublin 2
 Irlanda

Distributore principale e Agente principale incaricato dei servizi agli azionisti

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

Distributori e Agenti aggiuntivi incaricati dei servizi agli azionisti

Franklin Templeton International Services S.à r.l.
 8A, rue Albert Borschette
 L-1246 Luxembourg
 Granducato del Lussemburgo

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

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

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

Stato di "Reporting Fund" e stato di distributore (solo per gli azionisti del Regno Unito)

Gli azionisti del Regno Unito possono individuare quali classi azionarie della Società sono state accettate nel regime di "reporting fund" del Regno Unito e quali classi hanno ottenuto lo status di "UK Reporting", controllando l'elenco dei "Reporting Fund" di HM Revenue and Customs sul sito web <https://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds>. Tale elenco viene aggiornato mensilmente da HM Revenue and Customs.

Per ulteriori informazioni, consultare il prospetto supplementare per gli investitori del Regno Unito o contattare Franklin Templeton International Services S.à r.l..

Rappresentante per la Svizzera

First Independent Fund Services Ltd
 Klausstrasse 33
 CH-8008 Zurigo
 Svizzera

Agente di pagamento per la Svizzera

NPB Neue Privat Bank Ltd
 Limmatquai 1/am Bellevue
 CH-8024 Zurigo
 Svizzera

Il prospetto, i documenti contenenti le informazioni chiave per gli investitori, lo statuto della Società, le relazioni annuali e semestrali e la ripartizione delle operazioni di acquisto e di vendita dei Comparti possono essere ottenuti gratuitamente presso l'ufficio del rappresentante svizzero.

Consulente legale per l'Irlanda

Arthur Cox LLP
 Ten Earlsfort Terrace, Dublin 2
 Irlanda

Banca depositaria

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

Società di revisione indipendente

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

Agente amministrativo

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

Gestore e Promotore

Franklin Templeton International Services S.à r.l.
 8A, rue Albert Borschette
 L-1246 Luxembourg
 Granducato del Lussemburgo

Informazioni generali – (segue)

Nome del Comparto	Data di lancio del Fondo	Gestori degli investimenti / Sub-gestori degli investimenti
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund ^a	27 febbraio 2004	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Subgestore degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p>
FTGF Western Asset US Core Bond Fund*	30 agosto 2002	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Subgestore degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p>
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund*	20 aprile 2007	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Giappone</p>
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund*	1 ottobre 2003	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Subgestore degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p>
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund ^{a*b}	24 febbraio 2004 (ha cessato la negoziazione il 16 febbraio 2023)	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Subgestore degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p>
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund*	29 August 2002	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p>

Informazioni generali – (segue)

Nome del Comparto	Data di lancio del Fondo	Gestori degli investimenti / Sub-gestori degli investimenti
FTGF Western Asset US High Yield Fund*	27 febbraio 2004	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Subgestore degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p>
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund ^a * ^b	24 febbraio 2004 (ha cessato la negoziazione il 10 ottobre 2022)	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p>
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund ^a * ^b	21 ottobre 2011 (ha cessato la negoziazione il 21 giugno 2022)	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Giappone</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 San Paolo – Brasile</p>
FTGF Western Asset Global High Yield Fund*	20 aprile 2007	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p>
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund ^a * ^b	20 aprile 2007 (ha cessato la negoziazione l'8 novembre 2019)	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Subgestore degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p>

Informazioni generali – (segue)

Nome del Comparto	Data di lancio del Fondo	Gestori degli investimenti / Sub-gestori degli investimenti
Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^{^*b}	20 aprile 2007 (ha cessato la negoziazione il 2 agosto 2019)	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Subgestore degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p>
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^{^*b}	20 aprile 2007 (ha cessato la negoziazione il 5 dicembre 2022)	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Subgestore degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p>
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund*	12 giugno 2008	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd. 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p>
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund*	3 giugno 2009	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Giappone</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd. 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p>

Informazioni generali – (segue)

Nome del Comparto	Data di lancio del Fondo	Gestori degli investimenti / Sub-gestori degli investimenti
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund ^{^*}	3 dicembre 2010	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street, London EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Giappone</p>
FTGF Western Asset Global Credit Fund ^{^*}	19 novembre 2010	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p> <p>Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australia</p>
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund ^{^*p}	3 dicembre 2010 (ha cessato la negoziazione il 21 giugno 2022)	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p>
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund ^{^*}	5 settembre 2013	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Giappone</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p>

Informazioni generali – (segue)

Nome del Comparto	Data di lancio del Fondo	Gestori degli investimenti / Sub-gestori degli investimenti
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^{^*b}	16 dicembre 2015 (ha cessato la negoziazione il 10 dicembre 2019)	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Subgestore degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p>
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^{^*}	16 dicembre 2015	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 San Paolo – Brasile</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Giappone</p>
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^{^*b}	31 dicembre 2015 (ha cessato la negoziazione il 13 novembre 2019)	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Giappone</p> <p>Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australia</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 San Paolo – Brasile</p>

Informazioni generali – (segue)

Nome del Comparto	Data di lancio del Fondo	Gestori degli investimenti / Sub-gestori degli investimenti
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund ^{^*}	13 gennaio 2016	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Subgestore degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A</p>
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund ^{^*}	13 gennaio 2016	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Subgestore degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A</p>
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund ^{^*}	17 novembre 2016	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p>
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [*]	17 novembre 2016	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Subgestore degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p>
FTGF Western Asset Infrastructure Debt Fund ^{^*^}		<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Giappone</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 San Paolo – Brasile</p>

Informazioni generali – (segue)

Nome del Comparto	Data di lancio del Fondo	Gestori degli investimenti / Sub-gestori degli investimenti
FTGF Western Asset Short-Dated High Yield Fund ^{**^}		<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Subgestore degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p>
FTGF Western Asset Asian Income Fund ^{**^}		<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p>
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund ^{^*}	11 gennaio 2021	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Subgestore degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p>
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund ^{^*}	10 gennaio 2022	<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p> <p>Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australia</p>
FTGF Western Asset China Bond Fund ^{**^}		<p>Gestore degli investimenti: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londra, EC2A 2EN Regno Unito</p> <p>Sub-gestori degli investimenti: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145</p>

Informazioni generali – (segue)

Nome del Comparto	Data di lancio del Fondo	Gestori degli investimenti / Sub-gestori degli investimenti
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund*	1 ottobre 2003	Gestore degli investimenti: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 U.S.A.
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund ^{^*}	3 aprile 2012	Gestore degli investimenti: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 U.S.A.
FTGF Brandywine Global High Yield Fund ^{^*}	30 novembre 2012	Gestore degli investimenti: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 U.S.A.
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund*	25 giugno 2010	Gestore degli investimenti: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 U.S.A.
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund ^{^*b}	10 mag 2012 (ha cessato la negoziazione il 25 febbraio 2021)	Gestore degli investimenti: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 U.S.A.
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund*	3 giugno 2013	Gestore degli investimenti: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 U.S.A.
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund ^{^*}	30 giugno 2014	Gestore degli investimenti: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 U.S.A.
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund ^{^*b}	6 aprile 2017 (ha cessato la negoziazione il 24 marzo 2023)	Gestore degli investimenti: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 U.S.A.
Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund ^{^*b}	30 ottobre 2017 (ha cessato la negoziazione il 29 gennaio 2020)	Gestore degli investimenti: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 U.S.A.
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund ^{^*}	16 August 2018	Gestore degli investimenti: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 U.S.A.
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund ^{^*}	1 dicembre 2022	Gestore degli investimenti: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 U.S.A.
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund ^{^*b}	31 dicembre 2015 (ha cessato l'attività il 24 marzo 2023)	Gestore degli investimenti: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 U.S.A.

Informazioni generali – (segue)

Nome del Comparto	Data di lancio del Fondo	Gestori degli investimenti / Sub-gestori degli investimenti
FTGF Brandywine Global – EM Macro Bond Fund** [^]		Gestore degli investimenti: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 U.S.A.
FTGF ClearBridge Value Fund**	23 marzo 1998	Gestore degli investimenti: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 U.S.A.
Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^] ** ^b	25 febbraio 2004 (ha cessato la negoziazione il 15 febbraio 2019)	Gestore degli investimenti: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 U.S.A.
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund [^] ** ^b	1° settembre 2006 (ha cessato la negoziazione il 22 novembre 2019)	Gestore degli investimenti: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 U.S.A.
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund**	20 aprile 2007	Gestore degli investimenti: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 U.S.A.
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund**	20 aprile 2007	Gestore degli investimenti: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 U.S.A.
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund**	20 aprile 2007	Gestore degli investimenti: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 U.S.A.
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund**	3 giugno 2013	Gestore degli investimenti: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 U.S.A.
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund**	30 settembre 2015	Gestore degli investimenti: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 U.S.A.
FTGF ClearBridge Global Growth Fund** [^]	29 giugno 2018	Gestore degli investimenti: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 U.S.A.
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund** [^]	22 settembre 2023	Gestore degli investimenti: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 U.S.A.
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund** [^]	9 dicembre 2016	Gestore degli investimenti: ClearBridge Investments (North America) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australia
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund** [^] ^b	31 marzo 2017 (ha cessato la negoziazione il 17 novembre 2022)	Gestore degli investimenti: ClearBridge Investments (North America) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australia
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund**	30 aprile 2021	Gestore degli investimenti: ClearBridge Investments (North America) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australia

Informazioni generali – (segue)

Nome del Comparto	Data di lancio del Fondo	Gestori degli investimenti / Sub-gestori degli investimenti
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund**	8 novembre 2002	Gestore degli investimenti: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 U.S.A.
FTGF Royce US Smaller Companies Fund**	1 marzo 2004	Gestore degli investimenti: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 U.S.A.
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^**	1 dicembre 2021	Gestore degli investimenti: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 U.S.A.
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^***^b	30 agosto 2002 (ha cessato la negoziazione l'11 luglio 2022)	Gestore degli investimenti: FRANKLIN ADVISERS, INC. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 U.S.A.
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^***^b	25 febbraio 2004 (ha cessato la negoziazione il 17 luglio 2023)	Gestore degli investimenti: FRANKLIN ADVISERS, INC. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 U.S.A.
Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^***^b	20 aprile 2007 (ha cessato la negoziazione il 25 febbraio 2015)	
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^***^b	28 aprile 2008 (ha cessato la negoziazione il 14 aprile 2021)	Gestore degli investimenti: FRANKLIN ADVISERS, INC. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 U.S.A.
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^***^b	29 dicembre 2010 (ha cessato la negoziazione il 27 aprile 2022)	Gestore degli investimenti: FRANKLIN ADVISERS, INC. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 U.S.A.
Legg Mason QS US Large Cap Fund^1***		Gestore degli investimenti: FRANKLIN ADVISERS, INC. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 U.S.A.
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund**^{a^b}	11 marzo 2016 (ha cessato la negoziazione il 20 aprile 2023)	Gestore degli investimenti: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo, EH1 2ES Scozia Subgestore degli investimenti: Templeton Asset Management Ltd. 7 Temasek Boulevard, #38-03 Suntec Tower One Singapore 038987
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund**^{a^b}	11 marzo 2016 (ha cessato la negoziazione il 21 agosto 2019)	Gestore degli investimenti: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo, EH1 2ES Scozia Subgestore degli investimenti: Templeton Asset Management Ltd. 7 Temasek Boulevard, #38-03 Suntec Tower One Singapore 038987
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund**^{a^b}	11 marzo 2016 (ha cessato la negoziazione il 1° giugno 2021)	Gestore degli investimenti: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo, EH1 2ES Scozia

Informazioni generali – (segue)

Nome del Comparto	Data di lancio del Fondo	Gestori degli investimenti / Sub-gestori degli investimenti
Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund**^{AB}	11 marzo 2016 (ha cessato la negoziazione il 31 luglio 2017)	
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund**^{AB}	11 marzo 2016 (ha cessato la negoziazione il 15 novembre 2019)	Gestore degli investimenti: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo, EH1 2ES Scozia
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund**^A	Giugno 2016	Gestore degli investimenti: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo, EH1 2ES Scozia
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund**	Giugno 2016	Gestore degli investimenti: Franklin Templeton Australia Limited Level 47 120 Collins Street, Melbourne, VIC 3000 Australia
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund**^A	24 novembre 2017	Gestore degli investimenti: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo, EH1 2ES Scozia
FTGF Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund**^{1A}		Gestore degli investimenti: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo, EH1 2ES Scozia
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund**^{1A}	9 novembre 2018	Gestore degli investimenti: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo, EH1 2ES Scozia
FTGF Martin Currie Improving Society Fund**^A	20 giugno 2023	Gestore degli investimenti: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo, EH1 2ES Scozia
FTGF Multi-Asset Infrastructure Income Fund**^{1A}		Gestori del portafoglio: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 U.S.A. ClearBridge Investments (North America) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australia
Legg Mason US Equity Fund^{AB}	8 gennaio 2008 (ha cessato la negoziazione il 24 agosto 2010, rilanciato il 13 aprile 2012 e cessato la negoziazione il 30 agosto 2013)	
Legg Mason Japan Equity Fund^{AB}	2 ottobre 2008 (ha cessato la negoziazione il 30 novembre 2010)	
Franklin Responsible Income 2028 Fund*^A	23 gennaio 2023	Gestore degli investimenti: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Regno Unito
Franklin Responsible Series 2 Fund*^{1A}		Gestore degli investimenti: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Regno Unito

Informazioni generali – (segue)

Nome del Comparto	Data di lancio del Fondo	Gestori degli investimenti / Sub-gestori degli investimenti
Franklin Responsible Series 3 Fund ^{†^}		Gestore degli investimenti: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Regno Unito

[†] Alla chiusura del periodo finanziario, questi Comparti non hanno iniziato a operare.

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

^μ Money Market Fund.

^{*} Comparti a reddito fisso (Comparti che investono principalmente in titoli a reddito fisso e fruttiferi).

^{**} Fondi azionari (Fondi che investono principalmente in azioni).

^{***} Fondi multi-asset (qualsiasi Comparto definito come "fondo multi-asset" nel relativo Supplemento del Prospetto).

^p In attesa di revoca dell'autorizzazione da parte della Banca centrale.

Per ulteriori informazioni

Per ulteriori informazioni sulla gamma di Fondi di Franklin Templeton Global Funds Plc, contattare:

Per gli investitori professionali in Europa (esclusi Regno Unito e Svizzera)

Franklin Templeton International Services S.à r.l
 8A, rue Albert Borschette
 L-1246 Luxembourg
 Granducato del Lussemburgo
www.franklinresources.com

Per i rivenditori autorizzati nelle Americhe

Franklin Templeton Investments
 1395 Brickell Avenue
 Suite 1550
 Miami, Florida 33131, U.S.A.
 Tel.: + 305 529 4400

www.franklintempletonoffshore.com

Consultare il sito web pertinente per informazioni su:

- Prezzi giornalieri
- Letteratura, comprese le schede informative che forniscono le informazioni più recenti su ciascun Fondo
- Maggiori informazioni sulle affiliate di Franklin Templeton che gestiscono i Fondi

Lettera agli azionisti

Gentile Azionista,

Siamo lieti di sottoporle la relazione semestrale di Franklin Templeton Global Funds Plc (la "Società") per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023. In questa relazione evidenziamo i principali fattori determinanti della performance dei mercati obbligazionari e azionari durante il periodo in esame.

Analisi della situazione economica globale

L'economia globale ha affrontato numerose sfide, ma ha saputo resistere durante il periodo di riferimento. Detto questo, la crescita potrebbe subire una battuta di arresto per la presenza di alcuni venti contrari. Secondo l'*aggiornamento delle prospettive economiche mondiali* del luglio 2023, il Fondo Monetario Internazionale (il "FMI") ha previsto un calo della crescita del prodotto interno lordo globale ("PIL") dal 3,5% nel 2022 al 3,0% nel 2023. Secondo il FMI, "la ripresa globale dalla pandemia COVID-19 e dall'invasione dell'Ucraina da parte della Russia sta rallentando in un contesto di crescenti divergenze tra settori economici e regioni... Sebbene la previsione per il 2023 sia modestamente superiore a quanto previsto nelle previsioni economiche mondiali dell'aprile 2023, rimane debole rispetto agli standard storici". L'aumento dei tassi della politica delle banche centrali per combattere l'inflazione continua a pesare sull'attività economica... L'inflazione si sta attenuando nella maggior parte dei Paesi, ma rimane elevata, con divergenze tra economie e misure contro l'inflazione". Il FMI prevede per il 2023 un'espansione del PIL dell'1,8% negli Stati Uniti (rispetto al 2,1% del 2022), dello 0,9% nell'Eurozona (dal 3,5% del 2022), dello 0,4% nel Regno Unito (dal 4,1% del 2022) e dell'1,4% in Giappone (dall'1,1% del 2022).

Analisi dei mercati – Obbligazionarioⁱ

Il mercato obbligazionario globale ha registrato un incremento nel periodo di riferimento. Negli Stati Uniti, i rendimenti hanno sperimentato una crescita, con l'inflazione che è rimasta elevata. In questo contesto, il Consiglio della Federal Reserve degli Stati Uniti ("Fed") ha aumentato il tasso dei fondi federali in dieci riunioni consecutive da marzo 2022 a maggio 2023. Sebbene la Fed si sia astenuta dall'aumentare i tassi nel giugno 2023, la banca centrale li ha nuovamente alzati nel luglio 2023, portandoli ai massimi di 22 anni. A inizio periodo, i rendimenti dei Treasury decennali statunitensi erano pari al 3,92% mentre alla fine ammontavano al 4,09%. Oltre che negli Stati Uniti, l'aumento dei rendimenti si è verificato anche nella maggior parte dei Paesi sviluppati. Nel complesso, i titoli del Tesoro statunitensi e le obbligazioni societarieⁱⁱⁱ investment gradeⁱⁱ hanno registrato rendimenti positivi. Le obbligazioni societarie statunitensi con un rating inferiore e il debito sovrano denominato in dollari statunitensi dei mercati emergenti si sono elevati.

Analisi dei mercati – Azioni globali^{iv}

I titoli globali hanno avuto periodi di volatilità ma hanno registrato rendimenti positivi nel periodo di riferimento. Il sentimento degli investitori è stato sostenuto dalla tenuta dell'economia globale, dagli utili societari spesso superiori alle aspettative e dall'inflazione contenuta. Per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023, l'indice S&P 500 ha restituito il 14,50%. Fuori degli Stati Uniti, i titoli dei mercati sviluppati internazionali, misurati dall'indice MSCI EAFE (netto), hanno ottenuto il 4,75%, mentre i titoli dei mercati emergenti, misurati dall'indice MSCI Emerging Markets (netto) hanno restituito il 3,62%.

i Reddito fisso – obbligazioni.

ii Investment grade – indicatore della qualità creditizia che indica che un'obbligazione governativa o societaria ha un rischio di insolvenza relativamente basso.

La ringraziamo per la Sua rinnovata fiducia.

Cordiali saluti,

Franklin Templeton International Services S.à.r.l

Settembre 2023

I rendimenti passati non garantiscono risultati futuri. Le informazioni non sono da intendersi come una previsione di eventi futuri, una garanzia di risultati futuri o una consulenza sugli investimenti.

Tutti i dati al 31 agosto 2023, salvo diversa indicazione.

Franklin Templeton Global Funds plc è un fondo multicomparto con separazione patrimoniale tra i comparti, costituito come società d'investimento di tipo aperto a capitale variabile, autorizzato in Irlanda dalla Central Bank of Ireland come organismo d'investimento collettivo in valori mobiliari.

Tutti gli investimenti comportano rischi, inclusa la possibile perdita del capitale. Le performance passate non sono indicative di rendimenti futuri e non possono ripetersi.

Queste informazioni sono state preparate da fonti ritenute affidabili ma non sono garantite da Franklin Resources, Inc. o affiliate (insieme "Franklin Templeton") e non costituiscono un riassunto o una dichiarazione completa di tutti i dati disponibili.

Le opinioni espresse sono soggette a modifica senza preavviso e non tengono conto degli obiettivi d'investimento, della situazione finanziaria o delle esigenze particolari degli investitori.

Prima di investire è necessario leggere il documento contenente le informazioni chiave per gli investitori e il prospetto, che descrivono gli obiettivi e i fattori di rischio dei comparti. Questi e altri documenti rilevanti si possono ottenere in diverse lingue presso BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company, One Dockland Central, Guild Street, IFSC, Dublino 1, Irlanda, www.franklinresources.com e la sede legale.

Pubblicato e approvato da Franklin Templeton International Services S.à.r.l, 8A, rue Albert Borschette, L-1246 Lussemburgo, Granducato di Lussemburgo, costituita in Lussemburgo e regolamentata dalla Commission de Surveillance du Secteur Financier.

Questo materiale non è destinato a persone o ad utilizzi che risultino contrari alle leggi o ai regolamenti locali. Franklin Templeton non è responsabile e non si assume alcuna responsabilità per un'ulteriore diffusione di questo materiale.

iii Obbligazione societaria – obbligazione emessa da una società per raccogliere denaro in modo efficace per espandere la propria attività.

iv Equity – partecipazione di proprietà in una società sotto forma di azioni ordinarie o privilegiate.

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti governativi — 75,66% (28 febbraio 2023: 71,90%)					
Stati Uniti — 75,66% (28 febbraio 2023: 71,90%)					
15.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,340%, scadenza 20/09/2023 *	1,61	15.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 19/12/2023	1,59
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,320%, scadenza 14/11/2023 *	1,08	10.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 01/02/2024	1,06
3.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,325%, scadenza 30/11/2023 *	0,32	10.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 18/01/2024	1,05
2.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, serie 0000, 5,360%, scadenza 13/12/2023 *	0,21	15.000	Obbligazione a tasso variabile United States Treasury, 5,448%, scadenza 31/10/2023*	1,61
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,360%, scadenza 27/12/2023 *	1,08	Totale Obbligazioni ed effetti governativi (costo 702.821 dollari)		75,66
15.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, serie 0000, 5,330%, scadenza 08/01/2024 *	1,61	Pronti contro termine — 26,65% (28 febbraio 2023: 29,37%)		
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, serie 0000, 5,380%, scadenza 29/01/2024 *	1,08	Stati Uniti — 26,65% (28 febbraio 2023: 29,37%)		
15.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,345%, scadenza 20/02/2024 *	1,61	50.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, pronti contro termine da riacquistare a 50.007.319 dollari statunitensi (garantiti da US Treasury Bonds & Notes per un valore totale di 51.007.467 dollari), 5,270%, scadenza 01/09/2023	5,39
25.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,450%, scadenza 20/03/2024 *	2,69	55.000	HSBC Bank(USA), pronti contro termine da riacquistare a 55.008.021 dollari statunitensi (garantiti da US Treasury Bonds & Notes per un valore totale di 56.108.220 dollari), 5,250%, scadenza 01/09/2023	5,92
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, serie 0001, 5,380%, scadenza 06/05/2024 *	1,08	80.000	JP Morgan Securities LLC, pronti contro termine da riacquistare a 80.011.733 dollari statunitensi (garantiti da US Treasury Bonds & Notes per un valore totale di 81.611.971 dollari), 5,280%, scadenza 01/09/2023	8,61
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, serie 0001, 5,380%, scadenza 24/05/2024 *	1,08	50.000	Royal Bank of Canada, pronti contro termine da riacquistare a 50.007.278 dollari statunitensi (garantiti da US Treasury Bonds & Notes per un valore totale di 51.000.021 dollari), 5,240%, scadenza 01/09/2023	5,38
10.000	Titoli di sconto Federal Home Loan Bank, zero coupon, scadenza 01/09/2023	1,08	12.520	TD Securities (USA) LLC, pronti contro termine da riacquistare a 12.521.843 dollari statunitensi (garantiti da US Treasury Bonds & Notes per un valore totale di 12.770.400 dollari), 5,300%, scadenza 01/09/2023	1,35
10.000	Titoli di sconto Federal Home Loan Bank, zero coupon, scadenza 06/09/2023	1,07	Totale pronti contro termine (costo 247.520 dollari)		26,65
15.862	Titoli di sconto Federal Home Loan Bank, zero coupon, scadenza 15/09/2023	1,70	Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		102,31
15.000	Titoli di sconto Federal Home Loan Bank, zero coupon, scadenza 29/09/2023	1,61	Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		102,31
10.000	Titoli di sconto Federal Home Loan Bank, zero coupon, scadenza 27/10/2023	1,07	Passività in eccesso rispetto ad altre attività		(2,31)
5.000	Titoli di sconto Federal Home Loan Bank, zero coupon, scadenza 17/01/2024	0,53	Patrimonio in gestione		928.919\$
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0000, 5,360%, scadenza 05/09/2023 *	1,08	Analisi delle attività totali		
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,420%, scadenza 06/09/2023 *	1,08	Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato		73,79
4.500	Federal Home Loan Banks, 5,360%, scadenza 19/09/2023 *	0,48	Strumenti del mercato monetario		25,99
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,420%, scadenza 20/09/2023 *	1,08	Altre attività		0,22
26.200	Federal Home Loan Banks, serie 0002, 5,330%, scadenza 25/09/2023 *	2,82	Totale Attività		100,00
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0000, 5,340%, scadenza 23/10/2023 *	1,08	-		-
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,335%, scadenza 16/11/2023 *	1,08	* Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.		
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0000, 5,355%, scadenza 24/11/2023 *	1,08			
5.000	Federal Home Loan Banks, 5,370%, scadenza 27/11/2023 *	0,54			
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0000, 5,390%, scadenza 01/12/2023 *	1,08			
5.000	Federal Home Loan Banks, 5,380%, scadenza 24/01/2024 *	0,54			
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0001, 5,340%, scadenza 01/02/2024 *	1,08			
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0000, 5,340%, scadenza 16/02/2024 *	1,08			
20.000	Federal Home Loan Banks, 5,420%, scadenza 14/03/2024 *	2,15			
4.000	Federal Home Loan Banks, 5,360%, scadenza 03/05/2024 *	0,43			
15.000	Federal Home Loan Banks, serie 0000, 5,365%, scadenza 10/05/2024 *	1,61			
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,365%, scadenza 24/05/2024 *	1,08			
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0001, 5,420%, scadenza 28/05/2024 *	1,08			
10.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 09/05/2023	1,07			
15.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 09/07/2023	1,61			
15.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 09/12/2023	1,61			
15.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 19/09/2023	1,61			
15.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 21/09/2023	1,61			
15.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 26/09/2023	1,61			
10.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 28/09/2023	1,07			
20.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 10/03/2023	2,14			
10.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 10/05/2023	1,07			
20.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 10/12/2023	2,14			
10.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 19/10/2023	1,07			
10.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 24/10/2023	1,07			
15.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 26/10/2023	1,60			
10.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 31/10/2023	1,07			
10.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 11/07/2023	1,07			
10.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 11/09/2023	1,06			
15.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 16/11/2023	1,60			
10.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 21/11/2023	1,06			
20.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 24/11/2023	2,13			
10.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 30/11/2023	1,06			
10.000	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 12/12/2023	1,06			

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto		
Titoli garantiti da attività — 7,01% (28 febbraio 2023: 9,59%)							
100	AB BSL CLO 4 Ltd, serie 2023 4A, classe A, 144A, 6,957%, scadenza 20/04/2036 *	101	490	Trinitas CLO XVI Ltd, serie 2021 16A, classe A1, 144A, 6,768%, scadenza 20/07/2034 *	483	0,24	
500	Apidos CLO XXXVII, serie 2021 37A, classe A, 144A, 6,737%, scadenza 22/10/2034 *	497	660	Voya CLO 2016-3 Ltd, serie 2016 3A, classe A1R, 144A, 6,762%, scadenza 18/10/2031 *	659	0,32	
260	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, serie 2023 1A, classe A2, 144A, 7,824%, scadenza 05/03/2053	259	Totale titoli garantiti da attività (costo 14.468 dollari)			14.266	7,01
415	Argent Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Certificates serie 2003-W7, serie 2003 W3, classe M1, 3,972%, scadenza 25/09/2033 *	373	Titoli garantiti da ipoteca — 41,38% (28 febbraio 2023: 36,20%)				
320	Barings Private Credit Corp CLO 2023-1 Ltd, serie 2023 1A, classe A1, 144A, 7,807%, scadenza 15/07/2031 *	320	510	AREIT 2022-CRE7 LLC, serie 2022 CRE7, classe A, 144A, 7,556%, scadenza 17/06/2039 *	510	0,25	
471	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd, serie 2015 8A, classe A1AR, 144A, 6,688%, scadenza 20/01/2031 *	470	24	Banc of America Mortgage 2003-C Trust, serie 2003 C, classe B1, 4,746%, scadenza 25/04/2033 *	5	-	
140	Birch Grove CLO 6 Ltd, serie 2023 6A, classe A1, 144A, 7,489%, scadenza 20/07/2035 *	141	110	BANK 2018-BNK10, serie 2018 BN10, classe A5, 3,688%, scadenza 15/02/2061	102	0,05	
734	Brazos Higher Education Authority Inc, serie 2011 2, classe A3, 6,316%, scadenza 27/10/2036 *	726	130	Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, serie 2018 B1, classe A5, 3,666%, scadenza 15/01/2051 *	119	0,06	
630	Canyon CLO 2020-1 Ltd, serie 2020 1A, classe AR, 144A, 6,750%, scadenza 15/07/2034 *	622	10.116	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust, serie 2018 B5, classe XA, 0,614%, scadenza 15/07/2051 *	177	0,09	
270	Cayuga Park CLO Ltd, serie 2020 1A, classe AR, 144A, 6,690%, scadenza 17/07/2034 *	268	879	BHMS 2018-ATLS, serie 2018 ATLS, classe A, 144A, 6,857%, scadenza 15/07/2035 *	864	0,42	
435	CBAM 2017-1 Ltd, serie 2017 1A, classe A1, 144A, 6,838%, scadenza 20/07/2030 *	435	100	CD 2017-CD3 Mortgage Trust, Serie 2017 CD3, Classe A4, 3,631%, scadenza 02/10/2050	91	0,04	
71	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, serie 2001 HE22, classe A1, 5,892%, scadenza 25/02/2032 *	69	130	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, serie 2014 GC23, classe B, 4,175%, scadenza 10/07/2047 *	122	0,06	
31	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2007-13, serie 2007 13, classe 2A2, 6,229%, scadenza 25/10/2047 *	28	3.786	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, serie 2016 C3, XA, 1,121%, scadenza 15/11/2049 *	93	0,05	
140	CWABS Inc Asset-Backed Certificates Trust 2004-5, serie 2004 5, classe 2A, 5,929%, scadenza 25/10/2034 *	134	220	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-C4, serie 2017 C4, A3, 3,209%, scadenza 12/10/2050	202	0,10	
26	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust serie 2006-F, serie 2006 F, classe 2A1A, 5,565%, scadenza 15/07/2036 *	24	10	COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Serie 2013 CR12, Classe AM, 4,300%, scadenza 10/10/2046	9	-	
144	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust serie 2006-I, serie 2006 I, classe 2A, 5,565%, scadenza 15/01/2037 *	130	123	Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, serie 2014 UBS2, classe XA, 1,195%, scadenza 10/03/2047 *	-	-	
473	DB Master Finance LLC, serie 2017 1A, classe A2II, 144A, 4,030%, scadenza 20/11/2047	436	38	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust, Serie 2015 LC19, Classe ASB, 3,040%, scadenza 02/10/2048	38	0,02	
155	EFS Volunteer No 2 LLC, serie 2012 1, classe A2, 144A, 6,752%, scadenza 25/03/2036 *	155	200	COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Serie 2015 PC1, Classe A5, 3,902%, scadenza 07/10/2050	192	0,09	
420	Golub Capital Partners CLO 57M Ltd, serie 2021 57A, classe A1, 144A, 7,103%, scadenza 25/10/2034 *	413	340	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, serie 2022 R04, classe 1M2, 144A, 8,388%, scadenza 25/03/2042 *	345	0,17	
150	Golub Capital Partners CLO 66B Ltd, serie 2023 66A, classe A, 144A, 6,926%, scadenza 25/04/2036 *	150	430	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R06, serie 2023 R06, classe 1M2, 144A, 7,988%, scadenza 25/07/2043 *	433	0,21	
400	Goodleap Sustainable Home Solutions Trust 2023-3, serie 2023 3C, classe A, 144A, 6,500%, scadenza 20/07/2055	400	100	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, serie 2015 C1, classe A5, 3,791%, scadenza 15/04/2050 *	92	0,04	
250	Greenwood Park CLO Ltd, serie 2018 1A, classe A2, 144A, 6,580%, scadenza 15/04/2031 *	249	340	CSMC 2014-USA OA LLC, serie 2014 USA, classe A2, 144A, 3,953%, scadenza 15/09/2037	297	0,15	
320	Greywolf CLO V Ltd, serie 2015 1A, classe A1R, 144A, 6,773%, scadenza 27/01/2031 *	320	420	CSMC 2014-USA OA LLC, serie 2014 USA, classe B, 144A, 4,185%, scadenza 15/09/2037	342	0,17	
708	Home Equity Asset Trust 2006-4, serie 2006 4, classe 2A4, 5,989%, scadenza 25/08/2036 *	686	353	CSMC Trust 2018-J1 Trust, serie 2018 J1, classe A2, 144A, 3,500%, scadenza 25/02/2048 *	311	0,15	
485	Jack in the Box Funding LLC, serie 2022 1A, classe A2I, 144A, 3,445%, scadenza 26/02/2052	438	979	CSMC Trust 2018-J1 Trust, serie 2018 J1, classe B2, 144A, 3,586%, scadenza 25/02/2048 *	858	0,42	
323	Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, serie 2021 1GS, classe A, 144A, 2,290%, scadenza 20/01/2048	239	200	Fannie Mae 5Yr Pool, 4,830%, scadenza 01/09/2028 ∞	198	0,10	
589	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, serie 2004 1, classe M1, 6,179%, scadenza 25/02/2034 *	566	200	Fannie Mae 5Yr Pool, 4,880%, scadenza 01/09/2028 ∞	201	0,10	
245	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-4, serie 2004 4, classe M1, 6,329%, scadenza 25/10/2034 *	235	100	Fannie Mae 5Yr Pool, 5,340%, scadenza 01/09/2028 ∞	102	0,05	
430	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust serie 2004-WMC5, serie 2004 WMC5, classe M1, 6,359%, scadenza 25/07/2035 *	415	300	Fannie Mae 5Yr Pool, 5,000%, scadenza 01/10/2028 ∞	301	0,15	
443	MKS CLO 2017-2 Ltd, serie 2017 2A, classe A, 144A, 6,778%, scadenza 20/01/2031 *	442	134	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, serie 2014 C03, classe 1M2, 8,402%, scadenza 25/07/2024 *	137	0,07	
405	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2004-NC8, serie 2004 NC8, classe M1, 6,344%, scadenza 25/09/2034 *	390	1	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, serie 2014 C04, classe 2M2, 10,402%, scadenza 25/11/2024 *	1	-	
59	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-NC2, serie 2005 NC2, classe M4, 6,344%, scadenza 25/03/2035 *	59	1	Fannie Mae Interest Strip 390, classe C3, 6,000%, scadenza 25/07/2038	-	-	
369	Mosaic Solar Loan Trust 2021-3, serie 2021 3A, classe B, 144A, 1,920%, scadenza 20/06/2052	264	4	Fannie Mae Interest Strip 407, classe 41, 6,000%, scadenza 25/01/2038	1	-	
337	Navient Student Loan Trust 2017-3, serie 2017 3A, classe A3, 144A, 6,452%, scadenza 26/07/2066 *	332	8	Fannie Mae Interest Strip 409, classe C13, 3,500%, scadenza 25/11/2041	1	-	
350	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd, serie 2018 29A, classe A1, 144A, 6,712%, scadenza 19/10/2031 *	349	8	Fannie Mae Interest Strip 409, classe C18, 4,000%, scadenza 25/04/2042	1	-	
93	NovaStar Mortgage Funding Trust serie 2003-3, serie 2003 3, classe A1, 6,139%, scadenza 25/12/2033 *	90	5	Fannie Mae Interest Strip 409, classe C2, 3,000%, scadenza 25/04/2027	-	-	
730	Ocean Trails CLO X, serie 2020 10A, classe AR, 144A, 6,790%, scadenza 15/10/2034 *	720	1.600	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 2,000% ±	1.274	0,63	
240	Ocean Trails CLO XI, serie 2021 11A, classe A, 144A, 6,808%, scadenza 20/07/2034 *	237	2.400	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 2,500% ±	1.989	0,98	
59	SBA Small Business Investment Cos, serie 2018 10B, classe 1, 3,548%, scadenza 10/09/2028	55	2.600	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 3,000% ±	2.241	1,10	
75	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A, serie 2007 A, classe A4A, 5,792%, scadenza 16/12/2041 *	73	2.500	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 3,500% ±	2.235	1,10	
324	SLM Private Education Loan Trust 2010-C, serie 2010 C, classe A5, 144A, 10,175%, scadenza 15/10/2041 *	343	900	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 4,000% ±	831	0,41	
146	SMB Private Education Loan Trust 2020-A, serie 2020 A, classe A2A, 144A, 2,230%, scadenza 15/09/2037	135	600	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 4,500% ±	569	0,28	
371	Stonepeak 2021-1 ABS, serie 2021 1A, classe AA, 144A, 2,301%, scadenza 28/02/2033	336	600	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 5,000% ±	582	0,29	
			2.400	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 5,500% ±	2.370	1,16	
			100	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 6,000% ±	100	0,05	
			1	Pool Fannie Mae '888795', 5,500%, scadenza 01/11/2036	1	-	
			33	Pool Fannie Mae '890604', 4,500%, scadenza 01/10/2044	32	0,02	
			20	Pool Fannie Mae 'AB9594', 4,000%, scadenza 01/06/2043	19	0,01	
			197	Pool Fannie Mae 'AH4536', 4,000%, scadenza 01/02/2041	187	0,09	
			8	Pool Fannie Mae 'AL4324', 6,500%, scadenza 01/05/2040	8	-	
			66	Pool Fannie Mae 'AL9397', 3,000%, scadenza 01/10/2046	58	0,03	
			50	Pool Fannie Mae 'AL9546', 3,500%, scadenza 01/11/2046	46	0,02	
			37	Pool Fannie Mae 'AL9631', 3,000%, scadenza 01/12/2046	33	0,02	
			20	Pool Fannie Mae 'AM8674', 2,810%, scadenza 01/04/2025	19	0,01	
			94	Pool Fannie Mae 'AM8700', 2,930%, scadenza 01/06/2030	84	0,04	
			247	Pool Fannie Mae 'AN1187', 2,930%, scadenza 01/07/2028	228	0,11	

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
57	53	0,03	373	334	0,16
58	54	0,03	186	191	0,09
44	41	0,02	96	91	0,04
23	21	0,01	99	94	0,05
18	16	0,01	97	96	0,05
40	35	0,02	396	398	0,20
211	192	0,09	49	45	0,02
90	79	0,04	39	36	0,02
57	50	0,02	41	40	0,02
21	20	0,01	194	191	0,09
38	34	0,02	97	95	0,05
43	40	0,02	83	79	0,04
17	16	0,01	200	182	0,09
25	22	0,01	264	229	0,11
41	36	0,02	50	46	0,02
65	57	0,03	58	49	0,02
90	79	0,04	76	64	0,03
36	31	0,02	243	203	0,10
39	34	0,02	69	58	0,03
190	181	0,09	53	50	0,02
210	194	0,10	61	57	0,03
45	44	0,02	84	71	0,03
84	78	0,04	157	138	0,07
179	168	0,08	67	60	0,03
37	35	0,02	86	72	0,04
193	155	0,08	83	73	0,04
38	35	0,02	86	69	0,03
145	132	0,06	83	72	0,04
14	14	0,01	98	82	0,04
409	357	0,18	78	66	0,03
36	33	0,02	75	66	0,03
580	560	0,27	72	68	0,03
74	59	0,03	86	75	0,04
76	62	0,03	88	75	0,04
74	69	0,03	176	148	0,07
80	59	0,03	89	75	0,04
70	67	0,03	88	71	0,03
73	61	0,03	260	223	0,11
75	69	0,03	331	287	0,14
71	57	0,03	331	283	0,14
71	59	0,03	89	77	0,04
71	59	0,03	91	78	0,04
76	62	0,03	88	71	0,03
76	61	0,03	534	466	0,23
76	61	0,03	364	295	0,14
73	59	0,03	87	78	0,04
80	65	0,03	261	226	0,11
71	65	0,03	88	78	0,04
80	64	0,03	93	83	0,04
80	65	0,03	161	147	0,07
81	66	0,03	286	238	0,12
100	96	0,05	190	170	0,08
100	97	0,05	97	97	0,05
100	97	0,05	95	90	0,04
100	97	0,05	98	95	0,05
100	98	0,05	93	96	0,05
100	98	0,05	99	96	0,05
100	94	0,05	291	235	0,12
83	69	0,03	389	378	0,19
86	72	0,03	98	81	0,04
82	69	0,03	1.078	861	0,42
82	68	0,03	99	99	0,05
1.921	1.601	0,79	99	99	0,05
89	77	0,04	196	178	0,09
88	74	0,04	28	27	0,01
87	73	0,04	15	14	0,01
262	228	0,11	21	21	0,01
195	189	0,09	40	38	0,02
308	290	0,14	28	26	0,01
29	27	0,01	54	50	0,02
74	60	0,03	87	80	0,04
74	59	0,03	64	59	0,03
74	65	0,03	156	144	0,07
162	130	0,06	103	95	0,05
165	132	0,06	23	22	0,01
164	142	0,07	218	175	0,09
1.507	1.257	0,62	60	52	0,03
269	233	0,11	83	63	0,03
93	78	0,04	164	138	0,07
182	158	0,08	1.180	985	0,48
184	171	0,08	423	353	0,17
90	81	0,04	259	215	0,11
95	75	0,04	182	155	0,08
88	79	0,04	91	77	0,04

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
8 Fannie Mae REMICS, serie 2001 81, classe GE, 6,000%, scadenza 25/01/2032	8	-	157 Pool Freddie Mac 'RA3882', 2,000%, scadenza 01/11/2050	127	0,06
17 Fannie Mae REMICS, serie 2005 29, classe ZA, 5,500%, scadenza 25/04/2035	18	0,01	436 Pool Freddie Mac 'RA3913', 2,500%, scadenza 01/11/2050	367	0,18
4 Fannie Mae REMICS, serie 2011 87, classe SG, 1,148%, scadenza 25/04/2040 *	-	-	237 Pool Freddie Mac 'RA4703', 2,000%, scadenza 01/02/2051	191	0,09
11 Fannie Mae REMICS, serie 2012 101, classe AI, 3,000%, scadenza 25/06/2027	-	-	470 Pool Freddie Mac 'RA5117', 2,000%, scadenza 01/05/2051	378	0,19
133 Fannie Mae REMICS, serie 2012 118, classe VZ, 3,000%, scadenza 25/11/2042	119	0,06	86 Pool Freddie Mac 'RA5373', 2,000%, scadenza 01/06/2051	69	0,03
70 Fannie Mae REMICS, serie 2012 134, classe SK, 0,748%, scadenza 25/12/2042 *	7	-	174 Pool Freddie Mac 'RA6135', 2,500%, scadenza 01/10/2051	145	0,07
5 Fannie Mae REMICS, serie 2012 46, classe BA, 6,000%, scadenza 25/05/2042	6	-	86 Pool Freddie Mac 'RA6562', 2,500%, scadenza 01/01/2052	72	0,04
6 Fannie Mae REMICS, serie 2012 75, classe NS, 1,198%, scadenza 25/07/2042 *	1	-	365 Pool Freddie Mac 'RA6694', 2,000%, scadenza 01/01/2052	292	0,14
367 Fannie Mae REMICS, serie 2012 96, classe SB, 0,648%, scadenza 25/09/2042 *	25	0,01	272 Pool Freddie Mac 'RA7185', 4,000%, scadenza 01/04/2052	252	0,12
8 Fannie Mae REMICS, serie 2013 9, classe BC, 6,500%, scadenza 25/07/2042	9	-	449 Pool Freddie Mac 'RA7186', 4,000%, scadenza 01/04/2052	417	0,20
11 Fannie Mae REMICS, serie 2013 9, classe CB, 5,500%, scadenza 25/04/2042	11	0,01	371 Pool Freddie Mac 'RA7928', 4,500%, scadenza 01/09/2052	352	0,17
107 Fannie Mae REMICS, serie 2020 47, classe GZ, 2,000%, scadenza 25/07/2050	62	0,03	98 Pool Freddie Mac 'RA8790', 5,000%, scadenza 01/04/2053	96	0,05
78 Fannie Mae REMICS, serie 2020 56, classe DI, 2,500%, scadenza 25/08/2050	13	0,01	224 Pool Freddie Mac 'RB5084', 1,500%, scadenza 01/11/2040	181	0,09
153 Fannie Mae REMICS, serie 2020 57, classe TA, 2,000%, scadenza 25/04/2050	130	0,06	249 Pool Freddie Mac 'RB5110', 1,500%, scadenza 01/05/2041	200	0,10
76 Fannie Mae REMICS, serie 2020 74, classe EI, 2,500%, scadenza 25/10/2050	12	0,01	254 Pool Freddie Mac 'RB5117', 1,500%, scadenza 01/07/2041	204	0,10
527 Fannie Mae REMICS, serie 2020 89, classe DI, 2,500%, scadenza 25/12/2050	79	0,04	337 Pool Freddie Mac 'RB5125', 2,000%, scadenza 01/09/2041	282	0,14
439 Fannie Mae REMICS, serie 2020 97, classe AI, 2,000%, scadenza 25/01/2051	58	0,03	104 Pool Freddie Mac 'RB5130', 1,500%, scadenza 01/10/2041	84	0,04
713 Fannie Mae REMICS, serie 2021 3, classe QI, 2,500%, scadenza 25/02/2051	108	0,05	771 Pool Freddie Mac 'RB5131', 2,000%, scadenza 01/10/2041	643	0,32
75 Fannie Mae REMICS, serie 2021 65, classe JA, 2,000%, scadenza 25/01/2046	64	0,03	53 Pool Freddie Mac 'RB5134', 1,500%, scadenza 01/11/2041	42	0,02
48 Fannie Mae-Aces, serie 2013 M6, classe 1AC, 3,454%, scadenza 25/02/2043 *	45	0,02	87 Pool Freddie Mac 'RB5138', 2,000%, scadenza 01/12/2041	72	0,04
400 Fannie Mae-Aces, serie 2018 M15, classe 1A2, 3,700%, scadenza 25/01/2036	363	0,18	90 Pool Freddie Mac 'RB5145', 2,000%, scadenza 01/02/2042	74	0,04
165 Fannie Mae-Aces, serie 2018 M9, classe APT2, 3,209%, scadenza 25/04/2028 *	154	0,08	184 Pool Freddie Mac 'RB5166', 3,000%, scadenza 01/07/2042	162	0,08
533 Fannie Mae-Aces, serie 2020 M36, classe X1, 1,541%, scadenza 25/09/2034 *	34	0,02	469 Pool Freddie Mac 'SC0313', 2,000%, scadenza 01/01/2042	390	0,19
9 Freddie Mac Gold Pool 'G06409', 6,000%, scadenza 01/11/2039	9	-	287 Pool Freddie Mac 'SC0340', 3,000%, scadenza 01/09/2042	253	0,12
4 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500%, scadenza 01/09/2039	4	-	196 Pool Freddie Mac 'SC0384', 2,000%, scadenza 01/04/2042	165	0,08
153 Freddie Mac Gold Pool 'G61637', 3,000%, scadenza 01/09/2047	133	0,07	71 Pool Freddie Mac 'SD0573', 2,000%, scadenza 01/04/2051	58	0,03
20 Freddie Mac Gold Pool 'Q17792', 3,500%, scadenza 01/05/2043	19	0,01	88 Pool Freddie Mac 'SD0615', 4,500%, scadenza 01/01/2051	85	0,04
36 Freddie Mac Gold Pool 'Q29184', 4,000%, scadenza 01/10/2044	35	0,02	87 Pool Freddie Mac 'SD0745', 2,000%, scadenza 01/11/2051	71	0,03
38 Freddie Mac Gold Pool 'Q45560', 3,000%, scadenza 01/01/2047	33	0,02	88 Pool Freddie Mac 'SD0849', 2,500%, scadenza 01/01/2052	74	0,04
77 Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000%, scadenza 01/01/2047	68	0,03	273 Pool Freddie Mac 'SD0857', 2,500%, scadenza 01/01/2052	228	0,11
43 Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000%, scadenza 01/01/2047	37	0,02	946 Pool Freddie Mac 'SD1218', 4,000%, scadenza 01/07/2049	886	0,44
15 Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000%, scadenza 01/10/2042	14	0,01	188 Pool Freddie Mac 'SD1549', 3,500%, scadenza 01/04/2052	169	0,08
48 Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500%, scadenza 01/03/2045	44	0,02	96 Pool Freddie Mac 'SD1807', 4,500%, scadenza 01/07/2052	92	0,04
2.491 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K124, classe X1, 0,810%, scadenza 25/12/2030 *	102	0,05	190 Pool Freddie Mac 'SD1936', 3,500%, scadenza 01/06/2052	170	0,08
3.494 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K130, classe X1, 1,143%, scadenza 25/06/2031 *	218	0,11	98 Pool Freddie Mac 'SD2245', 5,500%, scadenza 01/12/2052	97	0,05
90 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates Q006, classe A2, 4,139%, scadenza 25/04/2028 *	82	0,04	93 Pool Freddie Mac 'SD2284', 6,000%, scadenza 01/12/2052	94	0,05
10.000 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, serie K 157, classe X1, 0,419%, scadenza 25/05/2033 *	234	0,11	97 Pool Freddie Mac 'SD2394', 4,500%, scadenza 01/11/2052	92	0,05
100 Freddie Mac Multifamily WI Certificates serie WI-K159 K159, classe A2, 4,500%, scadenza 25/11/2033	97	0,05	94 Pool Freddie Mac 'SD2395', 5,000%, scadenza 01/01/2053	92	0,04
71 Freddie Mac Non Gold Pool "840698", 2,104%, scadenza 01/03/2047 *	67	0,03	98 Pool Freddie Mac 'SD2443', 4,500%, scadenza 01/10/2052	93	0,05
350 Freddie Mac Non Gold Pool "841076", 3,008%, scadenza 01/11/2048 *	328	0,16	93 Pool Freddie Mac 'SD2452', 6,500%, scadenza 01/02/2053	95	0,05
112 Freddie Mac Non Gold Pool "841077", 2,871%, scadenza 01/11/2047 *	106	0,05	97 Pool Freddie Mac 'SD2591', 5,000%, scadenza 01/03/2053	94	0,05
112 Freddie Mac Non Gold Pool "841081", 3,099%, scadenza 01/02/2050 *	106	0,05	97 Pool Freddie Mac 'SD2688', 5,500%, scadenza 01/04/2053	96	0,05
370 Pool Freddie Mac 'QB3535', 2,000%, scadenza 01/09/2050	297	0,15	96 Pool Freddie Mac 'SD2723', 5,500%, scadenza 01/03/2053	96	0,05
75 Pool Freddie Mac 'QB4985', 2,000%, scadenza 01/11/2050	60	0,03	98 Pool Freddie Mac 'SD2762', 5,500%, scadenza 01/05/2053	97	0,05
74 Pool Freddie Mac 'QB5092', 2,500%, scadenza 01/11/2050	62	0,03	95 Pool Freddie Mac 'SD2792', 4,500%, scadenza 01/03/2047	92	0,05
69 Pool Freddie Mac 'QB5093', 2,500%, scadenza 01/11/2050	64	0,03	97 Pool Freddie Mac 'SD2892', 5,500%, scadenza 01/05/2053	96	0,05
76 Pool Freddie Mac 'QB8604', 2,000%, scadenza 01/02/2051	56	0,03	196 Pool Freddie Mac 'SD2919', 5,500%, scadenza 01/04/2053	193	0,09
287 Pool Freddie Mac 'QB9087', 2,000%, scadenza 01/02/2051	232	0,11	99 Pool Freddie Mac 'SD2961', 5,000%, scadenza 01/11/2052	96	0,05
76 Pool Freddie Mac 'QB9482', 2,000%, scadenza 01/03/2051	61	0,03	477 Pool Freddie Mac 'SD2981', 6,500%, scadenza 01/05/2053	485	0,24
85 Pool Freddie Mac 'QC3690', 2,500%, scadenza 01/07/2051	71	0,03	388 Pool Freddie Mac 'SD3171', 5,500%, scadenza 01/06/2053	384	0,19
87 Pool Freddie Mac 'QC4824', 2,500%, scadenza 01/08/2051	73	0,04	200 Pool Freddie Mac 'SD3382', 5,000%, scadenza 01/06/2053	194	0,10
258 Pool Freddie Mac 'QC5830', 2,500%, scadenza 01/08/2051	217	0,11	299 Pool Freddie Mac 'SD3400', 4,500%, scadenza 01/10/2052	283	0,14
91 Pool Freddie Mac 'QC9154', 3,000%, scadenza 01/10/2051	80	0,04	47 Pool Freddie Mac 'SD7509', 3,000%, scadenza 01/11/2049	41	0,02
89 Pool Freddie Mac 'QC9443', 2,500%, scadenza 01/10/2051	74	0,04	140 Pool Freddie Mac 'SD7525', 2,500%, scadenza 01/10/2050	118	0,06
92 Pool Freddie Mac 'QD5827', 2,000%, scadenza 01/02/2052	74	0,04	149 Pool Freddie Mac 'SD7534', 2,500%, scadenza 01/02/2051	126	0,06
			566 Pool Freddie Mac 'SD7548', 2,500%, scadenza 01/11/2051	475	0,23
			193 Pool Freddie Mac 'SD7560', 4,000%, scadenza 01/02/2053	180	0,09
			620 Pool Freddie Mac 'SD8121', 2,000%, scadenza 01/01/2051	496	0,24
			281 Pool Freddie Mac 'SD8209', 1,500%, scadenza 01/03/2052	212	0,10
			93 Pool Freddie Mac 'SD8214', 3,500%, scadenza 01/05/2052	83	0,04
			100 Pool Freddie Mac 'WN1227', 4,650%, scadenza 01/01/2033	98	0,05
			300 Pool Freddie Mac 'WN2371', 4,600%, scadenza 01/02/2030	291	0,14
			100 Pool Freddie Mac 'WN2372', 4,600%, scadenza 01/02/2030	97	0,05
			45 Pool Freddie Mac 'ZA2489', 3,500%, scadenza 01/01/2038	42	0,02
			7 Pool Freddie Mac 'Z17269', 5,000%, scadenza 01/03/2038	7	-
			21 Freddie Mac REMICS 3947, classe SG, 0,647%, scadenza 15/10/2041 *	2	-
			12 Freddie Mac REMICS 4194, classe BI, 3,500%, scadenza 15/04/2043	2	-
			2 Freddie Mac REMICS 4298, classe PI, 4,000%, scadenza 15/04/2043	-	-
			28 Freddie Mac REMICS 4813, classe CJ, 3,000%, scadenza 15/08/2048	24	0,01
			66 Freddie Mac REMICS 5010, classe IK, 2,500%, scadenza 25/09/2050	10	-
			238 Freddie Mac REMICS 5010, classe JJ, 2,500%, scadenza 25/09/2050	41	0,02
			81 Freddie Mac REMICS 5013, classe IN, 2,500%, scadenza 25/09/2050	13	0,01
			167 Freddie Mac REMICS 5018, classe MI, 2,000%, scadenza 25/10/2050	22	0,01
			394 Freddie Mac REMICS 5038, classe PJ, 0,750%, scadenza 25/10/2050	277	0,14
			71 Freddie Mac REMICS 5040, classe IB, 2,500%, scadenza 25/11/2050	12	0,01
			337 Freddie Mac REMICS 5059, classe IB, 2,500%, scadenza 25/01/2051	53	0,03
			75 Freddie Mac REMICS 5069, classe MI, 2,500%, scadenza 25/02/2051	11	0,01

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
426	50	0,02	38	38	0,02
80	68	0,03	87	80	0,04
176	25	0,01	205	198	0,10
200	179	0,09	66	54	0,03
420	428	0,21	64	54	0,03
68	67	0,03	251	214	0,11
16	17	0,01	315	278	0,14
10	9	-	86	73	0,04
3	3	-	603	532	0,26
62	58	0,03	87	77	0,04
35	32	0,02	94	88	0,04
52	46	0,02	92	78	0,04
115	104	0,05	96	92	0,04
7	7	-	193	188	0,09
6	6	-	191	190	0,09
4	4	-	284	251	0,12
15	15	0,01	99	96	0,05
8	8	-	96	99	0,05
13	12	0,01	194	171	0,08
445	420	0,21	300	248	0,12
11	10	-	1.000	851	0,42
24	107	0,05	1.400	1.231	0,60
21	22	0,01	1.200	1.090	0,54
55	46	0,02	500	466	0,23
85	68	0,03	900	858	0,42
330	278	0,14	1.100	1.070	0,53
169	142	0,07	800	792	0,39
166	140	0,07	500	502	0,25
172	145	0,07	100	101	0,05
84	71	0,03	5	-	-
87	73	0,04	7	-	-
176	148	0,07	1	-	-
175	148	0,07	15	-	-
344	288	0,14	15	-	-
268	226	0,11	25	14	0,01
89	79	0,04	30	24	0,01
93	80	0,04	30	30	0,01
95	86	0,04	78	-	-
772	681	0,33	39	-	-
98	96	0,05	17	-	-
100	87	0,04	20	2	-
25	23	0,01	12	-	-
29	26	0,01	17	-	-
73	68	0,03	20	-	-
31	30	0,01	12	11	0,01
106	91	0,04	29	1	-
28	26	0,01	13	13	0,01
10	9	-	75	67	0,03
104	96	0,05	18	-	-
56	51	0,02	54	-	-
14	13	0,01	8	7	-
43	40	0,02	10	-	-
14	13	0,01	49	1	-
44	40	0,02	247	1	-
13	13	0,01	391	388	0,19
43	40	0,02	44	8	-
14	14	0,01	29	5	-
83	74	0,04	536	4	-
16	16	0,01	262	9	-
21	18	0,01	74	10	-
148	140	0,07			
125	115	0,06			
11	10	-			
10	9	-			
99	91	0,04			
95	90	0,04			
19	19	0,01			
78	75	0,04			
37	36	0,02			
59	57	0,03			
16	16	0,01			
26	25	0,01			
48	47	0,02			
335	324	0,16			
15	15	0,01			
14	13	0,01			
42	39	0,02			
78	75	0,04			
19	19	0,01			
17	17	0,01			

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
153			300		
Government National Mortgage Association, serie 2020 123, classe NI, 2,500%, scadenza 20/08/2050					
74	21	0,01	289	243	0,12
Government National Mortgage Association, serie 2020 127, classe IN, 2,500%, scadenza 20/08/2050					
78	10	-	150	266	0,13
Government National Mortgage Association, serie 2020 129, classe IE, 2,500%, scadenza 20/09/2050					
80	11	-	1.379	137	0,07
Government National Mortgage Association, serie 2020 160, classe IH, 2,500%, scadenza 20/10/2050					
77	11	0,01	460	38	0,02
Government National Mortgage Association, serie 2020 160, classe VI, 2,500%, scadenza 20/10/2050					
313	11	0,01	1.501	377	0,18
Government National Mortgage Association, serie 2020 160, classe YI, 2,500%, scadenza 20/10/2050					
4.383	42	0,02	2	5	-
Government National Mortgage Association, serie 2020 178, classe IO, 1,422%, scadenza 16/10/2060 *					
3.216	399	0,20	Totale titoli garantiti da ipoteca (costo 88.667 dollari)		
Government National Mortgage Association, serie 2020 179, classe IO, 1,009%, scadenza 16/09/2062 *					
373	229	0,11	Obbligazioni ed effetti societari — 31,71% (28 febbraio 2023: 37,25%)		
Australia — 0,03% (28 febbraio 2023: 0,05%)					
70	41	0,02	70 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000%, scadenza 30/09/2043		
Belgio — 0,39% (28 febbraio 2023: 0,45%)					
1.653	108	0,05	110 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650%, scadenza 01/02/2026		
Government National Mortgage Association, serie 2020 195, classe IO, 0,926%, scadenza 16/12/2062 *					
253	43	0,02	230 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000%, scadenza 13/04/2028		
Government National Mortgage Association, serie 2020 47, classe MI, 3,500%, scadenza 20/04/2050					
71	12	0,01	60 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500%, scadenza 01/06/2030		
Government National Mortgage Association, serie 2020 H04, classe FP, 5,169%, scadenza 20/06/2069 *					
176	175	0,09	300 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350%, scadenza 01/06/2040		
Government National Mortgage Association, serie 2020 H09, classe FL, 4,850%, scadenza 20/05/2070 *					
108	186	0,09	15 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600%, scadenza 15/04/2048		
Government National Mortgage Association, serie 2020 H09, classe NF, 6,468%, scadenza 20/04/2070 *					
64	109	0,05	100 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439%, scadenza 06/10/2048		
Government National Mortgage Association, serie 2020 H13, classe FA, 4,989%, scadenza 20/07/2070 *					
5.902	62	0,03	30 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550%, scadenza 23/01/2049		
Government National Mortgage Association, serie 2021 10, classe IO, 0,986%, scadenza 16/05/2063 *					
159	408	0,20			
Government National Mortgage Association, serie 2021 115, classe MI, 2,500%, scadenza 20/05/2051					
436	17	0,01	Brasile — 0,77% (28 febbraio 2023: 0,57%)		
Government National Mortgage Association, serie 2021 188, classe PA, 2,000%, scadenza 20/10/2051					
169	361	0,18	10 Petrobras Global Finance BV, 6,250%, scadenza 17/03/2024		
Government National Mortgage Association, serie 2021 2, classe AH, 1,500%, scadenza 16/06/2063					
88	126	0,06	50 Petrobras Global Finance BV, 6,850%, scadenza 05/06/2115		
Government National Mortgage Association, serie 2021 223, classe P, 2,000%, scadenza 20/06/2051					
4.990	75	0,04	1.100 Suzano Austria GmbH, 6,000%, scadenza 15/01/2029		
Government National Mortgage Association, serie 2021 5, classe IO, 1,112%, scadenza 16/01/2061 *					
200	367	0,18	20 Vale Overseas Ltd, 6,875%, scadenza 21/11/2036		
Government National Mortgage Association, serie 2022 3, classe B, 1,850%, scadenza 16/02/2061					
874	101	0,05	390 Vale Overseas Ltd, 6,875%, scadenza 10/11/2039		
Government National Mortgage Association, serie 2022 3, classe IO, 0,640%, scadenza 16/02/2061 *					
100	44	0,02			
Government National Mortgage Association, serie 2022 63, classe LM, 3,500%, scadenza 20/10/2050					
300	83	0,04	Canada — 0,39% (28 febbraio 2023: 0,83%)		
Government National Mortgage Association, serie 2023 92, classe AH, 2,000%, scadenza 16/06/2064					
570	229	0,11	130 Bank of Montreal, 1,850%, scadenza 01/05/2025		
GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, serie 2018 3PCK, classe B, 144A, 8,174%, scadenza 15/09/2031 *					
466	555	0,27	30 Bank of Montreal, 3,803%, scadenza 15/12/2032 *		
GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, serie 2018 SRP5, classe A, 144A, 7,225%, scadenza 15/09/2031 *					
71	387	0,19	80 Bank of Nova Scotia/The, 3,450%, scadenza 04/11/2025		
HarborView Mortgage Loan Trust 2005-9, serie 2005 9, classe 2A1B, 6,168%, scadenza 20/06/2035 *					
450	64	0,03	240 Bank of Nova Scotia/The, 1,300%, scadenza 06/11/2025		
Independence Plaza Trust 2018-INDP, serie 2018 INDP, classe A, 144A, 3,763%, scadenza 10/07/2035					
10	423	0,21	70 Bank of Nova Scotia/The, 4,588%, scadenza 04/05/2037 *		
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, serie 2013 C17, classe B, 5,039%, scadenza 15/01/2047 *					
120	9	-	80 Barrick North America Finance LLC, 5,700%, scadenza 30/05/2041		
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23, serie 2014 C23, classe AS, 4,202%, scadenza 15/09/2047 *					
430	116	0,06	40 Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950%, scadenza 15/10/2039		
Mill City Mortgage Trust 2015-2, serie 2015 2, classe M3, 144A, 3,705%, scadenza 25/09/2057 *					
100	416	0,20	60 Royal Bank of Canada, 1,150%, scadenza 06/10/2025		
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18, serie 2014 C18, classe AS, 4,110%, scadenza 15/10/2047 *					
302	96	0,05	110 Royal Bank of Canada, 3,875%, scadenza 04/05/2032		
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C30, serie 2016 C30, classe A4, 2,600%, scadenza 15/09/2049					
217	277	0,14			
Morgan Stanley Capital I Trust 2017-ASHF, serie 2017 ASHF, classe A, 144A, 6,333%, scadenza 15/11/2034 *					
550	214	0,11	Cile — 0,32% (28 febbraio 2023: 0,28%)		
Natisix Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Classe A, 144A, 3,047%, scadenza 15/08/2036					
160	483	0,24	710 Corp Nacional del Cobre de Chile, 3,625%, scadenza 01/08/2027		
New Residential Mortgage Loan Trust 2015-2, serie 2015 2A, classe A1, 144A, 3,750%, scadenza 25/08/2055 *					
239	148	0,07	Cina — 0,37% (28 febbraio 2023: 0,45%)		
New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, serie 2016 3A, classe A1B, 144A, 3,250%, scadenza 25/09/2056 *					
239	217	0,11	120 NXP BV/NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700%, scadenza 01/05/2025		
New Residential Mortgage Loan Trust 2017-2, serie 2017 2A, classe B1, 144A, 4,500%, scadenza 25/03/2057 *					
264	221	0,11	670 Prosus NV, 144A, 4,027%, scadenza 03/08/2050		
New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, serie 2018 3A, classe A1, 144A, 4,500%, scadenza 25/05/2058 *					
174	252	0,12	250 Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 4,375%, scadenza 10/04/2024		
New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, serie 2021 NQM2R, classe A3, 144A, 1,353%, scadenza 25/10/2058 *					
5	155	0,08			
Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-4, serie 2007 4, classe 1A1, 3,827%, scadenza 25/09/2037 *					
5	5	-			

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Irlanda — (segue)					
360 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000%, scadenza 29/10/2028	312	0,16	450 Amazon.com Inc, 3,150%, scadenza 22/08/2027	423	0,21
	519	0,26	60 Amazon.com Inc, 3,450%, scadenza 13/04/2029	57	0,03
Giappone — 0,19% (28 febbraio 2023: 0,15%)					
400 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,837%, scadenza 17/04/2026 *	387	0,19	50 Amazon.com Inc, 1,500%, scadenza 03/06/2030	41	0,02
Kazakistan — 0,25% (28 febbraio 2023: 0,44%)					
560 KazMunayGas National Co JSC, 5,375%, scadenza 24/04/2030	510	0,25	80 Amazon.com Inc, 2,100%, scadenza 12/05/2031	66	0,03
Macao — 0,10% (28 febbraio 2023: 0,15%)					
200 Sands China Ltd, 5,375%, scadenza 08/08/2025	194	0,10	250 Amazon.com Inc, 3,600%, scadenza 13/04/2032	230	0,11
Messico — 0,60% (28 febbraio 2023: 0,62%)					
400 Comision Federal de Electricidad, 144A, 3,875%, scadenza 26/07/2033	312	0,15	80 Amazon.com Inc, 4,950%, scadenza 05/12/2044	79	0,04
450 Orbia Advance Corp SAB de CV, 144A, 2,875%, scadenza 11/05/2031	358	0,18	610 Amazon.com Inc, 2,500%, scadenza 03/06/2050	389	0,19
590 Southern Copper Corp, 5,250%, scadenza 08/11/2042	546	0,27	30 Amazon.com Inc, 4,250%, scadenza 22/08/2057	26	0,01
	1.216	0,60	290 American Express Co, 2,500%, scadenza 30/07/2024	282	0,14
Paesi Bassi — 0,60% (28 febbraio 2023: 0,65%)					
500 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375%, scadenza 04/08/2025	485	0,24	300 American Express Co, 4,050%, scadenza 03/05/2029	285	0,14
260 Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,375%, scadenza 21/05/2025	251	0,12	16 American International Group Inc, 2,500%, scadenza 30/06/2025	15	0,01
180 Shell International Finance BV, 2,750%, scadenza 06/04/2030	159	0,08	20 American International Group Inc, 4,750%, scadenza 01/04/2048	18	0,01
10 Shell International Finance BV, 4,550%, scadenza 12/08/2043	9	-	30 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650%, scadenza 15/01/2032	25	0,01
260 Shell International Finance BV, 4,000%, scadenza 10/05/2046	214	0,11	11 Amgen Inc, 4,663%, scadenza 15/06/2051	9	0,01
150 Shell International Finance BV, 3,250%, scadenza 06/04/2050	107	0,05	320 Apple Inc, 1,125%, scadenza 11/05/2025	299	0,15
	1.225	0,60	70 Applied Materials Inc, 1,750%, scadenza 01/06/2030	223	0,11
Perù — 0,21% (28 febbraio 2023: 0,33%)					
400 Petroleos del Perú SA, 4,750%, scadenza 19/06/2032	297	0,15	70 AT&T Inc, 3,800%, scadenza 15/02/2027	67	0,03
200 Petroleos del Perú SA, 144A, 5,625%, scadenza 19/06/2047	128	0,06	270 AT&T Inc, 2,300%, scadenza 01/06/2027	242	0,12
	425	0,21	40 AT&T Inc, 2,250%, scadenza 01/02/2032	31	0,02
Africa del Sud — 0,23% (28 febbraio 2023: 0,21%)					
490 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750%, scadenza 10/04/2027	475	0,23	50 AT&T Inc, 2,550%, scadenza 01/12/2033	38	0,02
Spagna — 0,50% (28 febbraio 2023: 0,52%)					
800 Banco Santander SA, 2,746%, scadenza 28/05/2025	757	0,37	10 AT&T Inc, 5,350%, scadenza 01/09/2040	9	-
300 Telefonica Emisiones SA, 5,213%, scadenza 08/03/2047	252	0,13	10 AT&T Inc, 5,550%, scadenza 15/08/2041	9	0,01
	1.009	0,50	37 AT&T Inc, 4,350%, scadenza 15/06/2045	29	0,01
Svizzera — 1,02% (28 febbraio 2023: 1,25%)					
620 Credit Suisse AG/New York NY, 7,950%, scadenza 01/09/2025	632	0,31	28 AT&T Inc, 4,500%, scadenza 09/03/2048	22	0,01
250 Credit Suisse AG/New York NY, 2,950%, scadenza 04/09/2025	238	0,12	160 AT&T Inc, 3,500%, scadenza 15/09/2053	105	0,05
400 UBS Group AG, 144A, 3,126%, scadenza 13/08/2030 *	343	0,17	76 AT&T Inc, 3,550%, scadenza 15/09/2055	50	0,02
500 UBS Group AG, 144A, 4,194%, scadenza 01/04/2031 *	451	0,22	10 AT&T Inc, 3,800%, scadenza 01/12/2057	7	-
500 UBS Group AG, 144A, 3,091%, scadenza 14/05/2032 *	412	0,20	63 AT&T Inc, 3,650%, scadenza 15/09/2059	41	0,02
	2.076	1,02	650 Bank of America Corp, 4,000%, scadenza 22/01/2025	634	0,31
Taiwan — 0,23% (28 febbraio 2023: 0,36%)					
570 TSMC Arizona Corp, 2,500%, scadenza 25/10/2031	475	0,23	10 Bank of America Corp, 4,450%, scadenza 03/03/2026	10	0,01
Emirati Arabi Uniti — 0,30% (28 febbraio 2023: 0,54%)					
650 DP World Ltd/Emirati Arabi Uniti, 144A, 5,625%, scadenza 25/09/2048	602	0,30	260 Bank of America Corp, 1,319%, scadenza 19/06/2026 *	239	0,12
Regno Unito — 1,11% (28 febbraio 2023: 1,57%)					
200 Barclays Plc, 4,972%, scadenza 16/05/2029 *	190	0,09	160 Bank of America Corp, 4,250%, scadenza 22/10/2026	154	0,08
400 HSBC Holdings Plc, 2,633%, scadenza 07/11/2025 *	384	0,19	90 Bank of America Corp, 3,593%, scadenza 21/07/2028 *	84	0,04
350 HSBC Holdings Plc, 4,300%, scadenza 08/03/2026	338	0,17	193 Bank of America Corp, 3,419%, scadenza 20/12/2028 *	177	0,09
600 HSBC Holdings Plc, 4,041%, scadenza 13/03/2028 *	564	0,28	220 Bank of America Corp, 3,970%, scadenza 05/03/2029 *	206	0,10
200 Lloyds Banking Group Plc, 4,650%, scadenza 24/03/2026	193	0,10	200 Bank of America Corp, 3,974%, scadenza 07/02/2030 *	184	0,09
400 NatWest Group Plc, 4,269%, scadenza 22/03/2025 *	396	0,19	210 Bank of America Corp, 2,592%, scadenza 29/04/2031 *	175	0,09
200 NatWest Group Plc, 4,892%, scadenza 18/05/2029 *	191	0,09	130 Bank of America Corp, 2,572%, scadenza 20/10/2032 *	104	0,05
	2.256	1,11	960 Bank of America Corp, 2,972%, scadenza 04/02/2033 *	790	0,39
Stati Uniti — 22,56% (28 febbraio 2023: 25,89%)					
10 3M Co, 2,375%, scadenza 26/08/2029	9	-	140 Bank of America Corp, 5,000%, scadenza 21/01/2044	133	0,07
140 3M Co, 3,700%, scadenza 15/04/2050	108	0,05	130 Bank of America Corp, 3,946%, scadenza 23/01/2049 *	102	0,05
10 Abbott Laboratories, 4,750%, scadenza 30/11/2036	10	0,01	180 Bank of America Corp, 4,083%, scadenza 20/03/2051 *	145	0,07
130 Abbott Laboratories, 4,900%, scadenza 30/11/2046	127	0,06	30 Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600%, scadenza 24/04/2025	28	0,01
90 AbbVie Inc, 3,800%, scadenza 15/03/2025	88	0,04	113 Becton Dickinson & Co, 4,685%, scadenza 15/12/2044	100	0,05
20 AbbVie Inc, 3,600%, scadenza 14/05/2025	19	0,01	110 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250%, scadenza 15/01/2049	97	0,05
90 AbbVie Inc, 2,950%, scadenza 21/11/2026	84	0,04	480 Boston Properties LP, 3,400%, scadenza 21/06/2029	411	0,20
1.080 AbbVie Inc, 3,200%, scadenza 21/11/2029	974	0,48	110 BP Capital Markets America Inc, 3,119%, scadenza 04/05/2026	105	0,05
10 AbbVie Inc, 4,875%, scadenza 14/11/2048	9	-	210 BP Capital Markets America Inc, 3,633%, scadenza 06/04/2030	194	0,10
70 AbbVie Inc, 4,250%, scadenza 21/11/2049	59	0,03	160 BP Capital Markets America Inc, 3,000%, scadenza 24/02/2050	107	0,05
280 Adobe Inc, 2,300%, scadenza 01/02/2030	243	0,12	19 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400%, scadenza 26/07/2029	18	0,01
10 Aetna Inc, 3,875%, scadenza 15/08/2047	8	-	140 Bristol-Myers Squibb Co, 4,250%, scadenza 26/10/2049	118	0,06
150 Air Lease Corp, 3,375%, scadenza 01/07/2025	143	0,07	380 Broadcom Inc, 144A, 3,137%, scadenza 15/11/2035	290	0,14
70 Air Lease Corp, 5,300%, scadenza 01/02/2028	69	0,03	50 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302%, scadenza 15/01/2035	448	0,22
320 Alphabet Inc, 1,100%, scadenza 15/08/2030	257	0,13	10 Carrier Global Corp, 3,577%, scadenza 05/04/2050	7	-
70 Alphabet Inc, 1,900%, scadenza 15/08/2040	47	0,02	240 Charles Schwab Corp/The, 5,875%, scadenza 24/08/2026	241	0,12
40 Alphabet Inc, 2,050%, scadenza 15/08/2050	24	0,01	50 Charles Schwab Corp/The, 6,136%, scadenza 24/08/2034 *	51	0,03
			180 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908%, scadenza 23/07/2025	177	0,09
			520 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200%, scadenza 15/03/2028	485	0,24
			80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050%, scadenza 30/03/2029	76	0,04
			80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400%, scadenza 01/04/2033	70	0,04
			90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, scadenza 01/04/2038	76	0,04
			90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484%, scadenza 23/10/2045	83	0,04
			10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, scadenza 01/05/2047	8	-
			360 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750%, scadenza 01/04/2048	304	0,15
			40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125%, scadenza 01/07/2049	31	0,02
			150 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800%, scadenza 01/03/2050	111	0,06
			60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500%, scadenza 01/04/2063	47	0,02
			150 Chevron Corp, 2,954%, scadenza 16/05/2026	143	0,07
			30 Chevron USA Inc, 3,850%, scadenza 15/01/2028	29	0,01
			200 Cigna Group/The, 4,125%, scadenza 15/11/2025	195	0,10
			480 Cigna Group/The, 4,375%, scadenza 15/10/2028	463	0,23

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Stati Uniti — (segue)					
20 Cigna Group/The, 4,900%, scadenza 15/12/2048	18	0,01	20 Enterprise Products Operating LLC, 4,850%, scadenza 15/03/2044	18	0,01
30 Cintas Corp n. 2, 3,700%, scadenza 01/04/2027	29	0,01	20 Enterprise Products Operating LLC, 4,800%, scadenza 01/02/2049	18	0,01
60 Cintas Corp n. 2, 4,000%, scadenza 01/05/2032	56	0,03	270 Enterprise Products Operating LLC, 4,200%, scadenza 31/01/2050	216	0,11
190 Citigroup Inc, 0,776%, scadenza 30/10/2024 *	188	0,09	20 Enterprise Products Operating LLC, 3,700%, scadenza 31/01/2051	15	0,01
300 Citigroup Inc, 4,400%, scadenza 10/06/2025	293	0,14	10 Enterprise Products Operating LLC, 3,950%, scadenza 31/01/2060	7	-
60 Citigroup Inc, 5,500%, scadenza 13/09/2025	60	0,03	30 Enterprise Products Operating LLC, 5,375%, scadenza 15/02/2078 *	25	0,01
90 Citigroup Inc, 3,106%, scadenza 08/04/2026 *	86	0,04	130 EOG Resources Inc, 4,375%, scadenza 15/04/2030	126	0,06
30 Citigroup Inc, 4,300%, scadenza 20/11/2026	29	0,01	350 EOG Resources Inc, 3,900%, scadenza 01/04/2035	310	0,15
220 Citigroup Inc, 4,450%, scadenza 29/09/2027	210	0,10	180 EOG Resources Inc, 4,950%, scadenza 15/04/2050	170	0,08
90 Citigroup Inc, 4,658%, scadenza 24/05/2028 *	88	0,04	140 EQT Corp, 7,000%, scadenza 01/02/2030	147	0,07
150 Citigroup Inc, 3,520%, scadenza 27/10/2028 *	139	0,07	50 FirstEnergy Corp, Serie A, 1,600%, scadenza 15/01/2026	45	0,02
200 Citigroup Inc, 3,980%, scadenza 20/03/2030 *	184	0,09	180 FirstEnergy Corp, Serie B, 4,150%, scadenza 15/07/2027	170	0,08
220 Citigroup Inc, 4,412%, scadenza 31/03/2031 *	204	0,10	200 FirstEnergy Corp, Serie C, 5,100%, scadenza 15/07/2047	174	0,09
280 Citigroup Inc, 2,572%, scadenza 03/06/2031 *	231	0,11	60 Freeport-McMoRan Inc, 5,400%, scadenza 14/11/2034	57	0,03
530 Citigroup Inc, 3,785%, scadenza 17/03/2033 *	461	0,23	30 Freeport-McMoRan Inc, 5,450%, scadenza 15/03/2043	27	0,01
170 Citigroup Inc, 4,910%, scadenza 24/05/2033 *	162	0,08	90 General Motors Co, 5,600%, scadenza 15/10/2032	87	0,04
90 Citigroup Inc, 8,125%, scadenza 15/07/2039	112	0,06	10 General Motors Co, 6,600%, scadenza 01/04/2036	10	0,01
77 Citigroup Inc, 4,650%, scadenza 30/07/2045	66	0,03	10 General Motors Co, 5,150%, scadenza 01/04/2038	9	-
10 Citigroup Inc, 4,750%, scadenza 18/05/2046	8	-	30 General Motors Co, 6,250%, scadenza 02/10/2043	28	0,01
110 Coca-Cola Co/The, 2,500%, scadenza 01/06/2040	80	0,04	10 General Motors Co, 5,950%, scadenza 01/04/2049	9	-
20 Coca-Cola Co/The, 2,600%, scadenza 01/06/2050	20	0,01	130 Gilead Sciences Inc, 3,650%, scadenza 01/03/2026	125	0,06
260 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036%, scadenza 15/11/2033	263	0,13	3 Goldman Sachs Capital II, 6,439%, perpetuo *	2	-
30 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,544%, scadenza 15/11/2053	31	0,02	50 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500%, scadenza 01/04/2025	145	0,07
120 Comcast Corp, 3,300%, scadenza 01/04/2027	113	0,06	90 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250%, scadenza 2/10/2025	87	0,04
100 Comcast Corp, 4,150%, scadenza 15/10/2028	96	0,05	800 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855%, scadenza 12/02/2026 *	743	0,37
80 Comcast Corp, 3,400%, scadenza 01/04/2030	73	0,04	90 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500%, scadenza 16/11/2026	85	0,04
130 Comcast Corp, 4,250%, scadenza 15/10/2030	124	0,06	40 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615%, scadenza 15/03/2028 *	37	0,02
361 Comcast Corp, 7,050%, scadenza 15/03/2033	412	0,20	180 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814%, scadenza 23/04/2029 *	167	0,08
80 Comcast Corp, 3,900%, scadenza 01/03/2038	68	0,03	660 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223%, scadenza 01/05/2029 *	622	0,31
10 Comcast Corp, 3,250%, scadenza 01/11/2039	8	-	30 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250%, scadenza 01/02/2041	32	0,02
40 Comcast Corp, 3,750%, scadenza 01/04/2040	33	0,02	260 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150%, scadenza 22/05/2045	239	0,12
20 Comcast Corp, 4,000%, scadenza 15/08/2047	16	0,01	10 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750%, scadenza 2/10/2045	9	-
20 Comcast Corp, 3,969%, scadenza 01/11/2047	16	0,01	50 Guardian Life Global Funding, 144A, 1,100%, scadenza 23/06/2025	46	0,02
20 Comcast Corp, 4,000%, scadenza 01/03/2048	16	0,01	4 Halliburton Co, 3,800%, scadenza 15/11/2025	4	-
10 Comcast Corp, 3,999%, scadenza 01/11/2049	8	-	30 Home Depot Inc/The, 2,500%, scadenza 15/04/2027	28	0,01
90 Comcast Corp, 2,800%, scadenza 15/01/2051	57	0,03	80 Home Depot Inc/The, 2,700%, scadenza 15/04/2030	70	0,03
291 Comcast Corp, 2,887%, scadenza 01/11/2051	187	0,09	60 Home Depot Inc/The, 3,250%, scadenza 15/04/2032	53	0,03
54 Comcast Corp, 2,937%, scadenza 01/11/2056	34	0,02	240 Home Depot Inc/The, 3,300%, scadenza 15/04/2040	189	0,09
10 Comcast Corp, 4,950%, scadenza 15/10/2058	9	-	20 Home Depot Inc/The, 3,900%, scadenza 15/06/2047	16	0,01
20 ConocoPhillips Co, 6,950%, scadenza 15/04/2029	22	0,01	60 Home Depot Inc/The, 3,350%, scadenza 15/04/2050	44	0,02
90 Consolidated Edison Co of New York Inc, serie 20A, 3,350%, scadenza 01/04/2030	81	0,04	20 Humana Inc, 4,500%, scadenza 01/04/2025	20	0,01
30 Consolidated Edison Co of New York Inc, serie 20B, 3,950%, scadenza 01/04/2050	24	0,01	110 Humana Inc, 3,950%, scadenza 15/03/2027	106	0,05
110 Constellation Brands Inc, 4,350%, scadenza 09/05/2027	107	0,05	150 Humana Inc, 3,700%, scadenza 23/03/2029	139	0,07
170 Continental Resources Inc/OK, 4,375%, scadenza 15/01/2028	160	0,08	30 Humana Inc, 2,150%, scadenza 03/02/2032	24	0,01
210 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750%, scadenza 15/01/2031	201	0,10	50 Intel Corp, 5,125%, scadenza 10/02/2030	50	0,02
140 Costco Wholesale Corp, 1,750%, scadenza 20/04/2032	111	0,06	30 Intel Corp, 5,200%, scadenza 10/02/2033	30	0,02
170 Coterra Energy Inc, 3,900%, scadenza 15/05/2027	162	0,08	180 Intel Corp, 4,750%, scadenza 25/03/2050	158	0,08
600 Coterra Energy Inc, 4,375%, scadenza 15/03/2029	565	0,28	20 Intel Corp, 3,050%, scadenza 12/08/2051	13	0,01
40 CVS Health Corp, 3,625%, scadenza 01/04/2027	38	0,02	210 Johnson & Johnson, 3,700%, scadenza 01/03/2046	175	0,09
70 CVS Health Corp, 4,300%, scadenza 25/03/2028	67	0,03	420 Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA, 1,750%, scadenza 15/09/2030	337	0,17
220 CVS Health Corp, 3,750%, scadenza 01/04/2030	200	0,10	230 JPMorgan Chase & Co, 4,023%, scadenza 05/12/2024 *	229	0,11
20 CVS Health Corp, 1,875%, scadenza 28/02/2031	16	0,01	360 JPMorgan Chase & Co, 0,563%, scadenza 16/02/2025 *	351	0,17
90 CVS Health Corp, 2,125%, scadenza 15/09/2031	71	0,04	520 JPMorgan Chase & Co, 2,083%, scadenza 22/04/2026 *	489	0,24
380 CVS Health Corp, 4,780%, scadenza 25/03/2038	341	0,17	70 JPMorgan Chase & Co, 4,125%, scadenza 15/12/2026	67	0,03
40 CVS Health Corp, 4,125%, scadenza 01/04/2040	33	0,02	100 JPMorgan Chase & Co, 4,250%, scadenza 01/10/2027	97	0,05
40 CVS Health Corp, 5,125%, scadenza 20/07/2045	36	0,02	130 JPMorgan Chase & Co, 4,203%, scadenza 23/07/2029 *	123	0,06
220 CVS Health Corp, 5,050%, scadenza 25/03/2048	193	0,10	110 JPMorgan Chase & Co, 4,452%, scadenza 05/12/2029 *	105	0,05
3 CVS Pass-Through Trust, 5,880%, scadenza 10/01/2028	3	-	210 JPMorgan Chase & Co, 2,522%, scadenza 22/04/2031 *	176	0,09
140 Deere & Co, 3,750%, scadenza 15/04/2050	120	0,06	280 JPMorgan Chase & Co, 2,580%, scadenza 22/04/2032 *	229	0,11
340 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500%, scadenza 20/10/2025	333	0,16	115 JPMorgan Chase & Co, 4,950%, scadenza 01/06/2045	106	0,05
190 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750%, scadenza 20/10/2028	183	0,09	50 JPMorgan Chase & Co, 3,109%, scadenza 22/04/2051 *	34	0,02
160 Devon Energy Corp, 5,850%, scadenza 15/12/2025	161	0,08	110 Kenvue Inc, 144A, 4,900%, scadenza 22/03/2033	109	0,05
18 Devon Energy Corp, 5,250%, scadenza 15/10/2027	18	0,01	30 Kimberly-Clark Corp, 3,100%, scadenza 26/03/2030	27	0,01
30 Devon Energy Corp, 4,500%, scadenza 15/01/2030	28	0,01	100 KLA Corp, 4,650%, scadenza 15/07/2032	98	0,05
40 Devon Energy Corp, 5,600%, scadenza 15/07/2041	37	0,02	340 Las Vegas Sands Corp, 3,200%, scadenza 08/08/2024	329	0,16
70 Devon Energy Corp, 4,750%, scadenza 15/05/2042	58	0,03	20 Las Vegas Sands Corp, 2,900%, scadenza 25/06/2025	19	0,01
300 Devon Energy Corp, 5,000%, scadenza 15/06/2045	257	0,13	70 Lowe's Cos Inc, 1,700%, scadenza 15/09/2028	60	0,03
260 Diamondback Energy Inc, 3,500%, scadenza 01/12/2029	235	0,12	90 Lowe's Cos Inc, 4,500%, scadenza 15/04/2030	87	0,04
30 Diamondback Energy Inc, 3,125%, scadenza 24/03/2031	26	0,01	340 Mars Inc, 144A, 3,200%, scadenza 01/04/2030	307	0,15
70 Eaton Corp, 4,150%, scadenza 02/11/2042	61	0,03	250 Mastercard Inc, 3,850%, scadenza 26/03/2050	208	0,10
60 Elevance Health Inc, 4,100%, scadenza 15/05/2032	55	0,03	50 McDonald's Corp, 3,500%, scadenza 01/07/2027	48	0,02
340 Enterprise Products Operating LLC, 4,150%, scadenza 16/10/2028	325	0,16	30 McDonald's Corp, 3,800%, scadenza 01/04/2028	29	0,01
160 Enterprise Products Operating LLC, 2,800%, scadenza 31/01/2030	139	0,07	60 McDonald's Corp, 2,125%, scadenza 01/03/2030	51	0,03
20 Enterprise Products Operating LLC, 7,550%, scadenza 15/04/2038	23	0,01	80 McDonald's Corp, 3,600%, scadenza 01/07/2030	74	0,04
60 Enterprise Products Operating LLC, 5,700%, scadenza 15/02/2042	59	0,03	220 McDonald's Corp, 4,875%, scadenza 09/12/2045	203	0,10
			20 McDonald's Corp, 3,625%, scadenza 01/09/2049	15	0,01
			60 McDonald's Corp, 4,200%, scadenza 01/04/2050	50	0,02
			15 Medtronic Inc, 4,625%, scadenza 15/03/2045	14	0,01
			10 Merck & Co Inc, 1,450%, scadenza 24/06/2030	105	0,05
			305 MetLife Inc, 6,400%, scadenza 15/12/2036	302	0,15
			110 Micron Technology Inc, 5,875%, scadenza 09/02/2033	109	0,05
			20 Microsoft Corp, 2,525%, scadenza 01/06/2050	13	0,01

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Stati Uniti — (segue)					
150	106	0,05	50	44	0,02
20	19	0,01	40	34	0,02
130	122	0,06	20	18	0,01
440	414	0,20	50	39	0,02
110	104	0,05	60	40	0,02
160	148	0,07	60	46	0,02
210	177	0,09	20	13	0,01
570	507	0,25	10	9	-
110	103	0,05	100	100	0,05
100	85	0,04	90	90	0,04
40	34	0,02	300	248	0,12
60	52	0,03	40	37	0,02
50	40	0,02	40	39	0,02
140	129	0,06	100	87	0,04
140	125	0,06	225	216	0,11
60	48	0,02	100	93	0,05
10	8	-	100	88	0,04
270	225	0,11	296	244	0,12
110	88	0,04	310	287	0,14
50	50	0,02	60	54	0,03
60	60	0,03	20	20	0,01
140	141	0,07	210	140	0,07
180	182	0,09	30	22	0,01
210	191	0,09	70	56	0,03
50	48	0,02	70	62	0,03
340	287	0,14	80	61	0,03
60	57	0,03	10	6	-
50	43	0,02	30	29	0,01
150	117	0,06	70	63	0,03
20	13	0,01	50	41	0,02
30	19	0,01	20	25	0,01
60	57	0,03	20	23	0,01
40	33	0,02	60	60	0,03
40	28	0,01	30	28	0,01
250	220	0,11	60	55	0,03
90	74	0,04	270	238	0,12
230	165	0,08	20	16	0,01
110	75	0,04	60	48	0,02
30	27	0,01	61	61	0,03
100	81	0,04	90	85	0,04
230	187	0,09	50	48	0,02
40	40	0,02	30	28	0,01
200	198	0,10	430	412	0,20
70	65	0,03	60	53	0,03
90	82	0,04	10	9	-
460	355	0,17	100	100	0,05
130	125	0,06	130	111	0,06
140	159	0,08	120	112	0,06
180	178	0,09	220	185	0,09
30	24	0,01	20	17	0,01
2	2	-	50	43	0,02
230	197	0,10	430	341	0,17
240	209	0,10	200	166	0,08
70	58	0,03	1070	967	0,48
70	61	0,03	30	32	0,02
170	105	0,05	Totale Obbligazioni ed effetti societari (costo 70.767 dollari)		64.519 31,71
30	29	0,01	Obbligazioni ed effetti governativi — 26,05% (28 febbraio 2023: 21,89%)		
100	87	0,04	Cile — 0,08% (28 febbraio 2023: 0,12%)		
100	97	0,05	250	158	0,08
100	97	0,05	Colombia — 0,33% (28 febbraio 2023: 0,48%)		
380	347	0,17	220	170	0,08
80	66	0,03	260	196	0,10
80	64	0,03	400	304	0,15
110	78	0,04			670 0,33
30	20	0,01	India — 0,20% (28 febbraio 2023: 0,14%)		
320	335	0,16	430	406	0,20
110	97	0,05	Israele — 0,34% (28 febbraio 2023: 0,54%)		
190	142	0,07	800	698	0,34
100	100	0,05	Kazakistan — 0,09% (28 febbraio 2023: 0,14%)		
130	112	0,06	200	179	0,09
230	168	0,08	Messico — 0,81% (28 febbraio 2023: 0,83%)		
30	29	0,01	1580	1.331	0,65
40	38	0,02			325 0,16
100	83	0,04			1.656 0,81
20	17	0,01			
50	47	0,02			
270	195	0,10			

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Contratti (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti governativi — (segue)					
Panama — 0,23% (28 febbraio 2023: 0,20%)					
640 Obbligazione governativa internazionale di Panama, 4,300%, scadenza 29/04/2053	463	0,23			
Perù — 0,22% (28 febbraio 2023: 0,13%)					
40 Obbligazione internazionale del governo peruviano, 3,550%, scadenza 10/03/2051	29	0,01			
640 Obbligazione internazionale del governo peruviano, 3,600%, scadenza 15/01/2072	422	0,21			
	451	0,22			
Corea del Sud — 0,24% (28 febbraio 2023: 0,20%)					
510 Korea Housing Finance Corp, 144A, 4,625%, scadenza 24/02/2033	488	0,24			
Stati Uniti — 23,00% (28 febbraio 2023: 18,58%)					
440 Titoli di sconto Federal Home Loan Bank, zero coupon, scadenza 12/12/2023	434	0,21			
640 Titoli di sconto Federal Home Loan Bank, zero coupon, scadenza 02/01/2024	629	0,31			
640 Titoli di sconto Federal Home Loan Bank, zero coupon, scadenza 29/01/2024	626	0,31			
2.160 United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 03/10/2023	2.150	1,06			
1.400 United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 12/12/2023	1.379	0,68			
1.760 United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 26/12/2023	1.730	0,85			
1.470 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125%, scadenza 15/01/2033 β	1.405	0,69			
20 United States Treasury Note/Bond, 2,250%, scadenza 30/04/2024	19	0,01			
340 United States Treasury Note/Bond, 4,625%, scadenza 28/02/2025	338	0,17			
20 United States Treasury Note/Bond, 4,625%, scadenza 15/03/2026	20	0,01			
70 United States Treasury Note/Bond, 2,250%, scadenza 31/03/2026	66	0,03			
310 United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/10/2027	307	0,15			
1.700 United States Treasury Note/Bond, 3,875%, scadenza 31/12/2027	1.669	0,82			
890 United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 31/01/2028	861	0,42			
10 United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 29/02/2028	10	-			
50 United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/03/2028	49	0,02			
1.819 United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/05/2028	1.819	0,89			
6.110 United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/07/2028	6.075	2,99			
280 United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/03/2030	270	0,13			
40 United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 30/04/2030	38	0,02			
1.140 United States Treasury Note/Bond, 3,750%, scadenza 31/05/2030	1.109	0,55			
970 United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 31/07/2030	959	0,47			
3.340 United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/08/2030	3.326	1,63			
245 United States Treasury Note/Bond, 3,375%, scadenza 15/05/2033	231	0,11			
170 United States Treasury Note/Bond, 3,250%, scadenza 15/05/2042	145	0,07			
380 United States Treasury Note/Bond, 3,875%, scadenza 15/02/2043	354	0,17			
1.990 United States Treasury Note/Bond, 3,875%, scadenza 15/05/2043	1.851	0,91			
1.500 United States Treasury Note/Bond, 4,375%, scadenza 15/08/2043	1.496	0,74			
640 United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/02/2048	508	0,25			
460 United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/02/2049	365	0,18			
130 United States Treasury Note/Bond, 2,875%, scadenza 15/05/2049	101	0,05			
3.200 United States Treasury Note/Bond, 2,000%, scadenza 15/02/2050	2.050	1,01			
700 United States Treasury Note/Bond, 1,625%, scadenza 15/11/2050	405	0,20			
280 United States Treasury Note/Bond, 2,250%, scadenza 15/02/2052	189	0,09			
1.590 United States Treasury Note/Bond, 2,875%, scadenza 15/05/2052	1.235	0,61			
3.450 United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/08/2052	2.750	1,35			
60 United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 15/11/2052	58	0,03			
2.315 United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/02/2053	2.086	1,03			
8.530 United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/05/2053	7.695	3,78			
	46.807	23,00			
Uruguay — 0,51% (28 febbraio 2023: 0,53%)					
440 Obbligazione governativa internazionale dell'Uruguay, 4,375%, scadenza 23/01/2031	433	0,22			
40 Uruguay Government International Bond, 5,750%, scadenza 28/10/2034	43	0,02			
220 Uruguay Government International Bond, 7,625%, scadenza 21/03/2036	267	0,13			
300 Obbligazione governativa internazionale dell'Uruguay, 5,100%, scadenza 18/06/2050	289	0,14			
	1.032	0,51			
Totale Obbligazioni ed effetti governativi (costo 57.071 dollari)					
	53.008	26,05			
Organismi di investimento collettivo — 5,29% (28 febbraio 2023: 1,32%)					
10.768 Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (distribuzione)	10.768	5,29			
Totale Organismi di investimento collettivo (Costo 10.768\$)					
	10.768	5,29			
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 241.741\$)					
	226.747	111,44			
Opzioni acquistate — 0,16% (28 febbraio 2023: 0,05%)					
- Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi dicembre 2023 Put 95.8750, scadenza 15/12/2023 - Goldman Sachs	20	0,01			
- Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi dicembre 2023 Put 96.00, scadenza 15/12/2023 - Goldman Sachs	57	0,03			
- Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi ottobre 2023 Put 97.00, scadenza 13/10/2023 - Goldman Sachs	80	0,04			
- CME futures SOFR 3 mesi marzo 2024 Call 95,25, scadenza 15/03/2024 - Goldman Sachs	8	-			
- CME futures SOFR 3 mesi settembre 2023 Call 96,00, scadenza 15/09/2023 - Goldman Sachs	-	-			
- Call 10 anni USA ottobre 2023 110.50, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	13	0,01			
- Call 10 anni USA ottobre 2023 111.00, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	9	-			
- Call 5 anni USA ottobre 2023 106.50, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	18	0,01			
- Call 5 anni USA ottobre 2023 107.25, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	14	0,01			
- Obbligazione USA ottobre 2023 call 119,00, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	39	0,02			
- Obbligazione USA ottobre 2023 call 120,00, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	15	0,01			
- Obbligazione USA ottobre 2023 call 121,00, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	36	0,02			
- Obbligazione USA ottobre 2023 call 121,50, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	13	-			
- Obbligazione USA ottobre 2023 call 122,00, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	5	-			
Totale opzioni acquistate (costo 233 dollari)					
	327	0,16			
Credit Default Swap — 0,17% (28 febbraio 2023: 0,23%)					
Apprezamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)	350	0,17			
Swap su indici — 0,48% (28 febbraio 2023: 1,66%)					
Apprezamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	971	0,48			
Futures — 0,15% (28 febbraio 2023: 0,23%)					
Apprezamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)	310	0,15			
Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico					
	228.705	112,40			
Opzioni scritte — (0,10%) (28 febbraio 2023: (0,05%))					
- Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi dicembre 2023 Put 95.25, scadenza 15/12/2023 - Goldman Sachs	(12)	(0,01)			
- Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi dicembre 2023 Put 95.3750, scadenza 15/12/2023 - Goldman Sachs	(36)	(0,02)			
- Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi ottobre 2023 Put 96,25, scadenza 13/10/2023 - Goldman Sachs	(34)	(0,02)			
- Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi ottobre 2023 Put 96,50, scadenza 13/10/2023 - Goldman Sachs	(48)	(0,02)			
- CME futures SOFR 3 mesi marzo 2024 Call 96,1250, scadenza 15/03/2024 - Goldman Sachs	(8)	(0,01)			
- CME futures SOFR 3 mesi settembre 2023 Call 96,75, scadenza 15/09/2023 - Goldman Sachs	-	-			
- 10 anni USA novembre 2023 call 112.00, scadenza 27/10/2023 - Goldman Sachs	(14)	(0,01)			
- 10 anni USA novembre 2023 call 107.50, scadenza 27/10/2023 - Goldman Sachs	(3)	-			
- 10 anni USA novembre 2023 call 108.00, scadenza 27/10/2023 - Goldman Sachs	(3)	-			
- 10 anni USA ottobre 2023 call 111.75, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	(7)	-			
- 10 anni USA ottobre 2023 call 112.00, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	(4)	-			
- 10 anni USA ottobre 2023 call 112.50, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	(6)	-			
- 10 anni USA ottobre 2023 put 109.00, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	(2)	-			
- 5 anni USA ottobre 2023 put 105.00, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	(1)	-			
- Obbligazione USA ottobre 2023 call 123,00, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	(7)	-			
- Obbligazione USA ottobre 2023 call 124,00, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	(9)	(0,01)			
- Obbligazione USA ottobre 2023 put 117,00, scadenza 22/09/2023 - Goldman Sachs	(1)	-			
Totale opzioni scritte (costo 171 dollari)					
	(195)	(0,10)			
Credit Default Swap — (0,01%) (28 febbraio 2023: (0,03%))					
Deprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)	(20)	(0,01)			
Futures - (0,07%) (28 febbraio 2023: (0,14%))					
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	(152)	(0,07)			
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico					
	(367)	(0,18)			
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico					
	228.338	112,22			
Passività in eccesso rispetto ad altre attività					
	(24.862)	(12,22)			
Patrimonio in gestione					
	203.476\$	100,00			

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

- Gli importi indicati con “-” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.
- 144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell’ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 27.078.000 dollari ovvero al 13,29% dell’attivo netto.
- * Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.
- † Illiquido.
- ∞ Il titolo è valutato in buona fede al valore equo o a discrezione del Comitato di valutazione.
- ± Titoli acquistati su base non definitiva.
- β Il tasso di interesse di questo tipo di titoli è legato all’indice dei prezzi al consumo (CPI)/indice dei prezzi al dettaglio (RPI). Il tasso cedolare è quello del 31 agosto 2023.

ABBREVIAZIONI:

- Perpetual – Un’obbligazione senza data di scadenza. Le obbligazioni perpetue non sono rimborsabili, ma pagano un flusso costante di interessi.
- REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.
- TBA – Da annunciare.

Analisi delle attività totali

	% delle Attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	90,97
Organismi di investimento collettivo	4,54
Strumenti finanziari derivati	0,82
Altre attività	3,67
Totale Attività	100,00

Prospetto dei Credit Default Swap

Controparte	Entità di riferimento – Protezione di acquisto/vendita	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000% - Vendita	20-giu-2033	4.870	\$ (20)
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000% - Vendita	20-giu-2028	22.680	350
Apprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 304\$)				\$ 350
Deprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (44)\$)				(20)
Apprezzamento netto dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 260\$)				\$ 330

Prospetto degli swap indicizzati

Controparte	Entità di riferimento	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Goldman Sachs	Tasso fisso di pagamento 2,500%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	21-apr-2052	559	\$ 105
Goldman Sachs	Tasso fisso di pagamento 2,600%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	15-feb-2048	954	160
Goldman Sachs	Tasso fisso di pagamento 2,850%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	15-Feb-2029	2.092	115
Goldman Sachs	Tasso fisso di pagamento 3,050%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	15-feb-2048	2.107	203
Goldman Sachs	Tasso fisso di pagamento 3,150%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	15-mag-2048	2.163	173
Goldman Sachs	Tasso fisso di pagamento 3,270%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	30-apr-2029	1.719	61
Goldman Sachs	Tasso variabile di pagamento SOFR composto in USD, tasso di credito fisso 4,000%	29-feb-2028	6.950	4
Goldman Sachs	Tasso variabile di pagamento SOFR composto in USD, tasso di credito fisso 4,180%	29-feb-2028	19.990	150
Apprezzamento non realizzato degli swap indicizzati (28 febbraio 2023 (in migliaia): 2.192\$)				\$ 971
Ammortamento non realizzato degli swap indicizzati (28 febbraio 2023 (in migliaia): (2)\$)				-
Apprezzamento netto degli swap indicizzati (28 febbraio 2023 (in migliaia): 2.190\$)				\$ 971

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato dei contratti (in migliaia)
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2023	Goldman Sachs	(115)	\$ (27.197)	\$ 165
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2024	Goldman Sachs	70	16.770	2
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2025	Goldman Sachs	29	6.990	9
Indice SOFR a 3 mesi giugno 2023	Goldman Sachs	1	237	(5)
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Goldman Sachs	(50)	(5.552)	(44)
U.S. 10 Year Ultra Note dicembre 2023	Goldman Sachs	(15)	(1.742)	(26)
U.S. 2 Year Note (CBT) dicembre 2023	Goldman Sachs	56	11.413	36
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Goldman Sachs	(100)	(10.692)	(72)
U.S. Long Bond (CBT) dicembre 2023	Goldman Sachs	(8)	(973)	(5)
U.S. Ultra Bond (CBT) dicembre 2023	Goldman Sachs	37	4.790	98
Apprezzamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 303\$)				\$ 310
Ammortamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (180)\$)				(152)
Apprezzamento netto dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 123\$)				\$ 158

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (000's)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Titoli garantiti da attività — 6,25% (28 febbraio 2023: 6,51%)			1.095 Structured Asset Investment Loan Trust 2005-HE1, serie 2005 HE1, classe M2, 6,149%, scadenza 25/07/2035 *		
640	AB BSL CLO 4 Ltd, serie 2023 4A, classe A, 144A, 6,957%, scadenza 20/04/2036 *	643	0,06	1.017	0,10
107	Aegis Asset Backed Sec Corp Mort Pass Thr Certs serie 2003-3, serie 2003 3, classe M2, 7,904%, scadenza 25/01/2034 *	98	0,01	Totale titoli garantiti da attività (costo 68.053 dollari)	
3.060	Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Cfts Ser 2005-R8, serie 2005 R8, classe M4, 6,299%, scadenza 25/10/2035 *	2.944	0,29	62.530	6,25
2.500	Apidos CLO XXXVII, serie 2021 37A, classe A, 144A, 6,737%, scadenza 22/10/2034 *	2.484	0,25	Titoli garantiti da ipoteca — 40,85% (28 febbraio 2023: 32,48%)	
2.390	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, serie 1996 1, classe B1, 7,875%, scadenza 10/10/2026	76	0,01	54	Alternative Loan Trust 2005-14, serie 2005 14, classe 2A2, 5,679%, scadenza 25/05/2035 *
1.500	BCRED MML CLO 2021-1 LLC, serie 2021 1A, classe A, 144A, 7,050%, scadenza 15/01/2035 *	1.482	0,15	190	Alternative Loan Trust 2005-56, serie 2005 56, classe 4A1, 6,049%, scadenza 25/11/2035 *
1.000	BCRED MML CLO 2022-1 LLC, serie 2022 1A, classe A1, 144A, 6,976%, scadenza 20/04/2035 *	973	0,10	37	Alternative Loan Trust 2006-18CB, serie 2006 18CB, classe A6, 6,882%, scadenza 25/07/2036 *
1.740	Cayuga Park CLO Ltd, serie 2020 1A, classe AR, 144A, 6,690%, scadenza 17/07/2034 *	1.727	0,17	3.660	AREIT 2022-CRE7 LLC, serie 2022 CRE7, classe A, 144A, 7,556%, scadenza 17/06/2039 *
13	ContiMortgage Home Equity Loan Trust 1999-1, serie 1999 1, classe B, 9,000%, scadenza 25/04/2030	16	-	992	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, serie 2016 GG10, classe AJA, 144A, 5,810%, scadenza 10/08/2045 *
2.628	Countrywide Asset-Backed Certificates, serie 2004 3, classe 1A, 5,849%, scadenza 25/08/2034 *	2.486	0,25	2.034	Banc of America Funding 2014-R2 Trust, serie 2014 R2, classe 2A2, 144A, 5,645%, scadenza 26/05/2037 *
845	DB Master Finance LLC, serie 2021 1A, classe A23, 144A, 2,791%, scadenza 20/11/2025	671	0,07	780	BANK 2017-BNK7, serie 2017 BNK7, classe A5, 3,435%, scadenza 15/09/2060
2.713	Educational Funding Co LLC/The, serie 2006 1A, classe A3, 144A, 5,963%, scadenza 25/04/2033 *	1.861	0,19	12.085	BANK 2017-BNK7, serie 2017 BNK7, classe XA, 0,850%, scadenza 15/09/2060 *
2.672	Encore Credit Receivables Trust 2005-3, serie 2005 3, classe M5, 6,389%, scadenza 25/10/2035 *	2.470	0,25	1.500	BANK 2018-BNK15, serie 2018 BN15, classe B, 4,814%, scadenza 15/11/2061 *
179	Fannie Mae Grantor Trust 2017-T1, serie 2017 T1, classe A, 2,898%, scadenza 25/06/2027	165	0,02	2.570	BCCRE Trust 2015-GTP, serie 2015 GTP, classe E, 144A, 4,715%, scadenza 10/08/2033 *
8.581	Fieldstone Mortgage Investment Trust serie 2005-2, serie 2005 2, classe M3, 6,209%, scadenza 25/12/2035 *	7.428	0,74	254	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR1, serie 2007 AR1, classe 1A1, 5,589%, scadenza 25/01/2037 *
185	Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates FRESR 2017-SR01, serie 2017 SR01, classe A3, 3,089%, scadenza 25/11/2027	172	0,02	560	Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, serie 2018 B1, classe A5, 3,666%, scadenza 15/01/2051 *
640	Golub Capital Partners CLO 66B Ltd, serie 2023 66A, classe A, 144A, 6,926%, scadenza 25/04/2036 *	641	0,06	3.100	BXP Trust 2017-CQHP, serie 2017 CQHP, classe A, 144A, 6,208%, scadenza 15/11/2034 *
2.450	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, serie 2021 4GS, classe A, 144A, 1,930%, scadenza 20/07/2048	1.845	0,18	51	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-3, serie 2005 3, classe 1A2, 6,009%, scadenza 25/04/2035 *
3.226	Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, serie 2021 1GS, classe A, 144A, 2,290%, scadenza 20/01/2048	2.389	0,24	300	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27, serie 2015 GC27, classe AS, 3,571%, scadenza 10/02/2048
1.264	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, serie 2004 1, classe M1, 6,179%, scadenza 25/02/2034 *	1.216	0,12	72.508	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, serie 2016 C3, XA, 1,121%, scadenza 15/11/2049 *
2.000	Magnetite XIV-R Ltd, serie 2015 14RA, classe A2, 144A, 6,692%, scadenza 18/10/2031 *	2.000	0,20	8.968	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, serie 2006 AR6, Class 2A4, 5,869%, scadenza 25/09/2036 *
1.757	Magnolia Finance, 8,205%, scadenza 09/08/2024	1.698	0,17	20	COMM 2013-CRE12 Mortgage Trust, serie 2013 CR12, classe B, 4,762%, scadenza 10/10/2046 *
3.113	MF1 2021-FL6 Ltd, serie 2021 FL6, classe A, 144A, 6,526%, scadenza 16/07/2036 *	3.055	0,30	10	COMM 2013-CRE12 Mortgage Trust, serie 2013 CR12, classe C, 5,124%, scadenza 10/10/2046 *
3.319	Mosaic Solar Loan Trust 2021-3, serie 2021 3A, classe B, 144A, 1,920%, scadenza 20/06/2052	2.380	0,24	340	COMM 2013-CRE6 Mortgage Trust, serie 2013 CR6, classe B, 144A, 3,397%, scadenza 10/03/2046
3.000	National Collegiate II Commutation Trust, serie 2005 AR15, classe AR15, 0,000%, scadenza 01/06/2045	337	0,03	610	COMM 2015-CRE22 Mortgage Trust, serie 2015 CR22, classe A4, 3,048%, scadenza 10/03/2048
3.300	National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, serie 2006 3, classe B, 5,789%, scadenza 26/01/2032 *	2.503	0,25	90	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, serie 2015 DC1, classe B, 4,035%, scadenza 02/10/2048 *
2.000	Nelnet Student Loan Trust 2014-2, serie 2014 2A, classe B, 144A, 6,902%, scadenza 25/06/2041 *	1.890	0,19	70	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, serie 2015 DC1, classe C, 4,438%, scadenza 02/10/2048 *
2.000	Neuberger Berman Loan Advisers Clo 42 Ltd, serie 2021 42A, classe A, 144A, 6,670%, scadenza 16/07/2035 *	1.989	0,20	1.450	COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, serie 2015 PC1, classe A5, 3,902%, scadenza 10/07/2050
1.500	Ocean Trails Clo X, serie 2020 10A, classe AR, 144A, 6,790%, scadenza 15/10/2034 *	1.480	0,15	77	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, serie 2019 R07, classe 1M2, 144A, 7,502%, scadenza 25/10/2039 *
635	Ocean Trails Clo XI, serie 2021 11A, classe A, 144A, 6,808%, scadenza 20/07/2034 *	628	0,06	1.620	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, serie 2023 R05, classe 1M2, 144A, 8,396%, scadenza 25/06/2043 *
1.123	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, serie 2007 FXD1, classe 1A1, 5,866%, scadenza 25/01/2037	901	0,09	560	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R06, serie 2023 R06, classe 1M2, 144A, 7,988%, scadenza 25/07/2043 *
253	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2006-A, serie 2006 A, classe A2, 6,675%, scadenza 15/10/2037 *	230	0,02	500	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, serie 2015 C1, classe AS, 3,791%, scadenza 15/04/2050 *
1.000	Point Au Roche Park CLO Ltd, serie 2021 1A, classe A, 144A, 6,668%, scadenza 20/07/2034 *	989	0,10	1.050	CSMC 2014-USA OA LLC, serie 2014 USA, classe A2, 144A, 3,953%, scadenza 15/09/2037
3.004	RASC serie 2007-KS1 Trust, serie 2007 KS1, classe A4, 5,649%, scadenza 25/01/2037 *	2.766	0,28	140	CSMC 2014-USA OA LLC, serie 2014 USA, classe E, 144A, 4,373%, scadenza 15/09/2037
1.859	Renaissance Home Equity Loan Trust 2004-1, serie 2004 1, classe AV3, 6,369%, scadenza 25/05/2034 *	1.645	0,16	5.170	CSMC 2014-USA OA LLC, serie 2014 USA, classe F, 144A, 4,373%, scadenza 15/09/2037
2.565	SLM Private Education Loan Trust 2010-C, serie 2010 C, classe A5, 144A, 10,175%, scadenza 15/10/2041 *	2.715	0,27	1.960	CSMC 2017-RPL1 Trust, serie 2017 RPL1, classe M2, 144A, 2,963%, scadenza 25/07/2057 *
192	SMB Private Education Loan Trust 2014-A, serie 2014 A, classe A3, 144A, 6,925%, scadenza 15/04/2032 *	192	0,02	2.360	CSMC 2021-NQMB, serie 2021 NQMB, classe A1, 144A, 1,841%, scadenza 25/10/2066 *
2	SMB Private Education Loan Trust 2015-A, serie 2015 A, classe R, 144A, 0,000%, scadenza 15/10/2048	463	0,05	600	CSMC Trust 2017-CHOP, serie 2017 CHOP, classe G, 144A, 10,794%, scadenza 15/07/2032 *
345	SMB Private Education Loan Trust, serie 2020 B, classe A1A, 144A, 1,290%, scadenza 15/07/2053	308	0,03	1.680	DBCG 2017-BBG Mortgage Trust, serie 2017 BBG, classe A, 144A, 8,500%, scadenza 15/06/2034 *
1.746	Stonepeak 2021-1 ABS, serie 2021 1A, classe A, 144A, 2,675%, scadenza 28/02/2033	1.557	0,16	150	Deutsche Mortgage Securities Inc Mortgage Loan Trust serie 2006-PR1, serie 2006 PR1, classe 3AF1, 144A, 5,705%, scadenza 15/04/2036 *
				200	Fannie Mae 5Yr Pool, 4,830%, scadenza 01/09/2028 ∞
				201	Fannie Mae 5Yr Pool, 4,880%, scadenza 01/09/2028 ∞
				203	Fannie Mae 5Yr Pool, 5,340%, scadenza 01/09/2028 ∞

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
320 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, serie 2014 C03, classe 1M2, 8,402%, scadenza 25/07/2024 *	326	0,03	101 Pool Fannie Mae 'AS6340', 3,500%, scadenza 01/12/2045	92	0,01
1.317 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, serie 2018 C03, classe 1B1, 9,152%, scadenza 25/10/2030 *	1.413	0,14	81 Pool Fannie Mae 'AS6541', 3,500%, scadenza 01/01/2046	74	0,01
11 Fannie Mae Interest Strip 390, classe C3, 6,000%, scadenza 25/07/2038	2	-	66 Pool Fannie Mae 'AS6562', 3,500%, scadenza 01/01/2046	60	0,01
6 Fannie Mae Interest Strip 407, classe 22, 5,000%, scadenza 25/01/2039	1	-	57 Pool Fannie Mae 'AS7844', 3,000%, scadenza 01/09/2046	50	-
3 Fannie Mae Interest Strip 407, classe 23, 5,000%, scadenza 25/01/2039 *	1	-	190 Pool Fannie Mae 'AS8623', 3,000%, scadenza 01/01/2047	167	0,02
6 Fannie Mae Interest Strip 407, classe 27, 5,500%, scadenza 25/01/2039 *	1	-	127 Pool Fannie Mae 'AS8740', 3,500%, scadenza 01/02/2037	119	0,01
5 Fannie Mae Interest Strip 407, classe 34, 5,000%, scadenza 25/01/2038	1	-	730 Pool Fannie Mae 'AS8745', 3,000%, scadenza 01/02/2047	640	0,06
15 Fannie Mae Interest Strip 407, classe 41, 6,000%, scadenza 25/01/2038	3	-	18 Pool Fannie Mae 'AT7208', 4,000%, scadenza 01/06/2043	17	-
47 Fannie Mae Interest Strip 409, classe C13, 3,500%, scadenza 25/11/2041	7	-	24 Pool Fannie Mae 'AT8394', 4,000%, scadenza 01/06/2043	23	-
54 Fannie Mae Interest Strip 409, classe C18, 4,000%, scadenza 25/04/2042	10	-	65 Pool Fannie Mae 'AT9637', 4,000%, scadenza 07/01/2043	62	0,01
53 Fannie Mae Interest Strip 409, classe C2, 3,000%, scadenza 25/04/2027	2	-	49 Pool Fannie Mae 'AT9653', 4,000%, scadenza 07/01/2043	46	-
53 Fannie Mae Interest Strip 409, classe C22, 4,500%, scadenza 25/11/2039	10	-	38 Pool Fannie Mae 'AT9657', 4,000%, scadenza 07/01/2043	36	-
644 Fannie Mae Interest Strip 427, classe C73, 3,000%, scadenza 25/12/2048	104	0,01	250 Pool Fannie Mae 'AU6735', 3,000%, scadenza 10/01/2043	222	0,02
200 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 3,500% ±	179	0,02	91 Pool Fannie Mae 'AW0318', 4,500%, scadenza 02/01/2044	86	0,01
700 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 4,000% ±	646	0,06	32 Pool Fannie Mae 'BC1509', 3,000%, scadenza 08/01/2046	29	-
1.500 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 5,000% ±	1.455	0,15	90 Pool Fannie Mae 'BC2817', 3,000%, scadenza 09/01/2046	79	0,01
1.500 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 2,000% ±	1.195	0,12	190 Pool Fannie Mae 'BC9077', 3,500%, scadenza 12/01/2046	199	0,02
300 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 2,500% ±	249	0,02	573 Pool Fannie Mae 'BD2455', 3,000%, scadenza 01/01/2047	503	0,05
2.300 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 3,000% ±	1.982	0,20	232 Pool Fannie Mae 'BD8104', 3,000%, scadenza 10/01/2046	203	0,02
6.400 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 5,500% ±	6.320	0,63	799 Pool Fannie Mae 'BF0104', 4,000%, scadenza 02/01/2056	761	0,08
100 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 6,000% ±	100	0,01	558 Pool Fannie Mae 'BF0163', 5,000%, scadenza 11/01/2046	550	0,05
6 Pool Fannie Mae '745000', 6,000%, scadenza 01/10/2035	6	-	463 Pool Fannie Mae 'BF0183', 4,000%, scadenza 01/01/2057	429	0,04
4 Fannie Mae Pool '843997', 6,018%, scadenza 01/11/2035 *	4	-	789 Pool Fannie Mae 'BF0191', 4,000%, scadenza 06/01/2057	739	0,07
4 Pool Fannie Mae '865915', 6,247%, scadenza 01/03/2036 *	4	-	677 Pool Fannie Mae 'BF0222', 4,500%, scadenza 01/09/2057	647	0,06
342 Pool Fannie Mae '890604', 4,500%, scadenza 01/10/2044	331	0,03	37 Pool Fannie Mae 'BF0301', 4,500%, scadenza 01/08/2058	35	-
116 Pool Fannie Mae '890827', 3,500%, scadenza 01/12/2037	108	0,01	263 Pool Fannie Mae 'BF0338', 4,500%, scadenza 01/01/2059	251	0,02
13 Pool Fannie Mae '995072', 5,500%, scadenza 01/08/2038	14	-	4.925 Pool Fannie Mae 'BF0646', 2,500%, scadenza 01/06/2062	3.964	0,40
32 Pool Fannie Mae 'AB9683', 4,000%, scadenza 01/06/2043	30	-	72 Pool Fannie Mae 'BJ2544', 3,000%, scadenza 12/01/2037	65	0,01
29 Pool Fannie Mae 'AE0758', 7,000%, scadenza 01/02/2039	20	-	656 Pool Fannie Mae 'BK7700', 4,500%, scadenza 10/01/2048	635	0,06
26 Pool Fannie Mae 'AK8441', 4,000%, scadenza 01/04/2042	25	-	179 Pool Fannie Mae 'BL2454', 3,160%, scadenza 05/01/2029	164	0,02
319 Pool Fannie Mae 'AL3024', 3,500%, scadenza 01/01/2043	292	0,03	684 Pool Fannie Mae 'BM1565', 3,000%, scadenza 04/01/2047	600	0,06
21 Pool Fannie Mae 'AL3026', 3,500%, scadenza 01/12/2042	29	-	40 Pool Fannie Mae 'BM3799', 3,000%, scadenza 08/01/2047	35	-
23 Pool Fannie Mae 'AL3508', 4,000%, scadenza 01/04/2043	22	-	249 Pool Fannie Mae 'BM4751', 3,500%, scadenza 03/01/2043	230	0,02
16 Pool Fannie Mae 'AL4741', 4,500%, scadenza 01/01/2044	15	-	356 Pool Fannie Mae 'BM4897', 3,500%, scadenza 12/01/2046	328	0,03
66 Pool Fannie Mae 'AL9397', 3,000%, scadenza 01/10/2046	58	0,01	184 Pool Fannie Mae 'BM6623', 2,500%, scadenza 10/01/2050	199	0,01
339 Pool Fannie Mae 'AL9546', 3,500%, scadenza 01/11/2046	311	0,03	577 Pool Fannie Mae 'BM6898', 2,149%, scadenza 01/02/2032 *	472	0,05
299 Pool Fannie Mae 'AL9631', 3,000%, scadenza 01/12/2046	263	0,03	184 Pool Fannie Mae 'BM6912', 2,500%, scadenza 01/01/2052	149	0,01
80 Pool Fannie Mae 'AM3347', 3,310%, scadenza 01/05/2033	73	0,01	290 Pool Fannie Mae 'BN1623', 4,500%, scadenza 01/11/2048	280	0,03
10 Pool Fannie Mae 'AM8674', 2,810%, scadenza 01/04/2025	10	-	942 Pool Fannie Mae 'BN3898', 4,500%, scadenza 12/01/2048	909	0,09
207 Pool Fannie Mae 'AM8700', 2,930%, scadenza 01/06/2030	186	0,02	109 Pool Fannie Mae 'BO1858', 3,000%, scadenza 08/01/2049	96	0,01
89 Pool Fannie Mae 'AN4677', 3,200%, scadenza 01/02/2029	82	0,01	79 Pool Fannie Mae 'BP3484', 2,500%, scadenza 01/06/2051	66	0,01
114 Pool Fannie Mae 'AN4927', 3,450%, scadenza 01/03/2029	106	0,01	382 Pool Fannie Mae 'BQ3331', 2,000%, scadenza 08/01/2050	308	0,03
135 Pool Fannie Mae 'AN5386', 3,250%, scadenza 01/05/2029	125	0,01	515 Pool Fannie Mae 'BQ4926', 2,000%, scadenza 10/01/2050	413	0,04
10 Pool Fannie Mae 'AO2711', 4,000%, scadenza 01/05/2042	9	-	240 Pool Fannie Mae 'BQ5876', 2,500%, scadenza 11/01/2050	202	0,02
19 Pool Fannie Mae 'AO6086', 4,000%, scadenza 01/06/2042	18	-	96 Pool Fannie Mae 'BQ7435', 2,500%, scadenza 01/09/2051	79	0,01
9 Pool Fannie Mae 'AO9859', 4,000%, scadenza 01/07/2042	8	-	84 Pool Fannie Mae 'BR0663', 2,000%, scadenza 02/01/2051	67	0,01
14 Pool Fannie Mae 'AP0692', 4,000%, scadenza 01/07/2042	14	-	322 Pool Fannie Mae 'BR1001', 2,500%, scadenza 05/01/2051	272	0,03
15 Pool Fannie Mae 'AP2530', 4,000%, scadenza 01/08/2042	14	-	246 Pool Fannie Mae 'BR1823', 2,000%, scadenza 01/01/2051	197	0,02
49 Pool Fannie Mae 'AP4710', 3,500%, scadenza 01/08/2042	45	-	224 Pool Fannie Mae 'BR2641', 2,000%, scadenza 02/01/2051	182	0,02
233 Pool Fannie Mae 'AP4781', 3,000%, scadenza 01/09/2042	206	0,02	324 Pool Fannie Mae 'BR2643', 2,000%, scadenza 02/01/2051	294	0,03
23 Pool Fannie Mae 'AP4903', 4,000%, scadenza 01/09/2042	22	-	141 Pool Fannie Mae 'BR2644', 2,000%, scadenza 02/01/2051	114	0,01
53 Pool Fannie Mae 'AP7399', 4,000%, scadenza 01/09/2042	51	-	214 Pool Fannie Mae 'BR3256', 2,000%, scadenza 02/01/2051	176	0,02
14 Pool Fannie Mae 'AP9229', 4,000%, scadenza 01/10/2042	13	-	379 Pool Fannie Mae 'BR3257', 2,000%, scadenza 02/01/2051	310	0,03
55 Pool Fannie Mae 'AP9766', 4,000%, scadenza 01/10/2042	46	-	228 Pool Fannie Mae 'BR3286', 2,000%, scadenza 03/01/2051	184	0,02
49 Pool Fannie Mae 'AP9862', 4,000%, scadenza 01/10/2042	42	-	321 Pool Fannie Mae 'BR4035', 2,000%, scadenza 02/01/2051	258	0,03
16 Pool Fannie Mae 'AQ0100', 4,000%, scadenza 01/10/2042	15	-	535 Pool Fannie Mae 'BR4052', 2,000%, scadenza 02/01/2051	428	0,04
54 Pool Fannie Mae 'AQ1641', 4,000%, scadenza 01/10/2042	51	-	245 Pool Fannie Mae 'BR4080', 2,000%, scadenza 03/01/2051	196	0,02
16 Pool Fannie Mae 'AQ3599', 4,000%, scadenza 01/11/2042	15	-	218 Pool Fannie Mae 'BR4722', 2,000%, scadenza 03/01/2051	176	0,02
21 Pool Fannie Mae 'AQ4078', 4,000%, scadenza 01/06/2043	20	-	161 Pool Fannie Mae 'BR4753', 2,000%, scadenza 03/01/2051	130	0,01
16 Pool Fannie Mae 'AQ4080', 4,000%, scadenza 01/06/2043	15	-	284 Pool Fannie Mae 'BR4756', 2,000%, scadenza 03/01/2051	229	0,02
28 Pool Fannie Mae 'AQ4555', 4,000%, scadenza 01/12/2042	26	-	158 Pool Fannie Mae 'BR5487', 2,000%, scadenza 03/01/2051	127	0,01
22 Pool Fannie Mae 'AQ5137', 4,000%, scadenza 01/11/2042	21	-	322 Pool Fannie Mae 'BR5587', 2,000%, scadenza 03/01/2051	260	0,03
40 Pool Fannie Mae 'AQ7003', 4,000%, scadenza 01/12/2042	38	-	155 Pool Fannie Mae 'BR5589', 2,000%, scadenza 03/01/2051	124	0,01
54 Pool Fannie Mae 'AQ7082', 4,000%, scadenza 01/01/2043	51	0,01	407 Pool Fannie Mae 'BR5633', 2,000%, scadenza 03/01/2051	329	0,03
109 Pool Fannie Mae 'AR7399', 3,000%, scadenza 01/06/2043	96	0,01	246 Pool Fannie Mae 'BR6462', 2,000%, scadenza 03/01/2051	197	0,02
259 Pool Fannie Mae 'AS0038', 3,000%, scadenza 01/07/2043	230	0,02	77 Pool Fannie Mae 'BR6515', 2,000%, scadenza 01/04/2051	63	0,01
23 Pool Fannie Mae 'AS0070', 4,000%, scadenza 01/08/2043	22	-	76 Pool Fannie Mae 'BR7744', 2,000%, scadenza 01/04/2051	62	0,01
83 Pool Fannie Mae 'AS3253', 4,000%, scadenza 01/09/2044	78	0,01	221 Pool Fannie Mae 'BR7745', 2,000%, scadenza 01/04/2051	179	0,02
22 Pool Fannie Mae 'AS4271', 4,500%, scadenza 01/01/2045	21	-	80 Pool Fannie Mae 'BR8478', 2,000%, scadenza 01/04/2051	65	0,01
38 Pool Fannie Mae 'AS4347', 4,000%, scadenza 01/01/2045	36	-	152 Pool Fannie Mae 'BR8518', 2,000%, scadenza 01/04/2051	123	0,01
			100 Pool Fannie Mae 'BS5233', 3,520%, scadenza 06/01/2032	91	0,01
			100 Pool Fannie Mae 'BS5754', 3,900%, scadenza 06/01/2032	93	0,01
			100 Pool Fannie Mae 'BS5808', 3,830%, scadenza 07/01/2032	93	0,01
			100 Pool Fannie Mae 'BS5955', 3,730%, scadenza 06/01/2032	92	0,01
			98 Pool Fannie Mae 'BS5964', 3,670%, scadenza 06/01/2032	91	0,01
			100 Pool Fannie Mae 'BS6002', 3,560%, scadenza 07/01/2032	91	0,01
			98 Pool Fannie Mae 'BS6023', 3,860%, scadenza 07/01/2032	92	0,01
			100 Pool Fannie Mae 'BS6084', 4,185%, scadenza 07/01/2032	95	0,01
			99 Pool Fannie Mae 'BS6103', 4,060%, scadenza 07/01/2032	93	0,01
			100 Pool Fannie Mae 'BS6130', 4,130%, scadenza 07/01/2032	95	0,01
			98 Pool Fannie Mae 'BS6147', 3,880%, scadenza 07/01/2032	92	0,01
			100 Pool Fannie Mae 'BS6169', 4,110%, scadenza 07/01/2032	95	0,01

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
100	97	0,01	872	783	0,08
200	186	0,02	172	161	0,02
300	276	0,03	74	70	0,01
300	290	0,03	265	256	0,03
300	290	0,03	2.583	2.352	0,24
100	97	0,01	435	348	0,03
99	99	0,01	276	250	0,02
900	867	0,09	96	87	0,01
300	290	0,03	186	157	0,02
320	325	0,03	47	45	-
200	291	0,03	446	411	0,04
300	194	0,02	233	196	0,02
200	195	0,02	482	403	0,04
200	196	0,02	100	94	0,01
100	101	0,01	393	357	0,04
249	208	0,02	304	256	0,03
190	153	0,02	2.430	2.034	0,20
345	289	0,03	230	209	0,02
86	72	0,01	94	89	0,01
176	147	0,01	111	345	0,03
165	138	0,01	169	142	0,01
409	341	0,03	80	68	0,01
274	228	0,02	796	748	0,07
802	697	0,07	121	114	0,01
351	295	0,03	79	66	0,01
81	71	0,01	324	272	0,03
92	90	0,01	422	357	0,04
349	293	0,03	333	282	0,03
189	171	0,02	228	201	0,02
169	148	0,01	1.488	1.310	0,13
179	150	0,01	1.020	897	0,09
171	159	0,02	2.061	1.729	0,17
627	568	0,06	202	181	0,02
90	84	0,01	658	552	0,06
390	370	0,04	163	138	0,01
84	86	0,01	1.036	861	0,09
297	294	0,03	169	142	0,01
280	285	0,03	265	221	0,02
292	284	0,03	250	219	0,02
342	331	0,03	206	191	0,02
595	575	0,06	429	343	0,03
504	486	0,05	826	722	0,07
262	245	0,02	358	286	0,03
467	437	0,04	312	265	0,03
451	379	0,04	781	655	0,07
516	453	0,05	428	375	0,04
1.137	910	0,09	298	263	0,03
1.484	1.188	0,12	215	205	0,02
78	68	0,01	600	526	0,05
402	349	0,03	624	540	0,05
160	139	0,01	82	72	0,01
81	70	0,01	264	225	0,02
2.304	1.924	0,19	260	229	0,02
1.391	1.204	0,12	967	812	0,08
878	703	0,07	258	218	0,02
167	140	0,01	180	161	0,02
257	221	0,02	993	832	0,08
3.769	3.135	0,31	1.359	1.138	0,11
2.423	2.094	0,21	269	226	0,02
173	155	0,02	268	225	0,02
1.349	1.119	0,11	279	234	0,02
742	622	0,06	88	71	0,01
729	631	0,06	91	74	0,01
994	890	0,09	346	297	0,03
91	83	0,01	100	57	0,01
912	848	0,08	140	121	0,01
555	479	0,05	100	80	0,01
182	177	0,02	3.380	2.951	0,29
280	251	0,02	344	289	0,03
84	83	0,01	265	222	0,02
1.399	1.432	0,14	1.364	1.106	0,11
482	457	0,05	520	465	0,05
397	377	0,04	512	464	0,05
582	577	0,06	795	700	0,07
1.780	1.790	0,18	252	223	0,02
342	315	0,03	546	490	0,05
118	109	0,01	523	474	0,05
124	119	0,01	346	307	0,03
992	978	0,10	459	412	0,04
97	91	0,01	1.917	1.735	0,17
870	826	0,08	739	616	0,06
			91	77	0,01

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
178	149	0,01	280	284	0,03
89	75	0,01	73	7	-
571	511	0,05	4	4	-
791	660	0,07	141	14	-
1.223	1.134	0,11	38	40	-
1.034	957	0,10	55	59	0,01
89	80	0,01	45	3	-
5.546	4.794	0,48	145	153	0,02
377	358	0,04	178	180	0,02
930	832	0,08	45	99	0,01
94	75	0,01	145	153	0,02
1.331	1.191	0,12	178	180	0,02
274	277	0,03	1.006	99	0,01
389	387	0,04	153	10	-
277	263	0,03	766	80	0,01
386	366	0,04	202	16	-
571	542	0,05	639	372	0,04
392	381	0,04	1.700	1.291	0,13
382	363	0,04	388	67	0,01
383	372	0,04	379	61	0,01
278	287	0,03	2.109	318	0,03
294	272	0,03	1.318	175	0,02
99	96	0,01	2.061	313	0,03
1.359	1.098	0,11	2.019	272	0,03
776	623	0,06	241	224	0,02
478	464	0,05	800	726	0,07
194	156	0,02	741	692	0,07
192	182	0,02	480	430	0,04
286	288	0,03	1.688	108	0,01
280	271	0,03	100	93	0,01
389	378	0,04	60	54	0,01
189	175	0,02	113	117	0,01
298	296	0,03	12	12	-
3.818	3.480	0,35	1.240	1.095	0,11
9	9	-	787	695	0,07
36	36	-	21	20	-
11	10	-	23	22	-
16	16	-	24	23	-
16	16	-	21	20	-
63	60	0,01	772	265	0,03
16	15	-	772	677	0,07
454	429	0,04	213	187	0,02
103	98	0,01	191	167	0,02
288	263	0,03	74	70	0,01
199	182	0,02	45	42	-
23	22	-			
42	41	-			
38	36	-			
18	17	-			
40	39	-			
121	115	0,01			
83	79	0,01			
54	50	-			
504	465	0,05			
387	357	0,04			
782	721	0,07			
323	297	0,03			
1.696	1.558	0,16			
839	770	0,08			
1.380	1.255	0,13			
297	286	0,03			
223	187	0,02			
300	260	0,03			
3.178	2.547	0,25			
233	186	0,02			
236	189	0,02			
1.016	768	0,08			
685	570	0,06			
840	670	0,07			
164	138	0,01			
518	429	0,04			
175	145	0,01			
445	370	0,04			
180	150	0,01			
267	228	0,02			
545	466	0,05			
183	152	0,02			
91	78	0,01			
69	70	0,01			

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)			2.887		
			Pool Freddie Mac 'RA5117', 2,000%, scadenza 01/05/2051	2.319	0,23
18	17	-	428 Pool Freddie Mac 'RA5373', 2,000%, scadenza 01/06/2051	344	0,03
546	518	0,05	177 Pool Freddie Mac 'RA6332', 2,000%, scadenza 01/11/2051	142	0,01
6.438	141	0,01	85 Pool Freddie Mac 'RA6531', 3,500%, scadenza 01/01/2052	76	0,01
			516 Pool Freddie Mac 'RA6562', 2,500%, scadenza 01/01/2052	434	0,04
8.433	255	0,03	162 Pool Freddie Mac 'RA6599', 3,500%, scadenza 01/01/2052	145	0,01
			7.309 Pool Freddie Mac 'RA6694', 2,000%, scadenza 01/01/2052	5.838	0,58
30.132	1.883	0,19	718 Pool Freddie Mac 'RA7183', 4,000%, scadenza 01/04/2052	664	0,07
			1.539 Pool Freddie Mac 'RA7185', 4,000%, scadenza 01/04/2052	1.427	0,14
4.491	204	0,02	2.427 Pool Freddie Mac 'RA7186', 4,000%, scadenza 01/04/2052	2.254	0,23
			836 Pool Freddie Mac 'RA7928', 4,500%, scadenza 01/09/2052	793	0,08
7.783	191	0,02	886 Pool Freddie Mac 'RA8790', 5,000%, scadenza 01/04/2053	860	0,09
			197 Pool Freddie Mac 'RA9079', 6,500%, scadenza 01/05/2053	203	0,02
500	441	0,04	195 Pool Freddie Mac 'RA9080', 6,500%, scadenza 01/05/2053	201	0,02
			395 Pool Freddie Mac 'RA9081', 6,500%, scadenza 01/05/2053	404	0,04
10.773	272	0,03	1.642 Pool Freddie Mac 'RB5084', 1,500%, scadenza 01/11/2040	1.331	0,13
			2.410 Pool Freddie Mac 'RB5110', 1,500%, scadenza 01/05/2041	1.935	0,19
18.000	422	0,04	1.780 Pool Freddie Mac 'RB5117', 1,500%, scadenza 01/07/2041	1.430	0,14
			1.940 Pool Freddie Mac 'RB5125', 2,000%, scadenza 01/09/2041	1.620	0,16
53	50	-	922 Pool Freddie Mac 'RB5130', 1,500%, scadenza 01/10/2041	740	0,07
			257 Pool Freddie Mac 'RB5131', 2,000%, scadenza 01/10/2041	214	0,02
1.552	1.453	0,15	123 Pool Freddie Mac 'RB5134', 1,500%, scadenza 01/11/2041	99	0,01
			262 Pool Freddie Mac 'RB5138', 2,000%, scadenza 01/12/2041	217	0,02
530	503	0,05	177 Pool Freddie Mac 'RB5141', 2,000%, scadenza 01/01/2042	148	0,01
			537 Pool Freddie Mac 'RB5145', 2,000%, scadenza 01/02/2042	447	0,04
758	719	0,07	269 Pool Freddie Mac 'RB5149', 2,500%, scadenza 03/01/2042	230	0,02
			275 Pool Freddie Mac 'RB5153', 2,000%, scadenza 01/04/2042	228	0,02
44	39	-	1.019 Pool Freddie Mac 'SC0093', 2,000%, scadenza 10/01/2040	857	0,09
402	349	0,03	974 Pool Freddie Mac 'SC0160', 2,000%, scadenza 01/07/2041	819	0,08
375	301	0,03	333 Pool Freddie Mac 'SC0188', 2,000%, scadenza 01/09/2041	279	0,03
370	311	0,03	598 Pool Freddie Mac 'SC0206', 2,000%, scadenza 01/11/2041	501	0,05
227	191	0,02	89 Pool Freddie Mac 'SC0269', 2,000%, scadenza 01/01/2042	75	0,01
65	54	0,01	94 Pool Freddie Mac 'SC0310', 2,000%, scadenza 08/01/2042	78	0,01
225	184	0,02	282 Pool Freddie Mac 'SC0313', 2,000%, scadenza 01/01/2042	234	0,02
278	225	0,02	96 Pool Freddie Mac 'SC0345', 2,000%, scadenza 05/01/2042	80	0,01
143	116	0,01	1.273 Pool Freddie Mac 'SC0384', 2,000%, scadenza 01/04/2042	1.069	0,11
79	63	0,01	54 Pool Freddie Mac 'SD0247', 4,000%, scadenza 07/01/2047	51	-
1.146	929	0,09	214 Pool Freddie Mac 'SD0573', 2,000%, scadenza 01/04/2051	175	0,02
227	183	0,02	438 Pool Freddie Mac 'SD0615', 4,500%, scadenza 01/01/2051	423	0,04
149	121	0,01	252 Pool Freddie Mac 'SD0618', 3,000%, scadenza 01/02/2051	219	0,02
76	62	0,01	437 Pool Freddie Mac 'SD0745', 2,000%, scadenza 01/11/2051	353	0,04
251	202	0,02	529 Pool Freddie Mac 'SD0777', 2,500%, scadenza 01/11/2051	442	0,04
197	159	0,02	351 Pool Freddie Mac 'SD0849', 2,500%, scadenza 01/01/2052	294	0,03
234	189	0,02	957 Pool Freddie Mac 'SD1132', 4,000%, scadenza 01/06/2052	886	0,09
82	67	0,01	83 Pool Freddie Mac 'SD1143', 4,500%, scadenza 01/09/2050	80	0,01
145	118	0,01	1.613 Pool Freddie Mac 'SD1305', 5,000%, scadenza 01/07/2052	1.567	0,16
80	68	0,01	1.224 Pool Freddie Mac 'SD1549', 3,500%, scadenza 01/04/2052	1.096	0,11
255	214	0,02	1.227 Pool Freddie Mac 'SD1749', 2,500%, scadenza 01/04/2052	1.028	0,10
175	147	0,01	652 Pool Freddie Mac 'SD1751', 2,500%, scadenza 01/10/2051	547	0,05
87	73	0,01	675 Pool Freddie Mac 'SD1807', 4,500%, scadenza 01/07/2052	642	0,06
1.376	1.155	0,12	758 Pool Freddie Mac 'SD1936', 3,500%, scadenza 01/06/2052	679	0,07
			196 Pool Freddie Mac 'SD2138', 5,500%, scadenza 01/01/2053	194	0,02
175	141	0,01	293 Pool Freddie Mac 'SD2245', 5,500%, scadenza 01/12/2052	290	0,03
423	355	0,04	290 Pool Freddie Mac 'SD2251', 4,500%, scadenza 01/11/2052	275	0,03
174	141	0,01	747 Pool Freddie Mac 'SD2284', 6,000%, scadenza 01/12/2052	753	0,08
266	223	0,02	387 Pool Freddie Mac 'SD2374', 5,000%, scadenza 01/01/2053	376	0,04
712	592	0,06	389 Pool Freddie Mac 'SD2394', 4,500%, scadenza 01/11/2052	370	0,04
169	141	0,01	471 Pool Freddie Mac 'SD2395', 5,000%, scadenza 01/01/2053	458	0,05
85	71	0,01	467 Pool Freddie Mac 'SD2452', 6,500%, scadenza 01/02/2053	476	0,05
91	73	0,01	184 Pool Freddie Mac 'SD2474', 5,500%, scadenza 01/01/2053	182	0,02
717	602	0,06	285 Pool Freddie Mac 'SD2549', 4,000%, scadenza 01/07/2052	265	0,03
92	78	0,01	388 Pool Freddie Mac 'SD2578', 6,000%, scadenza 01/03/2053	389	0,04
277	240	0,02	192 Pool Freddie Mac 'SD2588', 4,000%, scadenza 07/01/2050	181	0,02
200	226	0,02	677 Pool Freddie Mac 'SD2591', 5,000%, scadenza 01/03/2053	659	0,07
170	161	0,02	778 Pool Freddie Mac 'SD2688', 5,500%, scadenza 01/04/2053	770	0,08
178	181	0,02	98 Pool Freddie Mac 'SD2715', 4,500%, scadenza 01/09/2050	94	0,01
386	356	0,04	482 Pool Freddie Mac 'SD2723', 5,500%, scadenza 01/03/2053	478	0,05
195	185	0,02	687 Pool Freddie Mac 'SD2762', 5,500%, scadenza 01/05/2053	680	0,07
286	272	0,03	190 Pool Freddie Mac 'SD2792', 4,500%, scadenza 01/03/2047	185	0,02
289	281	0,03	294 Pool Freddie Mac 'SD2866', 4,000%, scadenza 01/07/2049	278	0,03
178	182	0,02	484 Pool Freddie Mac 'SD2892', 5,500%, scadenza 01/05/2053	479	0,05
193	176	0,02	2.056 Pool Freddie Mac 'SD2919', 5,500%, scadenza 01/04/2053	2.031	0,20
172	195	0,02	197 Pool Freddie Mac 'SD2961', 5,000%, scadenza 01/11/2052	191	0,02
192	175	0,02	191 Pool Freddie Mac 'SD2981', 6,500%, scadenza 01/05/2053	194	0,02
94	92	0,01	388 Pool Freddie Mac 'SD3171', 5,500%, scadenza 01/06/2053	388	0,04
200	198	0,02	399 Pool Freddie Mac 'SD3382', 5,000%, scadenza 01/06/2053	384	0,04
75	65	0,01	466 Pool Freddie Mac 'SD7509', 3,000%, scadenza 01/11/2049	408	0,04
445	370	0,04	1.073 Pool Freddie Mac 'SD7521', 2,500%, scadenza 07/01/2050	904	0,09
96	77	0,01	702 Pool Freddie Mac 'SD7525', 2,500%, scadenza 01/10/2050	591	0,06
709	573	0,06	1.268 Pool Freddie Mac 'SD7534', 2,500%, scadenza 01/02/2051	1.075	0,11
1.962	1.652	0,17			
512	431	0,04			
591	448	0,04			
1.263	1.018	0,10			

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
5.483 Pool Freddie Mac 'SD7548', 2,500%, scadenza 01/11/2051	4.604	0,46	5	Ginnie Mae II Pool '4871', 6,000%, scadenza 20/11/2040	6
5.444 Pool Freddie Mac 'SD7554', 2,500%, scadenza 01/04/2052	4.562	0,46	19	Ginnie Mae II Pool '4905', 6,000%, scadenza 20/12/2040	20
1.349 Pool Freddie Mac 'SD7560', 4,000%, scadenza 01/02/2053	1.260	0,13	3	Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000%, scadenza 20/01/2041	3
196 Pool Freddie Mac 'SD8129', 2,500%, scadenza 01/02/2051	163	0,02	12	Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000%, scadenza 20/02/2041	12
2.077 Pool Freddie Mac 'SD8146', 2,000%, scadenza 01/05/2051	1.661	0,17	163	Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500%, scadenza 20/03/2041	160
197 Pool Freddie Mac 'SI2048', 2,500%, scadenza 07/01/2050	165	0,02	4	Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000%, scadenza 20/07/2040	4
200 Pool Freddie Mac 'WN2371', 4,600%, scadenza 01/02/2030	194	0,02	49	Ginnie Mae II Pool '783368', 4,500%, scadenza 20/07/2041	48
100 Pool Freddie Mac 'WN2372', 4,600%, scadenza 01/02/2030	97	0,01	104	Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500%, scadenza 20/01/2046	96
117 Pool Freddie Mac 'ZA5318', 3,500%, scadenza 03/01/2046	107	0,01	1.151	Ginnie Mae II Pool '784674', 3,500%, scadenza 20/04/2048	1.069
986 Pool Freddie Mac 'ZAG342', 4,500%, scadenza 03/01/2049	952	0,10	78	Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500%, scadenza 20/10/2049	71
99 Pool Freddie Mac 'Z17269', 5,000%, scadenza 01/03/2038	99	0,01	423	Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000%, scadenza 20/01/2050	374
161 Pool Freddie Mac 'ZM1278', 3,500%, scadenza 06/01/2046	147	0,01	73	Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500%, scadenza 20/09/2048	67
45 Pool Freddie Mac 'ZNO480', 3,500%, scadenza 01/10/2042	42	-	760	Ginnie Mae II Pool '785565', 2,500%, scadenza 20/06/2051	640
3 Pool Freddie Mac 'ZS0823', 5,000%, scadenza 12/01/2034	3	-	1.245	Ginnie Mae II Pool '785568', 2,500%, scadenza 20/08/2051	1.048
5 Pool Freddie Mac 'ZS2059', 5,500%, scadenza 04/01/2038	5	-	2.660	Ginnie Mae II Pool '785657', 2,500%, scadenza 20/10/2051	2.241
17 Pool Freddie Mac 'ZS3059', 5,500%, scadenza 01/12/2038	18	-	925	Ginnie Mae II Pool '785663', 2,500%, scadenza 20/10/2051	779
80 Pool Freddie Mac 'ZS3204', 3,000%, scadenza 06/01/2041	79	0,01	1.038	Ginnie Mae II Pool '785667', 2,500%, scadenza 20/10/2051	874
49 Pool Freddie Mac 'ZS3412', 5,500%, scadenza 01/12/2038	50	-	528	Ginnie Mae II Pool '785762', 2,500%, scadenza 20/11/2051	445
96 Pool Freddie Mac 'ZS8669', 3,000%, scadenza 09/01/2032	91	0,01	613	Ginnie Mae II Pool '785789', 2,500%, scadenza 20/12/2051	516
101 Pool Freddie Mac 'ZS8673', 3,000%, scadenza 10/01/2032	95	0,01	895	Ginnie Mae II Pool '785821', 2,500%, scadenza 20/12/2051	754
13 Pool Freddie Mac 'ZS8779', 5,000%, scadenza 07/01/2025	13	-	1.335	Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000%, scadenza 20/02/2052	1.179
539 Pool Freddie Mac 'ZS9316', 3,500%, scadenza 01/01/2038	500	0,05	351	Ginnie Mae II Pool '786077', 3,000%, scadenza 20/03/2052	309
235 Pool Freddie Mac 'ZT1107', 3,500%, scadenza 03/01/2043	215	0,02	445	Ginnie Mae II Pool '786082', 3,000%, scadenza 20/11/2051	393
22 Pool Freddie Mac 'ZT1159', 3,500%, scadenza 02/01/2044	20	-	652	Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000%, scadenza 20/04/2052	561
321 Pool Freddie Mac 'ZT1257', 3,000%, scadenza 01/01/2046	284	0,03	263	Ginnie Mae II Pool '786107', 3,000%, scadenza 20/03/2052	233
550 Pool Freddie Mac 'ZT1970', 3,500%, scadenza 04/01/2033	526	0,05	286	Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500%, scadenza 20/03/2052	257
49 Freddie Mac Reference REMIC R007, classe ZA, 6,000%, scadenza 15/05/2036	51	-	920	Ginnie Mae II Pool '786134', 3,000%, scadenza 20/04/2052	795
33 Freddie Mac REMICS 3621, classe SB, 0,927%, scadenza 15/01/2040 *	3	-	558	Ginnie Mae II Pool '786216', 3,500%, scadenza 20/06/2052	496
181 Freddie Mac REMICS 4813, classe CJ, 3,000%, scadenza 15/08/2048	158	0,02	955	Ginnie Mae II Pool '786335', 4,500%, scadenza 20/09/2052	915
397 Freddie Mac REMICS 5010, classe IK, 2,500%, scadenza 25/09/2050	60	0,01	384	Ginnie Mae II Pool '786340', 5,000%, scadenza 20/09/2052	379
1.030 Freddie Mac REMICS 5010, classe JL, 2,500%, scadenza 25/09/2050	177	0,02	765	Ginnie Mae II Pool '786366', 4,500%, scadenza 20/08/2052	730
404 Freddie Mac REMICS 5013, classe IN, 2,500%, scadenza 25/09/2050	64	0,01	287	Ginnie Mae II Pool '786429', 4,000%, scadenza 20/06/2052	269
835 Freddie Mac REMICS 5018, classe ML, 2,000%, scadenza 25/10/2050	110	0,01	679	Ginnie Mae II Pool '786474', 5,000%, scadenza 20/01/2053	666
213 Freddie Mac REMICS 5040, classe IB, 2,500%, scadenza 25/11/2050	37	-	1.284	Ginnie Mae II Pool '786535', 5,500%, scadenza 20/02/2053	1.277
1.350 Freddie Mac REMICS 5059, classe IB, 2,500%, scadenza 25/01/2051	214	0,02	295	Ginnie Mae II Pool '786709', 5,000%, scadenza 20/05/2053	288
451 Freddie Mac REMICS 5069, classe MI, 2,500%, scadenza 25/02/2051	66	0,01	600	Ginnie Mae II Pool '786843', 3,000%, scadenza 20/03/2052	524
1.232 Freddie Mac REMICS 5140, classe NI, 2,500%, scadenza 25/05/2049	175	0,02	757	Ginnie Mae II Pool 'AP6338', 4,000%, scadenza 20/10/2045	717
1.200 Freddie Mac REMICS 5224, classe HL, 4,000%, scadenza 25/04/2052	1.073	0,11	203	Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500%, scadenza 20/10/2047	187
629 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, serie 2020 DNA2, classe M2, 144A, 7,252%, scadenza 25/02/2050 *	631	0,06	160	Ginnie Mae II Pool 'BD0384', 3,500%, scadenza 20/10/2047	147
1.298 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, Series 2020 DNA6, Class M2, 144A, 7,288%, scadenza 25/12/2050 *	1.308	0,13	86	Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500%, scadenza 20/02/2050	78
950 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Series 2021 DNA6, classe B1, 144A, 8,688%, scadenza 25/10/2041 *	953	0,10	93	Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000%, scadenza 20/10/2049	87
1.131 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Series 2022 DNA2, Class M1B, 144A, 7,688%, scadenza 25/02/2042 *	1.128	0,11	73	Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000%, scadenza 20/11/2049	68
40 Freddie Mac Strips 334, classe S7, 0,797%, scadenza 15/08/2044 *	4	-	76	Ginnie Mae II Pool 'BS1728', 4,000%, scadenza 20/01/2050	73
320 Freddie Mac Strips 353, classe S1, 0,697%, scadenza 15/12/2046 *	29	-	63	Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000%, scadenza 20/02/2050	60
1.302 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, serie 2015 HQ2, classe B, 13,352%, scadenza 25/05/2025 *	1.333	0,13	318	Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000%, scadenza 20/03/2050	274
28 Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000%, scadenza 15/04/2040	28	-	93	Ginnie Mae II Pool 'CI1513', 3,000%, scadenza 20/03/2052	81
47 Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000%, scadenza 15/05/2040	47	-	280	Ginnie Mae II Pool 'CK9592', 4,000%, scadenza 20/06/2052	262
49 Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000%, scadenza 15/09/2042	44	-	177	Ginnie Mae II Pool 'CL5523', 3,000%, scadenza 20/04/2052	153
373 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500%, scadenza 15/06/2048	346	0,03	318	Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500%, scadenza 20/06/2044	137
70 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000%, scadenza 15/09/2042	63	0,01	39	Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500%, scadenza 20/03/2045	36
165 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000%, scadenza 15/09/2042	149	0,01	62	Ginnie Mae II Pool 'MA3375', 3,000%, scadenza 20/01/2046	55
360 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000%, scadenza 15/10/2042	324	0,03	52	Ginnie Mae II Pool 'MA3521', 3,500%, scadenza 20/03/2046	48
232 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000%, scadenza 15/10/2042	206	0,02	236	Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500%, scadenza 20/04/2046	218
1 Ginnie Mae I Pool 'AB9205', 3,000%, scadenza 15/11/2042	1	-	127	Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500%, scadenza 20/05/2046	117
201 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000%, scadenza 15/11/2042	179	0,02	216	Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500%, scadenza 20/06/2046	199
16 Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500%, scadenza 20/10/2037	16	-	130	Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500%, scadenza 20/07/2046	120
19 Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500%, scadenza 20/01/2040	19	-	79	Ginnie Mae II Pool 'MA3937', 3,500%, scadenza 20/09/2046	73
22 Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500%, scadenza 20/05/2040	22	-	109	Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000%, scadenza 20/11/2046	97
75 Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000%, scadenza 20/07/2040	75	0,01	83	Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000%, scadenza 20/02/2047	74
14 Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000%, scadenza 20/08/2040	14	-	21	Ginnie Mae II Pool 'MA4381', 3,000%, scadenza 20/04/2047	18
10 Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000%, scadenza 20/09/2040	10	-	1.390	Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000%, scadenza 20/06/2047	1.318
			247	Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500%, scadenza 20/08/2047	240
			15	Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000%, scadenza 20/11/2047	13
			558	Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000%, scadenza 20/11/2047	528
			157	Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000%, scadenza 20/12/2047	140
			240	Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000%, scadenza 20/12/2047	227
			210	Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000%, scadenza 20/02/2048	198
			1.231	Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000%, scadenza 20/03/2048	1.164
			200	Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000%, scadenza 20/04/2048	189
			366	Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500%, scadenza 20/04/2048	357
			113	Ginnie Mae II Pool 'MA5192', 4,000%, scadenza 20/05/2048	104
			561	Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500%, scadenza 20/05/2048	542
			96	Ginnie Mae II Pool 'MA5194', 5,000%, scadenza 20/05/2048	95
			322	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500%, scadenza 20/06/2048	311
			140	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500%, scadenza 20/07/2048	135
			307	Ginnie Mae II Pool 'MA5399', 4,500%, scadenza 20/08/2048	297
			277	Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500%, scadenza 20/10/2048	267
			165	Ginnie Mae II Pool 'MA5530', 5,000%, scadenza 20/10/2048	163
			369	Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000%, scadenza 20/11/2048	364
			268	Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500%, scadenza 20/12/2048	259
			285	Ginnie Mae II Pool 'MA5653', 5,000%, scadenza 20/12/2048	281
			420	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500%, scadenza 20/01/2049	406

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto		
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)							
1.144	Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5,000%, scadenza 20/01/2049	1.128	0,11	206	Government National Mortgage Association, serie 2014 176, classe IA, 4,000%, scadenza 20/11/2044	37	-
697	Ginnie Mae II Pool 'MA5763', 4,000%, scadenza 20/02/2049	657	0,07	1.535	Government National Mortgage Association, serie 2014 H20, classe FA, 5,648%, scadenza 20/10/2064 *	1.524	0,15
467	Ginnie Mae II Pool 'MA5764', 4,500%, scadenza 20/02/2049	451	0,05	460	Government National Mortgage Association, serie 2015 167, classe OI, 4,000%, scadenza 16/04/2045	87	0,01
183	Ginnie Mae II Pool 'MA5817', 4,000%, scadenza 20/03/2049	173	0,02	797	Government National Mortgage Association, serie 2015 183, classe IO, 0,529%, scadenza 16/09/2057 *	19	-
1.124	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500%, scadenza 20/03/2049	1.086	0,11	393	Government National Mortgage Association, serie 2016 135, classe SB, 0,673%, scadenza 16/10/2046 *	52	0,01
181	Ginnie Mae II Pool 'MA5819', 5,000%, scadenza 20/03/2049	179	0,02	750	Government National Mortgage Association, serie 2016 21, classe ST, 0,722%, scadenza 20/02/2046 *	79	0,01
154	Ginnie Mae II Pool 'MA5876', 4,000%, scadenza 20/04/2049	146	0,01	356	Government National Mortgage Association, serie 2016 84, classe IG, 4,500%, scadenza 16/11/2045	70	0,01
91	Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500%, scadenza 20/04/2049	88	0,01	929	Government National Mortgage Association, serie 2017 111, classe IO, 0,526%, scadenza 16/02/2059 *	29	-
135	Ginnie Mae II Pool 'MA5878', 5,000%, scadenza 20/04/2049	133	0,01	920	Government National Mortgage Association, serie 2017 157, classe IO, 0,504%, scadenza 16/12/2059 *	32	-
113	Ginnie Mae II Pool 'MA6157', 5,000%, scadenza 20/09/2049	112	0,01	896	Government National Mortgage Association, serie 2017 28, classe IO, 0,680%, scadenza 16/02/2057 *	31	-
119	Ginnie Mae II Pool 'MA6287', 5,000%, scadenza 20/11/2049	118	0,01	511	Government National Mortgage Association, serie 2017 41, classe IO, 0,592%, scadenza 16/07/2058 *	15	-
285	Ginnie Mae II Pool 'MA6342', 5,000%, scadenza 20/12/2049	281	0,03	102	Government National Mortgage Association, serie 2017 H15, classe KI, 0,835%, scadenza 20/07/2067 *	5	-
363	Ginnie Mae II Pool 'MA6413', 5,000%, scadenza 20/01/2050	358	0,04	4.037	Government National Mortgage Association, serie 2017 H18, classe BI, 0,452%, scadenza 20/09/2067 *	174	0,02
170	Ginnie Mae II Pool 'MA6603', 5,000%, scadenza 20/04/2050	168	0,02	52	Government National Mortgage Association, serie 2017 H20, classe IB, 0,203%, scadenza 20/10/2067 *	2	-
1.489	Ginnie Mae II Pool 'MA6711', 3,500%, scadenza 20/06/2050	1.362	0,14	235	Government National Mortgage Association, serie 2018 H06, classe PF, 5,518%, scadenza 20/02/2068 *	233	0,02
1.685	Ginnie Mae II Pool 'MA6997', 3,500%, scadenza 20/11/2050	1.531	0,15	435	Government National Mortgage Association, serie 2018 H07, classe FD, 5,518%, scadenza 20/05/2068 *	433	0,04
433	Ginnie Mae II Pool 'MA6999', 4,500%, scadenza 20/11/2050	413	0,04	279	Government National Mortgage Association, serie 2019 90, classe AB, 3,000%, scadenza 20/07/2049	245	0,02
82	Ginnie Mae II Pool 'MA7056', 4,500%, scadenza 20/12/2050	79	0,01	1.464	Government National Mortgage Association, serie 2020 103, classe AD, 1,450%, scadenza 16/01/2063	1.115	0,11
144	Ginnie Mae II Pool 'MA7135', 2,000%, scadenza 20/01/2051	119	0,01	296	Government National Mortgage Association, serie 2020 123, classe IL, 2,500%, scadenza 20/08/2050	38	-
311	Ginnie Mae II Pool 'MA7136', 2,000%, scadenza 20/01/2051	265	0,03	915	Government National Mortgage Association, serie 2020 123, classe NI, 2,500%, scadenza 20/08/2050	127	0,01
1.609	Ginnie Mae II Pool 'MA7192', 2,000%, scadenza 20/02/2051	1.332	0,13	447	Government National Mortgage Association, serie 2020 127, classe IN, 2,500%, scadenza 20/08/2050	61	0,01
104	Ginnie Mae II Pool 'MA7194', 3,000%, scadenza 20/02/2051	93	0,01	388	Government National Mortgage Association, serie 2020 129, classe IE, 2,500%, scadenza 20/09/2050	53	0,01
137	Ginnie Mae II Pool 'MA7255', 2,500%, scadenza 20/03/2051	116	0,01	15.965	Government National Mortgage Association, serie 2020 157, classe IO, 0,940%, scadenza 16/06/2062 *	1.000	0,10
1.150	Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500%, scadenza 20/04/2051	980	0,10	241	Government National Mortgage Association, serie 2020 160, classe IH, 2,500%, scadenza 20/10/2050	33	-
1.067	Ginnie Mae II Pool 'MA7368', 3,000%, scadenza 20/05/2051	944	0,09	309	Government National Mortgage Association, serie 2020 160, classe VI, 2,500%, scadenza 20/10/2050	44	-
2.123	Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000%, scadenza 20/09/2051	1.876	0,19	1.331	Government National Mortgage Association, serie 2020 160, classe YI, 2,500%, scadenza 20/10/2050	177	0,02
2.813	Pool Ginnie Mae II 'MA7649', 2,500%, scadenza 20/10/2051	2.397	0,29	1.445	Government National Mortgage Association, serie 2020 173, classe MI, 2,500%, scadenza 20/11/2050	189	0,02
1.062	Pool Ginnie Mae II 'MA7650', 3,000%, scadenza 20/10/2051	938	0,09	12.214	Government National Mortgage Association, serie 2020 178, classe IO, 1,422%, scadenza 16/10/2060 *	1.111	0,11
2.620	Ginnie Mae II Pool 'MA7767', 2,500%, scadenza 20/12/2051	2.233	0,22	2.907	Government National Mortgage Association, serie 2020 181, classe WI, 2,000%, scadenza 20/12/2050	316	0,03
2.414	Ginnie Mae II Pool 'MA7768', 3,000%, scadenza 20/12/2051	2.129	0,21	759	Government National Mortgage Association, serie 2020 47, classe MI, 3,500%, scadenza 20/04/2050	128	0,01
3.237	Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500%, scadenza 20/02/2052	2.941	0,29	284	Government National Mortgage Association, serie 2020 47, classe NI, 3,500%, scadenza 20/04/2050	47	-
931	Ginnie Mae II Pool 'MA8046', 4,500%, scadenza 20/05/2052	888	0,09	804	Government National Mortgage Association, serie 2020 H09, classe FL, 4,850%, scadenza 20/05/2070 *	806	0,08
366	Ginnie Mae II Pool 'MA8197', 2,500%, scadenza 20/08/2052	312	0,03	162	Government National Mortgage Association, serie 2020 H09, classe NF, 6,468%, scadenza 20/04/2070 *	163	0,02
186	Ginnie Mae II Pool 'MA8264', 2,500%, scadenza 20/09/2052	158	0,02	97	Government National Mortgage Association, serie 2020 H12, classe F, 5,530%, scadenza 20/07/2070 *	95	0,01
1.056	Ginnie Mae II Pool 'MA8268', 4,500%, scadenza 20/09/2052	1.008	0,10	383	Government National Mortgage Association, serie 2020 H13, classe FA, 4,989%, scadenza 20/07/2070 *	375	0,04
671	Ginnie Mae II Pool 'MA8348', 5,000%, scadenza 20/10/2052	654	0,07	97	Government National Mortgage Association, serie 2020 H13, classe FC, 4,796%, scadenza 20/07/2070 *	95	0,01
1.063	Ginnie Mae II Pool 'MA8428', 5,000%, scadenza 20/11/2052	1.036	0,10	943	Government National Mortgage Association, serie 2021 14, classe AB, 1,340%, scadenza 16/06/2063	707	0,07
766	Ginnie Mae II Pool 'MA8429', 5,500%, scadenza 20/11/2052	758	0,08	1.834	Government National Mortgage Association, serie 2021 21, classe AH, 1,400%, scadenza 16/06/2063	1.390	0,14
1.233	Ginnie Mae II Pool 'MA8485', 2,500%, scadenza 20/12/2052	1.050	0,10	25.502	Government National Mortgage Association, serie 2021 5, classe IO, 1,112%, scadenza 16/01/2061 *	1.875	0,19
2.084	Ginnie Mae II Pool 'MA8486', 3,000%, scadenza 20/12/2052	1.838	0,18	1.107	Government National Mortgage Association, serie 2021 77, classe LC, 1,250%, scadenza 20/07/2050	850	0,08
195	Ginnie Mae II Pool 'MA8490', 5,000%, scadenza 20/12/2052	189	0,02	1.500	Government National Mortgage Association, serie 2022 139, classe AL, 4,000%, scadenza 20/07/2051	1.353	0,14
1.154	Ginnie Mae II Pool 'MA8642', 2,500%, scadenza 20/02/2053	984	0,10	1.748	Government National Mortgage Association, serie 2022 3, classe IO, 0,640%, scadenza 16/02/2061 *	88	0,01
688	Ginnie Mae II Pool 'MA8727', 6,000%, scadenza 20/03/2053	691	0,07	200	Government National Mortgage Association, serie 2022 63, classe LM, 3,500%, scadenza 20/10/2050	166	0,02
484	Ginnie Mae II Pool 'MA8796', 3,000%, scadenza 20/04/2053	429	0,04	3.000	Government National Mortgage Association, serie 2023 92, classe AH, 2,000%, scadenza 16/06/2064	2.290	0,23
197	Ginnie Mae II Pool 'MA8798', 4,000%, scadenza 20/04/2053	184	0,02				
1.800	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,000% ±	1.485	0,15				
1.100	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 3,000% ±	967	0,10				
200	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 3,500% ±	182	0,02				
300	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 4,000% ±	280	0,03				
1.900	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,000% ±	1.849	0,18				
2.200	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,500% ±	2.178	0,22				
1.800	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 6,000% ±	1.806	0,18				
200	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 6,500% ±	203	0,02				
122	Government National Mortgage Association, serie 2009 H01, classe FA, 6,578%, scadenza 20/11/2059 *	123	0,01				
4	Government National Mortgage Association, serie 2010 42, classe BS, 1,052%, scadenza 20/04/2040 *	-	-				
1	Government National Mortgage Association, serie 2010 85, classe HS, 1,222%, scadenza 20/01/2040 *	-	-				
390	Government National Mortgage Association, serie 2010 H11, classe FA, 6,430%, scadenza 20/06/2060 *	391	0,04				
240	Government National Mortgage Association, serie 2010 H20, classe AF, 5,585%, scadenza 20/10/2060 *	238	0,02				
1	Government National Mortgage Association, serie 2010 H22, classe FE, 5,605%, scadenza 20/05/2059 *	1	-				
380	Government National Mortgage Association, serie 2010 H24, classe FA, 5,605%, scadenza 20/10/2060 *	377	0,04				
15	Government National Mortgage Association, serie 2010 H26, classe LF, 5,605%, scadenza 20/08/2058 *	14	-				
133	Government National Mortgage Association, serie 2011 H01, classe AF, 5,705%, scadenza 20/11/2060 *	133	0,01				
30	Government National Mortgage Association, serie 2011 H09, classe AF, 5,755%, scadenza 20/03/2061 *	30	-				
299	Government National Mortgage Association, serie 2013 107, classe AD, 2,840%, scadenza 16/11/2047 *	266	0,03				
4.514	Government National Mortgage Association, serie 2013 50, classe IO, 0,062%, scadenza 16/10/2048 *	6	-				
821	Government National Mortgage Association, serie 2014 169, classe IO, 0,622%, scadenza 16/10/2056 *	18	-				
35	Government National Mortgage Association, serie 2014 17, classe AM, 3,537%, scadenza 16/06/2048 *	33	-				

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)			Obbligazioni ed effetti societari — 35,79% (28 febbraio 2023: 36,53%)		
Australia — 0,04% (28 febbraio 2023: 0,04%)			Australia — 0,04% (28 febbraio 2023: 0,04%)		
2.000	124	0,01	300	290	0,03
2.849	2.365	0,24	200	166	0,01
2.160	1.167	0,12		456	0,04
851	1	-	Belgio — 0,40% (28 febbraio 2023: 0,40%)		
15	14	-	1.110	1.033	0,10
3.980	835	0,08	680	655	0,07
4.070	1.085	0,11	280	258	0,03
1.812	1.750	0,17	920	824	0,08
175	154	0,02	153	138	0,01
30	28	-	1.060	1.087	0,11
160	133	0,01		3.995	0,40
72	18	-	Brasile — 0,60% (28 febbraio 2023: 0,67%)		
14	13	-	57	57	0,01
20	10	-	3.440	3.405	0,34
280	258	0,03	290	255	0,02
2.870	2.519	0,25	190	161	0,02
341	309	0,03	2.050	1.621	0,16
632	596	0,06	60	62	0,01
857	703	0,07	410	428	0,04
103	95	0,01		5.989	0,60
4	4	-	Canada — 0,38% (28 febbraio 2023: 0,34%)		
2.694	2.652	0,27	120	109	0,01
690	630	0,06	110	96	0,01
553	514	0,05	160	142	0,01
72.635	2.456	0,25	550	475	0,05
176	153	0,02	290	289	0,03
38	37	-	500	501	0,05
250	235	0,02	650	442	0,05
160	149	0,01	30	26	-
4.826	151	0,01	30	33	-
2.330	1.895	0,19	20	19	-
2.010	1.824	0,18	1.350	1.258	0,13
	408.481	40,85	390	370	0,04
				3.760	0,38
			Cina — 0,33% (28 febbraio 2023: 0,30%)		
			370	352	0,04
			2.650	2.014	0,20
			1.660	946	0,09
				3.312	0,33
			Colombia — 0,14% (28 febbraio 2023: 0,13%)		
			940	743	0,07
			960	678	0,07
				1.421	0,14
			Danimarca — 0,22% (28 febbraio 2023: 0,19%)		
			280	268	0,03
			2.040	1.921	0,19
				2.189	0,22
			Francia — 1,17% (28 febbraio 2023: 1,08%)		
			280	271	0,03
			310	308	0,03
			1.660	1.552	0,16
			620	595	0,06
			2.890	2.581	0,26
			1.160	1.097	0,11
			1.620	1.588	0,16
			360	348	0,03
			550	498	0,05
			710	709	0,07
			500	494	0,05
			590	529	0,05
			240	225	0,02
			940	897	0,09
				11.692	1,17

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
India — 0,10% (28 febbraio 2023: 0,10%)					
330	271	0,03	250	230	0,02
1.020	695	0,07	600	557	0,06
	966	0,10	350	302	0,03
Irlanda — 0,42% (28 febbraio 2023: 0,38%)					
850	838	0,08	160	145	0,01
1.990	1.792	0,18	770	669	0,07
1.000	868	0,09	270	222	0,02
480	390	0,04	1.120	796	0,08
162	162	0,02		4.900	0,49
120	119	0,01	Africa del Sud — 0,11% (28 febbraio 2023: 0,10%)		
	4.169	0,42	670	655	0,06
Israele — 0,41% (28 febbraio 2023: 0,42%)					
590	594	0,06	200	194	0,02
1.570	1.421	0,14	290	274	0,03
430	402	0,04		1.123	0,11
1.530	1.417	0,14	Spagna — 0,22% (28 febbraio 2023: 0,19%)		
240	255	0,03	1.200	1.136	0,11
	4.089	0,41	200	188	0,02
Italia — 0,19% (28 febbraio 2023: 0,17%)					
1.160	1.134	0,11	500	476	0,05
850	818	0,08	210	176	0,02
	1.952	0,19	260	208	0,02
Giappone — 0,40% (28 febbraio 2023: 0,37%)					
540	523	0,05		2.184	0,22
560	532	0,05	Svizzera — 1,19% (28 febbraio 2023: 1,28%)		
580	579	0,06	1.570	1.602	0,16
1.600	1.516	0,15	710	675	0,07
990	908	0,09	1.530	1.491	0,15
	4.058	0,40	1.640	1.755	0,17
Kazakistan — 0,06% (28 febbraio 2023: 0,05%)					
200	161	0,02	200	178	0,02
520	437	0,04	700	675	0,07
	598	0,06	270	262	0,03
Kuwait - 0,05% (28 febbraio 2023: 0,04%)					
520	499	0,05	610	569	0,06
Lussemburgo — 0,06% (28 febbraio 2023: 0,01%)					
620	491	0,05	680	653	0,06
150	155	0,01	670	604	0,06
	646	0,06	720	594	0,06
Macao — 0,40% (28 febbraio 2023: 0,43%)					
2.290	2.216	0,22	300	236	0,02
710	619	0,06	420	509	0,05
580	548	0,06	2.090	2.077	0,21
730	609	0,06		11.880	1,19
	3.992	0,40	Emirati Arabi Uniti — 0,09% (28 febbraio 2023: 0,08%)		
Messico — 0,11% (28 febbraio 2023: 0,11%)					
20	22	-	200	186	0,02
20	21	-	760	704	0,07
1.110	1.027	0,11		890	0,09
	1.070	0,11	Regno Unito — 0,93% (28 febbraio 2023: 1,05%)		
Marocco - 0,11% (28 febbraio 2023: 0,12%)					
940	778	0,08	410	390	0,04
480	341	0,03	2.610	2.393	0,24
	1.119	0,11	430	415	0,04
Paesi Bassi — 0,49% (28 febbraio 2023: 0,45%)					
200	194	0,02	330	319	0,03
1.840	1.785	0,18	400	376	0,04
			400	378	0,04
			950	845	0,09
			340	346	0,04
			820	792	0,08
			780	740	0,07
			630	623	0,06
			230	219	0,02
			250	238	0,02
			420	381	0,04
			340	311	0,03
			630	527	0,05
				9.293	0,93

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto		
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)							
Stati Uniti — 27,10% (28 febbraio 2023: 27,97%)							
470	3M Co, 2,375%, scadenza 26/08/2029	406	0,04	160	Becton Dickinson & Co, 4,669%, scadenza 06/06/2047	0,02	
130	3M Co, 3,050%, scadenza 15/04/2030	116	0,01	850	Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250%, scadenza 15/01/2049	749	0,08
670	3M Co, 3,700%, scadenza 15/04/2050	515	0,05	3.380	Boston Properties LP, 3,400%, scadenza 21/06/2029	2.895	0,29
230	Abbott Laboratories, 4,750%, scadenza 30/11/2036	229	0,02	950	BP Capital Markets America Inc, 3,119%, scadenza 04/05/2026	904	0,09
420	Abbott Laboratories, 4,900%, scadenza 30/11/2046	410	0,04	440	BP Capital Markets America Inc, 3,633%, scadenza 06/04/2030	407	0,04
140	AbbVie Inc, 3,750%, scadenza 14/11/2023	139	0,01	900	BP Capital Markets America Inc, 3,000%, scadenza 24/02/2050	600	0,06
1.990	AbbVie Inc, 2,600%, scadenza 21/11/2024	1.921	0,19	43	Brighthouse Financial Inc, 4,700%, scadenza 22/06/2047	32	-
590	AbbVie Inc, 3,800%, scadenza 15/03/2025	575	0,06	532	Bristol-Myers Squibb Co, 3,200%, scadenza 15/06/2026	508	0,05
250	AbbVie Inc, 3,600%, scadenza 14/05/2025	243	0,02	705	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400%, scadenza 26/07/2029	653	0,07
520	AbbVie Inc, 2,950%, scadenza 21/11/2026	487	0,05	2.040	Broadcom Inc, 144A, 3,137%, scadenza 15/11/2035	1.558	0,16
3.520	AbbVie Inc, 3,200%, scadenza 21/11/2029	3.175	0,32	110	Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250%, scadenza 01/02/2032	94	0,01
7	AbbVie Inc, 4,750%, scadenza 15/03/2045	6	-	630	Cameron LNG LLC, 144A, 2,902%, scadenza 15/07/2031	539	0,05
90	AbbVie Inc, 4,875%, scadenza 14/11/2048	83	0,01	850	Cameron LNG LLC, 144A, 3,302%, scadenza 15/01/2035	704	0,07
110	AbbVie Inc, 4,250%, scadenza 21/11/2049	93	0,01	30	Carrier Global Corp, 2,700%, scadenza 15/02/2031	25	-
450	Air Lease Corp, 3,375%, scadenza 01/07/2025	429	0,04	50	Carrier Global Corp, 3,577%, scadenza 05/04/2050	36	-
600	Air Lease Corp, 5,300%, scadenza 01/02/2028	590	0,06	70	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500%, scadenza 15/08/2030	59	0,01
370	Alphabet Inc, 1,100%, scadenza 15/08/2030	297	0,03	370	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750%, scadenza 01/02/2032	307	0,03
370	Alphabet Inc, 1,900%, scadenza 15/08/2040	249	0,03	770	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500%, scadenza 01/05/2032	625	0,06
230	Alphabet Inc, 2,050%, scadenza 15/08/2050	138	0,01	360	Centene Corp, 4,250%, scadenza 15/12/2027	337	0,03
210	Amazon.com Inc, 3,300%, scadenza 13/04/2027	200	0,02	520	Centene Corp, 4,625%, scadenza 15/12/2029	479	0,05
800	Amazon.com Inc, 1,200%, scadenza 03/06/2027	705	0,07	290	Centene Corp, 3,375%, scadenza 15/02/2030	248	0,03
320	Amazon.com Inc, 3,150%, scadenza 22/08/2027	301	0,03	50	Centene Corp, 3,000%, scadenza 15/10/2030	42	-
430	Amazon.com Inc, 3,450%, scadenza 13/04/2029	405	0,04	60	Centene Corp, 2,625%, scadenza 01/08/2031	48	-
510	Amazon.com Inc, 1,500%, scadenza 03/06/2030	415	0,04	1.170	Charles Schwab Corp/The, 5,875%, scadenza 24/08/2026	1.177	0,12
260	Amazon.com Inc, 2,100%, scadenza 12/05/2031	216	0,02	230	Charles Schwab Corp/The, 6,136%, scadenza 24/08/2034 *	234	0,02
1.040	Amazon.com Inc, 3,600%, scadenza 13/04/2032	957	0,10	760	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908%, scadenza 23/07/2025	747	0,07
1.710	Amazon.com Inc, 3,875%, scadenza 22/08/2037	1.540	0,15	1.440	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200%, scadenza 15/03/2028	1.342	0,13
340	Amazon.com Inc, 4,950%, scadenza 05/12/2044	336	0,03	1.200	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050%, scadenza 30/03/2029	1.143	0,11
320	Amazon.com Inc, 4,050%, scadenza 22/08/2047	276	0,03	380	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400%, scadenza 01/04/2033	335	0,03
650	Amazon.com Inc, 2,500%, scadenza 03/06/2050	415	0,04	500	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, scadenza 01/04/2038	424	0,04
140	Amazon.com Inc, 4,250%, scadenza 22/08/2057	121	0,01	270	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500%, scadenza 01/03/2042	177	0,02
440	American Express Co, 3,375%, scadenza 03/05/2024	433	0,04	260	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484%, scadenza 23/10/2045	239	0,02
1.000	American Express Co, 4,050%, scadenza 03/05/2029	951	0,10	70	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, scadenza 01/05/2047	56	0,01
246	American International Group Inc, 2,500%, scadenza 30/06/2025	233	0,02	430	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750%, scadenza 01/04/2048	363	0,04
220	American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650%, scadenza 15/01/2032	180	0,02	240	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125%, scadenza 01/07/2049	185	0,02
34	Amgen Inc, 4,663%, scadenza 15/06/2051	29	-	210	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800%, scadenza 01/03/2050	156	0,02
270	Apache Corp, 7,750%, scadenza 15/12/2029	282	0,03	440	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500%, scadenza 01/04/2063	346	0,03
17	Apache Corp, 6,000%, scadenza 15/01/2037	16	-	400	Cheniere Energy Inc, 4,625%, scadenza 15/10/2028	377	0,04
930	Apache Corp, 5,100%, scadenza 01/09/2040	774	0,08	130	Cheniere Energy Partners LP, 4,000%, scadenza 01/03/2031	115	0,01
60	Apache Corp, 5,250%, scadenza 01/02/2042	49	0,01	690	Cheniere Energy Partners LP, 3,250%, scadenza 31/01/2032	571	0,06
510	Apache Corp, 4,750%, scadenza 15/04/2043	390	0,04	340	Chevron Corp, 2,954%, scadenza 16/05/2026	324	0,03
180	Apache Corp, 4,250%, scadenza 15/01/2044	123	0,01	240	Chevron Corp, 1,995%, scadenza 11/05/2027	218	0,02
290	Apache Corp, 5,350%, scadenza 01/07/2049	233	0,02	80	Chevron Corp, 3,078%, scadenza 11/05/2050	57	0,01
720	Apple Inc, 2,450%, scadenza 04/08/2026	674	0,07	950	Chevron USA Inc, 3,850%, scadenza 15/01/2028	919	0,09
250	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000%, scadenza 01/09/2029	203	0,02	140	Chubb INA Holdings Inc, 3,350%, scadenza 03/05/2026	134	0,01
300	AT&T Inc, 3,800%, scadenza 15/02/2027	286	0,03	290	Cigna Group/The, 4,125%, scadenza 15/11/2025	283	0,03
970	AT&T Inc, 2,300%, scadenza 01/06/2027	869	0,09	2.840	Cigna Group/The, 4,375%, scadenza 15/10/2028	2.737	0,27
150	AT&T Inc, 2,250%, scadenza 01/02/2032	117	0,01	110	Cigna Group/The, 4,900%, scadenza 15/12/2048	98	0,01
60	AT&T Inc, 2,550%, scadenza 01/12/2033	46	-	90	Cigna Group/The, 3,400%, scadenza 15/03/2050	63	0,01
170	AT&T Inc, 5,350%, scadenza 01/09/2040	159	0,02	270	Cintas Corp n. 2, 3,700%, scadenza 01/04/2027	259	0,03
190	AT&T Inc, 5,550%, scadenza 15/08/2041	179	0,02	300	Cintas Corp n. 2, 4,000%, scadenza 01/05/2032	281	0,03
161	AT&T Inc, 4,350%, scadenza 15/06/2045	127	0,01	330	Citigroup Inc, 3,300%, scadenza 27/04/2025	319	0,03
1.218	AT&T Inc, 4,500%, scadenza 09/03/2048	973	0,10				
70	AT&T Inc, 3,800%, scadenza 01/12/2057	47	-				
465	AT&T Inc, 3,650%, scadenza 15/09/2059	301	0,03				
530	Ball Corp, 3,125%, scadenza 15/09/2031	430	0,04				
520	Bank of America Corp, 4,200%, scadenza 26/08/2024	511	0,05				
470	Bank of America Corp, 4,000%, scadenza 22/01/2025	458	0,05				
130	Bank of America Corp, 4,450%, scadenza 03/03/2026	126	0,01				
830	Bank of America Corp, 3,500%, scadenza 19/04/2026	790	0,08				
1.510	Bank of America Corp, 1,319%, scadenza 19/06/2026 *	1.390	0,14				
970	Bank of America Corp, 4,250%, scadenza 22/10/2026	932	0,09				
1.290	Bank of America Corp, 4,376%, scadenza 27/04/2028 *	1.239	0,12				
940	Bank of America Corp, 3,593%, scadenza 21/07/2028 *	875	0,09				
1.770	Bank of America Corp, 3,419%, scadenza 20/12/2028 *	1.624	0,16				
2.470	Bank of America Corp, 3,970%, scadenza 05/03/2029 *	2.309	0,23				
1.480	Bank of America Corp, 3,974%, scadenza 07/02/2030 *	1.363	0,14				
1.500	Bank of America Corp, 2,884%, scadenza 22/10/2030 *	1.288	0,13				
1.580	Bank of America Corp, 2,572%, scadenza 20/10/2032 *	1.267	0,13				
1.870	Bank of America Corp, 2,972%, scadenza 04/02/2033 *	1.538	0,15				
560	Bank of America Corp, 4,330%, scadenza 15/03/2050 *	475	0,05				
2.070	Bank of America Corp, 4,083%, scadenza 20/03/2051 *	1.665	0,17				
380	Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600%, scadenza 24/04/2025	357	0,04				
30	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500%, scadenza 01/11/2025	27	-				
435	Becton Dickinson & Co, 3,363%, scadenza 06/06/2024	427	0,04				
26	Becton Dickinson & Co, 3,734%, scadenza 15/12/2024	25	-				
377	Becton Dickinson & Co, 4,685%, scadenza 15/12/2044	334	0,03				

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Stati Uniti — (segue)					
440		0,04	530		0,05
220		0,02	410		0,03
490		0,05	400		0,04
110		0,01	220		0,02
1.260		0,12	440		0,04
450		0,04	2.800		0,25
60		0,01	70		0,01
1.360		0,13	15		-
1.180		0,11	28		-
1.470		0,14	150		0,02
1.590		0,15	140		0,01
1.180		0,09	510		0,04
1.150		0,10	410		0,04
540		0,05	630		0,07
1.456		0,18	530		0,05
255		0,02	260		0,02
390		0,04	40		-
90		0,01	520		0,04
100		0,01	1.480		0,13
720		0,07	50		-
370		0,03	660		0,06
20		-	480		0,04
280		0,02	450		0,04
1.090		0,11	410		0,03
380		0,04	230		0,02
130		0,01	40		-
640		0,06	170		0,01
280		0,03	130		0,01
1.090		0,11	640		0,06
390		0,04	420		0,04
510		0,05	36		-
60		0,01	200		0,02
60		0,01	840		0,08
13		-	360		0,03
1.420		0,12	720		0,07
400		0,03	510		0,04
300		0,02	1.880		0,15
80		0,01	280		0,02
120		0,01	90		0,01
224		0,02	220		0,02
110		0,01	240		0,02
293		0,02	190		0,02
200		0,01	690		0,06
619		0,04	190		0,02
66		0,01	690		0,06
137		0,01	28		-
100		0,01	20		-
74		-	28		-
20		-	1.340		0,13
300		0,03	200		0,02
130		0,01	420		0,04
85		0,01	200		0,02
240		0,02	180		0,02
190		0,02	440		0,04
440		0,04	1.010		0,09
450		0,04	80		0,01
130		0,01	270		0,02
290		0,03	810		0,07
1.000		0,09	570		0,05
390		0,04	150		0,01
100		0,01	400		0,04
1.020		0,09	1.390		0,13
340		0,03	600		0,05
1.790		0,17	610		0,06
560		0,05	260		0,02
300		0,02	200		0,02
200		0,01	810		0,07
510		0,04	890		0,08
210		0,04	500		0,04
130		0,01	30		-
541		0,05	260		0,02
220		0,02	240		0,02
268		0,03	670		0,06
			440		0,04
			210		0,02
			50		0,01

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Stati Uniti — (segue)					
50	44	-	250	245	0,02
230	217	0,02	1.400	1.393	0,14
330	296	0,03	940	885	0,09
50	48	-	1.000	922	0,09
200	195	0,02	610	576	0,06
250	228	0,02	780	744	0,07
10	10	-	640	537	0,05
80	78	0,01	790	638	0,06
3	2	-	1.660	1.527	0,15
800	787	0,08	300	203	0,02
760	734	0,07	870	866	0,09
460	447	0,04	380	380	0,04
1.390	1.290	0,13	110	108	0,01
1.970	1.852	0,19	300	293	0,03
270	253	0,03	520	496	0,05
4.320	3.999	0,40	270	257	0,03
2.240	2.112	0,21	370	335	0,03
2.940	2.360	0,24	60	52	0,01
670	708	0,07	30	27	-
160	115	0,01	130	123	0,01
380	263	0,03	150	141	0,01
450	414	0,04	20	22	-
540	486	0,05	80	78	0,01
100	87	0,01	50	55	0,01
580	546	0,05	10	9	-
410	375	0,04	170	155	0,02
370	329	0,03	80	478	0,05
11	11	-	520	66	0,01
60	56	0,01	260	231	0,02
320	288	0,03	300	290	0,03
100	99	0,01	1.860	1.802	0,18
270	268	0,03	1.320	1.247	0,12
10	10	-	160	-	-
170	168	0,02	120	119	0,01
30	30	-	50	49	0,01
90	90	0,01	460	446	0,04
660	664	0,07	280	270	0,03
930	813	0,08	300	271	0,03
400	364	0,04	110	91	0,01
180	167	0,02	100	93	0,01
380	351	0,04	460	445	0,04
70	67	0,01	310	295	0,03
440	387	0,04	360	342	0,03
360	284	0,03	260	249	0,03
90	73	0,01	120	120	0,01
1.120	821	0,08	80	60	0,01
400	413	0,04	600	499	0,05
1.100	979	0,10	60	53	0,01
190	149	0,02	450	363	0,04
70	60	0,01	300	297	0,03
20	18	-	540	534	0,05
50	37	-	50	49	0,01
350	301	0,03	10	9	-
240	241	0,02	650	430	0,04
130	99	0,01	10	7	-
380	334	0,03	207	144	0,01
200	130	0,01	584	583	0,06
1.230	1.176	0,12	960	898	0,09
210	196	0,02	2.060	1.940	0,19
1.940	1.905	0,19	340	321	0,03
790	699	0,07	1.150	1.067	0,11
			50	48	-
			960	809	0,08
			1.190	1.058	0,11
			460	366	0,04
			680	513	0,05
			230	216	0,02
			840	810	0,08
			410	348	0,03
			20	17	-
			830	667	0,07
			320	285	0,03
			580	542	0,05
			290	234	0,02
			760	588	0,06

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Stati Uniti — (segue)					
320 NVIDIA Corp, 2,850%, scadenza 01/04/2030	287	0,03	200 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000%, scadenza 15/01/2032	173	0,02
860 NVIDIA Corp, 3,500%, scadenza 01/04/2040	717	0,07	16 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850%, scadenza 16/12/2039	18	-
350 NVIDIA Corp, 3,500%, scadenza 01/04/2050	276	0,03	300 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,900%, scadenza 15/09/2044	270	0,03
620 NVIDIA Corp, 3,700%, scadenza 01/04/2060	495	0,05	30 Tenet Healthcare Corp, 4,375%, scadenza 15/01/2030	27	-
14 Occidental Petroleum Corp, 6,950%, scadenza 01/07/2024	14	-	160 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900%, scadenza 01/03/2030	137	0,01
130 Occidental Petroleum Corp, 5,550%, scadenza 15/03/2026	129	0,01	380 Texas Instruments Inc, 1,750%, scadenza 04/05/2030	317	0,03
410 Occidental Petroleum Corp, 3,400%, scadenza 15/04/2026	385	0,04	980 The Vanguard Group Inc, 3,050%, scadenza 22/08/2050 †	604	0,06
610 Occidental Petroleum Corp, 3,200%, scadenza 15/08/2026	558	0,06	85 Time Warner Cable Enterprises LLC, 8,375%, scadenza 15/07/2033	95	0,01
260 Occidental Petroleum Corp, 3,000%, scadenza 15/02/2027	234	0,02	182 Time Warner Cable LLC, 6,550%, scadenza 01/05/2037	173	0,02
360 Occidental Petroleum Corp, 3,500%, scadenza 15/08/2029	311	0,03	420 Time Warner Cable LLC, 7,300%, scadenza 01/07/2038	426	0,04
260 Occidental Petroleum Corp, 7,875%, scadenza 15/09/2031	288	0,03	560 Time Warner Cable LLC, 5,875%, scadenza 15/11/2040	488	0,05
730 Occidental Petroleum Corp, 6,450%, scadenza 15/09/2036	747	0,07	50 TJX Cos Inc/The, 2,250%, scadenza 15/09/2026	46	-
200 Occidental Petroleum Corp, 6,200%, scadenza 15/03/2040	198	0,02	1.600 T-Mobile USA Inc, 3,500%, scadenza 15/04/2025	1.606	0,16
240 Occidental Petroleum Corp, 4,625%, scadenza 15/06/2045	183	0,02	160 T-Mobile USA Inc, 2,250%, scadenza 15/02/2026	148	0,01
240 Occidental Petroleum Corp, 6,600%, scadenza 15/03/2046	247	0,02	120 T-Mobile USA Inc, 3,750%, scadenza 15/04/2027	114	0,01
100 Occidental Petroleum Corp, 4,400%, scadenza 15/04/2046	77	0,01	520 T-Mobile USA Inc, 2,625%, scadenza 15/02/2029	451	0,05
380 Occidental Petroleum Corp, 4,100%, scadenza 15/02/2047	262	0,03	1.720 T-Mobile USA Inc, 3,875%, scadenza 15/04/2030	1.571	0,16
260 Occidental Petroleum Corp, 4,200%, scadenza 15/03/2048	192	0,02	450 T-Mobile USA Inc, 2,550%, scadenza 15/02/2031	371	0,04
1.000 Occidental Petroleum Corp, 4,400%, scadenza 15/08/2049	716	0,07	380 T-Mobile USA Inc, 2,875%, scadenza 15/02/2031	320	0,03
220 ONEOK Inc, 5,550%, scadenza 01/11/2026	220	0,02	270 T-Mobile USA Inc, 3,500%, scadenza 15/04/2031	236	0,02
350 ONEOK Inc, 5,800%, scadenza 01/11/2030	351	0,04	70 T-Mobile USA Inc, 2,250%, scadenza 15/11/2031	56	0,01
720 ONEOK Inc, 6,050%, scadenza 01/09/2033	726	0,07	1.170 T-Mobile USA Inc, 2,700%, scadenza 15/03/2032	953	0,10
930 ONEOK Inc, 6,625%, scadenza 01/09/2053	939	0,09	220 T-Mobile USA Inc, 3,000%, scadenza 15/02/2041	156	0,02
1.000 Oracle Corp, 1,650%, scadenza 25/03/2026	912	0,09	10 T-Mobile USA Inc, 3,300%, scadenza 15/02/2051	7	-
90 Oracle Corp, 2,950%, scadenza 01/04/2030	78	0,01	850 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850%, scadenza 01/02/2026	889	0,09
430 Oracle Corp, 4,650%, scadenza 06/05/2030	413	0,04	560 Truist Financial Corp, 6,047%, scadenza 08/06/2027 *	560	0,06
1.390 Oracle Corp, 2,875%, scadenza 25/03/2031	1.175	0,12	340 Union Pacific Corp, 3,750%, scadenza 15/07/2025	331	0,03
300 Otis Worldwide Corp, 2,056%, scadenza 05/04/2025	284	0,03	820 Union Pacific Corp, 2,891%, scadenza 06/04/2036	649	0,07
310 Pacific Gas and Electric Co, 2,100%, scadenza 01/08/2027	268	0,03	1.010 Union Pacific Corp, 3,839%, scadenza 20/03/2060	776	0,08
390 Pacific Gas and Electric Co, 2,500%, scadenza 01/02/2031	305	0,03	470 Union Pacific Corp, 3,750%, scadenza 05/02/2070	343	0,03
80 Pacific Gas and Electric Co, 3,300%, scadenza 01/08/2040	54	0,01	440 United Airlines Inc, 144A, 4,375%, scadenza 15/04/2026	415	0,04
190 Pacific Gas and Electric Co, 3,500%, scadenza 01/08/2050	120	0,01	690 United Airlines Inc, 144A, 4,625%, scadenza 15/04/2029	614	0,06
90 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125%, scadenza 15/02/2028	85	0,01	70 United Rentals North America Inc, 3,875%, scadenza 15/11/2027	65	0,01
560 PayPal Holdings Inc, 1,650%, scadenza 01/06/2025	525	0,05	160 United Rentals North America Inc, 4,875%, scadenza 15/01/2028	152	0,02
70 PepsiCo Inc, 2,625%, scadenza 19/03/2027	65	0,01	210 United Rentals North America Inc, 5,250%, scadenza 15/01/2030	200	0,02
320 PepsiCo Inc, 1,625%, scadenza 01/05/2030	264	0,03	1.370 United Rentals North America Inc, 3,875%, scadenza 15/02/2031	1.173	0,12
220 PepsiCo Inc, 2,875%, scadenza 15/10/2049	156	0,02	420 United Rentals North America Inc, 3,750%, scadenza 15/01/2032	354	0,04
620 Pfizer Inc, 2,625%, scadenza 01/04/2030	545	0,05	660 UnitedHealth Group Inc, 3,875%, scadenza 15/12/2028	632	0,06
580 Pfizer Inc, 1,700%, scadenza 28/05/2030	478	0,05	430 UnitedHealth Group Inc, 4,000%, scadenza 15/05/2029	411	0,04
170 Pioneer Natural Resources Co, 1,125%, scadenza 15/01/2026	154	0,02	200 UnitedHealth Group Inc, 2,000%, scadenza 15/05/2030	167	0,02
270 Pioneer Natural Resources Co, 1,900%, scadenza 15/08/2030	218	0,02	110 UnitedHealth Group Inc, 2,300%, scadenza 15/05/2031	92	0,01
470 Pioneer Natural Resources Co, 2,150%, scadenza 15/01/2031	381	0,04	400 UnitedHealth Group Inc, 4,200%, scadenza 15/05/2032	378	0,04
250 PNC Bank NA, 3,875%, scadenza 10/04/2025	242	0,02	160 UnitedHealth Group Inc, 4,250%, scadenza 15/06/2048	136	0,01
310 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812%, scadenza 12/06/2026 *	310	0,03	130 UnitedHealth Group Inc, 4,450%, scadenza 15/12/2048	114	0,01
1.070 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582%, scadenza 12/06/2029 *	1.062	0,11	990 UnitedHealth Group Inc, 3,700%, scadenza 15/08/2049	769	0,08
240 Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250%, scadenza 23/06/2025	221	0,02	300 UnitedHealth Group Inc, 3,875%, scadenza 15/08/2059	232	0,02
120 Procter & Gamble Co/The, 2,800%, scadenza 25/03/2027	113	0,01	80 UnitedHealth Group Inc, 3,125%, scadenza 15/05/2060	53	0,01
340 Procter & Gamble Co/The, 3,000%, scadenza 25/03/2030	311	0,03	1.410 US Bancorp, 1,450%, scadenza 12/05/2025	1.319	0,13
3.900 Prologis LP, 1,250%, scadenza 15/10/2030	3.007	0,30	90 US Bancorp, serie mtn, 2,215%, scadenza 27/01/2028 *	80	0,01
200 Range Resources Corp, 4,875%, scadenza 15/05/2025	196	0,02	500 US Bancorp, 5,775%, scadenza 12/06/2029 *	499	0,05
60 Republic Services Inc, 2,500%, scadenza 15/08/2024	58	0,01	260 US Bancorp, 5,836%, scadenza 12/06/2034 *	260	0,03
140 Salesforce Inc, 3,700%, scadenza 11/04/2028	134	0,01	410 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875%, scadenza 01/11/2033	334	0,03
80 Santander Holdings USA Inc, 4,500%, scadenza 17/07/2025	78	0,01	260 Verizon Communications Inc, 2,625%, scadenza 15/08/2026	242	0,02
322 Schlumberger Holdings Corp, 3,900%, scadenza 17/05/2028	306	0,03	190 Verizon Communications Inc, 3,000%, scadenza 22/03/2027	177	0,02
430 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000%, scadenza 01/03/2032	487	0,05	580 Verizon Communications Inc, 2,100%, scadenza 22/03/2028	507	0,05
20 Southwestern Energy Co, 5,375%, scadenza 01/02/2029	19	-	962 Verizon Communications Inc, 4,329%, scadenza 21/09/2028	922	0,09
160 Southwestern Energy Co, 5,375%, scadenza 15/03/2030	150	0,02	190 Verizon Communications Inc, 3,875%, scadenza 08/02/2029	178	0,02
250 Southwestern Energy Co, 4,750%, scadenza 01/02/2032	222	0,02	500 Verizon Communications Inc, 3,150%, scadenza 22/03/2030	439	0,04
552 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000%, scadenza 20/09/2025	553	0,06	630 Verizon Communications Inc, 1,750%, scadenza 20/01/2031	491	0,05
20 Sprint Capital Corp, 6,875%, scadenza 15/11/2028	21	-	544 Verizon Communications Inc, 2,550%, scadenza 21/03/2031	448	0,04
655 Sprint Capital Corp, 8,750%, scadenza 15/03/2032	781	0,08	1.060 Verizon Communications Inc, 4,500%, scadenza 10/08/2033	980	0,10
10 Sprint LLC, 7,875%, scadenza 15/09/2023	10	-	580 Verizon Communications Inc, 5,250%, scadenza 16/03/2037	565	0,06
220 Sprint LLC, 7,625%, scadenza 15/02/2025	225	0,02			
370 Targa Resources Corp, 5,200%, scadenza 01/07/2027	366	0,04			
240 Targa Resources Corp, 4,200%, scadenza 01/02/2033	212	0,02			
150 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,000%, scadenza 15/01/2028	144	0,01			
290 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500%, scadenza 01/03/2030	278	0,03			
490 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875%, scadenza 01/02/2031	451	0,05			

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Stati Uniti — (segue)					
670 Verizon Communications Inc, 2,650%, scadenza 20/11/2040	448	0,04	1.680 Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 6,375%, scadenza 01/09/2037	640	0,06
180 Verizon Communications Inc, 3,400%, scadenza 22/03/2041	134	0,01	757 Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 6,375%, scadenza 01/09/2037	289	0,03
510 Verizon Communications Inc, 3,850%, scadenza 01/11/2042	396	0,04		2.090	0,21
430 Verizon Communications Inc, 4,125%, scadenza 15/08/2046	342	0,03	Brasile — 1,14% (28 febbraio 2023: 1,02%)		
550 Verizon Communications Inc, 4,862%, scadenza 21/08/2046	484	0,05	BRL 14.000 Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTN F, 10,000%, scadenza 01/01/2027	2.799	0,28
50 Verizon Communications Inc, 5,500%, scadenza 16/03/2047	48	0,01	BRL 17.099 Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTN F, 10,000%, scadenza 01/01/2033	3.243	0,32
270 Verizon Communications Inc, 4,000%, scadenza 22/03/2050	207	0,02	6.000 Brazilian Government International Bond, 5,000%, scadenza 27/01/2045	4.685	0,47
60 Verizon Communications Inc, 2,875%, scadenza 20/11/2050	37	—	880 Brazilian Government International Bond, 4,750%, scadenza 14/01/2050	649	0,07
690 Verizon Communications Inc, 3,550%, scadenza 22/03/2051	484	0,05		11.376	1,14
200 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125%, scadenza 15/11/2028	180	0,02	Colombia — 0,20% (28 febbraio 2023: 0,17%)		
770 Visa Inc, 3,150%, scadenza 14/12/2025	739	0,07	890 Colombia Government International Bond, 3,250%, scadenza 22/04/2032	669	0,07
640 Visa Inc, 4,300%, scadenza 14/12/2045	579	0,06	900 Colombia Government International Bond, 4,125%, scadenza 22/02/2042	585	0,06
300 Walmart Inc, 1,500%, scadenza 22/09/2028	259	0,03	990 Colombia Government International Bond, 5,625%, scadenza 26/02/2044	753	0,07
150 Walmart Inc, 1,800%, scadenza 22/09/2031	123	0,01		2.007	0,20
170 Walt Disney Co/The, 6,650%, scadenza 15/11/2037	192	0,02	Indonesia — 1,09% (28 febbraio 2023: 0,93%)		
510 Warnermedia Holdings Inc, 6,412%, scadenza 15/03/2026	511	0,05	610 Indonesia Government International Bond, 3,700%, scadenza 30/10/2049	467	0,04
300 Warnermedia Holdings Inc, 3,755%, scadenza 15/03/2027	281	0,03	IDR 159.624.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR91, 6,375%, scadenza 15/04/2032	10.476	1,05
370 Warnermedia Holdings Inc, 4,054%, scadenza 15/03/2029	340	0,03		10.943	1,09
640 Warnermedia Holdings Inc, 4,279%, scadenza 15/03/2032	565	0,06	Israele — 0,08% (28 febbraio 2023: 0,08%)		
130 Warnermedia Holdings Inc, 5,050%, scadenza 15/03/2042	107	0,01	650 Israel Government International Bond, 2,750%, scadenza 03/07/2030	568	0,05
200 Warnermedia Holdings Inc, 5,141%, scadenza 15/03/2052	479	0,05	390 Stato di Israele, 3,375%, scadenza 15/01/2050	277	0,03
640 Wells Fargo & Co, 3,750%, scadenza 24/01/2024	238	0,02		845	0,08
1.150 Wells Fargo & Co, 2,188%, scadenza 30/04/2026 *	1.082	0,11	Kenya — 0,17% (28 febbraio 2023: 0,15%)		
870 Wells Fargo & Co, 3,000%, scadenza 23/10/2026	806	0,08	2270 Republic of Kenya Government International Bond, 144A, 6,300%, scadenza 23/01/2034	1.650	0,17
880 Wells Fargo & Co, 4,300%, scadenza 22/07/2027	843	0,08	Messico — 3,76% (28 febbraio 2023: 3,56%)		
560 Wells Fargo & Co, 3,584%, scadenza 22/05/2028 *	520	0,05	MXN 37.380 Mexican Bonos, serie M, 8,500%, scadenza 31/05/2029	2.113	0,21
750 Wells Fargo & Co, 2,393%, scadenza 06/02/2028 *	668	0,07	MXN 194.400 Mexican Bonos, serie M, 7,750%, scadenza 23/11/2034	10.217	1,02
370 Wells Fargo & Co, 4,150%, scadenza 24/01/2029	349	0,04	MXN 232.457 Mexican Bonos, serie M, 7,750%, scadenza 13/11/2042	11.651	1,16
320 Wells Fargo & Co, 5,574%, scadenza 25/07/2029 *	319	0,03	MXN 220.640 Mexican Bonos, serie M, 8,000%, scadenza 07/11/2047	11.259	1,13
1.040 Wells Fargo & Co, 2,879%, scadenza 30/10/2030 *	890	0,09	2710 Mexico Government International Bond, 4,600%, scadenza 10/02/2048	2.185	0,22
620 Wells Fargo & Co, 4,478%, scadenza 04/04/2031 *	580	0,06	190 Mexico Government International Bond, 5,750%, scadenza 12/10/2110	167	0,02
330 Wells Fargo & Co, 3,350%, scadenza 03/02/2033 *	278	0,03		37.592	3,76
410 Wells Fargo & Co, 5,557%, scadenza 25/07/2034 *	405	0,04	Nigeria — 0,03% (28 febbraio 2023: 0,02%)		
580 Wells Fargo & Co, 4,900%, scadenza 17/11/2045	498	0,05	300 Nigeria Government International Bond, 144A, 6,500%, scadenza 28/11/2027	258	0,03
720 Wells Fargo & Co, 4,400%, scadenza 14/06/2046	571	0,06	Panama — 0,12% (28 febbraio 2023: 0,10%)		
1.200 Wells Fargo & Co, 4,750%, scadenza 07/12/2046	999	0,10	670 Panama Government International Bond, 2,252%, scadenza 29/09/2032	510	0,05
5.340 Wells Fargo & Co, 5,013%, scadenza 04/04/2051 *	4.826	0,48	950 Panama Government International Bond, 4,500%, scadenza 01/04/2056	692	0,07
130 Wells Fargo & Co, serie U, 5,875%, perpetuo *	129	0,01		1.202	0,12
460 Western Midstream Operating LP, 3,100%, scadenza 01/02/2025	441	0,04	Paraguay — 0,04% (28 febbraio 2023: 0,04%)		
110 Western Midstream Operating LP, 4,500%, scadenza 01/03/2028	104	0,01	470 Paraguay Government International Bond, 144A, 3,849%, scadenza 28/06/2033	402	0,04
1.340 Western Midstream Operating LP, 4,050%, scadenza 01/02/2030	1.197	0,12	Perù — 0,10% (28 febbraio 2023: 0,10%)		
40 Western Midstream Operating LP, 5,300%, scadenza 01/03/2048	33	-	730 Peruvian Government International Bond, 2,783%, scadenza 23/01/2031	621	0,06
250 Western Midstream Operating LP, 5,500%, scadenza 15/08/2048	208	0,02	380 Peruvian Government International Bond, 5,625%, scadenza 18/11/2050	379	0,04
310 Western Midstream Operating LP, 5,250%, scadenza 01/02/2050	251	0,03		1.000	0,10
350 Williams Cos Inc/The, serie A, 7,500%, scadenza 15/01/2031	384	0,04	Russia — 0,41% (28 febbraio 2023: 0,08%)		
760 Williams Cos Inc/The, 7,750%, scadenza 15/06/2031	835	0,08	RUB 16.270 Russian Federal Bond - OFZ, 0,000%, scadenza 16/09/2026 ty	51	-
718 Williams Cos Inc/The, 8,750%, scadenza 15/03/2032	842	0,08	RUB 89.250 Russian Federal Bond - OFZ, 0,000%, scadenza 03/02/2027 ty	279	0,03
110 Wyeth LLC, 5,950%, scadenza 01/04/2037	118	0,01	RUB 203.271 Russian Federal Bond - OFZ, 0,000%, scadenza 19/01/2028 ty	636	0,06
	271.019	27,10	RUB 436.124 Russian Federal Bond - OFZ, 0,000%, scadenza 23/05/2029 ty	1.365	0,14
			RUB 232.730 Russian Federal Bond - OFZ, 0,000%, scadenza 10/04/2030 ty	728	0,07
Zambia — 0,07% (28 febbraio 2023: 0,06%)					
680 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875%, scadenza 15/10/2027	663	0,07			
Totale Obbligazioni ed effetti societari (costo 401.364 dollari)					
	357.924	35,79			
Obbligazioni ed effetti governativi — 14,64% (28 febbraio 2023: 23,40%)					
Argentina — 0,21% (28 febbraio 2023: 0,18%)					
212 Argentine Republic Government International Bond, 1,000%, scadenza 09/07/2029	69	0,01			
596 Argentine Republic Government International Bond, 0,750%, scadenza 09/07/2030	200	0,02			
1.062 Argentine Republic Government International Bond, 3,625%, scadenza 09/07/2035	316	0,03			
1.850 Argentine Republic Government International Bond, 3,500%, scadenza 09/07/2041	576	0,06			

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti governativi — (segue)					
Russia — (segue)					
RUB 22.030	Russian Federal Bond - OFZ, 0,000%, scadenza 10/05/2034 †y	59			0,01
RUB 382.680	Russian Federal Bond - OFZ, 0,000%, scadenza 16/03/2039 †y	1.018			0,10
		4.136			0,41
Stati Uniti — 7,29% (28 febbraio 2023: 16,97%)					
1.440	Federal National Mortgage Association, 6,625%, scadenza 15/11/2030	1.640			0,16
13.460	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125%, scadenza 15/01/2033 β	12.864			1,29
7.480	United States Treasury Note/Bond, 4,375%, scadenza 15/08/2043	7.461			0,75
1.630	United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/02/2048	1.294			0,13
1.510	United States Treasury Note/Bond, 3,375%, scadenza 15/11/2048	1.284			0,13
5.770	United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/02/2049	4.581			0,46
900	United States Treasury Note/Bond, 2,875%, scadenza 15/05/2049	698			0,07
5.320	United States Treasury Note/Bond, 2,000%, scadenza 15/02/2050	3.408			0,34
9.430	United States Treasury Note/Bond, 1,250%, scadenza 15/05/2050	4.931			0,49
15.600	United States Treasury Note/Bond, 1,375%, scadenza 15/08/2050 =	8.434			0,84
1.270	United States Treasury Note/Bond, 1,625%, scadenza 15/11/2050	735			0,07
14.670	United States Treasury Note/Bond, 1,875%, scadenza 15/02/2051	9.052			0,91
11.000	United States Treasury Note/Bond, 2,375%, scadenza 15/05/2051 =	7.648			0,76
7.650	United States Treasury Note/Bond, 2,000%, scadenza 15/08/2051	4.858			0,49
4.679	United States Treasury Note/Bond, 1,875%, scadenza 15/11/2051	2.876			0,29
810	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/02/2053	730			0,07
470	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/05/2053	424			0,04
		72.918			7,29
Totale Obbligazioni ed effetti governativi (costo 195.617 dollari)			146.419		14,64
Titoli di prestito — 3,25% (28 febbraio 2023: 4,08%)					
554	Air Canada, 9,128%, scadenza 27/07/2028 *	556			0,06
562	Ali Group S.R.L., 7,446%, scadenza 13/10/2028 *	563			0,06
546	Alterra Mountain Co, 8,946%, scadenza 30/07/2028 *	548			0,06
445	AmWINS Group, Inc., 7,696%, scadenza 17/02/2028 *	445			0,04
614	API Group Inc, 7,946%, scadenza 01/10/2026 *	616			0,06
90	Asplundh Tree Expert LLC, 7,181%, scadenza 04/09/2027 *	90			0,01
768	Asurion LLC, 8,788%, scadenza 18/12/2026 *	748			0,08
1.074	Asurion LLC, 9,681%, scadenza 19/08/2028 *	1.040			0,10
746	Brown Group Holding LLC, 7,820%, scadenza 07/06/2028 *	738			0,07
90	Caesars Entertainment, 8,681%, scadenza 25/01/2030 *	90			0,01
106	Castlelake Aviation Ltd, 8,302%, scadenza 22/10/2026 *	106			0,01
196	Charter Communications Operating LLC, 7,116%, scadenza 01/02/2027 *	195			0,02
896	Citadel Securities, 7,888%, scadenza 25/07/2030 *	894			0,09
1.174	DCert Buyer, Inc., 9,331%, scadenza 16/10/2026 *	1.171			0,12
1.021	Deerfield Dakota Holding LLC, 8,992%, scadenza 05/03/2027 *	988			0,10
262	Energizer Holdings Inc., 7,679%, scadenza 16/12/2027 *	262			0,03
256	Eyecare Partners LLC, 9,253%, scadenza 20/02/2027 *	204			0,02
232	First Eagle Holdings Inc, 8,038%, scadenza 17/02/2027 *	228			0,02
857	Focus Financial Partners LLC, 8,581%, scadenza 30/06/2028 *	856			0,09
1.836	Gainwell Acquisition Corp., 9,342%, scadenza 01/10/2027 *	1.811			0,18
350	Garda World Security Corp, 9,668%, scadenza 30/10/2026 *	351			0,03
1.325	Gen Digital Inc, 7,431%, scadenza 12/09/2029 *	1.325			0,13
1.897	Genesee & Wyoming Inc, 7,342%, scadenza 30/12/2026 *	1.899			0,19
59	GFL Environmental Inc, 8,469%, scadenza 31/05/2027 *	59			0,01
1.060	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 7,481%, scadenza 15/11/2027 *	1.048			0,10
283	GVC Holdings Gibraltar Ltd, 7,437%, scadenza 16/03/2027 *	284			0,03
861	Harbor Freight Tools USA Inc, 8,196%, scadenza 19/10/2027 *	858			0,09
1.405	Hilton Worldwide Finance LLC, 7,165%, scadenza 21/06/2026 *	1.406			0,14
709	ICON Luxembourg S.a.r.l., 7,753%, scadenza 01/07/2028 *	711			0,07
177	Indigo Merger Sub, Inc., 7,753%, scadenza 01/07/2028 *	177			0,02
229	Mozart Borrower LP, 8,696%, scadenza 30/09/2028 *	229			0,02
264	PCI Gaming Authority, 7,946%, scadenza 31/05/2026 *	264			0,03
619	Phoenix Guarantor Inc, 8,696%, scadenza 05/03/2026 *	616			0,06
793	Prime Security Installations Ltd, 8,182%, scadenza 23/09/2026 *	795			0,08
349	Project Sky Merger Sub, Inc., 9,181%, scadenza 10/08/2028 *	342			0,03
612	Quikrete Holdings, Inc., 8,320%, scadenza 11/06/2028 *	613			0,06
219	Rackspace Technology Global, Inc, 8,177%, scadenza 09/02/2028 *	99			0,01
1.420	Setanta Aircraft Leasing DAC, 7,538%, scadenza 05/11/2028 *	1.422			0,14
1.258	SkyMiles IP Ltd, 9,076%, scadenza 16/09/2027 *	1.310			0,13
1.400	Sotera Health, 8,196%, scadenza 13/12/2026 *	1.388			0,14
1.278	Station Casinos LLC, 7,681%, scadenza 08/02/2027 *	1.276			0,13
470	Terrier Media Buyer, Inc., 8,842%, scadenza 17/12/2026 *	438			0,04
9	Triton Water Holdings, Inc., 8,753%, scadenza 16/03/2028 *	9			-
1.063	UFC Holding LLC, 8,369%, scadenza 29/04/2026 *	1.065			0,11
864	United Airlines Inc, 9,292%, scadenza 14/04/2028 *	867			0,09
1.472	Virgin Media Bristol LLC, 7,925%, scadenza 01/04/2028 *	1.434			0,14
Totale titoli di prestito (costo 32.727 dollari)			32.434		3,25
Azioni ordinarie — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
Svizzera: 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
2.840	Credit Suisse Group AG Escrow †	-			-
Totale azioni ordinarie (costo - dollari)			-		-
Totale investimenti e investimenti costituiti in pegno al valore equo rilevato a conto economico (costo 1.148.170 dollari)					
			1.007.788		100,78
Contratti (in migliaia)					
Opzioni acquistate — 0,23% (28 febbraio 2023: 0,05%)					
	- Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi dicembre 2023 Put 95.8750, scadenza 15/12/2023 - Morgan Stanley	176			0,02
	- Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi dicembre 2023 Put 96.00, scadenza 15/12/2023 - Morgan Stanley	501			0,05
	- Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi ottobre 2023 Put 97.00, scadenza 13/10/2023 - Morgan Stanley	651			0,06
	- CME futures SOFR 3 mesi marzo 2024 Call 95,25, scadenza 15/03/2024 - Morgan Stanley	43			-
	- CME futures SOFR 3 mesi settembre 2023 Call 96,00, scadenza 15/09/2023 - Morgan Stanley	-			-
	- U.S. 10 Year ottobre 2023 call 110.50, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	63			0,01
	- U.S. 10 Year ottobre 2023 call 111.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	46			-
	- U.S. 5 Year ottobre 2023 call 106.50, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	89			0,01
	- U.S. 5 Year ottobre 2023 call 107.25, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	69			0,01
	- U.S. Bond ottobre 2023 call 119.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	186			0,02
	- U.S. Bond ottobre 2023 call 120.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	77			0,01
	- U.S. Bond ottobre 2023 call 121.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	194			0,02
	- Obbligazioni USA ottobre 2023 Call 121,50, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	68			0,01
	- U.S. Bond ottobre 2023 call 122.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	23			-
10.370	Put USD/Call AUD 0,67, scadenza 03/11/2023 -JP Morgan	56			0,01
5.227	USD Put/MXN Call 16,9310, scadenza 06/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	14			-
Totale opzioni acquistate (costo 1.698 dollari)			2.256		0,23
Credit Default Swap — 0,27% (28 febbraio 2023: 0,19%)					
Apprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)			2.759		0,27
Swap indicizzati — 0,67% (28 febbraio 2023: 0,53%)					
Apprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)			6.710		0,67
Contratti a termine in valuta estera — 0,06% (28 febbraio 2023: 0,05%)					
Apprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)			567		0,06
Futures — 0,25% (28 febbraio 2023: 0,22%)					
Apprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)			2.534		0,25
Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico			1.022.614		102,26

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Contratti (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	
Opzioni scritte — (0,16%) (28 febbraio 2023: (0,06%))			
- Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi dicembre 2023 Put 95,25, scadenza 15/12/2023 - Morgan Stanley	(102)	(0,01)	
(1) Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi dicembre 2023 Put 95,3750, scadenza 15/12/2023 - Morgan Stanley	(319)	(0,03)	
- Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi ottobre 2023 Put 96,25, scadenza 13/10/2023 - Morgan Stanley	(275)	(0,03)	
- Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi ottobre 2023 Put 96,50, scadenza 13/10/2023 - Morgan Stanley	(394)	(0,04)	
- CME futures SOFR 3 mesi marzo 2024 Call 96,1250, scadenza 15/03/2024 - Morgan Stanley	(44)	(0,01)	
- CME futures SOFR 3 mesi settembre 2023 Call 96,75, scadenza 15/09/2023 - Morgan Stanley	(1)	-	
- U.S. 10 Year novembre 2023 call 112,00, scadenza 27/10/2023 - Morgan Stanley	(67)	(0,01)	
- U.S. 10 Year novembre 2023 put 107,50, scadenza 27/10/2023 - Morgan Stanley	(13)	-	
- U.S. 10 Year novembre 2023 put 108,00, scadenza 27/10/2023 - Morgan Stanley	(16)	-	
- U.S. 10 Year ottobre 2023 call 111,75, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	(37)	-	
- U.S. 10 Year ottobre 2023 call 112,00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	(20)	-	
- U.S. 10 Year ottobre 2023 call 112,50, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	(28)	-	
- U.S. 10 Year ottobre 2023 put 109,00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	(10)	-	
- U.S. 5 Year ottobre 2023 put 105,00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	(3)	-	
- U.S. Bond ottobre 2023 call 123,00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	(33)	-	
- U.S. Bond ottobre 2023 call 124,00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	(44)	(0,01)	
- U.S. Bond ottobre 2023 put 117,00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	(3)	-	
(14.030) USD Put/MXN Call 17,0655, scadenza 11/10/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(179)	(0,02)	
Totale opzioni scritte (costo (1.280) dollari)	(1.588)	(0,16)	
Credit Default Swap — (0,02%) (28 febbraio 2023: (0,01%))			
Deprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)	(222)	(0,02)	
Swap indicizzati — (0,02%) (28 febbraio 2023: (0,04%))			
Deprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)	(253)	(0,02)	
Interest Rate Swap — (0,13%) (28 febbraio 2023: (0,11%))			
Deprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)	(1.274)	(0,13)	
Contratti a termine in valuta estera — (0,20%) (28 febbraio 2023: (0,23%))			
Deprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)	(2.005)	(0,20)	
Futures — (0,15%) (28 febbraio 2023: (0,32%))			
Deprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)	(1.496)	(0,15)	
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(6.838)	(0,68)	
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	1.015.776	101,58	
Passività in eccesso rispetto ad altre attività	(15.747)	(1,58)	
Patrimonio in gestione	1.000.029\$	100,00	

- Gli importi indicati con “-” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.		
144A	Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 126.582.000 dollari ovvero al 12,70% dell'attivo netto.	
*	Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.	
†	Illiquido.	
∞	Il titolo è valutato in buona fede al valore equo o a discrezione del Comitato di valutazione.	
ε	Il titolo è inadempiente al 31 agosto 2023 (capitale e/o interessi).	
≠	Titoli (in tutto o in parte) costituiti in garanzia per la negoziazione di derivati al 31 agosto 2023.	
±	Titoli acquistati su base non definitiva.	
β	Il tasso di interesse di questo tipo di titoli è legato all'indice dei prezzi al consumo (CPI)/indice dei prezzi al dettaglio (RPI). Il tasso cedolare è quello del 31 agosto 2023.	
γ	Titolo che non matura più reddito durante e/o dopo il periodo finanziario chiuso al 31 agosto 2023 a causa dell'incertezza dei pagamenti degli interessi.	
ABBREVIAZIONI:		
Perpetual	- Un'obbligazione senza data di scadenza. Le obbligazioni perpetue non sono rimborsabili, ma pagano un flusso costante di interessi.	
REMIC	- Real Estate Mortgage Investment Conduit.	
TBA	- Da annunciare.	
BRL	- Real brasiliano	
IDR	- Rupia indonesiana	
MXN	- Peso messicano	
RUB	- Rublo russo	
		% delle attività totali
Analisi delle attività totali		
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato		92,40
Altri valori mobiliari negoziati in un altro mercato regolamentato		3,07
Strumenti finanziari derivati		1,40
Altre attività		3,13
Totale Attività		100,00

Prospetto dei Credit Default Swap

Controparte	Entità di riferimento – Protezione di acquisto/vendita	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5,000% - Acquisto	20-giu-2028	7.385	\$ (207)
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000% - Vendita	20-giu-2033	3.640	(15)
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000% - Vendita	20-giu-2028	178.551	2.759
Apprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 2.240\$)				\$ 2.759
Deprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (158)\$)				(222)
Apprezzamento netto dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 2.082\$)				\$ 2.537

Prospetto degli Interest Rate Swap

Controparte	Tasso	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
JP Morgan	Tasso variabile di pagamento SOFR in BRL, tasso di credito fisso 10,230%	02-gen-2029	82.920	\$ (222)
Morgan Stanley	Tasso variabile di pagamento TIE Banxico in MXN, tasso di credito fisso 7,450%	18-lug-2029	142.060	(513)
Morgan Stanley	Tasso variabile di pagamento TIE Banxico in MXN, tasso di credito fisso 7,440%	20-lug-2029	147.960	(539)
Apprezzamento non realizzato degli Interest Rate Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				\$ -
Ammortamento non realizzato degli Interest Rate Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1,287)\$)				(1.274)
Ammortamento netto degli Interest Rate Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1,287)\$)				\$ (1.274)

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto degli swap indicizzati

Controparte	Entità di riferimento	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Morgan Stanley	Tasso fisso di pagamento 2,500%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	21-apr-2052	86	\$ 16
Morgan Stanley	Tasso fisso di pagamento 2,600%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	15-feb-2048	6.547	1.100
Morgan Stanley	Tasso fisso di pagamento 2,850%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	15-Feb-2029	966	53
Morgan Stanley	Tasso fisso di pagamento 3,050%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	15-feb-2048	44.763	4.314
Morgan Stanley	Tasso fisso di pagamento 3,850%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	30-giu-2029	30.262	169
Morgan Stanley	Tasso variabile di pagamento SOFR composto in USD, tasso di credito fisso 4,180%	29-feb-2028	140.700	1.058
Morgan Stanley	Tasso variabile di pagamento SOFR composto in USD, tasso di credito fisso 3,500%	30-set-2024	13.390	(253)
Apprezamento non realizzato degli swap indicizzati (28 febbraio 2023 (in migliaia): 6.036\$)				\$ 6.710
Ammortamento non realizzato degli swap indicizzati (28 febbraio 2023 (in migliaia): (422)\$)				(253)
Apprezamento netto degli swap indicizzati (28 febbraio 2023 (in migliaia): 5.614\$)				\$ 6.457

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta di acquisto (in migliaia)			Valuta di vendita (in migliaia)			Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato dei contratti (in migliaia)
07-set-2023	Bank of America Merrill Lynch	Acquisto	USD	1.443	Vendita	MXN	25.059	\$ (25)
07-set-2023	Goldman Sachs	Acquisto	MXN	25.418	Vendita	USD	1.464	26
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	15	Vendita	AUD	23	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	882	Vendita	EUR	808	5
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1	Vendita	GBP	1	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	13	Vendita	USD	8	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	1.037	Vendita	USD	678	(6)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	37.206	Vendita	USD	40.926	(553)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	35	Vendita	USD	46	-
12-ott-2023	Bank of America Merrill Lynch	Acquisto	MXN	65.485	Vendita	USD	3.704	108
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	NOK	66.018	Vendita	EUR	5.692	31
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	CAD	24.270	Vendita	USD	18.313	(338)
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	AUD	13.031	Vendita	USD	8.696	(237)
20-ott-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	2.334	Vendita	MXN	40.567	(23)
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	5.210	Vendita	CNH	37.268	75
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	1.551	Vendita	IDR	23.418.528	15
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	ZAR	29.450	Vendita	USD	1.552	-
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	13.195	Vendita	CNH	94.905	118
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	7.133	Vendita	GBP	5.511	151
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	JPY	2.944.327	Vendita	USD	21.129	(727)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	INR	156.175	Vendita	USD	1.890	(4)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	EUR	3.034	Vendita	USD	3.350	(52)
06-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	3.714	Vendita	AUD	5.660	38
06-nov-2023	Morgan Stanley	Acquisto	AUD	5.690	Vendita	USD	3.735	(40)
Apprezamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 540\$)							\$ 567	
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (2.578)\$)							(2.005)	
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (2.038)\$)							\$ (1.438)	

Prospetto dei contratti futures

Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)	
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2023	Morgan Stanley	(240)	\$ (56.760)	\$ 121
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2024	Morgan Stanley	393	94.153	(43)
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2025	Morgan Stanley	196	47.238	49
Indice SOFR a 3 mesi giugno 2023	Morgan Stanley	5	1.184	(23)
Australia 10 Year Bond settembre 2023	Morgan Stanley	148	11.141	(13)
Valuta Euro FX settembre 2023	Morgan Stanley	3	407	1
Euro-Bobl dicembre 2023	Morgan Stanley	50	6.369	29
Euro-Buxl 30 Year Bond dicembre 2023	Morgan Stanley	(25)	(3.626)	(47)
Euro-OAT dicembre 2023	Morgan Stanley	91	12.578	91
Japan 10 Year Bond (OSE) settembre 2023	Morgan Stanley	(17)	(17.155)	136
Long Gilt dicembre 2023	Morgan Stanley	60	7.264	68
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	(72)	(7.994)	(61)
U.S. 10 Year Ultra Note dicembre 2023	Morgan Stanley	(633)	(73.497)	(1.081)
U.S. 2 Year Note (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	72	14.674	41
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	(425)	(45.442)	(228)
U.S. Long Bond (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	315	38.332	526
U.S. Ultra Bond (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	554	71.726	1.472
Apprezamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 2.474\$)			\$ 2.534	
Ammortamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (3.625)\$)			(1.496)	
Apprezamento netto dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1.151)\$)			\$ 1.038	

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (000's)	Valore (in migliaia) €	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (000's)	Valore (in migliaia) €	% del Valore patrimoniale netto
Titoli garantiti da ipoteca — 2,72% (28 febbraio 2023: 0,00%)			Lussemburgo — 2,55% (28 febbraio 2023: 1,71%)		
USD 300 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 2,500% ±	229	0,25	555 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,750%, scadenza 12/03/2029	435	0,48
USD 100 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 5,000% ±	89	0,10	1.400 Logicor Financing Sarl, 1,625%, scadenza 15/07/2027	1.177	1,30
USD 76 Pool Fannie Mae 'BQ3331', 2,000%, scadenza 01/08/2050	57	0,06	260 Prologis International Funding II SA, 2,375%, scadenza 14/11/2030	225	0,25
USD 74 Pool Fannie Mae 'BQ4926', 2,000%, scadenza 01/10/2050	54	0,06	500 SELP Finance Sarl, 1,500%, scadenza 20/11/2025	466	0,52
USD 76 Pool Fannie Mae 'BR4052', 2,000%, scadenza 01/02/2051	56	0,06		2.303	2,55
USD 29 Pool Fannie Mae 'CA2472', 4,000%, scadenza 01/10/2048	25	0,03			
USD 81 Pool Fannie Mae 'CA8779', 2,000%, scadenza 01/02/2051	60	0,07			
USD 269 Pool Fannie Mae 'CB2664', 3,000%, scadenza 01/01/2052	215	0,24			
USD 41 Pool Fannie Mae 'FM1263', 4,500%, scadenza 01/07/2049	37	0,04			
USD 83 Pool Fannie Mae 'FM3049', 4,000%, scadenza 01/04/2044	73	0,08			
USD 86 Pool Fannie Mae 'FM9195', 2,500%, scadenza 01/10/2051	66	0,07			
USD 86 Pool Fannie Mae 'FM9441', 2,000%, scadenza 01/04/2051	63	0,07			
USD 72 Pool Fannie Mae 'FS0067', 4,500%, scadenza 01/09/2051	63	0,07			
USD 87 Pool Fannie Mae 'FS1118', 3,500%, scadenza 01/03/2052	72	0,08			
USD 91 Pool Fannie Mae 'FS1374', 3,000%, scadenza 01/03/2052	72	0,08			
USD 185 Pool Fannie Mae 'MA3210', 3,500%, scadenza 01/12/2047	155	0,17			
USD 23 Pool Fannie Mae 'MA4031', 4,500%, scadenza 01/05/2050	20	0,02			
USD 75 Pool Freddie Mac 'QB4985', 2,000%, scadenza 01/11/2050	55	0,06			
USD 89 Pool Freddie Mac 'QC9443', 2,500%, scadenza 01/10/2051	68	0,08			
USD 89 Pool Freddie Mac 'QK1354', 2,000%, scadenza 01/02/2042	68	0,08			
USD 86 Pool Freddie Mac 'RB5131', 2,000%, scadenza 01/10/2041	66	0,07			
USD 98 Pool Freddie Mac 'SD2762', 5,500%, scadenza 01/05/2053	90	0,10			
USD 95 Pool Freddie Mac 'SD2792', 4,500%, scadenza 01/03/2047	85	0,10			
USD 193 Pool Freddie Mac 'SD7560', 4,000%, scadenza 01/02/2053	166	0,18			
USD 86 Ginnie Mae II Pool '785657', 2,500%, scadenza 20/10/2051	67	0,07			
USD 73 Ginnie Mae II Pool 'MA7192', 2,000%, scadenza 20/02/2051	56	0,06			
USD 100 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500% ±	79	0,09			
USD 100 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 3,000% ±	81	0,09			
USD 100 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 3,500% ±	84	0,09			
USD 100 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 4,000% ±	86	0,10			
Totale Titoli garantiti da ipoteca (costo 2.495 euro)	2.457	2,72			
Obbligazioni ed effetti societari — 45,77% (28 febbraio 2023: 43,18%)			Paesi Bassi — 1,45% (28 febbraio 2023: 1,45%)		
Australia — 1,04% (28 febbraio 2023: 0,70%)			Macao — 0,34% (28 febbraio 2023: 0,23%)		
970 Glencore Finance Europe Ltd, 1,750%, scadenza 17/03/2025			USD 400 Sands China Ltd, 3,100%, scadenza 03/08/2029		
	938	1,04		308	0,34
Belgio — 0,15% (28 febbraio 2023: 0,16%)			Norvegia — 0,87% (28 febbraio 2023: 0,76%)		
140 Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2,125%, scadenza 02/12/2027			790 DNB Bank ASA, 0,050%, scadenza 14/11/2023		
	132	0,15		784	0,87
Brasile — 0,75% (28 febbraio 2023: 0,52%)			Singapore — 0,34% (28 febbraio 2023: 0,24%)		
USD 930 Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125%, scadenza 15/01/2032			500 Temasek Financial I Ltd, 1,250%, scadenza 20/11/2049		
	678	0,75		303	0,34
Canada — 2,01% (28 febbraio 2023: 1,89%)			Africa del Sud — 0,33% (28 febbraio 2023: 0,22%)		
USD 60 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500%, scadenza 15/02/2029			310 Anglo American Capital Plc, 1,625%, scadenza 18/09/2025		
	48	0,05		296	0,33
1.000 Bank of Montreal, 2,750%, scadenza 15/06/2027			Spagna — 2,47% (28 febbraio 2023: 1,43%)		
	963	1,07	1.400 Banco Santander SA, 2,500%, scadenza 18/03/2025		
USD 10 MEG Energy Corp, 144A, 5,875%, scadenza 01/02/2029	9	0,01	400 Cellnex Finance Co SA, 2,000%, scadenza 15/09/2032		
GBP 280 Royal Bank of Canada, 3,625%, scadenza 14/06/2027	300	0,33	600 Lorca Telecom Bondco SA, 4,000%, scadenza 18/09/2027		
GBP 440 Royal Bank of Canada, 5,000%, scadenza 24/01/2028	494	0,55		2.236	2,47
	1.814	2,01			
Francia — 4,63% (28 febbraio 2023: 3,70%)			Sovranazionale — 1,19% (28 febbraio 2023: 3,10%)		
310 Altice France SA/Francia, 3,375%, scadenza 15/01/2028			1240 African Development Bank, 0,500%, scadenza 21/03/2029		
	219	0,24		1.078	1,19
1.400 BNP Paribas SA, 0,500%, scadenza 30/05/2028 *	1.221	1,35	Svizzera — 2,03% (28 febbraio 2023: 1,32%)		
700 Credit Agricole SA, 1,875%, scadenza 22/04/2027 *	658	0,73	160 Holcim Finance Luxembourg SA, 3,000%, perpetuo *		
GBP 200 Credit Agricole SA, 4,875%, scadenza 23/10/2029	221	0,25	320 UBS AG/Londra, 0,500%, scadenza 31/03/2031		
200 Credit Agricole SA, 4,000%, scadenza 18/01/2033	200	0,22	550 UBS Group AG, 1,500%, scadenza 30/11/2024		
400 Dassault Systemes SE, 0,125%, scadenza 16/09/2026	362	0,40	700 UBS Group AG, 3,250%, scadenza 02/04/2025 *		
660 Orange SA, 5,000%, perpetuo *	659	0,73	220 UBS Group AG, 1,000%, scadenza 24/06/2027 *		
200 RTE Reseau de Transport d'Electricite SADR, 2,125%, scadenza 27/09/2038	162	0,18		1.833	2,03
500 Thales SA, 0,750%, scadenza 23/01/2025	478	0,53	Emirati Arabi Uniti — 0,31% (28 febbraio 2023: 0,21%)		
	4.180	4,63	USD 200 Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 2,625%, scadenza 31/03/2036		
Germania — 2,74% (28 febbraio 2023: 2,06%)			180 MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000%, scadenza 10/03/2034		
800 Allianz SE, 2,625%, perpetuo *			279		
400 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250%, scadenza 26/05/2049 *			Regno Unito — 5,84% (28 febbraio 2023: 5,38%)		
	369	0,41	780 Annington Funding Plc, 1,650%, scadenza 12/07/2024		
1.020 NRW Bank, 0,375%, scadenza 16/05/2029	878	0,97	100 Aviva Plc, 3,375%, scadenza 04/12/2045 *		
690 Volkswagen Financial Services AG, 0,875%, scadenza 31/01/2028	598	0,66	1.050 Barclays Plc, 3,375%, scadenza 02/04/2025 *		
100 Vonovia SE, 1,000%, scadenza 16/06/2033	68	0,07	1.110 Lloyds Banking Group Plc, 4,331%, scadenza 21/06/2024 *		
	2.478	2,74	1.140 Lloyd's Banking Group Plc, 4,331%, scadenza 21/06/2024 *		
Israele — 0,26% (28 febbraio 2023: 0,28%)			GBP 140 Pinewood Finance Co Ltd, 3,250%, scadenza 30/09/2025		
USD 280 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, scadenza 01/10/2026			130 Premier Foods Finance Plc, 3,500%, scadenza 15/10/2026		
	234	0,26	420 Rentokil Initial Plc, 0,950%, scadenza 22/11/2024		
Italia — 2,49% (28 febbraio 2023: 1,91%)			100 Segro Capital Sarl, 1,875%, scadenza 23/03/2030		
760 CA Auto Bank SPA/Irlanda, 0,500%, scadenza 13/09/2024			580 Standard Chartered Plc, 3,125%, scadenza 19/11/2024		
	730	0,81	GBP 140 Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250%, scadenza 15/05/2029		
950 Intesa Sanpaolo SpA, 1,000%, scadenza 04/07/2024	926	1,02	800 Vodafone Group Plc, 2,875%, scadenza 20/11/2037		
620 UniCredit SpA, 2,000%, scadenza 23/09/2029 *	596	0,66	100 Wellcome Trust Ltd/The, 1,125%, scadenza 21/01/2027		
	2.252	2,49	5.276		
Giappone — 0,31% (28 febbraio 2023: 0,21%)			Stati Uniti — 13,46% (28 febbraio 2023: 14,56%)		
300 Asahi Group Holdings Ltd, 1,151%, scadenza 19/09/2025			430 AbbVie Inc, 1,250%, scadenza 01/06/2024		
	284	0,31	USD 200 Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625%, scadenza 01/06/2028		

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (000's)	Valore (in migliaia) €	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (000's)	Valore (in migliaia) €	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)			Italia — 5,97% (28 febbraio 2023: 6,17%)		
Stati Uniti — (segue)			1.670 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series 10Y, 2.500%, scadenza 01/12/2032		
USD	76	0,08	1.484	1,64	
USD	90	0,09	4.685	4,33	
430	DH Europe Finance II Sarl, 1,800%, scadenza 18/09/2049	281		5,397	5,97
30	Diamondback Energy Inc, 3,500%, scadenza 01/12/2029	25			
130	Energy Transfer LP, 5,950%, scadenza 01/10/2043	110			
60	Exxon Mobil Corp, 3,452%, scadenza 15/04/2051	41			
60	Ford Motor Co, 3,250%, scadenza 12/02/2032	43			
200	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000%, scadenza 13/11/2030	156			
20	Freeport-McMoRan Inc, 4,625%, scadenza 01/08/2030	17			
350	Freeport-McMoRan Inc, 5,450%, scadenza 15/03/2043	290			
780	General Electric Co, 0,875%, scadenza 17/05/2025	742			
260	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,125%, scadenza 30/09/2024	255			
50	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500%, scadenza 01/04/2025	45			
1.290	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,875%, scadenza 09/05/2029	1.067			
20	Humana Inc, 2,150%, scadenza 03/02/2032	15			
1.130	JPMorgan Chase & Co, 0,625%, scadenza 25/01/2024	1.116			
60	JPMorgan Chase & Co, 2,522%, scadenza 22/04/2031 *	46			
110	JPMorgan Chase & Co, 3,109%, scadenza 22/04/2051 *	69			
400	McDonald's Corp, 1,875%, scadenza 26/05/2027	375			
230	Morgan Stanley, 3,622%, scadenza 01/04/2031 *	189			
100	Morgan Stanley, 5,148%, scadenza 25/01/2034 *	106			
320	Netflix Inc, 3,875%, scadenza 15/11/2029	316			
180	Netflix Inc, 3,625%, scadenza 15/06/2030	174			
190	Prologis Euro Finance LLC, 1,875%, scadenza 01/05/2029	168			
700	Prologis Euro Finance LLC, 1,500%, scadenza 02/08/2034	519			
180	Southwestern Energy Co, 4,750%, scadenza 01/02/2032	147			
42	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000%, scadenza 20/09/2025	39			
40	State Street Corp, 3,152%, scadenza 30/03/2031 *	33			
130	Targa Resources Corp, 4,950%, scadenza 15/04/2052	97			
10	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000%, scadenza 15/01/2032	8			
10	T-Mobile USA Inc, 2,250%, scadenza 15/02/2026	9			
40	T-Mobile USA Inc, 2,625%, scadenza 15/02/2029	32			
110	T-Mobile USA Inc, 3,875%, scadenza 15/04/2030	93			
30	T-Mobile USA Inc, 2,875%, scadenza 15/02/2031	23			
40	T-Mobile USA Inc, 3,500%, scadenza 15/04/2031	32			
10	United Airlines Inc, 144A, 4,375%, scadenza 15/04/2026	9			
150	United Airlines Inc, 144A, 4,625%, scadenza 15/04/2029	123			
110	United Rentals North America Inc, 3,875%, scadenza 15/02/2031	87			
20	UnitedHealth Group Inc, 3,750%, scadenza 15/07/2025	18			
450	Wells Fargo & Co, 1,625%, scadenza 06/02/2025	432			
		12.155		13,46	
Zambia — 0,21% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
USD	200	0,21			
	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625%, scadenza 01/06/2031	188			
Totale Obbligazioni ed effetti societari (costo 7.536 dollari)			41.343 45,77		
Obbligazioni ed effetti governativi — 46,66% (28 febbraio 2023: 51,32%)					
Austria — 2,42% (28 febbraio 2023: 2,40%)					
	2.590	2,42			
	Republic of Austria Government Bond, 144A, 0,900%, scadenza 20/02/2032	2.189			
Belgio — 2,12% (28 febbraio 2023: 2,12%)					
	1.830	2,12			
	Kingdom of Belgium Government Bond, serie 71, 3,750%, scadenza 22/06/2045	1.919			
Franca — 11,17% (28 febbraio 2023: 11,80%)					
	4.210	3,81			
	French Republic Government Bond OAT, 0,000%, scadenza 25/11/2030	3.442			
	1.890	1,63			
	French Republic Government Bond OAT, 0,000%, scadenza 25/05/2032	1.474			
	3.545	3,86			
	French Republic Government Bond OAT, 3,250%, scadenza 25/05/2045	3.482			
	590	0,44			
	French Republic Government Bond OAT, 144A, 1,500%, scadenza 25/05/2050	397			
	400	0,49			
	French Republic Government Bond OAT, 4,000%, scadenza 25/04/2060	446			
	1.000	0,94			
	UNEDIC ASSEO, 1,250%, scadenza 25/05/2033	846			
		10.087		11,17	
Germania — 6,83% (28 febbraio 2023: 11,53%)					
	970	1,00			
	Bundesobligation, Series 183, 0,000%, scadenza 10/04/2026	904			
	580	0,55			
	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, scadenza 15/08/2030	493			
	5.050	5,28			
	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700%, scadenza 15/08/2032	4.768			
		6.165		6,83	
Irlanda — 1,06% (28 febbraio 2023: 1,03%)					
	1.190	1,06			
	Ireland Government Bond, 0,350%, scadenza 18/10/2032	955			
			Messico — 1,24% (28 febbraio 2023: 1,91%)		
			1.530 Mexico Government International Bond, 2,875%, scadenza 08/04/2039		
			1.123 1,24		
			Paesi Bassi — 4,30% (28 febbraio 2023: 4,24%)		
			4.660 Netherlands Government Bond, 144A, 0,000%, scadenza 15/07/2030		
			3.887 4,30		
			Polonia — 1,43% (28 febbraio 2023: 1,27%)		
			7.770 Republic of Poland Government Bond, Series 0432, 1,750%, scadenza 25/04/2032		
			1.293 1,43		
			Africa del Sud — 1,36% (28 febbraio 2023: 1,59%)		
			1.500 Republic of South Africa Government International Bond, 4,300%, scadenza 12/10/2028		
			1.224 1,36		
			Corea del Sud — 1,25% (28 febbraio 2023: 0,84%)		
			1.150 Export-Import Bank of Korea, 0,375%, scadenza 26/03/2024		
			1.126 1,25		
			Spagna — 5,03% (28 febbraio 2023: 5,75%)		
			1.080 Spain Government Bond, 144A, 1,300%, scadenza 31/10/2026		
			1.020 1,13		
			1.210 Spain Government Bond, 144A, 1,400%, scadenza 30/04/2028		
			1.121 1,24		
			890 Spain Government Bond, 144A, 2,900%, scadenza 31/10/2046		
			754 0,84		
			2.050 Spain Government Bond, Series 30Y, 144A, 2,700%, scadenza 31/10/2048		
			1.646 1,82		
			4.541 5,03		
			Sovranazionale — 2,06% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
			2.080 European Stability Mechanism, Series EUR, 0,750%, scadenza 05/09/2028		
			1.864 2,06		
			Regno Unito — 0,42% (28 febbraio 2023: 0,35%)		
			10 Gilt del Regno Unito, 2,500%, scadenza 22/07/2065		
			8 0,01		
			290 Gilt indicizzati all'inflazione del Regno Unito, serie 3MO, 0,125%, scadenza 22/03/2068 β		
			368 0,41		
			376 0,42		
Totale Obbligazioni ed effetti governativi (costo 49.965 dollari)			42.146 46,66		
Organismi di investimento collettivo — 0,58% (28 febbraio 2023: 0,50%)					
			564 Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (distribuzione)		
			520 0,58		
Totale Organismi di investimento collettivo (Costo 508€)			520 0,58		
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 97.472 dollari)			86.466 95,73		
Swap sull'inflazione - 0,02% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
			Apprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)		
			22 0,02		
Contratti a termine in valuta estera — 0,01% (28 febbraio 2023: 0,05%)					
			Apprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)		
			4 0,01		
Futures — 0,36% (28 febbraio 2023: 0,36%)					
			Apprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)		
			322 0,36		
Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico			86.814 96,12		
Contratti a termine in valuta estera — (0,20%) (28 febbraio 2023: (0,25%))					
			Deprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)		
			(179) (0,20)		
Futures - (0,10%) (28 febbraio 2023: (0,80%))					
			Deprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)		
			(91) (0,10)		
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico			(270) (0,30)		
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico			86.544 95,82		
Altre attività eccedenti le passività			3.779 4,18		
Patrimonio in gestione			90.323 € 100,00		
— Gli importi indicati con “-” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.					
144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 16.144.000 dollari ovvero al 17,87% dell'attivo netto.					
* Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.					
± Titoli acquistati su base non definitiva.					
β Il tasso di interesse di questo tipo di titoli è legato all'indice dei prezzi al consumo (CPI)/indice dei prezzi al dettaglio (RPI). Il tasso cedolare è quello del 31 agosto 2023.					

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

ABBREVIAZIONI:

Perpetual	– Un'obbligazione senza data di scadenza. Le obbligazioni perpetue non sono rimborsabili, ma pagano un flusso costante di interessi.
TBA	– Da annunciare.
GBP	– Sterlina britannica
PLN	– Zloty polacco
USD	– Dollaro statunitense

Analisi delle attività totali

Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	94,13
Organismi di investimento collettivo	0,57
Strumenti finanziari derivati	0,38
Altre attività	4,92
Totale Attività	100,00

Prospetto degli swap sull'inflazione

Controparte	Tasso	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Bank of America Merrill Lynch	USD - CPI Urban Consumers	08-mar-2053	930	€ -
Bank of America Merrill Lynch	EUR - Indice armonizzato dei prezzi al consumo	15-mar-2053	1120	€ 22
Apprezamento non realizzato degli swap sull'inflazione (28 febbraio 2023 (in migliaia): –€)				€ 22
Ammortamento non realizzato degli swap sull'inflazione (28 febbraio 2023 (in migliaia): –€)				-
Apprezamento netto degli swap sull'inflazione (28 febbraio 2023 (in migliaia): –€)				€ 22

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta di acquisto (in migliaia)		Valuta di vendita (in migliaia)		Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato dei contratti (in migliaia)	
16-nov-2023	Citi	Acquisto	SEK	10430	Vendita	EUR 893	€ (14)
16-nov-2023	Citi	Acquisto	EUR	122	Vendita	JPY 18.900	2
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	EUR	68	Vendita	CAD 100	-
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	EUR	451	Vendita	GBP 391	(4)
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	EUR	70	Vendita	GBP 60	-
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	EUR	3212	Vendita	USD 3.541	(41)
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	EUR	91	Vendita	AUD 152	-
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	EUR	62	Vendita	CAD 92	-
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	PLN	1120	Vendita	EUR 250	(2)
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	NOK	10885	Vendita	EUR 971	(29)
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	JPY	19538	Vendita	EUR 125	-
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	EUR	2573	Vendita	GBP 2.229	(21)
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	EUR	147	Vendita	JPY 22.627	2
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	EUR	665	Vendita	USD 733	(9)
16-nov-2023	UBS	Acquisto	EUR	4581	Vendita	USD 5.050	(59)
Apprezamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 72€)						€ 4	
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (338)€)						(179)	
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (266)€)						€ (175)	

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
Euro-Bobl dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	77	€ 9.045	€ 58
Euro-Bund dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	65	8.621	86
Euro-Buxl 30 Year Bond dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(8)	(1.070)	(15)
Euro-Schatz Dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	134	14.134	35
ICE 3 Month SONIA dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	50	13.769	(25)
ICE 3 Month SONIA giugno 2024	Bank of America Merrill Lynch	50	13.785	9
Japan 10 Year Bond (OSE) settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(11)	(10.237)	74
Long Gilt dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	9	1.005	18
U.S. 10 Year Ultra Note dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(33)	(3.533)	(51)
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	61	6.015	37
U.S. Ultra Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	3	358	5
Apprezamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 476€)				€ 322
Ammortamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1,065)€)				(91)
Apprezamento netto dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (589)€)				€ 231

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Titoli garantiti da attività — 0,24% (28 febbraio 2023: 0,24%)					
590 Home Equity Asset Trust 2005-6, serie 2005 6, classe M5, 6,374%, scadenza 25/12/2035 *	540	0,24	EUR 900 ZF Finance GmbH, 2,000%, scadenza 06/05/2027	869	0,39
				4.585	2,06
Totale titoli garantiti da attività (costo 577 dollari)					
	540	0,24	Guatemala - 0,50% (28 febbraio 2023: 1,05%)		
Titoli garantiti da ipoteca — 2,34% (28 febbraio 2023: 1,81%)					
580 BANK 2018-BNK15, serie 2018 BN15, classe B, 4,814%, scadenza 15/11/2061 *	505	0,23	1.233 Millicom International Cellular SA, 5,125%, scadenza 15/01/2028	1.119	0,50
234 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, serie 2019 R05, classe 1B1, 144A, 9,502%, scadenza 25/07/2039 *	241	0,11	Indonesia — 0,18% (28 febbraio 2023: 0,17%)		
260 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, serie 2020 R01, classe 1B1, 144A, 8,652%, scadenza 25/01/2040 *	261	0,12	460 Pertamina Persero PT, 3,100%, scadenza 27/08/2030	398	0,18
450 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, serie 2021 R01, classe 1B1, 144A, 8,388%, scadenza 25/10/2041 *	449	0,20	Irlanda — 0,71% (28 febbraio 2023: 0,69%)		
390 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, serie 2023 R05, classe 1M2, 144A, 8,396%, scadenza 25/06/2043 *	397	0,18	590 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300%, scadenza 30/01/2032	480	0,22
730 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, serie 2021 DNA3, classe B1, 144A, 8,788%, scadenza 25/10/2033 *	753	0,34	1.100 Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500%, scadenza 15/02/2024	1.093	0,49
947 Hilton USA Trust 2016-HHV, serie 2016 HHV, classe D, 144A, 4,333%, scadenza 05/11/2038 *	870	0,39		1.573	0,71
5.300 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, serie 2018 PHMZ, classe M, 144A, 13,933%, scadenza 15/06/2035	—	—	Israele — 0,81% (28 febbraio 2023: 0,99%)		
4 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12, serie 2007 LD12, classe AJ, 6,561%, scadenza 15/02/2051 * 4	—	—	EUR 300 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375%, scadenza 15/09/2029	334	0,15
365 PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, serie 2021 1R, classe A, 144A, 8,343%, scadenza 27/02/2024 *	363	0,16	1.250 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, scadenza 01/10/2026	1.131	0,51
427 Seasoned Credit Risk Transfer Trust serie 2017-1, serie 2017 1, classe M1, 144A, 4,000%, scadenza 25/01/2056 *	423	0,19	310 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125%, scadenza 15/09/2031	329	0,15
1.426 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates serie 2005- AR17 Trust, serie 2005 AR17, classe A1C3, 6,389%, scadenza 25/12/2045 *	927	0,42		1.794	0,81
Totale titoli garantiti da ipoteca (costo 10.949\$)					
	5.193	2,34	Italia — 1,22% (28 febbraio 2023: 1,51%)		
Obbligazioni ed effetti societari — 50,58% (28 febbraio 2023: 55,37%)					
Argentina — 0,21% (28 febbraio 2023: 0,20%)					
500 YPF SA, 8,500%, scadenza 28/07/2025	473	0,21	EUR 500 International Design Group SPA, 8,031%, scadenza 15/05/2026 *	542	0,25
Belgio — 0,14% (28 febbraio 2023: 0,18%)					
180 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900%, scadenza 01/02/2046	168	0,08	GBP 770 Intesa Sanpaolo SpA, 6,500%, scadenza 14/03/2029 *	938	0,42
110 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350%, scadenza 01/06/2040	98	0,04	EUR 270 Marcolin SpA, 6,125%, scadenza 15/11/2026	271	0,12
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439%, scadenza 06/10/2048	35	0,02	EUR 1.010 Telecom Italia SpA/Milano, 2,375%, scadenza 12/10/2027	956	0,43
	301	0,14		2.707	1,22
Brasile — 1,50% (28 febbraio 2023: 1,95%)					
1.400 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125%, scadenza 20/09/2031	1.185	0,53	Kazakistan — 1,04% (28 febbraio 2023: 1,01%)		
1.310 Braskem America Finance Co, 7,125%, scadenza 22/07/2041	1.189	0,53	460 KazMunayGas National Co JSC, 5,375%, scadenza 24/04/2030	419	0,19
1.040 Suzano Austria GmbH, 5,000%, scadenza 15/01/2030	968	0,44	660 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500%, scadenza 14/04/2033	498	0,22
	3.342	1,50	1.520 QazaqGaz NC JSC, 4,375%, scadenza 26/09/2027	1.401	0,63
Canada — 0,56% (28 febbraio 2023: 0,99%)					
380 MEG Energy Corp, 144A, 5,875%, scadenza 01/02/2029	363	0,16		2.318	1,04
260 Open Text Corp, 144A, 3,875%, scadenza 15/02/2028	232	0,11	Lussemburgo — 0,65% (28 febbraio 2023: 0,47%)		
740 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125%, scadenza 15/02/2030	638	0,29	EUR 820 Altice Financing SA, 2,250%, scadenza 15/01/2025	854	0,38
	1.233	0,56	GBP 530 Cidron Aida Finco Srl, 6,250%, scadenza 01/04/2028	592	0,27
Cina — 0,51% (28 febbraio 2023: 0,53%)					
1.980 Prosus NV, 3,832%, scadenza 08/02/2051	1.128	0,51		1.446	0,65
Colombia — 0,25% (28 febbraio 2023: 0,24%)					
550 Ecopetrol SA, 8,875%, scadenza 13/01/2033	558	0,25	Messico — 1,97% (28 febbraio 2023: 1,97%)		
Finlandia — 0,30% (28 febbraio 2023: 0,28%)					
EUR 650 Nordea Bank Abp, 3,500%, perpetuo *	663	0,30	1.250 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 7,500%, perpetuo *	1.141	0,51
Francia — 2,37% (28 febbraio 2023: 2,03%)					
EUR 840 Altice France SA/Francia, 2,125%, scadenza 15/02/2025	842	0,38	1.360 BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125%, scadenza 18/01/2033 *	1.184	0,53
EUR 1.000 BNP Paribas SA, 2,500%, scadenza 31/03/2032 *	978	0,44	1.220 Orbia Advance Corp SAB de CV, 5,875%, scadenza 17/09/2044	1.070	0,48
1.690 BNP Paribas SA, 7,375%, perpetuo *	1.660	0,75	1.070 Southern Copper Corp, 5,250%, scadenza 08/11/2042	991	0,45
EUR 560 Burger King France SAS, 8,475%, scadenza 01/11/2026 *	613	0,27		4.386	1,97
EUR 570 Goldstory SAS, 5,375%, scadenza 01/03/2026	600	0,27	Paesi Bassi — 1,97% (28 febbraio 2023: 1,90%)		
EUR 300 IPD 3 BV, 8,000%, scadenza 15/06/2028	334	0,15	250 Cooperatieve Rabobank UA, 3,649%, scadenza 06/04/2028 *	232	0,11
EUR 220 Kapla Holding SAS, 9,163%, scadenza 15/07/2027 *	243	0,11	800 Cooperatieve Rabobank UA, 3,250%, perpetuo *	729	0,33
	5.270	2,37	EUR 200 Cooperatieve Rabobank UA, 4,875%, perpetuo *	184	0,08
Germania — 2,06% (28 febbraio 2023: 2,93%)					
2.600 Allianz SE, 3,200%, perpetuo *	1.976	0,89	GBP 1.100 ING Groep NV, 5,000%, scadenza 30/08/2026 *	1.358	0,61
EUR 680 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625%, scadenza 15/01/2027	657	0,29	1.510 Trivium Packaging Finance BV, 5,500%, scadenza 15/08/2026	1.426	0,64
EUR 558 TK Elevator Holdco GmbH, 6,625%, scadenza 15/07/2028	525	0,24	550 VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000%, scadenza 15/01/2032	449	0,20
EUR 540 TUI Cruises GmbH, 6,500%, scadenza 15/05/2026	558	0,25		4.378	1,97
Perù — 0,18% (28 febbraio 2023: 0,63%)					
			610 Petroleos del Peru SA, 5,625%, scadenza 19/06/2047	391	0,18
Singapore — 0,06% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
			EUR 139 Cromwell Ereit Lux Finco Srl, 2,125%, scadenza 19/11/2025	133	0,06
Slovenia — 0,41% (28 febbraio 2023: 0,37%)					
EUR 1.020 United Group BV, 5,250%, scadenza 01/02/2030	919	0,41	Africa del Sud — 0,09% (28 febbraio 2023: 0,09%)		
Spagna — 1,37% (28 febbraio 2023: 0,49%)					
EUR 1.000 Banco Santander SA, 5,750%, scadenza 23/08/2033 *	1.083	0,49	200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750%, scadenza 10/04/2027	194	0,09
EUR 600 Lorca Telecom Bondco SA, 4,000%, scadenza 18/09/2027	604	0,27	Svezia — 0,67% (28 febbraio 2023: 0,77%)		
EUR 300 Telefonica Europe BV, 3,875%, perpetuo *	304	0,14	EUR 300 Assemblin Group AB, 8,587%, scadenza 05/07/2029 *	322	0,15
EUR 300 Telefonica Europe BV, 2,376%, perpetuo *	258	0,12			
EUR 770 Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA, 5,250%, scadenza 01/04/2026	787	0,35			
	3.036	1,37			

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Svezia — (segue)					
EUR	680	0,15	380	361	0,16
	Heimstaden Bostad AB, 3,625%, perpetuo *				
EUR	750	0,37	780	954	0,43
	Verisure Holding AB, 7,125%, scadenza 01/02/2028				
		1,484	390	347	0,16
			1.515	1.252	0,56
			1.430	1.285	0,58
			235	190	0,09
			590	662	0,30
Svizzera — 0,90% (28 febbraio 2023: 2,00%)					
	2.010	0,90	1.400	1.224	0,55
	UBS Group AG, 7,000%, perpetuo *				
Regno Unito — 8,57% (28 febbraio 2023: 7,21%)					
EUR	750	0,35	200	168	0,08
	888 Acquisitions Ltd, 7,558%, scadenza 15/07/2027				
GBP	620	0,32	30	20	0,01
	Barclays Plc, 7,125%, perpetuo *				
GBP	570	0,28	330	232	0,10
	Bellis Acquisition Co Plc, 4,500%, scadenza 16/02/2026				
GBP	210	0,11	270	248	0,11
	Galaxy Bidco Ltd, 6,500%, scadenza 31/07/2026				
GBP	1.160	0,61	440	381	0,17
	Gatwick Airport Finance Plc, 4,375%, scadenza 07/04/2026				
GBP	1.459	0,65	170	141	0,06
	Greene King Finance Plc, serie B2, 7,080%, scadenza 15/03/2036 *				
		1.439	1.430	1.271	0,57
		356	40	0,02	
	400 HSBC Holdings Plc, 4,762%, scadenza 29/03/2033 *				
		1.197	640	623	0,28
	1.240 HSBC Holdings Plc, 6,375%, perpetuo *				
EUR	110	0,05	690	597	0,27
	INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750%, scadenza 15/07/2026				
EUR	1.600	0,73	490	193	0,09
	Lloyds Banking Group Plc, 4,947%, perpetuo *				
GBP	1.275	0,52	1.850	1.672	0,75
	Marston's Issuer Plc, serie B1, 7,819%, scadenza 16/07/2035 *				
GBP	660	0,33	205	232	0,10
	NatWest Group Plc, 3,619%, scadenza 29/03/2029 *				
GBP	170	0,10	500	521	0,23
	NatWest Markets Plc, 6,375%, scadenza 08/11/2027				
EUR	230	0,11	1.210	1.073	0,48
	PEU Fin Plc, 7,250%, scadenza 01/07/2028				
GBP	540	0,29	700	702	0,32
	Pinewood Finance Co Ltd, 3,250%, scadenza 30/09/2025				
GBP	550	0,28	1.620	1.932	0,87
	Premier Foods Finance Plc, 3,500%, scadenza 15/10/2026				
GBP	1.150	0,50	640	614	0,28
	Saga Plc, 5,500%, scadenza 15/07/2026				
GBP	453	0,24	450	414	0,19
	Tesco Property Finance 5 Plc, 5,661%, scadenza 13/10/2041				
GBP	1.027	0,53	1.130	1.006	0,45
	Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411%, scadenza 13/07/2044				
EUR	300	0,12	790	775	0,35
	Victoria Plc, 3,625%, scadenza 24/08/2026				
GBP	810	0,36	1.000	856	0,39
	Vmed O2 UK Financing I Plc, 4,500%, scadenza 15/07/2031				
GBP	1.020	0,58	530	493	0,22
	Vodafone Group Plc, 8,000%, scadenza 30/08/2086 *				
GBP	680	0,32	1.000	929	0,42
	Wheel Bidco Ltd, 6,750%, scadenza 15/07/2026				
GBP	1.000	0,49	510	581	0,26
	Whitbread Group Plc, 2,375%, scadenza 31/05/2027				
		19.049	856	875	0,39
			530	493	0,22
			1.000	929	0,42
			510	581	0,26
			780	660	0,30
			880	875	0,39
			210	203	0,09
			480	400	0,18
			720	583	0,26
				47.505	21,38
Totale Obbligazioni ed effetti societari (costo 124.539 dollari)					
				112.381	50,58
Obbligazioni ed effetti governativi — 36,60% (28 febbraio 2023: 26,03%)					
Argentina — 0,56% (28 febbraio 2023: 0,55%)					
	3.264	0,56	3.264	1.244	0,56
	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 6,375%, scadenza 01/09/2037				
Brasile — 1,32% (28 febbraio 2023: 0,90%)					
BRL	14.694	1,32	14.694	2.938	1,32
	Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTNF, 10,000%, scadenza 01/01/2027				
Colombia — 0,46% (28 febbraio 2023: 0,43%)					
	1.350	0,46	1.350	1.027	0,46
	Colombia Government International Bond, 5,625%, scadenza 26/02/2044				
Costa d'Avorio - 0,36% (28 febbraio 2023: 0,34%)					
EUR	880	0,36	880	809	0,36
	Ivory Coast Government International Bond, 5,250%, scadenza 22/03/2030				
Repubblica Dominicana - 0,52% (28 febbraio 2023: 0,50%)					
	1.360	0,52	1.360	1.157	0,52
	Dominican Republic International Bond, 144A, 4,875%, scadenza 23/09/2032				
Egitto — 0,76% (28 febbraio 2023: 0,85%)					
	1360	0,76	1360	982	0,44
	Egypt Government International Bond, 3,875%, scadenza 16/02/2026				
EUR	1.180	0,76	1.180	708	0,32
	Egypt Government International Bond, 6,375%, scadenza 11/04/2031				
		1.690	1.690	0,76	
Germania — 0,16% (28 febbraio 2023: 0,15%)					
EUR	360	0,16	360	348	0,16
	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250%, scadenza 15/02/2029				
Indonesia — 3,24% (28 febbraio 2023: 2,96%)					
IDR	50.976.000	3,24	50.976.000	3.431	1,55
	Indonesia Treasury Bond, serie FR59, 7,000%, scadenza 15/05/2027				

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti governativi — (segue)					
Indonesia - (segue)					
IDR 52.396.000	Indonesia Treasury Bond, serie FR78, 8,250%, scadenza 15/05/2029	3.757	1,69		
		7.188	3,24		
Giordania - 0,18% (28 febbraio 2023: 0,17%)					
430	Jordan Government International Bond, 5,850%, scadenza 07/07/2030	399	0,18		
Messico — 3,68% (28 febbraio 2023: 3,33%)					
MXN 69.240	Mexican Bonos, serie M, 8,500%, scadenza 31/05/2029	3.913	1,76		
MXN 84.947	Mexican Bonos, serie M, 7,750%, scadenza 13/11/2042	4.258	1,92		
		8.171	3,68		
Nigeria — 0,44% (28 febbraio 2023: 0,42%)					
1400	Nigeria Government International Bond, 7,625%, scadenza 28/11/2047	970	0,44		
Oman — 0,18% (28 febbraio 2023: 0,17%)					
390	Oman Government International Bond, 6,000%, scadenza 01/08/2029	393	0,18		
Polonia — 1,76% (28 febbraio 2023: 1,46%)					
PLN 21.700	Republic of Poland Government Bond, serie 0432, 1,750%, scadenza 25/04/2032	3.916	1,76		
Romania — 0,33% (28 febbraio 2023: 0,29%)					
EUR 940	Romanian Government International Bond, 2,000%, scadenza 14/04/2033	729	0,33		
Russia — 0,80% (28 febbraio 2023: 0,18%)					
RUB 288.495	Russian Federal Bond – OFZ, 0,000%, scadenza 19/01/2028†‡	903	0,41		
RUB 329.535	Russian Federal Bond – OFZ, 0,000%, scadenza 10/05/2034†‡	876	0,39		
		1.779	0,80		
Africa del Sud — 1,63% (28 febbraio 2023: 1,46%)					
ZAR 90.478	Republic of South Africa Government Bond, serie R214, 6,500%, scadenza 28/02/2041	2.828	1,27		
1.130	Republic of South Africa Government International Bond, 5,750%, scadenza 30/09/2049	803	0,36		
		3.631	1,63		
Stati Uniti — 20,22% (28 febbraio 2023: 11,09%)					
6.240	United States Treasury Note/Bond, 2,000%, scadenza 30/04/2024	6.102	2,75		
4.310	United States Treasury Note/Bond, 2,000%, scadenza 15/11/2026	3.991	1,80		
2.250	United States Treasury Note/Bond, 0,625%, scadenza 31/03/2027	1.970	0,89		
11.820	United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/10/2027	11.712	5,27		
500	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/03/2028	486	0,22		
30	United States Treasury Note/Bond, 0,625%, scadenza 15/08/2030	24	0,01		
5.680	United States Treasury Note/Bond, 1,375%, scadenza 15/11/2031	4.604	2,07		
290	United States Treasury Note/Bond, 2,750%, scadenza 15/08/2032	260	0,12		
3.320	United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 15/11/2032	3.319	1,49		
120	United States Treasury Note/Bond, 1,750%, scadenza 15/08/2041	81	0,04		
140	United States Treasury Note/Bond, 2,000%, scadenza 15/11/2041	98	0,04		
600	United States Treasury Note/Bond, 3,375%, scadenza 15/08/2042	521	0,23		
2.320	United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 15/11/2042	2.202	0,99		
1.650	United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/05/2045	1.323	0,59		
15	United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/11/2045	12	0,01		
500	United States Treasury Note/Bond, 2,250%, scadenza 15/08/2046	344	0,15		
360	United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/02/2047	286	0,13		
7.240	United States Treasury Note/Bond, 3,125%, scadenza 15/05/2048	5.882	2,65		
820	United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/02/2049	651	0,29		
430	United States Treasury Note/Bond, 2,875%, scadenza 15/05/2049	333	0,15		
40	United States Treasury Note/Bond, 1,250%, scadenza 15/05/2050	21	0,01		
200	United States Treasury Note/Bond, 1,375%, scadenza 15/08/2050	108	0,05		
270	United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/08/2052	215	0,10		
410	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/05/2053	370	0,17		
		44.915	20,22		
Totale Obbligazioni ed effetti governativi (costo 100.042 dollari)				81.304	36,60
Titoli di prestito — 3,48% (28 febbraio 2023: 3,84%)					
579	Alterra Mountain Co, 8,946%, scadenza 30/07/2028 *	581	0,26		
873	API Group Inc, 7,946%, scadenza 01/10/2026 *	876	0,40		
674	Asurion LLC, 9,681%, scadenza 19/08/2028 *	652	0,29		
626	Focus Financial Partners LLC, 8,581%, scadenza 30/06/2028 *	625	0,28		
463	Gnifols Worldwide Operations USA Inc, 7,481%, scadenza 15/11/2027 *	458	0,21		
1.166	Hilton Worldwide Finance LLC, 7,165%, scadenza 21/06/2026 *	1.167	0,53		
138	Nexstar Broadcasting Inc, 7,946%, scadenza 19/09/2026 *	138	0,06		
269	Nord Anglia Education, 9,922%, scadenza 25/01/2028 *	270	0,12		
584	Prime Security Installations Ltd, 8,182%, scadenza 23/09/2026 *	585	0,26		
926	Sedgwick CMS Inc, 9,081%, scadenza 17/02/2028 *	929	0,42		
600	Sotera Health, 8,196%, scadenza 13/12/2026 *	595	0,27		
643	Terrier Media Buyer, Inc., 8,842%, scadenza 17/12/2026 *	600	0,27		
245	UFC Holding LLC, 8,369%, scadenza 29/04/2026 *	245	0,11		
Totale titoli di prestito (costo 7.792 dollari)				7.721	3,48
Organismi di investimento collettivo — 1,36% (28 febbraio 2023: 1,77%)					
22	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc - Western Asset India Bond Fund - classe LM ad accumulazione in US\$	3.032	1,36		
Totale Organismi di investimento collettivo (Costo 2.474\$)				3.032	1,36
Azioni ordinarie — 0,17% (28 febbraio 2023: 0,18%)					
Svizzera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
1.760	Credit Suisse Group AG Escrow †	–	–		
Stati Uniti — 0,17% (28 febbraio 2023: 0,18%)					
44	Berry Corp	376	0,17		
Totale azioni ordinarie (costo 491 dollari)				376	0,17
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 246.864 dollari)				210.547	94,77
Contratti a termine in valuta estera — 0,24% (28 febbraio 2023: 0,34%)					
Apprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)				535	0,24
Futures — 0,10% (28 febbraio 2023: 0,03%)					
Apprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)				221	0,10
Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico				211.303	95,11
Contratti a termine in valuta estera — (0,63%) (28 febbraio 2023: (1,76%))					
Deprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)				(1.411)	(0,63)
Futures - (0,08%) (28 febbraio 2023: (0,01%))					
Deprezzamento non realizzato dei contratti (vedi sotto)				(166)	(0,08)
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico				(1.577)	(0,71)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico				209.726	94,40
Altre attività eccedenti le passività				12.437	5,60
Patrimonio in gestione				222.163\$	100,00

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

ABBREVIAZIONI:

Perpetual	– Un'obbligazione senza data di scadenza. Le obbligazioni perpetue non sono rimborsabili, ma pagano un flusso costante di interessi.
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.
BRL	– Real brasiliano
EUR	– Euro
GBP	– Sterlina britannica
IDR	– Rupia indonesiana
MXN	– Peso messicano
PLN	– Zloty polacco
RUB	– Rublo russo
ZAR	– Rand sudafricano

Analisi delle attività totali

Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	89,05
Altri valori mobiliari negoziati in un altro mercato regolamentato	3,44
Organismi di investimento collettivo	1,35
Strumenti finanziari derivati	0,34
Altre attività	5,82
Totale Attività	100,00

% delle
Attività
totali

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta di acquisto (in migliaia)		Valuta di vendita (in migliaia)		Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato dei contratti (in migliaia)		
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	15	Vendita	EUR	14	\$ -
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	-	Vendita	SGD	-	-
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	4	Vendita	USD	3	-
13-set-2023	Citi	Acquisto	USD	1.450	Vendita	IDR	21548.873	35
13-set-2023	Citi	Acquisto	USD	1.630	Vendita	INR	134.728	2
13-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	3.267	Vendita	TWD	99.169	148
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	652	Vendita	CHF	572	4
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	130	Vendita	EUR	118	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	-	Vendita	EUR	-	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	8	Vendita	GBP	6	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	10	Vendita	GBP	8	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	34	Vendita	PLN	138	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	3	Vendita	SGD	4	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1	Vendita	SGD	1	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	ZAR	6	Vendita	USD	-	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	ZAR	6.128	Vendita	USD	322	3
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CHF	51.864	Vendita	USD	59.386	(577)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	560	Vendita	USD	362	1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	90.618	Vendita	USD	59.245	(496)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	PLN	11.606	Vendita	USD	2.847	(37)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	1.279	Vendita	USD	952	(5)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	-	Vendita	USD	-	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	2	Vendita	USD	3	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	5.901	Vendita	USD	6.492	(88)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	3	Vendita	USD	3	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	1.334	Vendita	USD	1.698	(8)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	3	Vendita	ZAR	62	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	2	Vendita	ZAR	41	-
16-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD	1.901	Vendita	PLN	7.723	36
16-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto	JPY	965.332	Vendita	USD	6.854	(136)
16-nov-2023	Citi	Acquisto	USD	8.106	Vendita	GBP	6.381	22
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	5.245	Vendita	EUR	4.772	51
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	1.802	Vendita	GBP	1.418	5
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	2.051	Vendita	MXN	35.905	(25)
16-nov-2023	HSBC	Acquisto	USD	21.021	Vendita	EUR	19.127	202
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	3.490	Vendita	GBP	2.747	9
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	ZAR	5.000	Vendita	USD	264	(1)
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	AUD	3.230	Vendita	USD	2.127	(29)
16-nov-2023	Morgan Stanley	Acquisto	CAD	1.230	Vendita	USD	921	(9)
16-nov-2023	UBS	Acquisto	USD	7.002	Vendita	GBP	5.513	17
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 775\$)							\$	535
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (4.011)\$)								(1.411)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (3.236)\$)							\$	(876)

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
Euro-Bobl dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(5)	\$ (637)	\$ (4)
Euro-Bund dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	89	12.800	127
Euro-Buxl 30 Year Bond dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(145)	(2)
Long Gilt dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	40	4.843	87
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(39)	(4.330)	(39)
U.S. 2 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	12	2.445	7
U.S. Long Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(23)	(2.799)	(40)
U.S. Ultra Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(30)	(3.884)	(81)
Apprezzamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 74\$)				\$ 221
Ammortamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (29)\$)				(166)
Apprezzamento netto dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 45\$)				\$ 55

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da attività — 7,24% (28 febbraio 2023: 6,50%)			450 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125%, scadenza 15/09/2031		
500	487	0,46	477	0,45	
250	239	0,23	1.216	1,15	
310	300	0,28	Italia — 1,48% (28 febbraio 2023: 0,70%)		
300	292	0,28	700	0,64	
440	432	0,41	380	0,30	
420	401	0,38	660	0,54	
250	250	0,24	1.566	1,48	
300	300	0,28	Lussemburgo — 1,19% (28 febbraio 2023: 1,51%)		
250	207	0,19	500	0,37	
510	465	0,44	710	0,36	
250	234	0,22	600	0,46	
443	425	0,40	1.265	1,19	
500	467	0,44	Macao — 1,56% (28 febbraio 2023: 1,80%)		
280	252	0,24	200	0,18	
500	479	0,45	200	0,18	
250	232	0,22	450	0,34	
500	485	0,46	200	0,18	
300	271	0,25	820	0,68	
200	200	0,19	1.651	1,56	
580	488	0,46	Paesi Bassi — 0,35% (28 febbraio 2023: 0,30%)		
280	263	0,25	420	0,35	
320	311	0,29	Polonia — 0,28% (28 febbraio 2023: 0,36%)		
190	190	0,18	370	0,28	
Totale Titoli garantiti da attività (Costo 8.0045)	7.670	7,24	Svizzera — 0,60% (28 febbraio 2023: 2,04%)		
Obbligazioni ed effetti societari — 81,60% (28 febbraio 2023: 84,70%)			210 VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 7,875%, scadenza 01/05/2027		
Bermuda — 0,53% (28 febbraio 2023: 0,65%)			130 VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 9,500%, scadenza 01/06/2028		
591	559	0,53	390	0,30	
Canada — 2,75% (28 febbraio 2023: 2,47%)			321 Ocean Trails CLO V, Serie 2014 5A, Classe DRR, 144A, 9,013%, scadenza 13/10/2031 *		
230	205	0,19	631	0,60	
180	180	0,17	Regno Unito — 3,24% (28 febbraio 2023: 2,54%)		
200	188	0,18	1.280	1,19	
440	425	0,40	800	0,59	
420	381	0,36	540	0,46	
700	659	0,62	770	0,64	
550	558	0,53	450	0,36	
310	312	0,30	3.427	3,24	
	2.908	2,75	Stati Uniti — 64,31% (28 febbraio 2023: 67,88%)		
Isole Cayman — 0,94% (28 febbraio 2023: 0,91%)			340 Academy Ltd, 144A, 6,000%, scadenza 15/11/2027		
1059	996	0,94	742	0,73	
Francia — 1,20% (28 febbraio 2023: 0,28%)			550 AdaptHealth LLC, 144A, 4,625%, scadenza 01/08/2029		
240	180	0,17	120	0,42	
670	474	0,45	290	0,09	
310	302	0,28	290	0,27	
320	320	0,30	500	0,36	
	1276	1,20	1.830	0,99	
Germania — 0,47% (28 febbraio 2023: 0,00%)			370 Alta Equipment Group Inc, 144A, 5,625%, scadenza 15/04/2026		
490	497	0,47	910	0,32	
Hong Kong — 0,36% (28 febbraio 2023: 0,45%)			910 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500%, scadenza 15/02/2029		
450	378	0,36	480	0,59	
India — 0,29% (28 febbraio 2023: 0,25%)			480 American Airlines Inc, 144A, 11,750%, scadenza 15/07/2025		
340	304	0,29	310	0,50	
Israele — 1,15% (28 febbraio 2023: 1,26%)			340 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750%, scadenza 20/04/2029		
500	461	0,44	460	0,31	
300	278	0,26	490	0,36	
			95	0,52	
			930	0,69	
			200	0,15	
			510	0,42	
			900	0,86	
			180	0,17	
			110	0,07	
			600	0,29	
			600	0,16	
			170	0,16	
			400	0,36	
			700	0,65	
			370	0,32	
			600	0,52	

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia)	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia)	% del valore netto d'inventario		
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)							
Stati Uniti — (segue)							
330	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875%, scadenza 15/04/2030	303	0,29	310	Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 4,500%, scadenza 15/11/2029	272	0,26
350	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250%, scadenza 01/07/2031	354	0,33	180	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,250%, scadenza 01/02/2027	163	0,15
280	Caesars Entertainment Inc, 144A, 8,125%, scadenza 01/07/2027	285	0,27	390	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,750%, scadenza 15/06/2029	328	0,31
640	Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000%, scadenza 15/02/2030	643	0,61	600	Las Vegas Sands Corp, 3,200%, scadenza 08/08/2024	581	0,55
400	Cano Health LLC, 144A, 6,250%, scadenza 01/10/2028	136	0,13	740	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144A, 5,000%, scadenza 01/02/2026	696	0,66
100	Carnival Corp, 144A, 7,625%, scadenza 01/03/2026	100	0,09	610	LifePoint Health Inc, 144A, 9,875%, scadenza 15/08/2030	603	0,57
230	Carnival Corp, 144A, 7,000%, scadenza 15/08/2029	234	0,22	300	LSF11 A5 HoldCo LLC, 144A, 6,625%, scadenza 15/10/2029	250	0,24
570	Carnival Corp, 144A, 10,500%, scadenza 01/06/2030	608	0,57	130	Madison IAQ LLC, 144A, 4,125%, scadenza 30/06/2028	115	0,11
220	Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375%, scadenza 01/05/2028	239	0,23	570	Madison IAQ LLC, 144A, 5,875%, scadenza 30/06/2029	480	0,45
800	Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875%, scadenza 15/10/2029	601	0,57	830	Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625%, scadenza 01/10/2031	677	0,64
250	Carriage Services Inc, 144A, 4,250%, scadenza 15/05/2029	217	0,21	600	Medline Borrower LP, 144A, 5,250%, scadenza 01/10/2029	533	0,50
370	Carrolls Restaurant Group Inc, 144A, 5,875%, scadenza 01/07/2029	319	0,30	440	Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250%, scadenza 01/05/2028	367	0,35
740	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750%, scadenza 01/02/2032	613	0,58	740	Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875%, scadenza 01/05/2029	514	0,49
550	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500%, scadenza 01/05/2032	446	0,42	280	Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500%, scadenza 01/05/2028	249	0,24
200	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500%, scadenza 01/06/2033	158	0,15	420	Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 5,625%, scadenza 15/01/2030	339	0,32
470	Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250%, scadenza 15/06/2029	464	0,44	650	MIWD Holdco II LLC / MIWD Finance Corp, 144A, 5,500%, scadenza 01/02/2030	552	0,52
600	Chord Energy Corp, 144A, 6,375%, scadenza 01/06/2026	592	0,56	430	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 13,250%, scadenza 15/12/2027	458	0,43
140	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125%, scadenza 01/04/2030	81	0,08	340	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500%, scadenza 15/03/2031	221	0,21
860	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 5,250%, scadenza 15/05/2030	679	0,64	700	Nabors Industries Ltd, 144A, 7,250%, scadenza 15/01/2026	674	0,64
470	Clarivate Science Holdings Corp, 144A, 4,875%, scadenza 01/07/2029	410	0,39	880	NCL Corp Ltd, 144A, 5,875%, scadenza 15/02/2027	854	0,81
165	Clean Harbors Inc, 144A, 6,375%, scadenza 01/02/2031	164	0,16	200	NCL Corp Ltd, 144A, 8,375%, scadenza 01/02/2028	206	0,19
410	Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500%, scadenza 01/06/2029	306	0,29	20	NCL Corp Ltd, 144A, 7,750%, scadenza 15/02/2029	19	0,02
480	CNX Midstream Partners LP, 144A, 4,750%, scadenza 15/04/2030	415	0,39	140	NextEra Energy Partners LP, 144A, 2,500%, scadenza 15/06/2026	125	0,12
360	Coinbase Global Inc, 144A, 3,625%, scadenza 01/10/2031	243	0,23	490	NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC, 144A, 7,125%, scadenza 01/04/2026	466	0,44
700	CommScope Inc, 144A, 4,750%, scadenza 01/09/2029	521	0,49	410	NMI Holdings Inc, 144A, 7,375%, scadenza 01/06/2025	413	0,39
130	CommScope Technologies LLC, 144A, 5,000%, scadenza 15/03/2027	72	0,07	400	Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125%, scadenza 01/03/2028	401	0,38
290	Crescent Energy Finance LLC, 144A, 9,250%, scadenza 15/02/2028	297	0,28	760	Northwest Acquisitions LLC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125%, scadenza 01/11/2022	-	-
270	CSC Holdings LLC, 144A, 11,250%, scadenza 15/05/2028	267	0,25	30	Pactiv LLC, 8,375%, scadenza 15/04/2027	30	0,03
810	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500%, scadenza 01/02/2029	670	0,63	510	Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500%, scadenza 01/04/2027	364	0,34
320	CSC Holdings LLC, 144A, 5,750%, scadenza 15/01/2030	177	0,17	220	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer, 144A, 5,875%, scadenza 01/10/2028	204	0,19
250	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125%, scadenza 01/12/2030	179	0,17	600	Park-Ohio Industries Inc, 6,625%, scadenza 15/04/2027	521	0,49
300	CSC Holdings LLC, 144A, 4,500%, scadenza 15/11/2031	214	0,20	450	Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000%, scadenza 15/06/2029	382	0,36
430	CSC Holdings LLC, 144A, 5,000%, scadenza 15/11/2031	230	0,22	250	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144A, 7,750%, scadenza 15/02/2029	239	0,23
110	Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875%, scadenza 01/09/2031	111	0,10	370	PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500%, scadenza 01/10/2028	357	0,34
350	Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000%, scadenza 15/06/2030	342	0,32	660	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 6,250%, scadenza 15/01/2028	629	0,59
600	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875%, scadenza 15/08/2027	532	0,50	430	Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500%, scadenza 15/02/2028	204	0,19
1.130	DISH DBS Corp, 7,750%, scadenza 01/07/2026	846	0,80	40	Radiology Partners Inc, 144A, 9,250%, scadenza 01/02/2028	16	0,01
1.050	DISH DBS Corp, 144A, 5,750%, scadenza 01/12/2028	817	0,77	400	Range Resources Corp, 8,250%, scadenza 15/01/2029	416	0,39
1.010	DISH DBS Corp, 5,125%, scadenza 01/06/2029	547	0,52	290	Range Resources Corp, 144A, 4,750%, scadenza 15/02/2030	262	0,25
90	Diversified Healthcare Trust, 9,750%, scadenza 15/06/2025	89	0,08	280	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 3,875%, scadenza 01/03/2031	228	0,22
170	Diversified Healthcare Trust, 4,750%, scadenza 15/02/2028	130	0,12	1.060	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 4,000%, scadenza 15/10/2033	839	0,79
440	Dornoch Debt Merger Sub Inc, 144A, 6,625%, scadenza 15/10/2029	380	0,36	630	Roller Bearing Co of America Inc, 144A, 4,375%, scadenza 15/10/2029	564	0,53
350	DraftKings Holdings Inc, zero coupon, scadenza 15/03/2028	268	0,25	310	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,625%, scadenza 15/08/2027	338	0,32
170	Earthstone Energy Holdings LLC, 144A, 8,000%, scadenza 15/04/2027	174	0,16	430	Royal Caribbean Cruises Ltd, 3,700%, scadenza 15/03/2028	375	0,35
140	Earthstone Energy Holdings LLC, 144A, 9,875%, scadenza 15/07/2031	154	0,15	590	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 7,250%, scadenza 15/01/2030	600	0,57
400	Elastic NV, 144A, 4,125%, scadenza 15/07/2029	344	0,33	220	RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,750%, scadenza 31/07/2028	220	0,21
510	FirstCash Inc, 144A, 4,625%, scadenza 01/09/2028	454	0,43	370	Ryan Specialty LLC, 144A, 4,375%, scadenza 01/02/2030	331	0,31
250	FirstCash Inc, 144A, 5,625%, scadenza 01/01/2030	227	0,21	2	Service Corp International/US, 7,500%, scadenza 01/09/2027	2	-
770	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875%, scadenza 15/11/2025	719	0,68	360	Sizzling Platter LLC / Sizzling Platter Finance Corp, 144A, 8,500%, scadenza 28/11/2025	357	0,34
1.090	Foot Locker Inc, 144A, 4,000%, scadenza 01/10/2029	821	0,78	340	Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 6,000%, scadenza 01/11/2028	327	0,31
440	Ford Motor Co, 3,250%, scadenza 12/02/2032	344	0,32	800	Southwestern Energy Co, 4,750%, scadenza 01/02/2032	710	0,67
570	Ford Motor Credit Co LLC, 5,113%, scadenza 03/05/2029	525	0,50	260	Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144A, 4,875%, scadenza 01/11/2027	241	0,23
590	Ford Motor Credit Co LLC, 7,350%, scadenza 06/03/2030	601	0,57	250	Spirit Airlines Inc, 1,000%, scadenza 15/05/2026	212	0,20
1.000	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000%, scadenza 13/11/2030	847	0,80	360	Sprint Capital Corp, 8,750%, scadenza 15/03/2032	429	0,41
670	Freeport-McMoRan Inc, 5,450%, scadenza 15/03/2043	602	0,57	240	StoneX Group Inc, 144A, 8,625%, scadenza 15/06/2025	243	0,23
570	Full House Resorts Inc, 144A, 8,250%, scadenza 15/02/2028	508	0,48	1.120	Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875%, scadenza 01/09/2026	987	0,93
410	Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000%, scadenza 01/11/2026	352	0,33	200	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000%, scadenza 31/12/2030	179	0,17
370	Gen Digital Inc, 144A, 7,125%, scadenza 30/09/2030	373	0,35	480	Titan International Inc, 7,000%, scadenza 30/04/2028	459	0,43
1.080	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875%, scadenza 15/12/2028	944	0,89	200	TopBuild Corp, 144A, 3,625%, scadenza 15/03/2029	172	0,16
110	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750%, scadenza 20/01/2026	102	0,10	580	TransDigm Inc, 144A, 6,750%, scadenza 15/08/2028	583	0,55
207	HCA Inc, 7,500%, scadenza 15/11/2095	228	0,22	320	Triton Water Holdings Inc, 144A, 6,250%, scadenza 01/04/2029	272	0,26
360	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 6,250%, scadenza 15/04/2032	331	0,31	460	United Airlines Inc, 144A, 4,625%, scadenza 15/04/2029	410	0,39
400	Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,750%, scadenza 15/01/2027	386	0,36	1.050	United Rentals North America Inc, 5,250%, scadenza 15/01/2030	999	0,94
150	iHeartCommunications Inc, 144A, 5,250%, scadenza 15/08/2027	119	0,11	240	Univision Communications Inc, 144A, 8,000%, scadenza 15/08/2028	240	0,23
230	iHeartCommunications Inc, 144A, 4,750%, scadenza 15/01/2028	177	0,17	250	Upbound Group Inc, 144A, 6,375%, scadenza 15/02/2029	227	0,21
680	IIP Operating Partnership LP, 5,500%, scadenza 25/05/2026	604	0,57	370	Urban One Inc, 144A, 7,375%, scadenza 01/02/2028	322	0,30
600	Iron Mountain Information Management Services Inc, 144A, 5,000%, scadenza 15/07/2032	519	0,49	459	US Renal Care Inc, 144A, 10,625%, scadenza 28/06/2028	296	0,28

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)			Organismi di investimento collettivo — 0,14% (28 febbraio 2023: 1,33%)		
Stati Uniti — (segue)			143 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing) 143 0,14		
420	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 6,250%, scadenza 15/01/2030	410	0,39		
180	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 4,125%, scadenza 15/08/2031	153	0,14		
120	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875%, scadenza 01/11/2033	98	0,09		
750	Vericast Corp, 144A, 11,000%, scadenza 15/09/2026	785	0,74		
510	Vertiv Group Corp, 144A, 4,125%, scadenza 15/11/2028	458	0,43		
120	Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875%, scadenza 15/09/2027	112	0,11		
450	Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000%, scadenza 15/02/2029	427	0,40		
260	Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125%, scadenza 15/07/2031	269	0,25		
390	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000%, scadenza 15/02/2028	362	0,34		
800	WW International Inc, 144A, 4,500%, scadenza 15/04/2029	555	0,52		
740	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125%, scadenza 15/02/2031	728	0,69		
690	XPO CNW Inc, 6,700%, scadenza 01/05/2034	687	0,65		
440	ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000%, scadenza 15/01/2030	370	0,35		
		68.081	64,31		
Zambia — 0,90% (28 febbraio 2023: 1,27%)					
940	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625%, scadenza 01/06/2031	958	0,90		
Totale Obbligazioni ed effetti societari (Costo 96.408\$)			86.386 81,60		
Obbligazioni ed effetti governativi — 0,26% (28 febbraio 2023: 0,22%)					
Argentina — 0,26% (28 febbraio 2023: 0,22%)					
55	Argentine Republic Government International Bond, 1,000%, scadenza 09/07/2029	18	0,02		
408	Argentine Republic Government International Bond, 0,750%, scadenza 09/07/2030	137	0,13		
94	Argentine Republic Government International Bond, 3,625%, scadenza 09/07/2035	28	0,02		
60	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 6,375%, scadenza 01/09/2037	23	0,02		
190	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 6,375%, scadenza 01/09/2037	73	0,07		
		279	0,26		
Totale Obbligazioni ed effetti governativi (Costo 378\$)			279 0,26		
Note di prestito — 6,55% (28 febbraio 2023: 5,28%)					
178	19th Holdings Golf, LLC, 8,666%, scadenza 07/02/2029 *	175	0,16		
322	Adtalem Global Education Inc, 9,446%, scadenza 12/02/2028 *	322	0,30		
150	Agility Health Inc, 8,247%, scadenza 01/05/2030 *	150	0,14		
427	Asurion LLC, 9,431%, scadenza 17/08/2028 *	412	0,39		
250	Clarios Global LP, 9,081%, scadenza 20/04/2030 *	250	0,24		
570	DCert Buyer, Inc., 12,331%, scadenza 16/02/2029 *	535	0,51		
190	Deerfield Dakota Holding LLC, 12,288%, scadenza 14/04/2028 *	180	0,17		
340	Equinox Holdings Inc, 14,731%, scadenza 08/03/2024 *†	329	0,31		
388	Eyecare Partners LLC, 9,253%, scadenza 05/02/2027 *	309	0,29		
494	Focus Financial Partners LLC, 8,581%, scadenza 30/06/2028 *	493	0,47		
231	Global Tel'Link Corp, 9,769%, scadenza 29/11/2025 *	218	0,21		
351	Great Outdoors Group LLC, 9,196%, scadenza 05/03/2028 *	351	0,33		
203	Magenta Buyer LLC, 10,631%, scadenza 03/05/2028 *	153	0,14		
82	MRI Software LLC, 10,842%, scadenza 10/02/2026 *	80	0,08		
47	MRI Software LLC, 10,842%, scadenza 10/02/2026 *	46	0,04		
160	Neptune Bidco U.S. Inc, 10,398%, scadenza 11/04/2029 *	146	0,14		
461	Phoenix Guarantor Inc, 8,696%, scadenza 05/03/2026 *	459	0,43		
417	R.R. Donnelley, 14,500%, scadenza 08/03/2028 *	418	0,40		
183	Redstone Holdco 2 LP, 10,179%, scadenza 27/04/2028 *	143	0,14		
660	Rent-A-Center Inc/TX, 8,881%, scadenza 17/02/2028 *	659	0,62		
410	Spencer Spirit IH LLC, 11,429%, scadenza 14/06/2026 *	408	0,39		
140	TruGreen LP, 14,131%, scadenza 30/10/2028 *†	88	0,08		
332	U.S. Renal Care Inc, 10,346%, scadenza 28/06/2028 *	214	0,20		
392	Verscend Holding Corp., 9,446%, scadenza 27/08/2025 *	392	0,37		
Totale Titoli di credito (Costo 7.230\$)			6.930 6,55		

Prospetto dei Credit default swap

Controparte	Entità di riferimento – Protezione acquisto/vendita	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Goldman Sachs	Ford Motor Co, 5,000% – Vendita	20-dic-2026	900	\$ 77
Goldman Sachs	Nova Chemicals Corp, 5,000% – Acquisto	20-giu-2027	429	(16)
Goldman Sachs	Occidental Petroleum Corporation, 1,000% - Vendita	20-giu-2026	920	11
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000% – Acquisto	20-giu-2027	580	(42)
Goldman Sachs	Xerox Holdings Corp., 1,000% – Acquisto	20-giu-2027	231	13
Apprezzamento non realizzato di Credit default swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 102\$)				\$ 101
Deprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (116)\$)				(58)
Apprezzamento netto dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (14)\$)				\$ 43

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta di acquisto (in migliaia)			Valuta di vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	5	Vendita	HKD	40	\$ -
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	19	Vendita	EUR	17	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	8	Vendita	GBP	6	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	4	Vendita	SGD	6	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	1.651	Vendita	USD	1.816	(24)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	-	Vendita	USD	-	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	1	Vendita	USD	1	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	537	Vendita	USD	399	(2)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	578	Vendita	USD	737	(4)
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD	6	Vendita	CAD	8	-
Apprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 1\$)								\$ -
Deprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (35)\$)								(30)
Deprezzamento netto dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (34)\$)								\$ (30)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Goldman Sachs	76	\$ 8126	\$ 50
Apprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				\$ 50
Deprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (31)\$)				-
Apprezzamento netto di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (31)\$)				\$ 50

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da attività — 0,46% (28 febbraio 2023: 0,40%)			Perù — 1,08% (28 febbraio 2023: 1,00%)		
250 Magnete XII Ltd, Serie 2015 12A, Classe ER, 144A, 11,250%, scadenza 15/10/2031 *	239	0,46	750 Petroles del Perù SA, 144A, 4,750%, scadenza 19/06/2032	557	1,08
Totale Titoli garantiti da attività (Costo 2475)	239	0,46	Polonia — 0,47% (28 febbraio 2023: 0,42%)		
Obbligazioni ed effetti societari — 75,74% (28 febbraio 2023: 73,14%)			Slovenia — 0,35% (28 febbraio 2023: 0,28%)		
Brasile — 2,13% (28 febbraio 2023: 1,86%)			Svezia — 1,44% (28 febbraio 2023: 1,47%)		
450 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125%, scadenza 20/09/2031	381	0,74	EUR 200 United Group BV, 5,250%, scadenza 01/02/2030	180	0,35
900 MercadoLibre Inc, 3,125%, scadenza 14/01/2031	721	1,39	Turchia — 1,36% (28 febbraio 2023: 1,19%)		
	1.102	2,13	EUR 100 Assemblin Group AB, 8,587%, scadenza 05/07/2029 *	108	0,21
Canada — 2,11% (28 febbraio 2023: 0,50%)			EUR 200 Heimstaden AB, 4,250%, scadenza 09/03/2026	114	0,22
340 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500%, scadenza 15/02/2029	298	0,58	EUR 300 Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 1,125%, scadenza 04/09/2026	213	0,41
150 Bombardier Inc, 144A, 7,125%, scadenza 15/06/2026	148	0,28	EUR 280 Verisure Holding AB, 7,125%, scadenza 01/02/2028	308	0,60
400 GFL Environmental Inc, 144A, 4,250%, scadenza 01/06/2025	387	0,75		743	1,44
250 Ritchie Bros Holdings Inc, 144A, 7,750%, scadenza 15/03/2031	259	0,50	Regno Unito — 7,44% (28 febbraio 2023: 5,97%)		
	1.092	2,11	EUR 220 Galaxy Bidco Ltd, 7,558%, scadenza 31/07/2026	228	0,44
Isole Cayman — 2,06% (28 febbraio 2023: 1,78%)			EUR 200 888 Acquisitions Ltd, 144A, 7,558%, scadenza 15/07/2027	207	0,40
1.131 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500%, scadenza 15/09/2024	1.064	2,06	200 Ashtead Capital Inc, 144A, 2,450%, scadenza 12/08/2031	157	0,30
Cina — 0,05% (28 febbraio 2023: 0,28%)			GBP 220 Bellis Acquisition Co Plc, 4,500%, scadenza 16/02/2026	245	0,47
400 China Aoyuan Group Ltd, 0,000%, scadenza 23/01/2024	11	0,02	GBP 100 Gatwick Airport Finance Plc, 4,375%, scadenza 07/04/2026	116	0,23
400 China Aoyuan Group Ltd, 6,350%, scadenza 08/02/2024	13	0,03	EUR 310 INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750%, scadenza 15/07/2026	299	0,58
	24	0,05	280 Lloyds Banking Group Plc, 8,000%, Perpetual *	254	0,49
Colombia — 0,78% (28 febbraio 2023: 0,44%)			GBP 100 Marks & Spencer Plc, 3,750%, scadenza 19/05/2026	118	0,23
260 Ecopetrol SA, 8,875%, scadenza 13/01/2033	264	0,51	GBP 510 Marston's Issuer Plc, Serie B1, 7,819%, scadenza 16/07/2035 *	462	0,89
200 Ecopetrol SA, 5,875%, scadenza 28/05/2045	141	0,27	GBP 310 Saga Plc, 5,500%, scadenza 15/07/2026	300	0,58
	405	0,78	EUR 100 Victoria Plc, 3,625%, scadenza 24/08/2026	88	0,17
Francia — 0,56% (28 febbraio 2023: 0,93%)			400 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500%, scadenza 15/05/2029	366	0,71
220 Altice France SA/France, 144A, 5,500%, scadenza 15/10/2029	159	0,31	560 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750%, scadenza 15/07/2031	469	0,91
EUR 120 Burger King France SAS, 8,475%, scadenza 01/11/2026 *	131	0,25	400 Vodafone Group Plc, 4,125%, scadenza 30/05/2025	391	0,76
	290	0,56	GBP 140 Wheel Bidco Ltd, 144A, 6,750%, scadenza 15/07/2026	147	0,28
Germania — 3,22% (28 febbraio 2023: 2,00%)				3.847	7,44
EUR 360 APCOA Parking Holdings GmbH, 144A, 4,625%, scadenza 15/01/2027	348	0,68	Stati Uniti — 38,27% (28 febbraio 2023: 36,14%)		
EUR 450 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625%, scadenza 15/01/2027	434	0,84	200 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000%, scadenza 01/05/2028	162	0,31
EUR 240 TUI Cruises GmbH, 6,500%, scadenza 15/05/2026	248	0,48	550 American Airlines Group Inc, 144A, 3,750%, scadenza 01/03/2025	527	1,02
430 ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875%, scadenza 14/04/2028	429	0,83	150 American Airlines Inc, 144A, 7,250%, scadenza 15/02/2028	147	0,29
200 ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125%, scadenza 14/04/2030	203	0,39	660 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000%, scadenza 01/10/2029	544	1,05
	1.662	3,22	280 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000%, scadenza 15/06/2027	273	0,53
Guatemala — 1,61% (28 febbraio 2023: 1,14%)			200 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250%, scadenza 15/08/2027	172	0,33
690 Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250%, scadenza 27/04/2029 *	634	1,23	40 Arsenal AIC Parent LLC, 144A, 8,000%, scadenza 01/10/2030	41	0,08
250 Millicom International Cellular SA, 4,500%, scadenza 27/04/2031	198	0,38	390 Ball Corp, 2,875%, scadenza 15/08/2030	319	0,62
	832	1,61	250 Ball Corp, 3,125%, scadenza 15/09/2031	203	0,39
Hong Kong — 0,42% (28 febbraio 2023: 0,67%)			80 Beacon Roofing Supply Inc, 144A, 6,500%, scadenza 01/08/2030	79	0,15
260 Melco Resorts Finance Ltd, 5,375%, scadenza 04/12/2029	218	0,42	340 Boise Cascade Co, 144A, 4,875%, scadenza 01/07/2030	307	0,59
Israele — 2,54% (28 febbraio 2023: 3,90%)			210 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000%, scadenza 15/02/2030	211	0,41
1.450 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, scadenza 01/10/2026	1.312	2,54	230 Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375%, scadenza 01/05/2028	250	0,48
Italia — 2,60% (28 febbraio 2023: 1,71%)			EUR 500 Carnival Plc, 1,000%, scadenza 28/10/2029	367	0,71
1.120 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198%, scadenza 01/06/2032 *	854	1,66	120 Carriage Services Inc, 144A, 4,250%, scadenza 15/05/2029	104	0,20
70 Telecom Italia Capital SA, 7,200%, scadenza 18/07/2036	63	0,12	320 Carrols Restaurant Group Inc, 144A, 5,875%, scadenza 01/07/2029	276	0,53
430 Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303%, scadenza 30/05/2024	425	0,82	1.050 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250%, scadenza 15/01/2034	805	1,56
	1.342	2,60	150 Charles Schwab Corp/The, Serie H, 4,000%, Perpetual *	113	0,22
Lussemburgo — 4,17% (28 febbraio 2023: 3,83%)			270 Comerica Bank, 2,500%, scadenza 23/07/2024	257	0,50
1.330 Altice Financing SA, 144A, 5,750%, scadenza 15/08/2029	1.055	2,04	230 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750%, scadenza 15/01/2030	127	0,25
200 Altice France Holding SA, 144A, 10,500%, scadenza 15/05/2027	109	0,21	380 CSC Holdings LLC, 144A, 4,625%, scadenza 01/12/2030	199	0,39
410 Altice France Holding SA, 144A, 6,000%, scadenza 15/02/2028	181	0,35	250 CSC Holdings LLC, 144A, 3,375%, scadenza 15/02/2031	172	0,33
390 ARD Finance SA, 144A, 6,500%, scadenza 30/06/2027	314	0,61	870 CSC Holdings LLC, 144A, 5,000%, scadenza 15/11/2031	466	0,90
GBP 220 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250%, scadenza 01/04/2028	245	0,48	60 Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875%, scadenza 01/09/2031	61	0,12
260 FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 144A, 5,625%, scadenza 15/08/2026	250	0,48	200 Delta Air Lines Inc, 2,900%, scadenza 28/10/2024	194	0,38
	2.154	4,17	870 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875%, scadenza 15/08/2027	772	1,49
Macao — 1,03% (28 febbraio 2023: 1,90%)			230 DISH DBS Corp, 5,875%, scadenza 15/11/2024	214	0,41
210 Sands China Ltd, 3,500%, scadenza 08/08/2031	169	0,33	270 DISH DBS Corp, 7,750%, scadenza 01/07/2026	202	0,39
440 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125%, scadenza 15/12/2029	361	0,70	280 DISH DBS Corp, 5,125%, scadenza 01/06/2029	152	0,29
	530	1,03	300 DISH Network Corp, 2,375%, scadenza 15/03/2024	285	0,55
Messico — 1,66% (28 febbraio 2023: 1,56%)			890 DISH Network Corp, 3,375%, scadenza 15/08/2026	543	1,05
200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625%, Perpetual *	186	0,36	100 Diversified Healthcare Trust, 4,375%, scadenza 01/03/2031	75	0,15
360 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 6,625%, Perpetual *	290	0,56	1.580 Ford Motor Co, 3,250%, scadenza 12/02/2032	1.235	2,39
440 BBVA Bancomer SA/Texas, 144A, 5,125%, scadenza 18/01/2033 *	383	0,74			
	859	1,66			

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Stati Uniti — (segue)					
830 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875%, scadenza 15/12/2028	725	1,40	400 Dominican Republic International Bond, 144A, 7,050%, scadenza 03/02/2031	399	0,77
500 Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375%, scadenza 01/05/2025	496	0,96	220 Dominican Republic International Bond, 4,875%, scadenza 23/09/2032	187	0,36
810 JB Poindexter & Co Inc, 144A, 7,125%, scadenza 15/04/2026	793	1,53		918	1,78
270 Las Vegas Sands Corp, 3,200%, scadenza 08/08/2024	262	0,51	Ecuador — 0,36% (28 febbraio 2023: 0,58%)		
540 Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625%, scadenza 01/10/2031	441	0,85	660 Ecuador Government International Bond, 144A, zero coupon, scadenza 31/07/2030	186	0,36
385 NCL Corp Ltd, 144A, 3,625%, scadenza 15/12/2024	369	0,71	Egitto — 0,82% (28 febbraio 2023: 0,89%)		
410 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875%, scadenza 15/03/2026	387	0,75	300 Egypt Government International Bond, 6,588%, scadenza 21/02/2028	197	0,38
200 NCL Finance Ltd, 144A, 6,125%, scadenza 15/03/2028	180	0,35	350 Egypt Government International Bond, 144A, 7,600%, scadenza 01/03/2029	226	0,44
340 Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500%, scadenza 15/02/2028	162	0,31		423	0,82
200 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250%, scadenza 01/07/2026	187	0,36	Giordania — 0,88% (28 febbraio 2023: 0,79%)		
930 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500%, scadenza 01/04/2028	873	1,69	440 Jordan Government International Bond, 144A, 7,750%, scadenza 15/01/2028	452	0,88
200 Service Corp International/US, 5,125%, scadenza 01/06/2029	189	0,37	Kenya — 0,33% (28 febbraio 2023: 0,30%)		
520 Service Properties Trust, 5,500%, scadenza 15/12/2027	461	0,89	200 Republic of Kenya Government International Bond, 144A, 7,250%, scadenza 28/02/2028	170	0,33
160 Service Properties Trust, 4,950%, scadenza 01/10/2029	126	0,24	Messico — 2,08% (28 febbraio 2023: 1,29%)		
290 Sirius XM Radio Inc, 144A, 4,125%, scadenza 01/07/2030	237	0,46	MXN 550 Mexican Bonos, Serie M, 7,750%, scadenza 29/05/2031	29	0,06
320 Southwestern Energy Co, 4,750%, scadenza 01/02/2032	284	0,55	MXN 10.720 Mexican Bonos, Serie M, 7,750%, scadenza 23/11/2034	563	1,09
250 Spirit Airlines Inc, 1,000%, scadenza 15/05/2026	212	0,41	MXN 4.680 Mexican Bonos, Serie M, 7,750%, scadenza 13/11/2042	235	0,45
80 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000%, scadenza 20/09/2025	80	0,16	300 Mexico Government International Bond, 2,659%, scadenza 24/05/2031	249	0,48
360 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000%, scadenza 20/09/2025	361	0,70		1.076	2,08
300 StoneMor Inc, 144A, 8,500%, scadenza 15/05/2029	251	0,49	Nigeria — 1,04% (28 febbraio 2023: 0,40%)		
150 Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 5,875%, scadenza 01/03/2027	147	0,28	360 Nigeria Government International Bond, 144A, 7,143%, scadenza 23/02/2030	295	0,57
520 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875%, scadenza 01/09/2026	458	0,89	300 Nigeria Government International Bond, 144A, 7,875%, scadenza 16/02/2032	245	0,47
190 Tenet Healthcare Corp, 6,250%, scadenza 01/02/2027	187	0,36		540	1,04
170 Titan International Inc, 7,000%, scadenza 30/04/2028	162	0,31	Panama — 0,96% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
250 T-Mobile USA Inc, 2,625%, scadenza 15/04/2026	232	0,45	650 Obbligazione governativa internazionale di Panama, 2,252%, scadenza 29/09/2032	495	0,96
450 T-Mobile USA Inc, 2,625%, scadenza 15/02/2029	390	0,75	Russia — 0,80% (28 febbraio 2023: 0,15%)		
400 United Airlines Inc, 144A, 4,625%, scadenza 15/04/2029	356	0,69	RUB 69.969 Russian Federal Bond – OFZ, 0,000%, scadenza 19/01/2028 ty	219	0,43
50 United Rentals North America Inc, 3,875%, scadenza 15/11/2027	510	0,99	RUB 61.500 Russian Federal Bond – OFZ, 0,000%, scadenza 23/05/2029 ty	192	0,37
550 Venture Global LNG Inc, 144A, 8,375%, scadenza 01/06/2031	50	0,10		411	0,80
120 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625%, scadenza 15/02/2029	112	0,22	Senegal — 0,31% (28 febbraio 2023: 0,28%)		
230 WW International Inc, 144A, 4,500%, scadenza 15/04/2029	159	0,31	230 Senegal Government International Bond, 144A, 6,750%, scadenza 13/03/2048	161	0,31
90 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125%, scadenza 15/02/2031	88	0,17	Sudafrica — 0,34% (28 febbraio 2023: 0,32%)		
	19.781	38,27	250 Republic of South Africa Government International Bond, 5,650%, scadenza 27/09/2047	178	0,34
Zambia — 0,39% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
200 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625%, scadenza 01/06/2031	204	0,39	Turchia — 1,03% (28 febbraio 2023: 1,46%)		
			360 Turkey Government International Bond, 4,250%, scadenza 14/04/2026	333	0,64
Totale Obbligazioni ed effetti societari (Costo 44.257\$)	39.143	75,74	300 Turkey Government International Bond, 4,875%, scadenza 16/04/2043	200	0,39
Obbligazioni ed effetti governativi — 21,43% (28 febbraio 2023: 17,71%)					
Angola — 0,53% (28 febbraio 2023: 0,52%)					
330 Angolan Government International Bond, 144A, 8,750%, scadenza 14/04/2032	272	0,53		533	1,03
Argentina — 2,31% (28 febbraio 2023: 2,30%)					
161 Argentine Republic Government International Bond, 1,000%, scadenza 09/07/2029	53	0,10	Ucraina — 0,25% (28 febbraio 2023: 0,15%)		
297 Argentine Republic Government International Bond, 0,750%, scadenza 09/07/2030	100	0,19	450 Ukraine Government International Bond, 144A, 7,750%, scadenza 01/09/2028	131	0,25
944 Argentine Republic Government International Bond, 3,625%, scadenza 09/07/2035	281	0,55	Stati Uniti — 5,16% (28 febbraio 2023: 4,50%)		
1.271 Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 6,375%, scadenza 01/09/2037	484	0,94	250 United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 09/05/2023	250	0,48
340 Provincia de Cordoba, 144A, 6,990%, scadenza 01/06/2027	275	0,53	650 United States Treasury Note/Bond, 0,750%, scadenza 30/04/2026	588	1,14
	1.193	2,31	750 United States Treasury Note/Bond, 2,750%, scadenza 31/05/2029	693	1,34
Bahamas — 0,38% (28 febbraio 2023: 0,34%)					
200 Bahamas Government International Bond, 144A, 5,750%, scadenza 16/01/2024	198	0,38	700 United States Treasury Note/Bond, 3,125%, scadenza 31/08/2029	659	1,28
Bahrain — 0,48% (28 febbraio 2023: 0,43%)					
310 Bahrain Government International Bond, 144A, 6,000%, scadenza 19/09/2044	250	0,48	500 United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 15/02/2033	476	0,92
Colombia — 0,52% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
350 Colombia Government International Bond, 3,125%, scadenza 15/04/2031	271	0,52		2.666	5,16
Costa Rica — 0,39% (28 febbraio 2023: 0,34%)					
200 Costa Rica Government International Bond, 6,125%, scadenza 19/02/2031	200	0,39	Totale Obbligazioni ed effetti governativi (Costo 14.188\$)		
Costa d'Avorio — 0,68% (28 febbraio 2023: 0,62%)					
410 Ivory Coast Government International Bond, 144A, 6,125%, scadenza 15/06/2033	352	0,68	Note di prestito — 0,44% (28 febbraio 2023: 0,31%)		
Repubblica Dominicana — 1,78% (28 febbraio 2023: 1,60%)					
380 Dominican Republic International Bond, 144A, 4,500%, scadenza 30/01/2030	332	0,65	300 WW International Inc, 8,946%, scadenza 13/04/2028 *	227	0,44
			Totale Note di prestito (Costo 229\$)		
			Azioni ordinarie — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
			Svizzera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
			1.680 Credit Suisse Group AG Escrow t	–	–
			Totale Azioni ordinarie (Costo \$–)		
				–	–

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$ d'inventario	% del valore netto
Garanzia — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Stati Uniti — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
4 EG Acquisition Corp	1	–
Totale Garanzia (Costo 4\$)	1	–
Totale Investimenti al valore equo rilevato a conto economico (Costo 58.925\$)	50.686	98,07
Contratti a termine in valuta estera — 0,06% (28 febbraio 2023: 0,10%)		
Apprezamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	32	0,06
Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	50.718	98,13
Contratti a termine in valuta estera — (0,20%) (28 febbraio 2023: (0,47%))		
Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(105)	(0,20)
Futures — (0,02%) (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(10)	(0,02)
Totale Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(115)	(0,22)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	50.603	97,91
Altre attività eccedenti le passività	1.080	2,09
Patrimonio in gestione	51.683\$	100,00

ABBREVIAZIONI:

Perpetual	–	Obbligazione senza scadenza. Le obbligazioni perpetual non sono riscattabili ma garantiscono interessi costanti.
EUR	–	Euro
GBP	–	Sterlina britannica
MXN	–	Peso messicano
RUB	–	Rublo russo

Analisi delle attività totali

	% delle Attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	95,35
Altri valori mobiliari negoziati su un altro mercato regolamentato	0,43
Strumenti finanziari derivati	0,06
Altre attività	4,16
Totale Attività	100,00

– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 28.353.000\$, ovvero al 54,87% dell'attivo netto.

* Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.

† Illiquido.

γ Titolo che non matura più reddito durante e/o dopo l'esercizio finanziario chiuso al 31 agosto 2023 a causa dell'incertezza dei pagamenti degli interessi.

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta di acquisto (in migliaia)		Valuta di vendita (in migliaia)		Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)			
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	4	Vendita	GBP	3	\$	-
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	2	Vendita	SGD	3		-
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	-	Vendita	USD	-		-
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	2	Vendita	SGD	2		-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	82	Vendita	AUD	126		-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	62	Vendita	AUD	97		(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	28	Vendita	EUR	27		-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	203	Vendita	GBP	160		1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	124	Vendita	SGD	166		-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	10	Vendita	SGD	14		-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	6.716	Vendita	USD	4.391		(37)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	73	Vendita	USD	47		-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	105	Vendita	USD	132		1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	2.414	Vendita	USD	1.796		(9)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	1.719	Vendita	USD	1.893		(26)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	1	Vendita	USD	-		-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	3.091	Vendita	USD	3.936		(20)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	2.048	Vendita	GBP	1.592		30
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	GBP	306	Vendita	USD	400		(12)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	EUR	8	Vendita	USD	9		-
Apprezamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 60\$)							\$	32	
Deprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (271)\$)								(105)	
Deprezzamento netto dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (211)\$)							\$	(73)	

Prospetto dei contratti futures

Valuta Euro FX settembre 2023	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)	
	UBS	(23)	\$ (3.120)	\$ (10)	
Apprezamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 38\$)				\$	-
Deprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)					(10)
Deprezzamento netto dei Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 38\$)				\$	(10)

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	
Obbligazioni ed effetti societari — 13,21% (28 febbraio 2023: 14,21%)			Malesia — 10,85% (28 febbraio 2023: 11,48%)			
Francia — 1,46% (28 febbraio 2023: 1,32%)			MYR 25.000 Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955%, scadenza 15/09/2025			
SGD 8.000	Credit Agricole SA, 3,800%, scadenza 30/04/2031 *	5.744	1,46	5.438	1,38	
Hong Kong — 0,45% (28 febbraio 2023: 0,46%)			MYR 1.200 Malaysia Government Bond, Serie 0308, 5,248%, scadenza 15/09/2028			
3.000	Panther Ventures Ltd, 3,500%, Perpetual	1.785	0,45	277	0,07	
India — 0,92% (28 febbraio 2023: 0,80%)			MYR 26.850 Malaysia Government Bond, Serie 0219, 3,885%, scadenza 15/08/2029			
4.000	REC Ltd, 2,250%, scadenza 01/09/2026	3.611	0,92	5.824	1,48	
Indonesia — 1,76% (28 febbraio 2023: 2,30%)			MYR 50.000 Malaysia Government Bond, Serie 0411, 4,232%, scadenza 30/06/2031			
3.350	Pelabuhan Indonesia Persero PT, 5,375%, scadenza 05/05/2045	3.134	0,80	11.051	2,81	
4.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4,125%, scadenza 15/05/2027	3.796	0,96	10.920	2,78	
		6.930	1,76	4.833	1,23	
Malesia — 0,56% (28 febbraio 2023: 0,51%)			MYR 20.360 Malaysia Government Bond, Serie 0419, 3,828%, scadenza 05/07/2034			
SGD 3.000	Cagamas Global Plc, 3,850%, scadenza 11/09/2023	2.220	0,56	4.327	1,10	
Qatar — 2,32% (28 febbraio 2023: 2,05%)			Filippine — 5,46% (28 febbraio 2023: 4,92%)			
IDR 140.000.000	QNB Finance Ltd, 6,900%, scadenza 23/01/2025	9.123	2,32	PHP 1.256.000 Philippine Government International Bond, 6,250%, scadenza 14/01/2036		
Singapore — 1,68% (28 febbraio 2023: 3,78%)			Singapore — 5,22% (28 febbraio 2023: 6,16%)			
SGD 11.500	Temasek Financial I Ltd, 2,800%, scadenza 17/08/2071	6.593	1,68	SGD 2.000 Housing & Development Board, 3,995%, scadenza 06/12/2029		
Sovranazionale — 4,06% (28 febbraio 2023: 1,46%)			SGD 4.000 Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 15/09/2023			
INR 800.000	European Bank for Reconstruction & Development, 5,150%, scadenza 16/02/2024	9.578	2,44	SGD 4.600 Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 13/10/2023		
IDR 20.000.000	International Bank for Reconstruction & Development, 4,300%, scadenza 13/09/2023	1.312	0,33	SGD 8.250 National Environment Agency, 2,500%, scadenza 15/09/2051		
IDR 77.000.000	International Finance Corp, 8,000%, scadenza 09/10/2023	5.062	1,29	SGD 11.000 Singapore Government Bond, 2,625%, scadenza 01/08/2032		
		15.952	4,06	20.524		
Totale Obbligazioni ed effetti societari (Costo 57.0375)			51.958			
Obbligazioni ed effetti governativi — 85,50% (28 febbraio 2023: 83,94%)			Corea del Sud — 17,49% (28 febbraio 2023: 18,25%)			
Australia — 1,57% (28 febbraio 2023: 0,00%)			IDR 50.000.000 Export-Import Bank of Korea, 144A, 6,700%, scadenza 02/12/2024			
AUD 10.000	Australia Government Bond, 3,750%, scadenza 21/04/2037	6.192	1,57	2.600 Korea Electric Power Corp, 5,375%, scadenza 31/07/2026		
Cina — 18,85% (28 febbraio 2023: 17,35%)			KRW 25.000.000 Korea Treasury Bond, Serie 2912, 1,375%, scadenza 10/12/2029			
CNY 110.000	Agricultural Development Bank of China, Serie 1806, 4,650%, scadenza 11/05/2028	16.480	4,19	KRW 46.300.000 Korea Treasury Bond, Serie 3006, 1,375%, scadenza 10/06/2030		
HKD 7.500	China Development Bank/Hong Kong, 5,710%, scadenza 24/01/2024 *	957	0,24	KRW 13.200.000 Korea Treasury Bond, Serie 3206, 3,375%, scadenza 10/06/2032		
CNY 33.000	China Government Bond, 3,380%, scadenza 21/11/2024	4.593	1,17	KRW 13.000.000 Korea Treasury Bond, Serie 3909, 1,125%, scadenza 10/09/2039		
CNY 50.000	China Government Bond, Serie INBK, 2,680%, scadenza 21/05/2030	6.914	1,76	6.731		
CNY 96.500	China Government Bond, 3,600%, scadenza 21/05/2030	13.979	3,55	68.825		
CNY 100.000	China Government Bond, Serie INBK, 3,390%, scadenza 16/03/2050	14.877	3,78	Thailandia — 6,03% (28 febbraio 2023: 5,38%)		
CNY 5.000	Export-Import Bank of China/The, 4,400%, scadenza 14/05/2024	695	0,18	THB 801.030 Thailand Government Bond, 3,300%, scadenza 17/06/2038		
CNY 40.000	Export-Import Bank of China/The, Serie 2007, 3,260%, scadenza 24/02/2027	5.622	1,43	Vietnam — 1,12% (28 febbraio 2023: 0,34%)		
CNY 30.000	Export-Import Bank of China/The, Serie 1910, 3,860%, scadenza 20/05/2029	4.380	1,11	4.500 Vietnam Government International Bond, 4,800%, scadenza 19/11/2024		
CNY 40.000	Export-Import Bank of China/The, Serie 2010, 3,230%, scadenza 23/03/2030	5.669	1,44	4.413		
		74.166	18,85	Totale Obbligazioni ed effetti governativi (Costo 389.2225)		
India — 7,40% (28 febbraio 2023: 7,70%)			336.426			
INR 280.000	India Government Bond, 8,150%, scadenza 24/11/2026	3.480	0,88	85,50		
INR 750.000	India Government Bond, Serie SPB, 8,240%, scadenza 15/02/2027	9.354	2,38	Organismi di investimento collettivo — 0,67% (28 febbraio 2023: 0,88%)		
INR 450.000	India Government Bond, 7,170%, scadenza 08/01/2028	5.433	1,38	2.645 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)		
INR 700.000	India Government Bond, 7,610%, scadenza 09/05/2030	8.667	2,20	Totale Organismi di investimento collettivo (Costo 2.6455)		
INR 190.000	India Government Bond, 6,570%, scadenza 05/12/2033	2.196	0,56	2.645		
		29.130	7,40	Totale Investimenti al valore equo rilevato a conto economico (Costo 448.9045)		
Indonesia — 11,51% (28 febbraio 2023: 10,13%)			391.029			
IDR 108.875.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR59, 7,000%, scadenza 15/05/2027	7.328	1,86	Contratti a termine in valuta estera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,04%)		
IDR 20.000.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR47, 10,000%, scadenza 15/02/2028	1.490	0,38	Apprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)		
IDR 27.500.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR64, 6,125%, scadenza 15/05/2028	1.799	0,46	6		
IDR 100.000.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR87, 6,500%, scadenza 15/02/2031	6.611	1,68	Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
IDR 114.000.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR54, 9,500%, scadenza 15/07/2031	8.862	2,25	391.035		
IDR 25.000.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR58, 8,250%, scadenza 15/06/2032	1.820	0,46	Contratti a termine in valuta estera — (0,16%) (28 febbraio 2023: (0,26%))		
IDR 160.000.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR89, 6,875%, scadenza 15/08/2051	10.681	2,72	Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)		
IDR 100.000.000	Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Serie OB, 8,250%, scadenza 15/08/2024	6.685	1,70	(618)		
		45.276	11,51	Futures — (0,07%) (28 febbraio 2023: (0,09%))		
			Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)			
			(269)			
			Totale Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico			
			(887)			
			Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico			
			390.148			
			Altre attività eccedenti le passività			
			3.317			
			Patrimonio in gestione			
			393.4655			
			100,00			

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

- Gli importi indicati con “-” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.
- 144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell’ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 3.285.000\$, ovvero allo 0,84% dell’attivo netto.
- * Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.

ABBREVIAZIONI:

Perpetual	– Obbligazione senza scadenza. Le obbligazioni perpetual non sono riscattabili ma garantiscono interessi costanti.
AUD	– Dollaro australiano
CNY	– Renminbi cinese
HKD	– Dollaro di Hong Kong
IDR	– Rupia indonesiana
INR	– Rupia indiana
KRW	– Won sud-coreano
MYR	– Ringgit malese
PHP	– Peso filippino
SGD	– Dollaro di Singapore
THB	– Baht thailandese

Analisi delle attività totali

Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	97,90
Organismi di investimento collettivo	0,67
Strumenti finanziari derivati	-
Altre attività	1,43
Totale Attività	100,00

**% delle
Attività
totali**

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta di acquisto (in migliaia)		Valuta di vendita (in migliaia)		Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)		
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	34	Vendita	CNH	250	\$ -
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	-	Vendita	EUR	-	-
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	-	Vendita	USD	-	-
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	-	Vendita	SGD	-	-
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	2	Vendita	USD	1	-
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	-	Vendita	USD	-	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	38	Vendita	AUD	60	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	316	Vendita	AUD	487	3
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	4	Vendita	CHF	3	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	30	Vendita	CNH	215	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	289	Vendita	CNH	2.107	(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	304	Vendita	EUR	277	3
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	-	Vendita	SGD	-	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	27	Vendita	SGD	36	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	18.993	Vendita	USD	12.417	(142)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	20	Vendita	USD	13	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CHF	269	Vendita	USD	308	(4)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH	48.745	Vendita	USD	6.762	(60)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH	450	Vendita	USD	62	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	3.174	Vendita	USD	2.362	(18)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	11	Vendita	USD	9	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	13.712	Vendita	USD	15.087	(274)
25-set-2023	Citi	Acquisto	SGD	5.500	Vendita	USD	4.146	(83)
28-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	16.150	Vendita	USD	11.970	(36)
Apprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 162\$)							\$	6
Deprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1.130)\$)								(618)
Deprezzamento netto dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (968)\$)							\$	(612)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
Korea 10 Year Bond settembre 2023	UBS	234	\$ 19.400	\$ (269)
Apprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				\$ -
Deprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (373)\$)				(269)
Deprezzamento netto dei Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (373)\$)				\$ (269)

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti societari — 89,69% (28 febbraio 2023: 83,61%)					
Australia — 0,80% (28 febbraio 2023: 0,69%)					
EUR 720	Optus Finance Pty Ltd, 1,000%, scadenza 20/06/2029	652	0,14		
EUR 3.000	Westpac Banking Corp, 0,625%, scadenza 22/11/2024	3.122	0,66		
		3.774	0,80		
Canada — 2,14% (28 febbraio 2023: 2,72%)					
GBP 1.230	Royal Bank of Canada, 1,375%, scadenza 09/12/2024	1.470	0,31		
GBP 3.270	Royal Bank of Canada, 5,000%, scadenza 24/01/2028	3.979	0,84		
GBP 1.980	Toronto-Dominion Bank/The, 2,875%, scadenza 05/04/2027	2.254	0,47		
GBP 2.000	Toronto-Dominion Bank/The, 5,288%, scadenza 11/01/2028	2.454	0,52		
		10.157	2,14		
Danimarca — 1,07% (28 febbraio 2023: 2,09%)					
1.580	Danske Bank A/S, 144A, 5,375%, scadenza 12/01/2024	1.574	0,33		
GBP 2.890	Danske Bank A/S, 4,625%, scadenza 13/04/2027 *	3.519	0,74		
		5.093	1,07		
Finlandia — 0,28% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
EUR 1.220	Neste Oyj, 3,875%, scadenza 16/03/2029	1.328	0,28		
Francia — 7,49% (28 febbraio 2023: 6,57%)					
EUR 300	Air Liquide Finance SA, 1,000%, scadenza 02/04/2025	312	0,07		
EUR 2.300	APRR SA, 0,125%, scadenza 18/01/2029	2.087	0,44		
EUR 800	APRR SA, 1,500%, scadenza 25/01/2030	772	0,16		
GBP 2.600	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1,500%, scadenza 07/10/2026	2.884	0,61		
	230 BNP Paribas SA, 4,705%, scadenza 10/01/2025 *	229	0,05		
EUR 2.700	BNP Paribas SA, 0,375%, scadenza 14/10/2027 *	2.607	0,55		
EUR 1.100	BNP Paribas SA, 1,375%, scadenza 28/05/2029	1.020	0,21		
GBP 2.600	BNP Paribas SA, 5,750%, scadenza 13/06/2032	3.155	0,66		
EUR 1.800	Bouygues SA, 4,625%, scadenza 07/06/2032	2.042	0,43		
EUR 1.000	BPCE SA, 1,000%, scadenza 01/04/2025	1.035	0,22		
GBP 2.600	BPCE SA, 1,375%, scadenza 23/12/2026	2.861	0,60		
EUR 300	Credit Agricole SA/Londra, 1,250%, scadenza 14/04/2026	305	0,06		
6.350	Credit Agricole SA/Londra, 1,907%, scadenza 16/06/2026 *	5.914	1,25		
EUR 300	Credit Agricole SA/Londra, 1,750%, scadenza 05/03/2029	288	0,06		
EUR 400	Engie SA, 1,000%, scadenza 13/03/2026	405	0,09		
EUR 300	Engie SA, 2,375%, scadenza 19/03/2026	314	0,07		
EUR 1.100	Engie SA, 0,500%, scadenza 24/10/2030	951	0,20		
EUR 2.400	L'Oreal SA, 0,875%, scadenza 29/06/2026	2.438	0,51		
EUR 2.100	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 3,375%, scadenza 21/10/2025	2.273	0,48		
EUR 600	RTE Réseau de Transport d'Electricité SADR, 1,000%, scadenza 19/10/2026	603	0,13		
EUR 1.100	TotalEnergies Capital International SA, 1,405%, scadenza 04/03/2027	1.099	0,23		
GBP 1.700	Vinci SA, 2,250%, scadenza 15/03/2027	1.932	0,41		
		35.526	7,49		
Germania — 4,34% (28 febbraio 2023: 5,72%)					
EUR 900	Allianz Finance II BV, 0,000%, scadenza 14/01/2025	931	0,20		
EUR 700	Allianz Finance II BV, 1,500%, scadenza 15/01/2030	683	0,14		
EUR 300	BASF SE, 0,875%, scadenza 15/11/2027	296	0,06		
EUR 600	Clearstream Banking AG, 0,000%, scadenza 01/12/2025	599	0,13		
EUR 500	Deutsche Boerse AG, 1,125%, scadenza 26/03/2028	501	0,10		
EUR 1.500	HOWOGE Wohnungs-baugesellschaft mbH, 0,625%, scadenza 01/11/2028	1.357	0,29		
GBP 6.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,875%, scadenza 18/07/2024	7.310	1,54		
EUR 2.500	Robert Bosch GmbH, 3,625%, scadenza 02/06/2027	2.704	0,57		
EUR 4.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1,000%, scadenza 25/02/2030	3.732	0,79		
GBP 2.000	Volkswagen Financial Services NV, 5,500%, scadenza 07/12/2026	2.486	0,52		
		20.599	4,34		
Giappone — 1,52% (28 febbraio 2023: 1,80%)					
EUR 3.370	NTT Finance Corp, 0,010%, scadenza 03/03/2025	3.453	0,73		
EUR 2.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0,632%, scadenza 23/10/2029	1.772	0,37		
GBP 1.600	Unilever Finance Netherlands BV, 4,625%, scadenza 08/06/2026	1.976	0,42		
		7.201	1,52		
Lussemburgo — 0,47% (28 febbraio 2023: 0,41%)					
EUR 2.275	Prologis International Funding II SA, 1,750%, scadenza 15/03/2028	2.234	0,47		
Paesi Bassi — 5,98% (28 febbraio 2023: 5,25%)					
EUR 220	ABN AMRO Bank NV, 1,000%, scadenza 16/04/2025	228	0,05		
GBP 2.400	ABN AMRO Bank NV, 5,250%, scadenza 26/05/2026	2.995	0,63		
GBP 4.300	ABN AMRO Bank NV, 5,125%, scadenza 22/02/2028	5.200	1,10		
EUR 1.470	Alliander NV, 2,625%, scadenza 09/09/2027	1.552	0,33		
GBP 2.500	Coöperatieve Rabobank UA, 1,250%, scadenza 14/01/2025	2.979	0,63		
EUR 2.300	Coöperatieve Rabobank UA, 0,375%, scadenza 01/12/2027 *	2.214	0,47		
	270 Coöperatieve Rabobank UA/NY, 3,375%, scadenza 21/05/2025	261	0,05		
EUR 2.010	Enxsis Holding NV, 0,750%, scadenza 02/07/2031	1.787	0,38		
EUR 300	ING Groep NV, 2,125%, scadenza 10/01/2026	314	0,07		
EUR 1.300	ING Groep NV, 0,875%, scadenza 29/11/2030 *	1.149	0,24		
1.780	Shell International Finance BV, 3,250%, scadenza 11/05/2025	1.724	0,36		
1.700	Shell International Finance BV, 2,750%, scadenza 06/04/2030	1.500	0,32		
EUR 1.910	TenneT Holding BV, 1,625%, scadenza 17/11/2026	1.971	0,42		
EUR 2.220	TenneT Holding BV, 1,375%, scadenza 05/06/2028	2.206	0,46		
EUR 1.000	Vesteda Finance BV, 2,000%, scadenza 10/07/2026	1.019	0,21		
EUR 1.500	Vesteda Finance BV, 0,750%, scadenza 18/10/2031	1.247	0,26		
		28.346	5,98		
Norvegia — 1,94% (28 febbraio 2023: 1,69%)					
EUR 940	Avinor AS, 0,750%, scadenza 01/10/2030	835	0,18		
GBP 2.150	DNB Bank ASA, 4,000%, scadenza 17/08/2027 *	2.547	0,54		
EUR 3.400	DNB Bank ASA, 3,125%, scadenza 21/09/2027 *	3.601	0,76		
EUR 1.000	Equinor ASA, 0,750%, scadenza 22/05/2026	1.005	0,21		
EUR 540	Equinor ASA, 1,250%, scadenza 17/02/2027	542	0,11		
EUR 620	Statkraft AS, 2,875%, scadenza 13/09/2029	653	0,14		
		9.183	1,94		
Singapore — 1,20% (28 febbraio 2023: 1,06%)					
EUR 5.300	Temasek Financial I Ltd, 3,250%, scadenza 15/02/2027	5.699	1,20		
Spagna — 2,35% (28 febbraio 2023: 1,42%)					
EUR 2.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Serie gmtm, 3,375%, scadenza 20/09/2027	2.117	0,45		
GBP 500	Banco Santander SA, 2,750%, scadenza 12/09/2023	633	0,13		
3.400	Banco Santander SA, 5,294%, scadenza 18/08/2027	3.336	0,70		
EUR 1.700	Banco Santander SA, 0,625%, scadenza 24/06/2029 *	1.562	0,33		
EUR 3.200	Banco Santander SA, 4,250%, scadenza 12/06/2030	3.495	0,74		
		11.143	2,35		
Sovranazionale — 2,00% (28 febbraio 2023: 2,06%)					
GBP 6.300	Inter-American Development Bank, 0,500%, scadenza 15/09/2026	6.963	1,47		
GBP 2.090	International Finance Facility for Immunisation Co, 2,750%, scadenza 07/06/2025	2.520	0,53		
		9.483	2,00		
Svezia — 2,12% (28 febbraio 2023: 2,08%)					
EUR 2.190	Hemso Treasury Oyj, 0,000%, scadenza 19/01/2028	1.935	0,41		
EUR 3.050	Swedbank AB, 0,250%, scadenza 09/10/2024	3.176	0,67		
EUR 2.250	Swedbank AB, 0,300%, scadenza 20/05/2027 *	2.188	0,46		
EUR 2.000	Vattenfall AB, 3,750%, scadenza 18/10/2026	2.174	0,46		
EUR 550	Volvo Treasury AB, 0,125%, scadenza 17/09/2024	573	0,12		
		10.046	2,12		
Svizzera — 4,38% (28 febbraio 2023: 3,77%)					
EUR 1.480	ABB Finance BV, 3,250%, scadenza 16/01/2027	1.586	0,33		
EUR 800	Cloverie Plc per Zurich Insurance Co Ltd, 1,500%, scadenza 15/12/2028	786	0,16		
GBP 3.530	Credit Suisse AG/Londra, 1,125%, scadenza 15/12/2025	3.983	0,84		
500	Credit Suisse AG/New York NY, 3,625%, scadenza 09/09/2024	487	0,10		
EUR 6.000	Novartis Finance SA, 0,000%, scadenza 23/09/2028	5.545	1,17		
EUR 1.560	Sika Capital BV, 3,750%, scadenza 03/11/2026	1.689	0,36		
EUR 1.050	Sika Capital BV, 3,750%, scadenza 03/05/2030	1.129	0,24		
GBP 1.050	UBS Group AG, 2,125%, scadenza 12/09/2025 *	1.274	0,27		
4.430	UBS Group AG, 4,703%, scadenza 05/08/2027 *	4.277	0,91		
		20.776	4,38		
Regno Unito — 9,99% (28 febbraio 2023: 9,14%)					
EUR 3.850	AstraZeneca Plc, 3,625%, scadenza 03/03/2027	4.190	0,88		
GBP 1.700	British Land Co Plc/The, 2,375%, scadenza 14/09/2029	1.689	0,36		
EUR 400	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 1,250%, scadenza 13/04/2025	413	0,09		
EUR 270	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,250%, scadenza 21/05/2026	276	0,06		
EUR 550	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,000%, scadenza 12/09/2026	554	0,12		
EUR 5.000	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,375%, scadenza 12/09/2029	4.826	1,02		
EUR 1.200	GSK Capital BV, 3,125%, scadenza 28/11/2032	1.255	0,26		
EUR 520	HSBC Holdings Plc, 0,875%, scadenza 06/09/2024	547	0,11		
1.660	HSBC Holdings Plc, 3,803%, scadenza 11/03/2025	1.640	0,34		
390	HSBC Holdings Plc, 1,645%, scadenza 18/04/2026	363	0,08		
1.220	HSBC Holdings Plc, 2,099%, scadenza 04/06/2026	1.138	0,24		
EUR 1.630	HSBC Holdings Plc, Serie GEN, 0,309%, scadenza 13/11/2026 *	1.619	0,34		
GBP 300	HSBC Holdings Plc, 3,000%, scadenza 22/07/2028	335	0,07		
1.800	HSBC Holdings Plc, 6,161%, scadenza 09/03/2029	1.813	0,38		
EUR 1.000	Lloyds Banking Group Plc, 0,500%, scadenza 12/11/2025 *	1.036	0,22		
EUR 890	Lloyds Banking Group Plc, 3,500%, scadenza 01/04/2026 *	951	0,20		
EUR 3.000	Lloyds Banking Group Plc, 3,125%, scadenza 24/08/2030 *	3.015	0,64		
EUR 200	London Stock Exchange Group Plc, 0,875%, scadenza 19/09/2024	210	0,04		
EUR 690	London Stock Exchange Group Plc, 1,750%, scadenza 06/12/2027	697	0,15		
GBP 1.250	London Stock Exchange Group Plc, 1,625%, scadenza 06/04/2030	1.265	0,27		
EUR 1.560	Motability Operations Group Plc, 0,125%, scadenza 20/07/2028	1.424	0,30		
GBP 990	Nationwide Building Society, 6,178%, scadenza 07/12/2027 *	1.237	0,26		
GBP 1.590	Nationwide Building Society, 6,125%, scadenza 21/08/2028	2.024	0,43		
EUR 4.750	NatWest Markets Plc, 1,375%, scadenza 02/03/2027	4.691	0,99		
GBP 1.270	NatWest Markets Plc, 6,375%, scadenza 08/11/2027	1.615	0,34		

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto			
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)								
Regno Unito — (segue)								
EUR 1.340	Segro Capital Sarl, 1,250%, scadenza 23/03/2026	1.348	0,28	EUR 1.600	NVIDIA Corp, 2,850%, scadenza 01/04/2030	1.437	0,30	
EUR 2.200	Segro Capital Sarl, 0,500%, scadenza 22/09/2031	1.772	0,37	EUR 310	PepsiCo Inc, 0,750%, scadenza 18/03/2027	307	0,06	
580	Standard Chartered Plc, 144A, 1,214%, scadenza 23/03/2025 *	565	0,12	EUR 3.000	PepsiCo Inc, 0,500%, scadenza 06/05/2028	2.862	0,60	
850	Unilever Capital Corp, 3,250%, scadenza 07/03/2024	840	0,18	GBP 1.260	PepsiCo Inc, 3,200%, scadenza 22/07/2029	1.437	0,30	
EUR 480	Unilever Finance Netherlands BV, 1,250%, scadenza 25/03/2025	502	0,11	8.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,650%, scadenza 19/05/2030	7.878	1,66	
EUR 550	Unilever Finance Netherlands BV, 1,125%, scadenza 12/02/2027	553	0,12	EUR 1.250	Procter & Gamble Co/The, 0,625%, scadenza 30/10/2024	1.308	0,28	
EUR 2.000	Unilever Finance Netherlands BV, 3,250%, scadenza 23/02/2031	2.142	0,45	EUR 350	Prologis Euro Finance LLC, 1,875%, scadenza 05/01/2029	336	0,07	
EUR 810	Wellcome Trust Ltd/The, 1,125%, scadenza 21/01/2027	808	0,17	EUR 2.200	Prologis Euro Finance LLC, 1,000%, scadenza 08/02/2029	2.006	0,42	
		47.353	9,99	EUR 2.600	Public Storage Operating Co, 0,500%, scadenza 09/09/2030	2.195	0,46	
				EUR 3.500	Roche Finance Europe BV, 3,204%, scadenza 27/08/2029	3.800	0,80	
				EUR 4.200	Roche Holdings Inc, 144A, 1,930%, scadenza 13/12/2028	3.636	0,77	
				EUR 400	Sanofi, 1,000%, scadenza 01/04/2025	417	0,09	
				EUR 1.040	Sanofi, 3,625%, scadenza 19/06/2028	1.005	0,21	
				EUR 4.900	Sanofi, 1,250%, scadenza 06/04/2029	4.778	1,04	
				EUR 2.400	Schneider Electric SE, 3,125%, scadenza 13/10/2029	2.557	0,51	
				560	Texas Instruments Inc, 1,375%, scadenza 12/03/2025	529	0,11	
				1.150	Texas Instruments Inc, 2,900%, scadenza 03/11/2027	1.071	0,23	
				3.850	Texas Instruments Inc, 4,600%, scadenza 15/02/2028	3.833	0,81	
				1.630	TJX Cos Inc/The, 1,600%, scadenza 15/05/2031	1.311	0,28	
				GBP 1.340	Toyota Motor Credit Corp, 0,750%, scadenza 19/11/2026	1.467	0,31	
				EUR 5.320	Union Pacific Corp, 4,750%, scadenza 21/02/2026	5.296	1,12	
				EUR 2.000	United Parcel Service Inc, 1,625%, scadenza 15/11/2025	2.078	0,44	
				EUR 2.800	UnitedHealth Group Inc, 5,350%, scadenza 15/02/2033	2.875	0,61	
				540	Visa Inc, 3,150%, scadenza 14/12/2025	518	0,11	
				4.000	Visa Inc, 1,900%, scadenza 15/04/2027	3.627	0,76	
				251	Walmart Inc, 2,375%, scadenza 24/09/2029	224	0,05	
						197.365	41,62	
						Totale Obbligazioni ed effetti societari (Costo 459.4275)	425.306	89,69
						Obbligazioni ed effetti governativi — 7,37% (28 febbraio 2023: 14,70%)		
						Canada — 1,08% (28 febbraio 2023: 0,94%)		
				GBP 1.200	CPPIB Capital Inc, 0,875%, scadenza 17/12/2024	1.430	0,30	
				GBP 3.000	CPPIB Capital Inc, 4,375%, scadenza 02/03/2026	3.711	0,78	
						5.141	1,08	
						Paesi Bassi — 2,31% (28 febbraio 2023: 2,02%)		
				GBP 8.800	Nederlandse Waterschapsbank NV, 4,500%, scadenza 18/06/2025	10.936	2,31	
						Corea del Sud — 0,15% (28 febbraio 2023: 0,13%)		
				EUR 660	Korea Development Bank/The, 0,000%, scadenza 10/07/2024	692	0,15	
						Svezia — 1,59% (28 febbraio 2023: 1,40%)		
				GBP 6.100	Svensk Exportkredit AB, 4,500%, scadenza 11/03/2026	7.547	1,59	
						Stati Uniti — 2,24% (28 febbraio 2023: 10,21%)		
				11.180	United States Treasury Note/Bond, 1,000%, scadenza 15/12/2024	10.600	2,24	
						Totale Obbligazioni ed effetti governativi (Costo 34.5555)	34.916	7,37
						Organismi di investimento collettivo — 0,83% (28 febbraio 2023: 3,25%)		
				3.957	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	3.957	0,83	
						Totale Organismi di investimento collettivo (Costo 3.9575)	3.957	0,83
						Totale Investimenti al valore equo rilevato a conto economico (Costo 497.9395)	464.179	97,89
						Contratti a termine in valuta estera — 0,52% (28 febbraio 2023: 0,71%)		
						Apprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	2.481	0,52
						Futures — 0,15% (28 febbraio 2023: 0,92%)		
						Apprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	718	0,15
						Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	467.378	98,56
						Credit Default Swap — (0,07%) (28 febbraio 2023: 0,00%)		
						Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(326)	(0,07)
						Contratti a termine in valuta estera — (0,68%) (28 febbraio 2023: (0,62%))		
						Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(3.247)	(0,68)
						Futures — (0,15%) (28 febbraio 2023: (0,01%))		
						Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(705)	(0,15)
						Totale Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(4.278)	(0,90)
						Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	463.100	97,66
						Altre attività eccedenti le passività	11.108	2,34
						Patrimonio in gestione	474.208\$	100,00
						– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.		
				144A	Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 14.370.000\$, ovvero allo 3,03% dell'attivo netto.			
				*	Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.			

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

ABBREVIAZIONI:

EUR	– Euro
GBP	– Sterlina britannica

% delle
Attività
totali

Analisi delle attività totali

Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	95,59
Organismi di investimento collettivo	0,82
Strumenti finanziari derivati	0,66
Altre attività	2,93
Totale Attività	100,00

Prospetto dei Credit default swap

Controparte	Entità di riferimento – Protezione acquisto/vendita	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000% – Acquisto	20-giu-2028	23.140	\$ (326)
Apprezamento non realizzato di Credit default swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 213\$)				\$ –
Deprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				(326)
Ammortamento netto dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 213\$)				\$ (326)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta di acquisto (in migliaia)		Valuta di vendita (in migliaia)		Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)		
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	56	Vendita	EUR	51	\$ -
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	141	Vendita	GBP	111	1
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	130	Vendita	USD	12	-
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	42	Vendita	USD	54	-
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	55	Vendita	USD	60	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1.077	Vendita	EUR	995	(4)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	28.831	Vendita	EUR	26.487	87
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	578	Vendita	GBP	458	(2)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	2.050	Vendita	GBP	1.613	10
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	165	Vendita	SEK	1.819	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	100	Vendita	SEK	1.077	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	16	Vendita	USD	17	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	14.578	Vendita	USD	9.531	(80)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CHF	4.000	Vendita	USD	4.580	(45)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	88.023	Vendita	USD	96.841	(1.320)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	1.165	Vendita	USD	1.472	5
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	214.727	Vendita	USD	273.454	(1.422)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	121	Vendita	USD	11	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	131.492	Vendita	USD	12.329	(310)
16-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD	8.148	Vendita	EUR	7.411	82
16-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD	19.786	Vendita	GBP	15.572	57
16-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto	GBP	743	Vendita	USD	945	(3)
16-nov-2023	Citi	Acquisto	USD	34.253	Vendita	EUR	31.171	325
16-nov-2023	Citi	Acquisto	USD	11.668	Vendita	GBP	9.184	32
16-nov-2023	Citi	Acquisto	EUR	602	Vendita	USD	666	(11)
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	34.018	Vendita	EUR	30.951	329
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	6.415	Vendita	GBP	5.048	19
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	568	Vendita	JPY	79.998	11
16-nov-2023	HSBC	Acquisto	USD	29.035	Vendita	EUR	26.419	279
16-nov-2023	HSBC	Acquisto	USD	543	Vendita	EUR	500	(2)
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	38.225	Vendita	EUR	34.772	377
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	10.441	Vendita	GBP	8.220	27
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	EUR	9.000	Vendita	USD	9.818	(22)
16-nov-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	34.696	Vendita	EUR	31.568	336
16-nov-2023	Morgan Stanley	Acquisto	EUR	2.000	Vendita	USD	2.180	(3)
16-nov-2023	Royal Bank of Canada	Acquisto	USD	16.646	Vendita	GBP	13.106	40
16-nov-2023	UBS	Acquisto	USD	37.727	Vendita	EUR	34.331	359
16-nov-2023	UBS	Acquisto	USD	42.615	Vendita	GBP	33.552	105
16-nov-2023	UBS	Acquisto	EUR	5.032	Vendita	USD	5.500	(23)
Apprezamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 3.707\$)							\$	2.481
Deprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (3.219)\$)								(3.247)
Deprezzamento netto dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 488\$)							\$	(766)

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
Euro-Bobl dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(631)	\$ (80.376)	\$ (469)
Euro-Bund dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(174)	(25.024)	(229)
Japan 10 Year Bond (OSE) settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(12)	(12.110)	91
Long Gilt dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	99	11.986	215
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	354	39.305	412
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(10)	(1.069)	(7)
Apprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 4.839\$)				\$ 718
Deprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (61)\$)				(705)
Apprezzamento netto di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 4.778\$)				\$ 13

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Titoli garantiti da ipoteca — 16,05% (28 febbraio 2023: 10,40%)					
1.000 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 4,000% ±	923	0,60	17 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000%, scadenza 15/09/2042	16	0,01
500 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 4,500% ±	474	0,31	10 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000%, scadenza 15/09/2042	9	0,01
600 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 5,000% ±	582	0,38	43 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000%, scadenza 15/10/2042	39	0,03
200 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 1,500% ±	151	0,10	29 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000%, scadenza 15/10/2042	26	0,02
2.200 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 2,000% ±	1.752	1,13	25 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000%, scadenza 15/11/2042	22	0,01
3.300 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 2,500% ±	2.734	1,77	17 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500%, scadenza 20/10/2049	15	0,01
2.600 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 3,000% ±	2.241	1,45	75 Ginnie Mae II Pool '785218', 2,000%, scadenza 20/12/2050	62	0,04
1.100 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 3,500% ±	983	0,64	148 Ginnie Mae II Pool '785219', 2,000%, scadenza 20/12/2050	121	0,08
1.600 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 5,000% ±	1.580	1,02	79 Ginnie Mae II Pool '785220', 2,000%, scadenza 20/12/2050	65	0,04
200 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 6,000% ±	201	0,13	152 Ginnie Mae II Pool '785221', 2,000%, scadenza 20/12/2050	125	0,08
100 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 6,500% ±	102	0,07	72 Ginnie Mae II Pool 'BS8546', 2,500%, scadenza 20/12/2050	60	0,04
3 Fannie Mae Pool '255984', 4,500%, scadenza 01/11/2025	3	—	79 Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500%, scadenza 20/12/2050	68	0,04
53 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500%, scadenza 01/01/2043	49	0,03	93 Ginnie Mae II Pool 'BZ4350', 2,500%, scadenza 20/03/2051	78	0,05
69 Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000%, scadenza 01/05/2045	66	0,04	76 Ginnie Mae II Pool 'CD8312', 2,500%, scadenza 20/05/2051	64	0,04
19 Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930%, scadenza 01/06/2030	17	0,01	129 Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500%, scadenza 20/06/2044	120	0,08
22 Fannie Mae Pool 'AS4271', 4,500%, scadenza 01/01/2045	21	0,01	14 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500%, scadenza 20/04/2046	13	0,01
50 Fannie Mae Pool 'AS8951', 3,500%, scadenza 01/03/2047	45	0,03	14 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500%, scadenza 20/06/2046	13	0,01
17 Fannie Mae Pool 'AS9760', 4,500%, scadenza 01/06/2047	16	0,01	18 Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000%, scadenza 20/11/2046	16	0,01
299 Fannie Mae Pool 'AX0756', 3,500%, scadenza 01/07/2044	276	0,18	13 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000%, scadenza 20/06/2047	12	0,01
31 Fannie Mae Pool 'BC9077', 3,500%, scadenza 01/12/2046	28	0,02	4 Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000%, scadenza 20/11/2047	3	—
96 Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000%, scadenza 01/12/2037	87	0,06	14 Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000%, scadenza 20/11/2047	14	0,01
97 Fannie Mae Pool 'BK7700', 4,500%, scadenza 01/10/2048	94	0,06	50 Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500%, scadenza 20/02/2048	46	0,03
36 Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500%, scadenza 01/12/2046	33	0,02	11 Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000%, scadenza 20/04/2048	10	0,01
20 Fannie Mae Pool 'BM6898', 2,149%, scadenza 01/02/2032 *	16	0,01	57 Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500%, scadenza 20/05/2048	55	0,04
26 Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500%, scadenza 01/11/2048	25	0,02	20 Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500%, scadenza 20/06/2048	19	0,01
33 Fannie Mae Pool 'BP1585', 3,500%, scadenza 01/01/2050	30	0,02	28 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500%, scadenza 20/07/2048	27	0,02
71 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000%, scadenza 01/02/2051	59	0,04	10 Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500%, scadenza 20/09/2048	9	0,01
76 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000%, scadenza 01/02/2051	62	0,04	40 Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500%, scadenza 20/10/2048	38	0,02
83 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000%, scadenza 01/03/2051	67	0,04	25 Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500%, scadenza 20/01/2049	24	0,02
82 Fannie Mae Pool 'BT5574', 2,500%, scadenza 01/08/2051	68	0,04	72 Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500%, scadenza 20/04/2051	61	0,04
258 Fannie Mae Pool 'BU1030', 2,000%, scadenza 01/11/2051	208	0,13	236 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000%, scadenza 20/09/2051	208	0,13
46 Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500%, scadenza 01/07/2048	44	0,03	86 Ginnie Mae II Pool 'MA7705', 2,500%, scadenza 20/11/2051	73	0,05
92 Fannie Mae Pool 'CA2199', 4,500%, scadenza 01/08/2048	88	0,06	77 Ginnie Mae II Pool 'MA7828', 3,000%, scadenza 20/01/2052	77	0,05
43 Fannie Mae Pool 'CA2482', 4,500%, scadenza 01/10/2048	41	0,03	92 Ginnie Mae II Pool 'MA8197', 2,500%, scadenza 20/08/2052	78	0,05
270 Fannie Mae Pool 'CA6672', 2,000%, scadenza 01/07/2050	217	0,14	284 Ginnie Mae II Pool 'MA8486', 3,000%, scadenza 20/12/2052	251	0,16
25 Fannie Mae Pool 'FM1193', 3,500%, scadenza 01/06/2049	22	0,01	192 Ginnie Mae II Pool 'MA8642', 2,500%, scadenza 20/02/2053	164	0,11
125 Fannie Mae Pool 'FM1578', 3,500%, scadenza 01/09/2034	119	0,08	500 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500% ±	425	0,28
76 Fannie Mae Pool 'FM1579', 3,500%, scadenza 01/10/2034	72	0,05	1.200 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 3,000% ±	1.055	0,68
145 Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000%, scadenza 01/09/2049	143	0,09	400 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 3,500% ±	363	0,24
70 Fannie Mae Pool 'FM3215', 3,500%, scadenza 01/01/2049	63	0,04	600 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 4,000% ±	559	0,36
46 Fannie Mae Pool 'FM4737', 3,500%, scadenza 01/09/2050	42	0,03	600 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 4,500% ±	572	0,37
264 Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000%, scadenza 01/01/2049	248	0,16	800 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,000% ±	779	0,50
81 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500%, scadenza 01/07/2051	68	0,04	500 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,500% ±	495	0,32
84 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500%, scadenza 01/07/2051	71	0,05	200 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 6,000% ±	201	0,13
82 Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500%, scadenza 01/10/2051	69	0,04	100 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 6,500% ±	101	0,07
608 Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000%, scadenza 01/07/2051	487	0,32	97 Government National Mortgage Association, Serie 2022 3, Classe IO, 0,640%, scadenza 16/02/2061 *	5	—
178 Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000%, scadenza 01/01/2052	154	0,10	Totale Titoli garantiti da ipoteca (Costo 25.9455)	24.785	16,05
88 Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500%, scadenza 01/01/2052	74	0,05	Obbligazioni ed effetti societari — 26,29% (28 febbraio 2023: 28,56%)		
91 Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000%, scadenza 01/02/2052	79	0,05	Belgio — 0,23% (28 febbraio 2023: 0,24%)		
90 Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500%, scadenza 01/02/2052	76	0,05	260 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900%, scadenza 01/02/2046	242	0,16
90 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500%, scadenza 01/06/2049	82	0,05	110 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350%, scadenza 01/06/2040	98	0,06
95 Fannie Mae Pool 'FS3836', 4,500%, scadenza 01/01/2053	90	0,06	15 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600%, scadenza 15/04/2048	14	0,01
95 Fannie Mae Pool 'FS4454', 6,000%, scadenza 01/04/2053	96	0,06		354	0,23
294 Fannie Mae Pool 'FS5059', 3,500%, scadenza 01/11/2048	268	0,17	Brasile — 0,63% (28 febbraio 2023: 0,66%)		
73 Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000%, scadenza 01/10/2050	58	0,04	230 Petrobras Global Finance BV, 5,750%, scadenza 01/02/2029	225	0,15
60 Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000%, scadenza 01/04/2038	54	0,03	940 Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125%, scadenza 15/01/2032	743	0,48
20 Freddie Mac Gold Pool 'G67721', 4,500%, scadenza 01/04/2049	20	0,01		968	0,63
18 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,104%, scadenza 01/03/2047 *	17	0,01	Canada — 1,06% (28 febbraio 2023: 1,09%)		
40 Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500%, scadenza 01/02/2050	36	0,02	130 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875%, scadenza 15/01/2028	118	0,07
69 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000%, scadenza 01/02/2051	56	0,04	130 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500%, scadenza 15/02/2029	114	0,07
172 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500%, scadenza 01/08/2051	144	0,09	EUR 750 Bank of Montreal, 2,750%, scadenza 15/06/2027	783	0,51
80 Freddie Mac Pool 'QC6768', 3,000%, scadenza 01/09/2051	69	0,04	GBP 540 Royal Bank of Canada, 3,625%, scadenza 14/06/2027	629	0,41
90 Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500%, scadenza 01/02/2052	75	0,05		1.644	1,06
35 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500%, scadenza 01/10/2041	28	0,02	Cina — 0,01% (28 febbraio 2023: 0,01%)		
71 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000%, scadenza 01/04/2051	58	0,04	20 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700%, scadenza 01/05/2025	19	0,01
88 Freddie Mac Pool 'SD0615', 4,500%, scadenza 01/01/2051	85	0,05	Danimarca — 0,51% (28 febbraio 2023: 0,54%)		
82 Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500%, scadenza 01/07/2051	69	0,04	840 Danske Bank A/S, 144A, 4,298%, scadenza 01/04/2028 *	791	0,51
175 Freddie Mac Pool 'SD0809', 3,000%, scadenza 01/01/2052	152	0,10	Francia — 1,12% (28 febbraio 2023: 0,92%)		
344 Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000%, scadenza 01/07/2049	322	0,21	200 BNP Paribas SA, 144A, 2,219%, scadenza 09/06/2026 *	187	0,12
187 Freddie Mac Pool 'SD2384', 6,500%, scadenza 01/02/2053	191	0,12	GBP 300 BNP Paribas SA, 1,875%, scadenza 14/12/2027	318	0,21
97 Freddie Mac Pool 'SD2578', 6,000%, scadenza 01/03/2053	97	0,06			
174 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500%, scadenza 01/11/2051	146	0,09			
150 Freddie Mac Pool 'SD8146', 2,000%, scadenza 01/05/2051	120	0,08			
62 Freddie Mac Pool 'ZA6680', 4,000%, scadenza 01/04/2049	58	0,04			
60 Freddie Mac Pool 'ZS3204', 5,000%, scadenza 01/06/2041	59	0,04			
117 Freddie Mac Pool 'ZS3940', 4,500%, scadenza 01/06/2038	114	0,07			
34 Freddie Mac Pool 'ZS4720', 4,500%, scadenza 01/05/2047	33	0,02			
49 Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000%, scadenza 15/09/2042	44	0,03			
341 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500%, scadenza 15/06/2048	318	0,21			

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Francia — (segue)					
EUR 1.000	BNP Paribas SA, 0,500%, scadenza 30/05/2028 *	946	0,61	610	Bank of America Corp, 5,015%, scadenza 22/07/2033 *
210	BNP Paribas SA, 144A, 2,824%, scadenza 26/01/2041	137	0,09	27	Becton Dickinson & Co, 3,734%, scadenza 15/12/2024
200	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750%, scadenza 17/09/2044	136	0,09	220	BP Capital Markets America Inc, 3,633%, scadenza 06/04/2030
		1.724	1,12	130	Broadcom Inc, 144A, 3,137%, scadenza 15/11/2035
Germania — 0,53% (28 febbraio 2023: 1,15%)					
GBP 250	E.ON International Finance BV, 5,625%, scadenza 06/12/2023	316	0,21	330	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250%, scadenza 15/01/2034
EUR 500	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG di Muenchen, 3,250%, scadenza 26/05/2049 *	500	0,32	130	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908%, scadenza 23/07/2025
		816	0,53	60	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200%, scadenza 15/03/2028
Israele — 0,58% (28 febbraio 2023: 0,58%)					
30	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, scadenza 01/10/2026	27	0,02	290	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050%, scadenza 30/03/2029
200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,750%, scadenza 01/03/2028	200	0,13	140	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750%, scadenza 01/04/2048
720	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125%, scadenza 09/05/2029	667	0,43	110	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,250%, scadenza 01/04/2053
		894	0,58	110	Cheniere Energy Partners LP, 3,250%, scadenza 31/01/2032
Italia — 0,74% (28 febbraio 2023: 0,74%)					
EUR 1.100	UniCredit SpA, 1,200%, scadenza 20/01/2026 *	1.139	0,74	420	Cigna Group/The, 4,375%, scadenza 15/10/2028
Lussemburgo — 0,58% (28 febbraio 2023: 0,42%)					
330	Altice Financing SA, 144A, 5,750%, scadenza 15/08/2029	262	0,17	230	Cigna Group/The, 3,200%, scadenza 15/03/2040
EUR 620	Logicor Financing Sarl, 1,625%, scadenza 15/07/2027	565	0,36	130	Cigna Group/The, 4,900%, scadenza 15/12/2048
EUR 100	Logicor Financing Sarl, 2,000%, scadenza 17/01/2034	71	0,05	290	Citigroup Inc, 1,750%, scadenza 28/01/2025
		898	0,58	120	Citigroup Inc, 5,500%, scadenza 13/09/2025
Macao — 0,11% (28 febbraio 2023: 0,12%)					
200	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625%, scadenza 26/08/2028	177	0,11	120	Citigroup Inc, 4,600%, scadenza 09/03/2026
Paesi Bassi — 0,81% (28 febbraio 2023: 0,97%)					
EUR 900	ING Groep NV, 2,500%, scadenza 15/02/2029 *	962	0,62	350	Citigroup Inc, 4,300%, scadenza 20/11/2026
80	Shell International Finance BV, 2,750%, scadenza 06/04/2030	70	0,05	260	Citigroup Inc, 4,450%, scadenza 29/09/2027
200	Shell International Finance BV, 4,375%, scadenza 11/05/2045	174	0,11	230	Citigroup Inc, 3,785%, scadenza 17/03/2033 *
60	Shell International Finance BV, 3,250%, scadenza 06/04/2050	43	0,03	93	Citigroup Inc, 5,300%, scadenza 06/05/2044
		1.249	0,81	85	Citigroup Inc, 4,650%, scadenza 30/07/2045
Spagna — 0,28% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
EUR 500	Cellnex Finance Co SA, 2,000%, scadenza 15/09/2032	432	0,28	120	Comcast Corp, 4,000%, scadenza 01/03/2048
Svizzera — 1,43% (28 febbraio 2023: 1,41%)					
EUR 1.470	UBS Group AG, 1,500%, scadenza 30/11/2024	1.577	1,02	60	Comcast Corp, 3,999%, scadenza 01/11/2049
EUR 290	UBS Group AG, 3,250%, scadenza 02/04/2026 *	308	0,20	360	Comcast Corp, 2,887%, scadenza 01/11/2051
EUR 100	UBS Group AG, 1,000%, scadenza 24/06/2027 *	98	0,06	51	Comcast Corp, 4,049%, scadenza 01/11/2052
250	UBS Group AG, 144A, 4,194%, scadenza 01/04/2031 *	225	0,15	57	Comcast Corp, 2,987%, scadenza 01/11/2063
		2.208	1,43	200	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500%, scadenza 01/02/2029
Emirati Arabi Uniti — 0,48% (28 febbraio 2023: 0,50%)					
530	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 2,625%, scadenza 31/03/2036	420	0,27	360	CSC Holdings LLC, 144A, 4,500%, scadenza 15/11/2031
EUR 400	MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000%, scadenza 10/03/2034	320	0,21	180	CVS Health Corp, 3,750%, scadenza 01/04/2030
		740	0,48	200	CVS Health Corp, 2,700%, scadenza 21/08/2040
Regno Unito — 2,51% (28 febbraio 2023: 2,96%)					
GBP 670	Aviva Plc, 6,125%, scadenza 14/11/2036 *	840	0,54	390	CVS Health Corp, 5,050%, scadenza 25/03/2048
GBP 100	Aviva Plc, 5,125%, scadenza 04/06/2050 *	112	0,07	40	Diamondback Energy Inc, 3,500%, scadenza 01/12/2029
565	HSBC Holdings Plc, 4,250%, scadenza 18/08/2025	545	0,35	120	DISH DBS Corp, 5,875%, scadenza 15/11/2024
EUR 550	HSBC Holdings Plc, 3,019%, scadenza 15/06/2027	575	0,37	60	DISH DBS Corp, 144A, 5,750%, scadenza 01/12/2028
GBP 1.000	Lloyds Bank Plc, 7,625%, scadenza 22/04/2025	1.291	0,84	170	DISH DBS Corp, 5,125%, scadenza 01/06/2029
EUR 140	Segro Capital Sarl, 1,875%, scadenza 23/03/2030	131	0,09	180	Enterprise Products Operating LLC, 2,800%, scadenza 31/01/2030
460	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750%, scadenza 15/07/2031	385	0,25	330	Enterprise Products Operating LLC, 5,100%, scadenza 15/02/2045
		3.879	2,51	6	EQT Corp, 6,125%, scadenza 01/02/2025
Stati Uniti — 14,68% (28 febbraio 2023: 15,12%)					
EUR 100	3M Co, 3,700%, scadenza 15/04/2050	77	0,05	10	Exelon Corp, 5,625%, scadenza 15/06/2035
EUR 120	AbbVie Inc, 1,500%, scadenza 15/11/2023	129	0,08	100	Exxon Mobil Corp, 3,452%, scadenza 15/04/2051
100	AbbVie Inc, 3,800%, scadenza 15/03/2025	97	0,06	310	Ford Motor Co, 3,250%, scadenza 12/02/2032
80	AbbVie Inc, 3,200%, scadenza 21/11/2029	72	0,05	520	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000%, scadenza 13/11/2030
120	AbbVie Inc, 4,875%, scadenza 14/11/2048	111	0,07	20	Freemont-McMoRan Inc, 5,450%, scadenza 15/03/2043
320	AbbVie Inc, 4,250%, scadenza 21/11/2049	270	0,17	70	General Motors Co, 6,600%, scadenza 01/04/2036
80	Amazon.com Inc, 4,250%, scadenza 22/08/2057	69	0,04	10	General Motors Co, 5,200%, scadenza 01/04/2045
40	American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650%, scadenza 15/01/2032	33	0,02	70	General Motors Co, 6,750%, scadenza 01/04/2046
150	AT&T Inc, 2,250%, scadenza 01/02/2032	117	0,08	150	Gilead Sciences Inc, 4,800%, scadenza 01/04/2044
184	AT&T Inc, 4,500%, scadenza 09/03/2048	147	0,10	30	Gilead Sciences Inc, 4,750%, scadenza 01/03/2046
34	AT&T Inc, 3,650%, scadenza 15/09/2059	22	0,01	110	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500%, scadenza 01/04/2025
580	Ball Corp, 3,125%, scadenza 15/09/2031	470	0,30	620	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750%, scadenza 01/10/2037
160	Bank of America Corp, 4,250%, scadenza 22/10/2026	154	0,10	300	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250%, scadenza 01/02/2041
945	Bank of America Corp, 2,592%, scadenza 29/04/2031 *	787	0,51	280	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150%, scadenza 22/05/2045
				280	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875%, scadenza 15/12/2028
				140	Haleon Netherlands Capital BV, 1,750%, scadenza 29/03/2030
				231	Haleon US Capital LLC, 3,625%, scadenza 24/03/2032
				340	HCA Inc, 5,000%, scadenza 15/03/2024
				380	HCA Inc, 5,250%, scadenza 15/06/2026
				200	HCA Inc, 4,500%, scadenza 15/02/2027
				130	Home Depot Inc/The, 3,300%, scadenza 15/04/2040
				70	Home Depot Inc/The, 3,350%, scadenza 15/04/2050
				230	Home Depot Inc/The, 4,950%, scadenza 15/09/2052
				16	Humana Inc, 2,150%, scadenza 03/02/2032
				430	Humana Inc, 5,875%, scadenza 01/03/2033
				70	JPMorgan Chase & Co, 4,125%, scadenza 15/12/2026
				1.080	JPMorgan Chase & Co, 2,522%, scadenza 22/04/2031
				440	JPMorgan Chase & Co, 2,956%, scadenza 13/05/2031
				280	JPMorgan Chase & Co, 5,717%, scadenza 14/09/2033 *
				23	McDonald's Corp, 3,625%, scadenza 01/09/2049
				110	McDonald's Corp, 4,200%, scadenza 01/04/2050
				29	Medtronic Inc, 4,625%, scadenza 15/03/2045

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Stati Uniti — (segue)					
	40	0,03	EUR 1.070		
40 MetLife Inc, 6,400%, scadenza 15/12/2036			Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700%, scadenza 15/08/2032	1.095	0,71
10 Morgan Stanley, 4,431%, scadenza 23/01/2030 *	10	0,01	EUR 1.110		
760 Morgan Stanley, 3,622%, scadenza 01/04/2031 *	676	0,44	German Treasury Bill, zero coupon, scadenza 19/06/2024	1.169	0,76
290 Morgan Stanley, 6,342%, scadenza 18/10/2033 *	304	0,20		13.380	8,66
EUR 850 Netflix Inc, 3,625%, scadenza 15/06/2030	893	0,58	Indonesia — 1,16% (28 febbraio 2023: 1,19%)		
70 NVIDIA Corp, 3,500%, scadenza 01/04/2050	55	0,04	IDR 23.602.000		
EUR 380 Prologis Euro Finance LLC, 0,500%, scadenza 16/02/2032	301	0,19	Indonesia Treasury Bond, Series FR79, 8,375%, scadenza 15/04/2039	1.793	1,16
EUR 271 Prologis Euro Finance LLC, 1,500%, scadenza 08/02/2034	218	0,14	Italia — 1,12% (28 febbraio 2023: 0,99%)		
180 Southwestern Energy Co, 4,750%, scadenza 01/02/2032	160	0,10	EUR 1.910		
10 Sprint Capital Corp, 8,750%, scadenza 15/03/2032	12	0,01	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 31Y, 144A, 3,250%, scadenza 01/09/2046	1.730	1,12
4 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850%, scadenza 16/12/2039	4	-	Giappone — 1,67% (28 febbraio 2023: 5,86%)		
90 Texas Instruments Inc, 1,750%, scadenza 04/05/2030	75	0,05	JPY 14.850		
100 Time Warner Cable LLC, 7,300%, scadenza 01/07/2038	101	0,07	Japan Government Thirty Year Bond, Serie 59, 0,700%, scadenza 20/06/2048	85	0,05
40 Time Warner Cable LLC, 6,750%, scadenza 15/06/2039	39	0,02	JPY 485.000		
30 T-Mobile USA Inc, 2,250%, scadenza 15/02/2026	28	0,02	Ἐπικρατὶς Ἰσπανίας Ἐθνικὰ Ὑποχρεωτικὰ Ὑποβληθέντα 20/03/2050	2.500	1,62
90 T-Mobile USA Inc, 2,625%, scadenza 15/02/2029	78	0,05		2.585	1,67
240 T-Mobile USA Inc, 3,875%, scadenza 15/04/2030	219	0,14	Messico — 3,82% (28 febbraio 2023: 4,03%)		
60 T-Mobile USA Inc, 2,875%, scadenza 15/02/2031	51	0,03	MXN 77.520		
100 T-Mobile USA Inc, 3,500%, scadenza 15/04/2031	87	0,06	EUR 360		
150 T-Mobile USA Inc, 2,700%, scadenza 15/03/2032	122	0,08	Mexico Bonos, Series M, 7,750%, scadenza 13/11/2042	3.885	2,51
140 T-Mobile USA Inc, 3,000%, scadenza 15/02/2041	99	0,06	EUR 360		
50 United Rentals North America Inc, 5,250%, scadenza 15/01/2030	48	0,03	Mexico Government International Bond, 2,875%, scadenza 08/04/2039	287	0,19
80 United Rentals North America Inc, 4,000%, scadenza 15/07/2030	70	0,05	830		
320 United Rentals North America Inc, 3,875%, scadenza 15/02/2031	274	0,18	Mexico Government International Bond, 5,550%, scadenza 21/01/2045	777	0,50
70 United Rentals North America Inc, 3,750%, scadenza 15/01/2032	59	0,04	1.180		
440 UnitedHealth Group Inc, 5,350%, scadenza 15/02/2033	452	0,29	Mexico Government International Bond, 4,600%, scadenza 23/01/2046	958	0,62
380 Verizon Communications Inc, 2,355%, scadenza 15/03/2032	301	0,19		5.907	3,82
190 Verizon Communications Inc, 4,500%, scadenza 10/08/2033	176	0,11	Paesi Bassi — 0,52% (28 febbraio 2023: 0,51%)		
50 Verizon Communications Inc, 5,250%, scadenza 16/03/2037	49	0,03	EUR 970		
10 Verizon Communications Inc, 4,862%, scadenza 21/08/2046	9	0,01	BNG Bank NV, 0,010%, scadenza 05/10/2032	796	0,52
10 Verizon Communications Inc, 5,500%, scadenza 16/03/2047	10	0,01	Polonia — 1,35% (28 febbraio 2023: 1,32%)		
90 Visa Inc, 2,700%, scadenza 15/04/2040	67	0,04	PLN 11.570		
340 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000%, scadenza 15/02/2028	316	0,20	Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750%, scadenza 25/04/2032	2.088	1,35
180 Warnermedia Holdings Inc, 5,141%, scadenza 15/03/2052	144	0,09	Sudafrica — 1,35% (28 febbraio 2023: 1,55%)		
220 Warnermedia Holdings Inc, 5,391%, scadenza 15/03/2062	175	0,11	ZAR 66.492		
840 Wells Fargo & Co, 4,897%, scadenza 25/07/2033 *	791	0,51	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 6,500%, scadenza 28/02/2041	2.078	1,35
810 Wells Fargo & Co, 5,013%, scadenza 04/04/2051 *	732	0,47	Corea del Sud — 1,18% (28 febbraio 2023: 1,23%)		
	22.683	14,68	KRW 2.533.840		
Totale Obbligazioni ed effetti societari (Costo 45.623\$)	40.615	26,29	Korea Treasury Bond, Serie 2606, 1,875%, scadenza 10/06/2026	1.825	1,18
Obbligazioni ed effetti governativi — 55,60% (28 febbraio 2023: 53,61%)					
Belgio — 0,49% (28 febbraio 2023: 0,56%)					
EUR 670			Spagna — 0,71% (28 febbraio 2023: 1,44%)		
Kingdom of Belgium Government Bond, Serie 71, 3,750%, scadenza 22/06/2045	762	0,49	EUR 500		
Brasile — 1,69% (28 febbraio 2023: 1,50%)					
BRL 1.000			Spain Government Bond, 144A, 5,150%, scadenza 31/10/2044	638	0,42
Brasile Notas do Tesouro Nacional Serie B, Serie NTNBF, 6,000%, scadenza 15/05/2035 β	880	0,57	EUR 520		
BRL 9.000			Spain Government Bond, Serie 30Y, 144A, 2,700%, scadenza 31/10/2048	453	0,29
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNBF, 10,000%, scadenza 01/01/2031	1.732	1,12		1.091	0,71
	2.612	1,69	Emirati Arabi Uniti — 0,46% (28 febbraio 2023: 0,50%)		
Canada — 2,39% (28 febbraio 2023: 1,63%)					
CAD 1.640			890 Abu Dhabi Government International Bond, 3,875%, scadenza 16/04/2050		
Canadian Government Bond, 2,250%, scadenza 01/06/2025	1.165	0,75	Regno Unito — 5,33% (28 febbraio 2023: 5,56%)		
CAD 1.900			GBP 4.290		
Canadian Government Bond, 2,750%, scadenza 01/06/2033	1.313	0,85	United Kingdom Gilt, 4,250%, scadenza 07/06/2032	5.429	3,51
CAD 1.030			GBP 100		
Province of Ontario Canada, 3,450%, scadenza 02/06/2045	656	0,43	United Kingdom Gilt, 3,750%, scadenza 29/01/2038	116	0,08
CAD 860			GBP 1.290		
Province of Quebec Canada, 3,500%, scadenza 01/12/2045	552	0,36	United Kingdom Gilt, 4,250%, scadenza 07/12/2040	1.565	1,01
	3.686	2,39	GBP 550		
Francia — 2,86% (28 febbraio 2023: 2,99%)					
EUR 840			United Kingdom Gilt, 2,500%, scadenza 22/07/2065	446	0,29
French Republic Government Bond OAT, 4,250%, scadenza 25/10/2023	912	0,59	GBP 490		
EUR 1.670			United Kingdom Inflation-Linked Gilt, Serie 3MO, 0,125%, scadenza 22/03/2068 β	675	0,44
French Republic Government Bond OAT, 0,000%, scadenza 25/05/2032	1.412	0,91		8.231	5,33
EUR 1.400			Stati Uniti — 20,84% (28 febbraio 2023: 19,91%)		
French Republic Government Bond OAT, 2,000%, scadenza 25/11/2032	1.405	0,91	9.130		
EUR 670			United States Treasury Note/Bond, 0,375%, scadenza 15/04/2024	8.848	5,73
French Republic Government Bond OAT, 144A, 1,500%, scadenza 25/05/2050	489	0,32	5.000		
EUR 160			United States Treasury Note/Bond, 1,125%, scadenza 28/02/2025	4.717	3,05
French Republic Government Bond OAT, 4,000%, scadenza 25/04/2060	193	0,13	3.000		
	4.411	2,86	United States Treasury Note/Bond, 0,375%, scadenza 30/04/2025	2.780	1,80
Germania — 8,66% (28 febbraio 2023: 2,84%)					
EUR 640			42		
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,000%, scadenza 15/08/2025	669	0,43	United States Treasury Note/Bond, 0,250%, scadenza 30/06/2025	39	0,02
EUR 10.710			9.820		
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250%, scadenza 15/08/2028	10.447	6,76	United States Treasury Note/Bond, 0,250%, scadenza 31/08/2025	8.968	5,81
			3.680		
			United States Treasury Note/Bond, 1,375%, scadenza 31/10/2028	3.191	2,07
			130		
			United States Treasury Note/Bond, 3,875%, scadenza 15/05/2043	121	0,08
			20		
			United States Treasury Note/Bond, 2,750%, scadenza 15/11/2047	15	0,01
			2.300		
			United States Treasury Note/Bond, 2,875%, scadenza 15/05/2049	1.783	1,15
			2.110		
			United States Treasury Note/Bond, 2,875%, scadenza 15/05/2052	1.638	1,06
			20		
			United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/08/2052	16	0,01

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti governativi — (segue)		
Stati Uniti — (segue)		
80 United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/02/2053	72	0,05
	32.188	20,84
Totale Obbligazioni ed effetti governativi (Costo 95.271\$)	85.881	55,60
Organismi di investimento collettivo — 7,95% (28 febbraio 2023: 7,65%)		
852 Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Classe LM	11.973	7,75
2 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Class USD Accumulating	310	0,20
Totale Organismi di investimento collettivo (Costo 12.184\$)	12.283	7,95
Totale Investimenti al valore equo rilevato a conto economico (Costo 179.023\$)	163.564	105,89
Swap sull'inflazione — 0,04% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Apprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	61	0,04
Contratti a termine in valuta estera — 0,61% (28 febbraio 2023: 0,69%)		
Apprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	937	0,61
Futures — 0,26% (28 febbraio 2023: 0,23%)		
Apprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	404	0,26
Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	164.966	106,80
Contratti a termine in valuta estera — (0,84%) (28 febbraio 2023: (1,43%))		
Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(1.300)	(0,84)
Futures — (0,16%) (28 febbraio 2023: (0,71%))		
Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(245)	(0,16)
Totale Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(1.545)	(1,00)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	163.421	105,80
Passività eccedenti le altre attività	(8.957)	(5,80)
Patrimonio in gestione	154.464\$	100,00

Prospetto degli swap sull'inflazione

Controparte	Tasso	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Bank of America Merrill Lynch	USD - CPI consumatori urbani	08-mar-2053	1.490	\$ -
Bank of America Merrill Lynch	EUR - Indice armonizzato dei prezzi al consumo	15-mar-2053	2.850	61
Apprezzamento non realizzato degli swap sull'inflazione (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				\$ 61
Deprezzamento non realizzato degli swap sull'inflazione (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				-
Apprezzamento netto degli swap sull'inflazione (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				\$ 61

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta di acquisto (in migliaia)	Valuta di vendita (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
13-set-2023	Citi	Acquisto USD 9.218	Vendita CNH 64.960	\$ 286
13-set-2023	Citi	Acquisto USD 300	Vendita INR 24.760	-
13-set-2023	Citi	Acquisto CNH 5.890	Vendita USD 816	(7)
13-set-2023	Goldman Sachs	Acquisto USD 2.057	Vendita CNH 14.460	69
13-set-2023	JP Morgan	Acquisto USD 1.581	Vendita CNH 11.110	54
13-set-2023	JP Morgan	Acquisto USD 1.965	Vendita KRW 2.554.455	34
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 912	Vendita CAD 1.227	4
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 896	Vendita CAD 1.214	(2)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 44	Vendita EUR 40	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 829	Vendita EUR 759	6
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD -	Vendita GBP -	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 41	Vendita NZD 69	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 42	Vendita NZD 70	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto GBP -	Vendita USD -	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto NZD 7.027	Vendita USD 4.251	(62)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto CAD 122.816	Vendita USD 91.475	(560)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto CAD 1.665	Vendita USD 1.231	2
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto EUR 34.731	Vendita USD 38.206	(518)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto GBP 2	Vendita USD 2	-
19-set-2023	Goldman Sachs	Acquisto JPY 12.443	Vendita USD 86	-
16-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto USD 10.299	Vendita EUR 9.367	103
16-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto PLN 1.355	Vendita USD 334	(6)

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

– Gli importi indicati con “-” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 7.257.000\$, ovvero allo 4,69% dell'attivo netto.

* Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.

± Titoli acquistati su base to be announced.

β Il tasso di interesse su questo tipo di titoli è legato all'Indice dei prezzi al consumo (IPC)/Indice dei prezzi al dettaglio (IPD). Il tasso cedolare corrisponde al tasso in vigore al 31 agosto 2023.

ABBREVIAZIONI:

TBA – To Be Announced.
 BRL – Real brasiliano
 CAD – Dollaro canadese
 EUR – Euro
 GBP – Sterlina britannica
 IDR – Rupia indonesiana
 JPY – Yen giapponese
 KRW – Won sud-coreano
 MXN – Peso messicano
 PLN – Zloty polacco
 ZAR – Rand sudafricano

Analisi delle attività totali	% delle Attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	86,82
Organismi di investimento collettivo	7,05
Strumenti finanziari derivati	0,80
Altre attività	5,33
Totale Attività	100,00

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

Data di scadenza	Controparte	Valuta di acquisto (in migliaia)		Valuta di vendita (in migliaia)		Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)		
16-nov-2023	Citi	Acquisto	USD	4.480	Vendita	EUR	4.077	\$ 43
16-nov-2023	Citi	Acquisto	USD	3.726	Vendita	GBP	2.933	10
16-nov-2023	Citi	Acquisto	SEK	16.710	Vendita	USD	1.573	(41)
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	1.077	Vendita	CAD	1.438	11
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	132	Vendita	EUR	120	1
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	79	Vendita	MXN	1.386	(1)
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	JPY	182.572	Vendita	USD	1.295	(25)
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	NOK	16.400	Vendita	USD	1.607	(61)
16-nov-2023	HSBC	Acquisto	USD	12.196	Vendita	EUR	11.098	117
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	1.271	Vendita	CAD	1.698	13
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	2.981	Vendita	CNH	21.360	32
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	106	Vendita	EUR	97	-
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	10.807	Vendita	GBP	8.508	27
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	AUD	46	Vendita	USD	31	(1)
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	ZAR	2.721	Vendita	USD	144	-
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	EUR	46	Vendita	USD	50	-
16-nov-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	118	Vendita	CAD	158	1
16-nov-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	2.957	Vendita	EUR	2.690	29
16-nov-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	1.749	Vendita	GBP	1.376	5
16-nov-2023	Morgan Stanley	Acquisto	AUD	1.800	Vendita	USD	1.186	(16)
16-nov-2023	UBS	Acquisto	USD	9.469	Vendita	EUR	8.617	90
Apprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 1.011\$)							\$	937
Deprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (2.097)\$)								(1.300)
Deprezzamento netto dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1.086)\$)							\$	(363)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
Australia 10 Year Bond settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	18	\$ 1.355	\$ (17)
Euro-Bobl dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	9	1.146	7
Euro-Bund dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	62	8.917	89
Euro-Buxl 30 Year Bond dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(145)	(2)
Euro-Schatz dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	63	7.206	18
ICE 3 mesi SONIA dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	86	25.681	(42)
ICE 3 mesi SONIA giugno 2024	Bank of America Merrill Lynch	87	26.009	16
Japan 10 Year Bond (OSE) settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(11)	(11.100)	84
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	48	5.329	56
U.S. 10 Year Ultra Note dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(103)	(11.959)	(177)
U.S. 2 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	71	14.470	35
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	130	13.900	86
U.S. Long Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(4)	(487)	(7)
U.S. Ultra Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	5	647	13
Apprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 338\$)				\$ 404
Deprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1.043)\$)				(245)
Apprezzamento netto di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (705)\$)				\$ 159

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)		Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)		Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto					
Obbligazioni ed effetti societari — 84,68% (28 febbraio 2023: 80,76%)												
Australia — 1,15% (28 febbraio 2023: 1,56%)												
EUR	140	AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1,625%, scadenza 11/03/2081 *	133	0,42	EUR	170	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,625%, scadenza 20/10/2028	97	0,31			
	190	Glencore Finance Canada Ltd, 6,000%, scadenza 15/11/2041	183	0,58		137	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,625%, scadenza 20/04/2030	137	0,44			
	60	Westpac Banking Corp, 2,668%, scadenza 15/11/2035 *	46	0,15	EUR	150	Logicor Financing Sarl, 3,250%, scadenza 13/11/2028	142	0,46			
			362	1,15	EUR	125	Prologis International Funding II SA, 1,750%, scadenza 15/03/2028	123	0,39			
Belgio — 0,02% (28 febbraio 2023: 0,39%)												
	8	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600%, scadenza 15/04/2048	7	0,02	EUR	140	SELP Finance Sarl, 1,500%, scadenza 20/11/2025	142	0,45			
Brasile — 0,20% (28 febbraio 2023: 1,03%)												
	60	Vale Canada Ltd, 7,200%, scadenza 15/09/2032	63	0,20	EUR	160	SELP Finance Sarl, 1,500%, scadenza 20/12/2026	157	0,50			
Colombia — 0,38% (28 febbraio 2023: 0,25%)												
	170	Ecopetrol SA, 5,875%, scadenza 28/05/2045	120	0,38	EUR	110	SES SA, 3,500%, scadenza 14/01/2029	113	0,36			
Danimarca — 1,61% (28 febbraio 2023: 2,07%)												
EUR	140	Coloplast Finance BV, 2,250%, scadenza 19/05/2027	144	0,46				1.034	3,30			
EUR	150	Danske Bank A/S, 1,375%, scadenza 12/02/2030 *	154	0,49	Paesi Bassi — 2,46% (28 febbraio 2023: 2,39%)							
EUR	190	Danske Bank A/S, 4,750%, scadenza 21/06/2030 *	208	0,66	EUR	170	CTP NV, 2,125%, scadenza 01/10/2025	170	0,54			
			506	1,61	EUR	130	Enexis Holding NV, 3,625%, scadenza 12/06/2034	141	0,45			
Finlandia — 1,03% (28 febbraio 2023: 0,67%)												
EUR	130	Fortum Oyj, 1,625%, scadenza 27/02/2026	133	0,43	EUR	140	Euronext NV, 1,000%, scadenza 18/04/2025	144	0,46			
EUR	200	Neste Oyj, 0,750%, scadenza 25/03/2028	190	0,60	EUR	200	ING Groep NV, 2,500%, scadenza 15/02/2029 *	214	0,68			
			323	1,03	EUR	100	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1,750%, scadenza 02/04/2027	103	0,33			
Francia — 6,92% (28 febbraio 2023: 7,01%)												
EUR	200	BNP Paribas SA, 4,705%, scadenza 10/01/2025 *	199	0,63				772	2,46			
GBP	100	BNP Paribas SA, 2,000%, scadenza 24/05/2031 *	109	0,35	Portogallo — 0,97% (28 febbraio 2023: 0,40%)							
EUR	200	Bouygues SA, 3,875%, scadenza 17/07/2031	216	0,69	EUR	200	EDP – Energias de Portugal SA, 1,875%, scadenza 02/08/2081 *	194	0,62			
EUR	200	Eiffage SA, 1,625%, scadenza 14/01/2027	194	0,62	EUR	100	Floene Energias SA, 4,875%, scadenza 03/07/2028	109	0,35			
EUR	200	Electricite de France SA, 1,000%, scadenza 29/11/2033	161	0,51				303	0,97			
EUR	100	Engie SA, 0,500%, scadenza 24/10/2030	87	0,28	Singapore — 0,61% (28 febbraio 2023: 0,40%)							
EUR	100	Engie SA, 4,250%, scadenza 11/01/2043	107	0,34	EUR	200	Cromwell Ereit Lux Finco Sarl, 2,125%, scadenza 19/11/2025	191	0,61			
EUR	310	GELF Bond Issuer I SA, 1,125%, scadenza 18/07/2029	274	0,87	Spagna — 2,22% (28 febbraio 2023: 3,53%)							
EUR	190	Orange SA, 5,000%, Perpetual *	206	0,66	EUR	200	Banco Santander SA, 5,294%, scadenza 18/08/2027	196	0,63			
EUR	200	Suez SACA, 1,875%, scadenza 24/05/2027	202	0,64	EUR	100	Banco Santander SA, 5,750%, scadenza 23/08/2033 *	109	0,34			
EUR	100	Terega SA, 0,875%, scadenza 17/09/2030	86	0,28	GBP	100	CaixaBank SA, 6,875%, scadenza 25/10/2033 *	121	0,39			
EUR	200	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 4,750%, scadenza 17/09/2044	136	0,43	EUR	200	Cellnex Telecom SA, 1,875%, scadenza 26/06/2029	186	0,59			
			2.172	6,92	EUR	100	Telefonica Europe BV, 2,376%, Perpetual *	86	0,27			
Germania — 7,16% (28 febbraio 2023: 7,27%)												
EUR	400	Allianz SE, 3,200%, Perpetual *	304	0,97				698	2,22			
EUR	200	alstria office REIT-AG, 1,500%, scadenza 23/06/2026	168	0,53	Svezia — 1,34% (28 febbraio 2023: 1,88%)							
EUR	100	Amprion GmbH, 3,971%, scadenza 22/09/2032	108	0,34	EUR	140	H&M Finance BV, 0,250%, scadenza 25/08/2029	124	0,40			
EUR	140	Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750%, scadenza 15/06/2030	165	0,53	EUR	100	Heimstaden AB, 4,250%, scadenza 09/03/2026	57	0,18			
EUR	100	EnBW International Finance BV, 4,049%, scadenza 22/11/2029	110	0,35	EUR	130	Heimstaden Bostad AB, 3,625%, Perpetual *	65	0,21			
EUR	200	Hannover Rueck SE, 1,125%, scadenza 09/10/2039 *	173	0,55	EUR	160	Svenska Handelsbanken AB, 5,000%, scadenza 16/08/2034 *	173	0,55			
EUR	100	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG di Muenchen, 3,250%, scadenza 26/05/2049 *	100	0,32				419	1,34			
EUR	100	Robert Bosch GmbH, 4,000%, scadenza 02/06/2035	109	0,35	Svizzera — 2,81% (28 febbraio 2023: 2,96%)							
EUR	100	Sirius Real Estate Ltd, 1,125%, scadenza 22/06/2026	93	0,30	EUR	200	Julius Baer Group Ltd, 6,625%, Perpetual *	192	0,61			
EUR	100	Sirius Real Estate Ltd, 1,750%, scadenza 24/11/2028	82	0,26	EUR	170	UBS Group AG, 144A, 1,305%, scadenza 02/02/2027 *	241	0,77			
EUR	200	Vier Gas Transport GmbH, 4,625%, scadenza 26/09/2032	225	0,72	GBP	200	UBS Group AG, 2,250%, scadenza 09/06/2028 *	218	0,70			
GBP	100	Volkswagen Financial Services NV, 4,250%, scadenza 09/10/2025	122	0,39				229	0,73			
EUR	100	Volkswagen International Finance NV, Serie PNC5, 7,500%, Perpetual *	110	0,35				880	2,81			
EUR	200	Vonovia SE, 0,375%, scadenza 16/06/2027	183	0,58	Regno Unito — 14,82% (28 febbraio 2023: 13,41%)							
EUR	200	ZF Finance GmbH, 2,000%, scadenza 06/05/2027	193	0,62	GBP	130	Anglian Water Osprey Financing Plc, 2,000%, scadenza 31/07/2028	125	0,40			
			2.245	7,16	GBP	130	Barclays Plc, 1,700%, scadenza 03/11/2026 *	148	0,47			
Irlanda — 1,36% (28 febbraio 2023: 0,64%)												
EUR	240	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,850%, scadenza 29/10/2041	178	0,57	GBP	210	Barclays Plc, 6,375%, Perpetual *	235	0,75			
EUR	230	CRH SMW Finance DAC, 4,000%, scadenza 11/07/2031	248	0,79	EUR	170	Cadent Finance Plc, 0,750%, scadenza 11/03/2032	141	0,45			
			426	1,36	GBP	120	CPUK Finance Ltd, 3,588%, scadenza 28/08/2025	143	0,45			
Israele — 0,39% (28 febbraio 2023: 0,00%)												
EUR	110	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375%, scadenza 15/09/2029	122	0,39	GBP	160	Gatwick Airport Finance Plc, 4,375%, scadenza 07/04/2026	186	0,59			
Italia — 3,24% (28 febbraio 2023: 3,22%)												
EUR	180	CA Auto Bank SPA/Ireland, 0,500%, scadenza 13/09/2024	188	0,60	GBP	100	Gatwick Funding Ltd, 2,500%, scadenza 15/04/2030	103	0,33			
EUR	200	Enel Finance International NV, 144A, 7,750%, scadenza 14/10/2052	229	0,73	GBP	180	Grainger Plc, 3,000%, scadenza 03/07/2030	179	0,57			
EUR	200	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198%, scadenza 01/06/2032 *	152	0,48	EUR	200	HSBC Holdings Plc, 2,357%, scadenza 18/08/2031	159	0,51			
EUR	100	Terna – Rete Elettrica Nazionale, 2,375%, Perpetual *	94	0,30	GBP	160	Legal & General Group Plc, 4,500%, scadenza 01/11/2050 *	172	0,55			
EUR	340	UniCredit SpA, 2,000%, scadenza 23/09/2029 *	354	1,13	GBP	180	Lloyds Banking Group Plc, 1,985%, scadenza 15/12/2031 *	194	0,62			
			1.017	3,24	GBP	200	Lloyds Banking Group Plc, 5,125%, Perpetual *	232	0,74			
Lussemburgo — 3,30% (28 febbraio 2023: 2,48%)												
EUR	110	ArcelorMittal SA, 6,550%, scadenza 29/11/2027	113	0,36	GBP	200	Marston's Issuer Plc, Serie B1, 7,819%, scadenza 16/07/2035 *	181	0,58			
EUR	10	ArcelorMittal SA, 6,750%, scadenza 01/03/2041	10	0,03	GBP	220	NatWest Group Plc, 3,754%, scadenza 01/11/2029 *	210	0,67			
					EUR	290	NatWest Group Plc, 4,500%, Perpetual *	280	0,89			
Stati Uniti — 32,69% (28 febbraio 2023: 27,84%)												
EUR	190	Abbott Ireland Financing DAC, 0,375%, scadenza 19/11/2027	182	0,58	EUR	100	RELEX Finance BV, 3,750%, scadenza 12/06/2031	108	0,35			
EUR	110	AbbVie Inc, 3,200%, scadenza 21/11/2029	99	0,32	EUR	100	Rentokil Initial Finance BV, 3,875%, scadenza 27/06/2027	109	0,35			
					EUR	140	Smith & Nephew Plc, 4,565%, scadenza 11/10/2029	155	0,49			
					EUR	170	SSE Plc, 4,000%, Perpetual *	171	0,54			
					EUR	270	Standard Chartered Plc, 2,500%, scadenza 09/09/2030 *	277	0,88			
					EUR	150	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 0,375%, scadenza 27/07/2029	131	0,42			
					GBP	100	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,750%, scadenza 27/04/2030	104	0,33			
					EUR	130	Tritax EuroBox Plc, 0,950%, scadenza 02/06/2026	123	0,39			
					GBP	190	UNITE Group Plc/The, 3,500%, scadenza 15/10/2028	211	0,67			
					GBP	200	Vodafone Group Plc, 8,000%, scadenza 30/08/2086 *	253	0,81			
					GBP	100	Whitbread Group Plc, 2,375%, scadenza 31/05/2027	108	0,35			
					GBP	100	Whitbread Group Plc, 3,000%, scadenza 31/05/2031	99	0,32			
					EUR	100	WPP Finance SA, 4,125%, scadenza 30/05/2028	109	0,35			
								4.646	14,82			

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto				
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)									
Stati Uniti — (segue)									
200	AbbVie Inc, 4,875%, scadenza 14/11/2048	185	0,59	100	Range Resources Corp, 144A, 4,750%, scadenza 15/02/2030	90	0,29		
110	Air Lease Corp, 1,875%, scadenza 15/08/2026	98	0,31	120	Service Corp International/US, 3,375%, scadenza 15/08/2030	99	0,32		
60	Air Lease Corp, 5,300%, scadenza 01/02/2028	59	0,19	100	Southwestern Energy Co, 5,375%, scadenza 15/03/2030	94	0,30		
EUR	120	Air Products and Chemicals Inc, 4,000%, scadenza 03/03/2035	131	0,42	40	Targa Resources Corp, 4,200%, scadenza 01/02/2033	35	0,11	
55	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500%, scadenza 20/04/2026	54	0,17	40	Targa Resources Corp, 4,950%, scadenza 15/04/2052	33	0,10		
150	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750%, scadenza 20/04/2029	144	0,46	130	Texas Instruments Inc, 3,875%, scadenza 15/03/2039	113	0,36		
50	American Express Co, 3,550%, Perpetual *	42	0,13	100	Time Warner Cable LLC, 7,300%, scadenza 01/07/2038	101	0,32		
90	Amgen Inc, 5,250%, scadenza 02/03/2033	90	0,29	50	T-Mobile USA Inc, 5,650%, scadenza 15/01/2053	49	0,16		
50	Amgen Inc, 5,650%, scadenza 02/03/2053	50	0,16	30	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850%, scadenza 01/02/2026	31	0,10		
30	Antero Resources Corp, 144A, 5,375%, scadenza 01/03/2030	28	0,09	19	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875%, scadenza 15/01/2026	19	0,06		
160	Apple Inc, 2,650%, scadenza 11/05/2050	107	0,34	120	United Airlines Inc, 144A, 4,375%, scadenza 15/04/2026	113	0,36		
EUR	100	AT&T Inc, Serie B, 2,875%, Perpetual *	101	0,32	130	UnitedHealth Group Inc, 4,450%, scadenza 15/12/2048	114	0,36	
EUR	290	Bank of America Corp, 1,662%, scadenza 25/04/2028 *	288	0,92	49	Verizon Communications Inc, 5,250%, scadenza 16/03/2037	49	0,16	
80	Bank of America Corp, 5,288%, scadenza 25/04/2034 *	78	0,25	120	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 4,125%, scadenza 15/08/2030	105	0,34		
160	Bank of America Corp, 2,676%, scadenza 19/06/2041 *	110	0,35	110	Warnemedia Holdings Inc, 5,050%, scadenza 15/03/2042	91	0,29		
90	Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,200%, scadenza 15/08/2048	78	0,25	EUR	210	Wells Fargo & Co, 1,000%, scadenza 02/02/2027	205	0,65	
120	Boeing Co/The, 3,950%, scadenza 01/08/2059	86	0,27	150	Wells Fargo & Co, 5,389%, scadenza 24/04/2034 *	146	0,47		
17	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400%, scadenza 26/07/2029	16	0,05	100	Wells Fargo & Co, 4,875%, scadenza 29/11/2035	108	0,35		
160	Broadcom Inc, 4,300%, scadenza 15/11/2032	145	0,46	60	Western Midstream Operating LP, 5,450%, scadenza 01/04/2044	50	0,16		
EUR	120	Cargill Inc, 3,875%, scadenza 24/04/2030	130	0,42	130	Western Midstream Operating LP, 5,250%, scadenza 01/02/2050	105	0,34	
100	Centene Corp, 4,625%, scadenza 15/12/2029	92	0,29	50	Williams Cos Inc/The, 5,300%, scadenza 15/08/2028	50	0,16		
80	Charles Schwab Corp/The, Serie H, 4,000%, Perpetual *	61	0,19	90	Williams Cos Inc/The, 5,750%, scadenza 24/06/2044	85	0,27		
420	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500%, scadenza 01/06/2041	279	0,89	20	Williams Cos Inc/The, 3,500%, scadenza 15/10/2051	13	0,04		
20	Chevron USA Inc, 3,850%, scadenza 15/01/2028	19	0,06	140	Workday Inc, 3,800%, scadenza 01/04/2032	124	0,40		
160	Cigna Group/The, 2,400%, scadenza 15/03/2030	135	0,43			10.250	32,69		
220	Cigna Group/The, 3,400%, scadenza 15/03/2050	154	0,49			Totale Obbligazioni ed effetti societari (Costo 30.455\$)	26.556	84,68	
100	Citigroup Inc, 6,174%, scadenza 25/05/2034 *	100	0,32			Obbligazioni ed effetti governativi — 8,56% (28 febbraio 2023: 13,07%)			
200	Citigroup Inc, 8,125%, scadenza 15/07/2039	249	0,79			Germania — 4,50% (28 febbraio 2023: 6,86%)			
70	Comcast Corp, 4,950%, scadenza 15/10/2058	65	0,21	EUR	100	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,100%, scadenza 15/11/2029	106	0,34	
170	ConocoPhillips Co, 5,550%, scadenza 15/03/2054	171	0,54	EUR	280	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, scadenza 15/02/2031	255	0,81	
80	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750%, scadenza 15/01/2031	77	0,24	EUR	380	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, scadenza 15/08/2031	342	1,09	
150	Coterra Energy Inc, 3,900%, scadenza 15/05/2027	143	0,45	EUR	110	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,300%, scadenza 15/02/2033	118	0,38	
110	CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 144A, 3,875%, scadenza 30/06/2028	96	0,31	EUR	130	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Serie 05, 4,000%, scadenza 04/01/2037	163	0,52	
160	CVS Health Corp, 5,050%, scadenza 25/03/2048	140	0,45	EUR	150	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Serie 2007, 4,250%, scadenza 04/07/2039	197	0,63	
70	DCP Midstream Operating LP, 5,625%, scadenza 15/07/2027	70	0,22	EUR	110	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Serie 08, 4,750%, scadenza 04/07/2040	154	0,49	
38	Devon Energy Corp, 4,500%, scadenza 15/01/2030	36	0,11	EUR	90	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,250%, scadenza 15/08/2048	75	0,24	
130	Devon Energy Corp, 5,000%, scadenza 15/06/2045	111	0,36				1.410	4,50	
90	Elevance Health Inc, 3,650%, scadenza 01/12/2027	85	0,27			Indonesia — 0,96% (28 febbraio 2023: 0,63%)			
40	Energy Transfer LP, 6,500%, scadenza 01/02/2042	40	0,13	EUR	350	Indonesia Government International Bond, 1,400%, scadenza 30/10/2031	301	0,96	
130	Enterprise Products Operating LLC, 5,375%, scadenza 15/02/2078 *	108	0,34			Messico — 1,11% (28 febbraio 2023: 1,10%)			
40	Exelon Corp, 3,400%, scadenza 15/04/2026	38	0,12	420	Mexico Government International Bond, 3,500%, scadenza 12/02/2034	349	1,11		
50	Fidelity & Guaranty Life Holdings Inc, 5,500%, scadenza 01/05/2025	49	0,16			Panama — 0,49% (28 febbraio 2023: 0,33%)			
EUR	180	Ford Motor Credit Co LLC, 2,386%, scadenza 17/02/2026	184	0,59	200	Obbligazione governativa internazionale di Panama, 2,252%, scadenza 29/09/2032	152	0,49	
EUR	100	General Electric Co, 4,125%, scadenza 19/09/2035	109	0,35			Regno Unito — 1,11% (28 febbraio 2023: 0,54%)		
110	General Motors Co, 6,125%, scadenza 01/10/2025	110	0,35	GBP	100	United Kingdom Gilt, 0,125%, scadenza 30/01/2026	114	0,36	
130	General Motors Co, 6,750%, scadenza 01/04/2046	128	0,41	GBP	180	United Kingdom Gilt, 4,125%, scadenza 29/01/2027	223	0,71	
16	Goldman Sachs Capital II, 6,439%, Perpetual *	13	0,04	GBP	10	United Kingdom Gilt, 0,125%, scadenza 31/01/2028	11	0,04	
EUR	170	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,875%, scadenza 03/06/2026	181	0,58				348	1,11
110	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800%, scadenza 15/03/2030	100	0,32			Stati Uniti — 0,39% (28 febbraio 2023: 3,61%)			
20	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150%, scadenza 22/05/2045	18	0,06	130	United States Treasury Note/Bond, 3,375%, scadenza 15/05/2033	122	0,39		
EUR	120	Haleon Netherlands Capital BV, 1,750%, scadenza 29/03/2030	114	0,36			Totale Obbligazioni ed effetti governativi (Costo 2.962\$)	2.682	8,56
70	Halliburton Co, 5,000%, scadenza 15/11/2045	63	0,20			Organismi di investimento collettivo — 0,71% (28 febbraio 2023: 1,21%)			
130	HCA Inc, 3,500%, scadenza 01/09/2030	114	0,36	222	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	222	0,71		
50	HEICO Corp, 5,250%, scadenza 01/08/2028	50	0,16			Totale Organismi di investimento collettivo (Costo 222\$)	222	0,71	
20	HEICO Corp, 5,350%, scadenza 01/08/2033	20	0,06			Azioni ordinarie — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)			
100	Humana Inc, 3,125%, scadenza 15/08/2029	89	0,28			Svizzera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)			
90	Humana Inc, 5,875%, scadenza 01/03/2033	93	0,30	680	Credit Suisse Group AG Escrow †	–	–		
20	Intercontinental Exchange Inc, 4,250%, scadenza 21/09/2048	17	0,05			Totale Azioni ordinarie (Costo \$-)	–	–	
EUR	500	JPMorgan Chase & Co, 0,389%, scadenza 24/02/2028 *	478	1,53			Totale Investimenti al valore equo rilevato a conto economico (Costo 33.639\$)	29.460	93,95
30	Lowe's Cos Inc, 3,000%, scadenza 15/10/2050	19	0,06			Contratti a termine in valuta estera — 0,69% (28 febbraio 2023: 0,74%)			
20	Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375%, scadenza 15/04/2050	14	0,04			Apprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	216	0,69	
100	McDonald's Corp, 3,700%, scadenza 30/01/2026	97	0,31			Futures — 0,35% (28 febbraio 2023: 0,44%)			
170	McDonald's Corp, 5,450%, scadenza 14/08/2053	270	0,86			Apprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	110	0,35	
150	Microsoft Corp, 2,921%, scadenza 17/03/2052	106	0,34			Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	29.786	94,99	
EUR	340	Morgan Stanley, 4,656%, scadenza 02/03/2029 *	373	1,19					
50	Morgan Stanley, 5,948%, scadenza 19/01/2038 *	49	0,16						
100	MPLX LP, 4,500%, scadenza 15/04/2038	85	0,27						
EUR	130	Netflix Inc, 3,625%, scadenza 15/06/2030	137	0,44					
60	NRG Energy Inc, 144A, 2,450%, scadenza 02/12/2027	51	0,16						
50	Nuveen LLC, 4,000%, scadenza 01/11/2028	47	0,15						
100	Olin Corp, 5,000%, scadenza 01/02/2030	92	0,29						
50	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750%, scadenza 19/05/2033	49	0,16						
110	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,300%, scadenza 19/05/2053	110	0,35						
EUR	170	Prologis Euro Finance LLC, 0,625%, scadenza 10/09/2031	140	0,45					
120	Prudential Financial Inc, 3,000%, scadenza 10/03/2040	89	0,28						

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Credit Default Swap — (0,29%) (28 febbraio 2023: (0,17%))		
Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(92)	(0,29)
Contratti a termine in valuta estera — (0,25%) (28 febbraio 2023: (0,19%))		
Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(79)	(0,25)
Futures — (0,13%) (28 febbraio 2023: (0,08%))		
Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(41)	(0,13)
Totale Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(212)	(0,67)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	29.574	94,32
Altre attività eccedenti le passività	1.785	5,68
Patrimonio in gestione	31.359\$	100,00

– Gli importi indicati con “-” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 1.484.000\$, ovvero allo 4,72% dell'attivo netto.

* Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.

† Illiquido.

ABBREVIAZIONI:

Perpetual	– Obbligazione senza scadenza. Le obbligazioni perpetual non sono riscattabili ma garantiscono interessi costanti.
EUR	– Euro
GBP	– Sterlina britannica

Analisi delle attività totali	% delle Attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	91,92
Organismi di investimento collettivo	0,70
Strumenti finanziari derivati	1,02
Altre attività	6,36
Totale Attività	100,00

Prospetto dei Credit default swap

Controparte	Entità di riferimento – Protezione acquisto/vendita	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA1G, 1,000% - Acquisto	20-giu-2028	4.200	\$ (65)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000% – Acquisto	20-giu-2028	1.940	(27)
Apprezzamento non realizzato di Credit default swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				\$ -
Deprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (76)\$)				(92)
Ammortamento netto dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (76)\$)				\$ (92)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta di acquisto (in migliaia)		Valuta di vendita (in migliaia)		Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 63	Vendita	EUR 57	\$ -
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD -	Vendita	GBP -	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP 15	Vendita	USD 19	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 4.386	Vendita	USD 4.825	(65)
16-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD 550	Vendita	EUR 500	6
16-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD 48	Vendita	GBP 38	-
16-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD 63	Vendita	JPY 9.130	(1)
16-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto	JPY 3.867	Vendita	USD 28	(1)
16-nov-2023	Citi	Acquisto	USD 665	Vendita	EUR 606	6
16-nov-2023	Citi	Acquisto	USD 360	Vendita	GBP 284	1
16-nov-2023	Citi	Acquisto	EUR 50	Vendita	USD 55	(1)
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD 6.743	Vendita	EUR 6.135	66
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD 392	Vendita	GBP 309	1
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	EUR 343	Vendita	USD 380	(6)
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	JPY 33.510	Vendita	USD 238	(5)
16-nov-2023	HSBC	Acquisto	USD 66	Vendita	EUR 60	1
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	USD 4.385	Vendita	EUR 3.989	43
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	USD 2.481	Vendita	GBP 1.953	6
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	EUR 276	Vendita	USD 300	-
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	GBP 556	Vendita	USD 700	5
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	EUR 2.954	Vendita	USD 3.200	16
16-nov-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD 1.875	Vendita	EUR 1.706	18
16-nov-2023	Royal Bank of Canada	Acquisto	USD 811	Vendita	EUR 738	8
16-nov-2023	UBS	Acquisto	USD 3.697	Vendita	EUR 3.364	35
16-nov-2023	UBS	Acquisto	USD 1.661	Vendita	GBP 1.307	4
Apprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 343\$)						\$ 216
Deprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (90)\$)						(79)
Apprezzamento netto di Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 253\$)						\$ 137

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
10 Year Mini Japanese Government Bond settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(5)	\$ (505)	\$ 3
Euro-Bobl dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(21)	(2.675)	(15)
Euro-BTP dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(10)	(1.252)	(10)
Euro-Bund dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	4	575	6
Japan 10 Year Bond (OSE) settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(2)	(2.018)	15
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	20	2.221	23
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	24	2.566	15
U.S. Long Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(9)	(1.095)	(16)
U.S. Ultra Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	16	2.071	48
Apprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 202\$)				\$ 110
Deprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (34)\$)				(41)
Apprezzamento netto di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 168\$)				\$ 69

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da attività — 5,94% (28 febbraio 2023: 4,57%)					
11.500 Apidos CLO XXXVI, Serie 2021 36A, Classe D, 144A, 8,488%, scadenza 20/07/2034 *	11.079	0,73	INR 500.000 Power Finance Corp Ltd, Serie 130C, 8,390%, scadenza 19/04/2025	6.114	0,41
9.070 Apidos CLO XXXVIII, Serie 2021 38A, Classe D, 144A, 8,545%, scadenza 21/01/2034 *	8.667	0,57	INR 250.000 Power Grid Corp of India Ltd, Serie C, 8,200%, scadenza 23/01/2025	3.048	0,20
13.950 Bain Capital Credit CLO 2021-4 Ltd, Serie 2021 4A, Classe D, 144A, 8,688%, scadenza 20/10/2034 *	13.081	0,87	INR 500.000 REC Ltd, Serie 133, 8,300%, scadenza 10/04/2025	6.107	0,40
4.492 Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Serie 2016 1A, Classe AA, 144A, 2,487%, scadenza 16/12/2041	4.331	0,29		21.415	1,42
6.000 Canyon Capital CLO 2017-1 Ltd, Serie 2017 1A, Classe DR, 144A, 8,570%, scadenza 15/07/2030 *	5.816	0,38	Irlanda — 0,03% (28 febbraio 2023: 0,02%)		
2.829 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2006-I, Serie 2006 I, Classe 2A, 5,565%, scadenza 15/01/2037 *	2.547	0,17	490 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300%, scadenza 30/01/2032	398	0,03
7.153 DB Master Finance LLC, Serie 2021 1A, Classe A23, 144A, 2,791%, scadenza 20/11/2051	5.684	0,38	Israele — 3,29% (28 febbraio 2023: 4,11%)		
8.000 Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Serie 2018 4, Classe A, 4,060%, scadenza 15/11/2030	7.577	0,50	8.027 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150%, scadenza 01/02/2036	7.406	0,49
2.123 Loanpal Solar Loan Ltd, Serie 2020 3GS, Classe B, 144A, 3,450%, scadenza 20/12/2047	1.575	0,10	3.805 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, scadenza 01/10/2026	3.444	0,23
5.375 Nassau 2021-1 Ltd, Serie 2021 IA, Classe D, 144A, 9,320%, scadenza 26/08/2034 *	5.148	0,34	310 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750%, scadenza 09/05/2027	290	0,02
5.110 Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Classe DR, 144A, 9,290%, scadenza 15/10/2034 *	5.017	0,33	2.110 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,750%, scadenza 01/03/2028	2.110	0,14
2.350 Ocean Trails CLO XIV Ltd, Serie 2023 14A, Classe D, 144A, 11,146%, scadenza 20/01/2035 *	2.351	0,16	2.810 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125%, scadenza 09/05/2029	2.602	0,17
5.295 Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Classe A, 144A, 2,675%, scadenza 28/02/2033	4.721	0,31	7.400 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125%, scadenza 15/09/2031	7.849	0,52
7.200 Venture XXVI CLO Ltd, Serie 2017 26A, Classe D, 144A, 9,838%, scadenza 20/01/2029 *	6.614	0,44	39.981 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100%, scadenza 01/10/2046	26.090	1,72
6.000 Vibrant Clo VII Ltd, Serie 2017 7A, Classe C, 144A, 9,188%, scadenza 15/09/2030 *	5.586	0,37		49.791	3,29
Totale Titoli garantiti da attività (Costo 96.2775)	89.794	5,94	Italia — 0,19% (28 febbraio 2023: 0,13%)		
Titoli garantiti da ipoteca — 8,87% (28 febbraio 2023: 0,91%)					
10.400 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Serie 2021 R03, Classe 1M2, 144A, 6,938%, scadenza 25/12/2041 *	10.150	0,67	2.950 Enel Finance International NV, 144A, 6,000%, scadenza 07/10/2039	2.829	0,19
16.900 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 5,500% ±	16.688	1,10	Lussemburgo — 0,01% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
36.500 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 6,000% ±	36.598	2,42	220 Altice Financing SA, 144A, 5,750%, scadenza 15/08/2029	174	0,01
33 Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500%, scadenza 01/12/2047	30	-	Macao — 1,54% (28 febbraio 2023: 1,08%)		
7.870 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Classe M2, 144A, 6,788%, scadenza 25/10/2041 *	7.712	0,51	10.380 Sands China Ltd, 5,375%, scadenza 08/08/2025	10.044	0,66
40.700 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,500% ±	40.290	2,67	3.462 Sands China Ltd, 2,800%, scadenza 08/03/2027	3.017	0,20
21.100 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 6,000% ±	21.170	1,40	1.540 Sands China Ltd, 3,100%, scadenza 08/03/2029	1.285	0,09
1.167 MortgageIT Trust 2005-3, Serie 2005 3, Classe A1, 6,029%, scadenza 25/08/2035 *	1.114	0,08	3.570 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875%, scadenza 01/10/2024	3.488	0,23
400 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQ2R, Classe A3, 144A, 1,353%, scadenza 25/10/2058 *	356	0,02	5.750 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500%, scadenza 15/01/2026	5.403	0,36
Totale Titoli garantiti da ipoteca (Costo 134.1645)	134.108	8,87		23.237	1,54
Obbligazioni ed effetti societari — 40,36% (28 febbraio 2023: 40,30%)					
Bermuda — 0,88% (28 febbraio 2023: 0,61%)					
14.150 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625%, scadenza 15/10/2025	13376	0,88	Malesia — 0,52% (28 febbraio 2023: 0,39%)		
Brasile — 0,37% (28 febbraio 2023: 0,38%)					
1.780 Petrobras Global Finance BV, 5,999%, scadenza 27/01/2028	1.769	0,12	11.920 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064%, scadenza 19/08/2050	7.947	0,52
4.380 Petrobras Global Finance BV, 6,850%, scadenza 05/06/2115	3.847	0,25	Messico — 0,41% (28 febbraio 2023: 0,43%)		
	5.616	0,37	3.810 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625%, Perpetual *	3.552	0,23
Canada — 0,29% (28 febbraio 2023: 0,20%)					
260 Toronto-Dominion Bank/The, 8,125%, scadenza 31/10/2082 *	262	0,01	4.350 Petroleos Mexicanos, 6,375%, scadenza 23/01/2045	2.647	0,18
4.430 Yamana Gold Inc, 4,625%, scadenza 15/12/2027	4.200	0,28		6.199	0,41
	4.462	0,29	Sovranazionale — 0,53% (28 febbraio 2023: 0,37%)		
Colombia — 0,45% (28 febbraio 2023: 0,47%)					
4.130 Ecopetrol SA, 5,375%, scadenza 26/06/2026	4.004	0,26	IDR 127.100.000 European Bank for Reconstruction & Development, 5,000%, scadenza 06/10/2026	8.085	0,53
2.770 Ecopetrol SA, 8,875%, scadenza 13/01/2033	2.810	0,19	Svezia — 0,23% (28 febbraio 2023: 0,18%)		
	6.814	0,45	4.400 Svenska Handelsbanken AB, 4,750%, Perpetual *	3.432	0,23
Francia — 0,89% (28 febbraio 2023: 0,78%)					
2.260 Altice France SA/France, 144A, 5,500%, scadenza 15/01/2028	1.696	0,11	Svizzera — 0,75% (28 febbraio 2023: 2,18%)		
400 BNP Paribas SA, 144A, 7,000%, Perpetual *	371	0,03	4.540 UBS Group AG, 144A, 9,016%, scadenza 15/11/2033 *	5.501	0,37
200 BNP Paribas SA, 144A, 9,250%, Perpetual *	207	0,01	6.160 UBS Group SA, 6,875%, Perpetual *	5.795	0,38
5.420 Credit Agricole SA, 144A, 8,125%, Perpetual *	5.417	0,36		11.296	0,75
GBP 4.830 Credit Agricole SA, 7,500%, Perpetual *	5.807	0,38	Emirati Arabi Uniti — 0,44% (28 febbraio 2023: 0,37%)		
	13.498	0,89	8.460 MDGH GMTN RSC Ltd, 3,950%, scadenza 21/05/2050	6.670	0,44
India — 1,42% (28 febbraio 2023: 1,00%)					
INR 500.000 NTPC Ltd, Serie 53, 9,170%, scadenza 22/09/2024	6.146	0,41	Regno Unito — 0,69% (28 febbraio 2023: 0,65%)		
			3.760 Barclays Plc, 7,750%, Perpetual *	3.769	0,25
			2.290 BAT Capital Corp, 4,540%, scadenza 15/08/2047	1.667	0,11
			2.040 Lloyds Banking Group Plc, 7,500%, Perpetual *	1.990	0,13
			270 Reynolds American Inc, 6,150%, scadenza 15/09/2043	248	0,02
			700 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500%, scadenza 15/05/2029	641	0,04
			2.330 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,250%, scadenza 31/01/2031	1.908	0,13
			210 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750%, scadenza 15/07/2031	176	0,01
				10.399	0,69
			Stati Uniti — 26,83% (28 febbraio 2023: 26,93%)		
			520 Altria Group Inc, 2,450%, scadenza 04/02/2032	406	0,03
			1.720 Altria Group Inc, 5,950%, scadenza 14/02/2049	1.603	0,11
			2.395 Altria Group Inc, 6,200%, scadenza 14/02/2059	2.417	0,16
			557 Amazon.com Inc, 4,250%, scadenza 22/08/2057	483	0,03

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario		
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)							
Stati Uniti — (segue)							
1.830	Amazon.com Inc, 2,700%, scadenza 03/06/2060	1.132	0,07	12.990	Energy Transfer LP, Serie B, 6,625%, Perpetual *	10.478	0,69
12.480	Amazon.com Inc, 4,100%, scadenza 13/04/2062	10.364	0,69	11.260	Energy Transfer LP, Serie F, 6,750%, Perpetual *	10.380	0,69
18.226	Apache Corp, 5,100%, scadenza 01/09/2040	15.171	1,00	8.650	Energy Transfer LP, Serie G, 7,125%, Perpetual *	7.676	0,51
140	Apache Corp, 7,375%, scadenza 15/08/2047	135	0,01	828	Enterprise Products Operating LLC, 6,125%, scadenza 15/10/2039	861	0,06
1.933	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250%, scadenza 15/08/2027	1.658	0,11	1	Enterprise Products Operating LLC, 6,450%, scadenza 01/09/2040	1	–
4.500	BAC Capital Trust XIV, Serie G, 5,952%, Perpetual *	3.562	0,24	1.670	Enterprise Products Operating LLC, 5,100%, scadenza 15/02/2045	1.534	0,10
19.930	Bank of America Corp, Serie FF, 5,875%, Perpetual *	18.418	1,22	111	EQT Corp, 6,125%, scadenza 01/02/2025	111	0,01
1.719	Bank of America Corp, Serie AA, 6,100%, Perpetual *	1.694	0,11	510	EQT Corp, 144A, 3,125%, scadenza 15/05/2026	475	0,03
210	Bank of America Corp, Serie X, 6,250%, Perpetual *	209	0,01	730	EQT Corp, 7,000%, scadenza 01/02/2030	765	0,05
1.300	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500%, scadenza 01/11/2025	1.172	0,08	1.510	EQT Corp, 144A, 3,625%, scadenza 15/05/2031	1.306	0,09
2.978	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000%, scadenza 15/02/2026	2.867	0,19	90	FirstEnergy Corp, Serie C, 5,100%, scadenza 15/07/2047	78	–
2.510	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625%, scadenza 15/12/2025	2.520	0,17	360	Ford Motor Co, 3,250%, scadenza 12/02/2032	281	0,02
2.050	Boeing Co/The, 3,250%, scadenza 01/02/2035	1.648	0,11	5.500	Ford Motor Co, 6,100%, scadenza 19/08/2032	5.260	0,35
780	Boeing Co/The, 3,550%, scadenza 01/03/2038	599	0,04	200	Ford Motor Credit Co LLC, 3,375%, scadenza 13/11/2025	187	0,01
1.130	Boeing Co/The, 5,805%, scadenza 01/05/2050	1.101	0,07	840	Ford Motor Credit Co LLC, 4,389%, scadenza 08/01/2026	795	0,05
992	Boeing Co/The, 5,930%, scadenza 01/05/2060	959	0,06	200	Ford Motor Credit Co LLC, 4,542%, scadenza 01/08/2026	189	0,01
130	Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250%, scadenza 01/02/2032	111	0,01	200	Ford Motor Credit Co LLC, 2,700%, scadenza 10/08/2026	179	0,01
2.320	California Institute of Technology, 3,650%, scadenza 01/09/2119	1.508	0,10	4.120	Ford Motor Credit Co LLC, 4,271%, scadenza 09/01/2027	3.813	0,25
430	Cameron LNG LLC, 144A, 3,302%, scadenza 15/01/2035	356	0,02	200	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900%, scadenza 10/02/2029	165	0,01
5.250	Carnival Corp, 144A, 6,000%, scadenza 01/05/2029	4.745	0,31	760	Ford Motor Credit Co LLC, 5,113%, scadenza 03/05/2029	700	0,05
7.320	Carnival Corp, 144A, 10,500%, scadenza 01/06/2030	7.803	0,52	620	Freemont-McMoran Inc, 4,625%, scadenza 01/08/2030	574	0,04
320	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750%, scadenza 01/02/2032	265	0,02	675	Goldman Sachs Capital II, 6,439%, Perpetual *	544	0,04
2.100	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, scadenza 01/04/2038	1.780	0,12	4.620	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750%, scadenza 01/10/2037	4.902	0,32
540	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800%, scadenza 01/03/2050	400	0,03	1.420	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150%, scadenza 22/05/2045	1.306	0,09
780	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 5,125%, scadenza 30/06/2027	772	0,05	300	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875%, scadenza 15/12/2028	262	0,02
700	Cheniere Energy Inc, 4,625%, scadenza 15/10/2028	660	0,04	2.440	Hackensack Meridian Health Inc, 4,211%, scadenza 01/07/2048	2.073	0,14
800	Cheniere Energy Partners LP, 3,250%, scadenza 31/01/2032	662	0,04	610	HCA Inc, 3,500%, scadenza 01/09/2030	533	0,04
6.095	Citigroup Inc, 8,125%, scadenza 15/07/2039	7.593	0,50	4.401	HCA Inc, 7,500%, scadenza 15/11/2095	4.855	0,32
11.765	Citigroup Inc, Serie P, 5,950%, Perpetual *	11.358	0,75	6.290	ILFC E-Capital Trust I, 144A, 7,064%, scadenza 21/12/2065 *	4.566	0,30
15.510	Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,544%, scadenza 15/11/2053	15.871	1,05	1.089	Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,500%, scadenza 01/09/2039	1.098	0,07
1.019	CommonSpirit Health, 4,350%, scadenza 01/11/2042	852	0,06	400	Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,550%, scadenza 15/09/2040	398	0,03
960	CommonSpirit Health, 3,817%, scadenza 01/10/2049	721	0,05	1.180	Kraft Heinz Foods Co, 4,375%, scadenza 01/06/2046	977	0,06
330	CommScope Inc, 144A, 4,750%, scadenza 01/09/2029	246	0,02	2.840	Las Vegas Sands Corp, 3,200%, scadenza 08/08/2024	2.751	0,18
900	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750%, scadenza 15/01/2031	861	0,06	610	Las Vegas Sands Corp, 2,900%, scadenza 25/06/2025	576	0,04
3.290	Continental Resources Inc/OK, 4,900%, scadenza 01/06/2044	2.526	0,17	1.670	Las Vegas Sands Corp, 3,500%, scadenza 18/08/2026	1.550	0,10
5.110	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500%, scadenza 01/02/2029	4.229	0,28	1.392	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500%, scadenza 20/06/2027	1.389	0,09
2.150	CSC Holdings LLC, 144A, 5,750%, scadenza 15/01/2030	1.191	0,08	860	MPLX LP, 5,500%, scadenza 15/02/2049	767	0,05
3.390	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125%, scadenza 01/12/2030	2.420	0,16	2.490	Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125%, scadenza 01/03/2028	2.498	0,16
2.405	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450%, scadenza 03/11/2036	2.457	0,16	6.760	Occidental Petroleum Corp, 6,625%, scadenza 01/09/2030	6.986	0,46
1.160	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750%, scadenza 15/09/2037	1.226	0,08	4.070	Occidental Petroleum Corp, 6,125%, scadenza 01/01/2031	4.105	0,27
2.640	Delta Air Lines Inc, 7,375%, scadenza 15/01/2026	2.719	0,18	5.220	Occidental Petroleum Corp, 4,300%, scadenza 15/08/2039	3.992	0,26
264	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,500%, scadenza 20/10/2025	258	0,02	11.725	Occidental Petroleum Corp, 4,500%, scadenza 15/07/2044	8.542	0,56
2.264	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500%, scadenza 20/10/2025	2.214	0,15	7.150	Occidental Petroleum Corp, 4,625%, scadenza 15/06/2045	5.447	0,36
354	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,750%, scadenza 20/10/2028	340	0,02	8.980	Occidental Petroleum Corp, 6,600%, scadenza 15/03/2046	9.251	0,61
2.370	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750%, scadenza 20/10/2028	2.277	0,15	4.520	Occidental Petroleum Corp, 4,400%, scadenza 15/04/2046	3.473	0,23
866	Devon Energy Corp, 5,850%, scadenza 15/12/2025	871	0,06	2.360	Occidental Petroleum Corp, 4,100%, scadenza 15/02/2047	1.630	0,11
1.736	Devon Energy Corp, 5,250%, scadenza 15/10/2027	1.723	0,11	16.140	Occidental Petroleum Corp, 4,200%, scadenza 15/03/2048	11.889	0,79
1.670	Devon Energy Corp, 5,875%, scadenza 15/06/2028	1.673	0,11	2.572	Occidental Petroleum Corp, 4,400%, scadenza 15/08/2049	1.842	0,12
1.436	Devon Energy Corp, 4,500%, scadenza 15/01/2030	1.345	0,09	890	Pacific Gas and Electric Co, 3,300%, scadenza 01/08/2040	598	0,04
1.690	Devon Energy Corp, 7,875%, scadenza 30/09/2031	1.907	0,13	2.280	Plains All American Pipeline LP, Serie B, 9,736%, Perpetual *	2.103	0,14
1.440	Devon Energy Corp, 7,950%, scadenza 15/04/2032	1.636	0,11	2.180	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700%, scadenza 15/05/2036	2.164	0,14
805	Devon Energy Corp, 5,000%, scadenza 15/06/2045	690	0,05	4.800	Range Resources Corp, 8,250%, scadenza 15/01/2029	4.988	0,33
3.720	Dignity Health, 5,267%, scadenza 01/11/2064	3.344	0,22	6.910	Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,875%, scadenza 15/04/2040	6.245	0,41
170	DISH DBS Corp, 144A, 5,250%, scadenza 01/12/2026	144	0,01	7.540	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,375%, scadenza 15/07/2027	7.102	0,47
90	DISH DBS Corp, 144A, 5,750%, scadenza 01/12/2028	70	–	670	Southwestern Energy Co, 4,750%, scadenza 01/02/2032	594	0,04
1.220	DISH DBS Corp, 5,125%, scadenza 01/06/2029	661	0,04	2.262	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000%, scadenza 20/09/2025	2.267	0,15
1.530	Energy Transfer LP, 6,850%, scadenza 15/02/2040	1.530	0,10	560	Sprint Capital Corp, 8,750%, scadenza 15/03/2032	668	0,04
2.135	Energy Transfer LP, 6,100%, scadenza 15/02/2042	2.014	0,13	210	Sprint LLC, 7,875%, scadenza 15/09/2023	210	0,01
412	Energy Transfer LP, 5,400%, scadenza 01/10/2047	355	0,02	1.530	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500%, scadenza 01/03/2030	1.468	0,10
410	Energy Transfer LP, 6,000%, scadenza 15/06/2048	379	0,02	360	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875%, scadenza 01/02/2031	331	0,02
730	Energy Transfer LP, 6,250%, scadenza 15/04/2049	700	0,05	280	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000%, scadenza 15/01/2032	242	0,02
4.018	Energy Transfer LP, Serie H, 6,500%, Perpetual *	3.675	0,24	11.910	The Vanguard Group Inc, 3,050%, scadenza 22/08/2050 †	7.340	0,49

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)			Ungheria — 1,32% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Stati Uniti — (segue)			HUF 2.116.280 Hungary Government Bond, Serie 25/C, 1,000%, scadenza 26/11/2025		
90 T-Mobile USA Inc, 3,375%, scadenza 15/04/2029	81	0,01	5.151	0,34	
200 T-Mobile USA Inc, 3,500%, scadenza 15/04/2031	175	0,01			
5.160 Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, zero coupon, scadenza 15/02/2024	4.997	0,33	14.782	0,98	
2.100 Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, zero coupon, scadenza 15/02/2038	760	0,05	19.933	1,32	
9.590 United Airlines Inc, 144A, 4,375%, scadenza 15/04/2026	9.047	0,60			
340 United Rentals North America Inc, 3,875%, scadenza 15/02/2031	291	0,02			
5.130 Warnermedia Holdings Inc, 5,141%, scadenza 15/03/2052	4.092	0,27			
6.590 Warnermedia Holdings Inc, 5,391%, scadenza 15/03/2062	5.235	0,35			
1.926 Wells Fargo & Co, Serie U, 5,875%, Perpetual *	1.914	0,13			
1.630 Wesleyan University, 4,781%, scadenza 01/07/2116	1.298	0,09			
2.530 Western Midstream Operating LP, 3,950%, scadenza 01/06/2025	2.444	0,16			
2.770 Western Midstream Operating LP, 4,500%, scadenza 01/03/2028	2.609	0,17			
5.274 Western Midstream Operating LP, 5,450%, scadenza 01/04/2044	4.436	0,29			
6.980 Western Midstream Operating LP, 5,500%, scadenza 15/08/2048	5.813	0,38			
1.330 Western Midstream Operating LP, 5,250%, scadenza 01/02/2050	1.078	0,07			
130 Williams Cos Inc/The, 3,750%, scadenza 15/06/2027	122	0,01			
2.790 Williams Cos Inc/The, Serie A, 7,500%, scadenza 15/01/2031	3.057	0,20			
3.400 Williams Cos Inc/The, 8,750%, scadenza 15/03/2032	3.986	0,26			
1.770 Williams Cos Inc/The, 6,300%, scadenza 15/04/2040	1.816	0,12			
665 Williams Cos Inc/The, 5,100%, scadenza 15/09/2045	587	0,04			
2.070 Willis-Knighton Medical Center, Serie 2018, 4,813%, scadenza 01/09/2048	1.768	0,12			
7.313 XPO CNW Inc, 6,700%, scadenza 01/05/2034	7.277	0,48			
	405.718	26,83	111.860	7,40	
Zambia — 0,60% (28 febbraio 2023: 0,01%)			Indonesia — 7,40% (28 febbraio 2023: 7,79%)		
220 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875%, scadenza 15/10/2027	215	0,02	IDR 18.941.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR56, 8,375%, scadenza 15/09/2026	1.317	0,09
8.640 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625%, scadenza 01/06/2031	8.803	0,58	IDR 482.620.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR78, 8,250%, scadenza 15/05/2029	34.604	2,29
	9.018	0,60	IDR 500.248.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR87, 6,500%, scadenza 15/02/2031	33.073	2,19
Totale Obbligazioni ed effetti societari (Costo 686.4745)	610.374	40,36	IDR 222.343.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR96, 7,000%, scadenza 15/02/2033	15.246	1,01
Obbligazioni ed effetti governativi — 40,49% (28 febbraio 2023: 40,57%)			Kenya — 0,22% (28 febbraio 2023: 0,22%)		
Angola — 0,20% (28 febbraio 2023: 0,17%)			3.870 Republic of Kenya Government International Bond, 7,250%, scadenza 28/02/2028		
2.000 Angolan Government International Bond, 8,250%, scadenza 09/05/2028	1.754	0,12	3.293	0,22	
1.450 Angolan Government International Bond, 144A, 8,750%, scadenza 14/04/2032	1.196	0,08			
	2.950	0,20			
Australia — 0,63% (28 febbraio 2023: 0,74%)			Messico — 5,99% (28 febbraio 2023: 5,39%)		
AUD 18.430 Australia Government Bond, Serie 150, 3,000%, scadenza 21/03/2047	9.494	0,63	MXN 1.344.674 Mexican Bonos, Series M, 7,750%, scadenza 13/11/2042	67.399	4,46
Brasile — 1,32% (28 febbraio 2023: 1,07%)			MXN 453.610 Mexican Bonos, Series M, 8,000%, scadenza 07/11/2047		
BRL 21.530 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2027	4.304	0,28	90.547	5,99	
BRL 81.647 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2031	15.710	1,04			
	20.014	1,32			
Costa d'Avorio — 1,15% (28 febbraio 2023: 1,01%)			Nigeria — 0,18% (28 febbraio 2023: 0,14%)		
EUR 4.020 Ivory Coast Government International Bond, 144A, 4,875%, scadenza 30/01/2032	3.369	0,22	3.240 Nigeria Government International Bond, 6,125%, scadenza 28/09/2028	2.682	0,18
EUR 4.010 Ivory Coast Government International Bond, 4,875%, scadenza 30/01/2032	3.360	0,22	Polonia — 3,56% (28 febbraio 2023: 2,62%)		
590 Ivory Coast Government International Bond, 5,750%, scadenza 31/12/2032	536	0,04	PLN 298.370 Republic of Poland Government Bond, Serie O432, 1,750%, scadenza 25/04/2032	53.849	3,56
7.540 Ivory Coast Government International Bond, 144A, 6,125%, scadenza 15/06/2033	6.472	0,43	Russia — 1,51% (28 febbraio 2023: 0,25%)		
4.164 Ivory Coast Government International Bond, 6,125%, scadenza 15/06/2033	3.574	0,24	RUB 354.791 Russian Federal Bond – OFZ, 0,000%, scadenza 03/02/2027 [†]	1.110	0,07
	17.311	1,15	RUB 1.685.880 Russian Federal Bond – OFZ, 0,000%, scadenza 23/05/2029 [†]	5.275	0,35
Repubblica Dominicana — 0,35% (28 febbraio 2023: 0,35%)			RUB 287.190 Russian Federal Bond – OFZ, 0,000%, scadenza 10/04/2030 [†]		
6.920 Dominican Republic International Bond, 144A, 5,875%, scadenza 30/01/2060	5.336	0,35	RUB 4.428.300 Russian Federal Bond – OFZ, 0,000%, scadenza 10/05/2034 [†]	11.778	0,78
Egitto — 0,28% (28 febbraio 2023: 0,24%)			RUB 1.407.660 Russian Federal Bond – OFZ, 0,000%, scadenza 16/03/2039 [†]		
EGP 22.000 Egypt Government Bond, Serie 7YR, 18,400%, scadenza 30/05/2024	679	0,04	3.744	0,25	
4.620 Egypt Government International Bond, 5,250%, scadenza 06/10/2025	3.592	0,24	22.806	1,51	
	4.271	0,28			
			Sudafrica — 3,03% (28 febbraio 2023: 1,46%)		
			ZAR 1.101.930 Republic of South Africa Government Bond, Serie R209, 6,250%, scadenza 31/03/2036		
			ZAR 271.600 Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 6,500%, scadenza 28/02/2041		
			8.488		
			45.876		
			3,03		
			Stati Uniti — 5,82% (28 febbraio 2023: 14,05%)		
			1.820 Morongo Band of Mission Indians/The, 144A, 7,000%, scadenza 01/10/2039		
			3.500 United States Treasury Note/Bond, 3,875%, scadenza 15/05/2043		
			11.250 United States Treasury Note/Bond, 4,375%, scadenza 15/08/2043		
			1.320 United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/02/2049		
			1.895		
			3.256		
			11.222		
			1.048		
			0,13		
			0,22		
			0,74		
			0,07		

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Contratti (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario		
Obbligazioni ed effetti governativi — (segue)							
Stati Uniti — (segue)							
2.570	Obbligazioni del Tesoro degli Stati Uniti, 1,875%, scadenza 15/11/2051	1.580	0,11	EUR	– Future su valuta euro settembre 2023 Put 1,1050, scadenza 08/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	247	0,02
18.446	United States Treasury Note/Bond, 2,250%, scadenza 15/02/2052	12.450	0,82	– Euro-Bund ottobre 2023 Call 132,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	312	0,02	
16.910	United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/08/2052	13.481	0,89	– Future su valuta yen giapponese settembre 2023 Call 69,50, scadenza 08/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	106	0,01	
27.000	United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 15/11/2052 =	26.060	1,72	1 Future su valuta yen giapponese settembre 2023 Call 70,00, scadenza 08/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	69	0,01	
14.474	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/02/2053	13.044	0,86	1 Valuta FX yen giapponese ottobre 2023 Call 70,00, scadenza 06/10/2023 - Bank of America Merrill Lynch	584	0,04	
2.900	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/05/2053 =	2.616	0,17	1 U.S. 10 anni ottobre 2023 Call 110,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	1.381	0,09	
1.400	United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 15/08/2053	1.381	0,09	– U.S. 10 anni ottobre 2023 Call 110,50, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	207	0,01	
		88.033	5,82	1 U.S. 10 anni ottobre 2023 Call 111,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	605	0,04	
				– U.S. 10 anni ottobre 2023 Put 110,75, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	247	0,02	
Totale Obbligazioni ed effetti governativi (Costo 747.016€)							
		612.189	40,49	1 U.S. 10 anni W1 settembre 2023 Call 109,75, scadenza 01/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	1.271	0,09	
Note di prestito — 1,87% (28 febbraio 2023: 1,98%)							
3.991	1011778 BC ULC, 7,196%, scadenza 14/11/2026 *	3.975	0,26	1 U.S. 5 anni ottobre 2023 Call 106,25, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	1.099	0,07	
1.421	Alterra Mountain Co, 8,946%, scadenza 30/07/2028 *	1.426	0,09	2 U.S. 5 anni ottobre 2023 Call 106,75, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	1.036	0,07	
2.745	Asurion LLC, 9,681%, scadenza 19/08/2028 *	2.657	0,17	1 U.S. 5 anni W1 settembre 2023 Call 106,25, scadenza 01/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	1.033	0,07	
6.033	Charter Communications Operating LLC, 7,116%, scadenza 30/04/2025 *	6.042	0,40	1 U.S. 5 anni W1 settembre 2023 Call 106,50, scadenza 01/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	585	0,04	
1.807	Hunter Douglas Inc, 8,891%, scadenza 09/02/2029 *	1.761	0,12	1 U.S. 5 anni W1 settembre 2023 Put 106,25, scadenza 01/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	21	–	
1.600	Jane Street Group, LLC, 8,196%, scadenza 21/01/2027 *	1.599	0,11	– U.S. Bond ottobre 2023 Call 119,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	948	0,06	
1.315	Phoenix Guarantor Inc, 8,696%, scadenza 05/03/2026 *	1.309	0,09	– U.S. Bond ottobre 2023 Call 120,50, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	633	0,04	
5.685	Prime Security Installations Ltd, 8,182%, scadenza 23/09/2026 *	5.693	0,38	– U.S. Bond ottobre 2023 Call 121,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	357	0,02	
2.358	RegionalCare Hospital Partners Holding, 9,377%, scadenza 16/11/2025 *	2.342	0,15	– U.S. Bond ottobre 2023 Call 122,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	255	0,02	
1.550	Virgin Media Bristol LLC, 7,925%, scadenza 04/01/2028 *	1.510	0,10	1 U.S. Bond ottobre 2023 Call 123,50, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	561	0,04	
		28.314	1,87	1 U.S. Bond ottobre 2023 Call 126,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	187	0,01	
Totale Titoli di credito (Costo 28.551€)							
Obbligazioni municipali — 0,86% (28 febbraio 2023: 0,61%)							
4.240	City of Detroit MI, 4,000%, scadenza 01/04/2044	3.173	0,21	– US Long Bond W1 settembre 2023 Call 119,00, scadenza 01/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	1.064	0,07	
950	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 3,706%, scadenza 15/05/2120	617	0,04	1 US Long Bond W1 settembre 2023 Call 119,50, scadenza 01/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	1.306	0,09	
9.530	State of Illinois, 5,100%, scadenza 01/06/2033	9.257	0,61	16.066 USD Put/MNR Call 82,00, scadenza 16/09/2023 - JP Morgan	6	–	
		13.047	0,86	16.066 USD Put/MNR Call 82,00, scadenza 19/12/2023 - JP Morgan	58	–	
Totale Obbligazioni municipali (Costo 13.943€)							
Organismi di investimento collettivo — 0,11% (28 febbraio 2023: 0,87%)							
1.606	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	1.606	0,11	Totale opzioni acquistate (Costo 19.225€)			
		1.606	0,11	Swap su indici — 6,68% (28 febbraio 2023: 6,92%)			
Totale Organismi di investimento collettivo (Costo 1.606€)							
Azioni ordinarie — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)							
Svizzera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)							
41.200	Credit Suisse Group AG Escrow †	–	–	Apprezamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)			
		–	–	100.987	6,68		
Totale Azioni ordinarie (Costo –€)							
Totale Investimenti e investimenti costituiti in pegno al valore equo rilevato a conto economico (Costo 1.708.031€)							
		1.489.432	98,50	Swap di tassi d'interesse — 0,83% (28 febbraio 2023: 0,12%)			
				Apprezamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)			
				12.503	0,83		
				Contratti a termine in valuta estera — 0,89% (28 febbraio 2023: 1,01%)			
				Apprezamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)			
				13.409	0,89		
				Futures — 3,64% (28 febbraio 2023: 0,96%)			
				Apprezamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)			
				54.997	3,64		
				Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico			
				1.692.854	111,96		
				Contratti (in migliaia)			
				Opzioni scritte — (3,03%) (28 febbraio 2023: (2,17%))			
				– Futures SOFR 1 anno Mid-Curve 3 mesi dicembre 2023 Call 96,75, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch			
				(51)	–		
				(7) Futures SOFR 1 anno Mid-Curve 3 mesi dicembre 2023 Call 97,00, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch			
				(1.023)	(0,07)		
				(2) Futures SOFR 1 anno Mid-Curve 3 mesi dicembre 2023 Put 95,25, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch			
				(385)	(0,03)		
				(3) Futures SOFR 1 anno Mid-Curve 3 mesi dicembre 2023 Put 95,3750, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch			
				(1.165)	(0,08)		
				(1) Futures SOFR 1 anno Mid-Curve 3 mesi ottobre 2023 Put 96,25, scadenza 13/10/2023 - Bank of America Merrill Lynch			
				(1.608)	(0,11)		
				Contratti (in migliaia)			
				Opzioni scritte — (3,03%) (28 febbraio 2023: (2,17%))			
				– Futures SOFR 1 anno Mid-Curve 3 mesi dicembre 2023 Call 96,75, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch			
				(51)	–		
				(7) Futures SOFR 1 anno Mid-Curve 3 mesi dicembre 2023 Call 97,00, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch			
				(1.023)	(0,07)		
				(2) Futures SOFR 1 anno Mid-Curve 3 mesi dicembre 2023 Put 95,25, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch			
				(385)	(0,03)		
				(3) Futures SOFR 1 anno Mid-Curve 3 mesi dicembre 2023 Put 95,3750, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch			
				(1.165)	(0,08)		
				(1) Futures SOFR 1 anno Mid-Curve 3 mesi ottobre 2023 Put 96,25, scadenza 13/10/2023 - Bank of America Merrill Lynch			
				(1.608)	(0,11)		

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Contratti (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Contratti (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Opzioni scritte — (segue)					
(1) Futures SOFR 1 anno Mid-Curve 3 mesi ottobre 2023 Put 96,50, scadenza 13/10/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(2.303)	(0,15)	(1) U.S. Bond ottobre 2023 Call 124,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(330)	(0,02)
(2) Futures CME 3 mesi SOFR dicembre 2023 Call 94,75, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(517)	(0,03)	(2) U.S. Bond ottobre 2023 Call 125,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(854)	(0,06)
(1) Futures CME 3 mesi SOFR dicembre 2023 Call 95,00, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(202)	(0,01)	- U.S. Bond ottobre 2023 Call 130,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(19)	-
(3) Futures CME 3 mesi SOFR dicembre 2023 Call 95,50, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(341)	(0,02)	- U.S. Bond ottobre 2023 Put 117,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(40)	-
- Futures CME 3 mesi SOFR dicembre 2023 Call 95,75, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(11)	-	(1) U.S. Bond ottobre 2023 Put 118,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(324)	(0,02)
(4) Futures SOFR 3 mesi CME dicembre 2023 Call 97,25, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(136)	(0,01)	- U.S. Bond ottobre 2023 Put 119,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(51)	-
(6) Futures SOFR 3 mesi CME dicembre 2023 Call 98,1250, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(156)	(0,01)	- U.S. Bond ottobre 2023 Put 120,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(309)	(0,02)
(1) Futures CME 3 mesi SOFR dicembre 2023 Put 94,50, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(175)	(0,01)	- U.S. Bond ottobre 2023 Put 121,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(199)	(0,01)
(8) Futures CME 3 mesi SOFR dicembre 2023 Put 95,50, scadenza 15/12/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(18.997)	(1,26)	(1) US Long Bond W1 settembre 2023 Call 120,00, scadenza 01/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(1.698)	(0,11)
(1) Futures SOFR 3 mesi CME marzo 2024 Put 95,00, scadenza 15/03/2024 - Bank of America Merrill Lynch	(852)	(0,06)	(15.910) USD Call/BRL Put 4,9620, scadenza 20/09/2023 - Morgan Stanley	(193)	(0,01)
- Future valuta Euro ottobre 2023 Call 1,09, scadenza 06/10/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(120)	(0,01)	(15.910) USD Put/BRL Call 4,9620, scadenza 20/09/2023 - Morgan Stanley	(187)	(0,01)
- Future valuta Euro ottobre 2023 Call 1,10, scadenza 06/10/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(67)	-	Totale opzioni scritte (Costo 5(48.781))	(45.858)	(3,03)
EUR - Euro-Bund ottobre 2023 Put 130,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(121)	(0,01)	Credit Default Swap — (0,11%) (28 febbraio 2023: (0,03%))		
EUR (1) Euro-Bund ottobre 2023 Put 131,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(518)	(0,03)	Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(1.582)	(0,11)
EUR (1) Euro-Bund ottobre 2023 Put 132,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(698)	(0,05)	Swap su indici — (1,60%) (28 febbraio 2023: (0,92%))		
- Future su valuta yen giapponese settembre 2023 Call 71,00, scadenza 08/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(2)	-	Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(24.167)	(1,60)
- Future su valuta yen giapponese settembre 2023 Call 71,50, scadenza 08/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(1)	-	Interest Rate Swap — (1,82%) (28 febbraio 2023: (1,07%))		
(1) US 10 anni novembre 2023 Call 111,00, scadenza 27/10/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(1.195)	(0,08)	Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(27.540)	(1,82)
(1) US 10 anni novembre 2023 Call 112,50, scadenza 27/10/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(601)	(0,04)	Contratti a termine in valuta estera — (0,95%) (28 febbraio 2023: (2,05%))		
(1) US 10 anni novembre 2023 Call 113,00, scadenza 27/10/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(370)	(0,02)	Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(14.349)	(0,95)
(1) U.S. 10 anni ottobre 2023 Call 112,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(210)	(0,01)	Futures — (3,58%) (28 febbraio 2023: (2,21%))		
- U.S. 10 anni ottobre 2023 Call 112,50, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(93)	(0,01)	Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(54.049)	(3,58)
(5) U.S. 10 anni ottobre 2023 Call 113,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(704)	(0,05)	Totale Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(167.545)	(11,09)
- U.S. 10 anni ottobre 2023 Put 109,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(31)	-	Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	1.525.309	100,87
(1) U.S. 10 anni ottobre 2023 Put 110,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(392)	(0,03)	Passività eccedenti le altre attività	(13.149)	(0,87)
(1) U.S. 10 anni ottobre 2023 Put 110,50, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(408)	(0,03)	Patrimonio in gestione	1.512.160\$	100,00
(1) U.S. 10 anni ottobre 2023 Put 111,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(433)	(0,03)			
(2) U.S. 2 anni ottobre 2023 Call 102,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(592)	(0,04)	- Gli importi indicati con “-” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.		
(1) US 5 anni novembre 2023 Call 107,50, scadenza 27/10/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(555)	(0,04)	144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 265.530.000\$, ovvero al 17,57% dell'attivo netto.		
(2) U.S. 5 anni ottobre 2023 Call 106,50, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(1.334)	(0,09)	* Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.		
(1) U.S. 5 anni ottobre 2023 Call 107,75, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(133)	(0,01)	+ Illiquido.		
(1) U.S. 5 anni ottobre 2023 Call 108,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(266)	(0,02)	∞ Il titolo è valutato in buona fede al valore equo o a discrezione del Comitato di valutazione.		
(2) U.S. 5 anni ottobre 2023 Call 109,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(146)	(0,01)	≠ Titolo costituito in pegno (interamente o parzialmente) come garanzia per la negoziazione di derivati al 31 agosto 2023.		
- U.S. 5 anni ottobre 2023 Put 105,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(19)	-	± Titoli acquistati su base to be announced.		
(2) U.S. 5 anni ottobre 2023 Put 106,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(446)	(0,03)	γ Titolo che non matura più reddito durante e/o dopo l'esercizio finanziario chiuso al 31 agosto 2023 a causa dell'incertezza dei pagamenti degli interessi.		
(1) U.S. 5 anni ottobre 2023 Put 106,50, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(231)	(0,01)			
(3) U.S. 5 anni W1 settembre 2023 Call 106,00, scadenza 01/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(2.718)	(0,18)	ABBREVIAZIONI:		
(1) U.S. Bond novembre 2023 Put 118,00, scadenza 27/10/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(581)	(0,04)	Perpetual - Obbligazione senza scadenza. Le obbligazioni perpetual non sono riscattabili ma garantiscono interessi costanti.		
- U.S. Bond ottobre 2023 Call 120,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(239)	(0,02)	REMIC - Real Estate Mortgage Investment Conduit.		
(1) U.S. Bond ottobre 2023 Call 123,00, scadenza 22/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(508)	(0,03)	TBA - To Be Announced.		
			AUD - Dollaro australiano		
			BRL - Real brasiliano		
			EGP - Sterlina egiziana		
			EUR - Euro		
			GBP - Sterlina britannica		
			HUF - Fiorino ungherese		
			IDR - Rupia indonesiana		
			INR - Rupia indiana		
			MXN - Peso messicano		
			PLN - Zloty polacco		
			RUB - Rublo russo		
			ZAR - Rand sudafricano		

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

	% delle Attività totali
Analisi delle attività totali	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	77,03
Altri valori mobiliari negoziati su un altro mercato regolamentato	1,49
Organismi di investimento collettivo	0,08
Strumenti finanziari derivati	10,74
Altre attività	10,66
Totale Attività	100,00

Prospetto dei Credit default swap

Controparte	Entità di riferimento – Protezione acquisto/vendita	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000% – Acquisto	20-giu-2028	9.923	\$ (278)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000% – Acquisto	20-giu-2028	71.900	(1.111)
Bank of America Merrill Lynch	Teva Pharmaceutical Industries Ltd, 1,000% – Vendita	20-giu-2026	12.479	(193)
Apprezamento non realizzato di Credit default swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 5.762\$)				\$ –
Deprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (520)\$)				(1.582)
Ammortamento netto dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 5.242\$)				\$ (1.582)

Prospetto degli Interest Rate Swap

Controparte	Tasso	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 3,550%	01-mar-2025	2.219.704	\$ (26.833)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 11,993%	04-gen-2027	496.488	2.559
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIE Banxico, Receive Fixed 9,260%	25-ott-2032	1.009.497	1.912
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIE Banxico, Receive Fixed 8,450%	01-mar-2033	640.415	(707)
BNP Paribas	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 12,610%	02-gen-2029	679.541	7.142
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 12,893%	02-gen-2029	73.048	890
Apprezamento non realizzato degli Interest Rate Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 2.585\$)				\$ 12.503
Deprezzamento non realizzato degli Interest Rate Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (22.883)\$)				(27.540)
Deprezzamento netto degli Interest Rate Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (20.298)\$)				\$ (15.037)

Prospetto degli Index Swaps

Controparte	Entità di riferimento	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520%, Receive Floating USD SOFR Compound	15-feb-2047	26.146	\$ 8.742
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,500%, Receive Floating USD SOFR Compound	21-apr-2052	111.770	20.918
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,600%, Receive Floating USD SOFR Compound	15-feb-2048	261.696	43.970
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,850%, Receive Floating USD SOFR Compound	15-feb-2029	25.846	1.425
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,050%, Receive Floating USD SOFR Compound	15-feb-2048	38.696	3.730
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,150%, Receive Floating USD SOFR Compound	15-mag-2048	44.912	3.597
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,220%, Receive Floating USD SOFR Compound	15-mag-2032	230.335	10.330
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,270%, Receive Floating USD SOFR Compound	30-apr-2029	116.556	4.097
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,850%, Receive Floating USD SOFR Compound	30-giu-2029	23.101	129
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 1,396%	13-ott-2025	582.851	(14.081)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 3,400%	21-giu-2025	826.407	(7.760)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 4,000%	29-feb-2028	531.450	305
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 4,180%	29-feb-2028	498.040	3.744
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 4,600%	04-giu-2024	354.373	(2.326)
Apprezamento non realizzato di Index Swaps (28 febbraio 2023 (in migliaia): 147.520\$)				\$ 100.987
Deprezzamento non realizzato degli Index Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (19.599)\$)				(24.167)
Apprezamento netto degli Index Swaps (28 febbraio 2023 (in migliaia): 127.921\$)				\$ 76.820

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)		Valuta vendita (in migliaia)		Apprezamento/Deprezzamento non realizzato su contratti (in migliaia)		
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	39.976	Vendita	BRL	195.607	\$ 508
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1.440	Vendita	BRL	7.175	(8)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	4	Vendita	CHF	4	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	354	Vendita	EUR	324	2
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	–	Vendita	GBP	–	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	56	Vendita	GBP	44	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	11	Vendita	NOK	116	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	74	Vendita	USD	48	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	62	Vendita	USD	67	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	72	Vendita	USD	53	–

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NOK	23	Vendita	USD	2	\$ -
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	BRL	202.782	Vendita	USD	42.695	(1.780)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	30	Vendita	USD	38	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	76	Vendita	AUD	116	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1.591	Vendita	AUD	2.479	(13)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	901	Vendita	CHF	793	6
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	166	Vendita	CHF	147	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	29	Vendita	CNH	211	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	85	Vendita	CNH	627	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	21.893	Vendita	EUR	20.043	142
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1.673	Vendita	EUR	1.546	(6)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	5.084	Vendita	GBP	3.993	21
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	132	Vendita	GBP	104	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	631	Vendita	JPY	90.997	3
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1.549	Vendita	JPY	225.757	(6)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	143	Vendita	NOK	1.486	1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	76	Vendita	NOK	801	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	48	Vendita	PLN	199	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	40	Vendita	SEK	444	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	20	Vendita	SEK	226	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	53	Vendita	SGD	72	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1.911	Vendita	SGD	2.588	(6)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	JPY	7.368.520	Vendita	USD	51.522	(755)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	12	Vendita	USD	14	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	377.463	Vendita	USD	415.138	(5.537)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	46.660	Vendita	USD	34.721	(173)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	1.280	Vendita	USD	948	1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH	497	Vendita	USD	68	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CHF	-	Vendita	USD	1	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	47.263	Vendita	USD	30.900	(259)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	1.147	Vendita	USD	741	1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	417	Vendita	USD	451	1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NOK	193	Vendita	USD	18	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	PLN	5.067	Vendita	USD	1.243	(16)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	4	Vendita	USD	-	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	15.069	Vendita	USD	1.410	(35)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NOK	37.670	Vendita	USD	3.687	(141)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	61.363	Vendita	USD	78.143	(405)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH	19.036	Vendita	USD	2.641	(23)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CHF	18.402	Vendita	USD	21.068	(204)
20-set-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	4.667	Vendita	RUB	338.380	1.159
20-set-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	7.381	Vendita	INR	606.961	46
03-ott-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	2.644	Vendita	BRL	13.000	33
03-ott-2023	BNY Mellon	Acquisto	BRL	187.700	Vendita	USD	38.175	(470)
20-ott-2023	Bank of America Merrill Lynch	Acquisto	USD	3.253	Vendita	EUR	3.000	(8)
20-ott-2023	Bank of America Merrill Lynch	Acquisto	USD	4.345	Vendita	GBP	3.410	26
20-ott-2023	Bank of America Merrill Lynch	Acquisto	USD	1.507	Vendita	JPY	219.000	(11)
20-ott-2023	Bank of America Merrill Lynch	Acquisto	USD	53.026	Vendita	PLN	218.312	247
20-ott-2023	Bank of America Merrill Lynch	Acquisto	USD	36.723	Vendita	TWD	1.138.961	730
20-ott-2023	Bank of America Merrill Lynch	Acquisto	AUD	8.600	Vendita	USD	5.660	(78)
20-ott-2023	Bank of America Merrill Lynch	Acquisto	GBP	8.010	Vendita	USD	10.343	(195)
20-ott-2023	Bank of America Merrill Lynch	Acquisto	EUR	2.950	Vendita	USD	3.281	(74)
20-ott-2023	Bank of America Merrill Lynch	Acquisto	TWD	19.728	Vendita	USD	621	3
20-ott-2023	Bank of America Merrill Lynch	Acquisto	JPY	1.155.000	Vendita	USD	8.017	(14)
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD	8.726	Vendita	NOK	88.076	429
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	NOK	360.721	Vendita	USD	33.945	35
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	KRW	43.312.887	Vendita	USD	33.439	(661)
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	CAD	56.254	Vendita	USD	42.447	(784)
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	AUD	67.276	Vendita	USD	44.966	(1.293)
20-ott-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	63.100	Vendita	MXN	1.096.623	(630)
20-ott-2023	Goldman Sachs	Acquisto	MXN	16.381	Vendita	USD	961	(9)
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	3.116	Vendita	CNH	22.291	45
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	18.586	Vendita	HUF	6.687.871	(242)
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	99.676	Vendita	IDR	1.505.267.629	911
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	17.115	Vendita	MXN	290.466	235
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	CNH	22.291	Vendita	USD	3.117	(45)
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	COP	32.482.100	Vendita	USD	7.648	174
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	19.111	Vendita	ZAR	362.607	(3)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	15.185	Vendita	CNH	109.335	120
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	7.871	Vendita	COP	32.482.100	49
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	20.624	Vendita	EUR	18.679	320

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)		Valuta vendita (in migliaia)		Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)		
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	66.150	Vendita	GBP	51.499	\$ 901
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	43.434	Vendita	INR	3.589.152	92
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	19.501	Vendita	INR	1.616.645	(22)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	195.080	Vendita	JPY	27.183.749	6.708
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	16.964	Vendita	MXN	287.712	244
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	16.462	Vendita	MYR	75.281	175
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	BRL	101.634	Vendita	USD	20.537	(167)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	CNH	109.335	Vendita	USD	15.261	(196)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	MYR	75.281	Vendita	USD	16.310	(23)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	GBP	8.750	Vendita	USD	11.143	(57)
20-dic-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	6.783	Vendita	INR	559.782	41
Apprezamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 21.504\$)							\$	13.409
Deprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (43.616)\$)								(14.349)
Deprezzamento netto dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (22.112)\$)							\$	(940)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(2.417)	\$ (571.620)	\$ 896
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	935	224.003	(937)
Indice SOFR a 3 mesi marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	1.591	377.067	(809)
Indice SOFR a 3 mesi settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(4.585)	(1.084.209)	4.224
Valuta Dollaro australiano dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(50)	(3.250)	–
Valuta Dollaro australiano settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	922	59.727	(1.286)
Sterlina britannica dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(100)	(7.916)	37
Valuta sterlina britannica settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(292)	(23.114)	177
Valuta Dollaro canadese settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(590)	(43.651)	735
Euribor 3 mesi dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	1.788	465.995	(257)
Valuta Euro FX dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(24)	(3.270)	15
Valuta Euro FX settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(416)	(56.433)	1.206
Euro-Bund dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(756)	(108.726)	(979)
Euro-Buxl 30 Year Bond dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	161	23.352	349
Obbligazione Euro-Buxl a 30 anni settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	40	5.803	230
Fed Fund 30 giorni agosto 2023	Bank of America Merrill Lynch	(7.532)	(2.971.298)	199
Fed Fund 30 giorni settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(56)	(22.089)	1
ICE 3 mesi SONIA dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	1.330	397.160	(1.287)
ICE 3 mesi SONIA giugno 2024	Bank of America Merrill Lynch	1.352	404.179	100
Japan 10 Year Bond (OSE) settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(661)	(667.020)	4.925
Valuta yen giapponese dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(278)	(24.301)	(47)
Valuta yen giapponese settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	2.826	243.460	(12.122)
Long Gilt dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	338	40.921	724
Valuta peso messicano settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	3.062	89.946	1.416
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(16.133)	(1.791.267)	(15.224)
U.S. 10 Year Ultra Note dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(8.421)	(977.757)	(14.383)
U.S. 2 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	3.662	746.333	2.480
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(9.577)	(1.023.991)	(6.718)
U.S. Long Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	14.987	1.823.731	30.929
U.S. Ultra Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	2.496	323.154	6.354
Apprezamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 20.467\$)				\$ 54.997
Deprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (47.194)\$)				(54.049)
Apprezamento netto di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (26.727)\$)				\$ 948

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario		
Titoli garantiti da attività — 12,81% (28 febbraio 2023: 14,21%)							
140	AB BSL CLO 4 Ltd, serie 2023 4A, Classe A, 144A, 6,957%, scadenza 20/04/2036 *	141	0,05	710	National Collegiate II Commutation Trust, Serie 2005 AR15, Classe AR15, 0,000%, scadenza 01/06/2045	80	0,03
68	ABFC 2003-OPT1 Trust, Serie 2003 OPT1, Classe A3, 6,109%, scadenza 25/04/2033 *	65	0,02	600	National Collegiate Student Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Classe B, 5,809%, scadenza 26/03/2035 *	529	0,18
1.274	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Serie 2005-HE3, Serie 2005 HE3, Classe M4, 6,374%, scadenza 25/05/2035 *	1.144	0,40	65	National Collegiate Student Loan Trust 2006-1, Serie 2006 1, Classe A5, 5,779%, scadenza 25/03/2033 *	62	0,02
617	Aegis Asset Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Cfts Ser 2005-4, Serie 2005 4, Classe M2, 6,134%, scadenza 25/10/2035 *	573	0,20	790	National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Serie 2006 3, Classe B, 5,789%, scadenza 26/01/2032 *	599	0,21
950	AGL CLO 12 Ltd, Serie 2021 12A, Classe D, 144A, 8,438%, scadenza 20/07/2034 *	918	0,32	730	National Collegiate Student Loan Trust 2007-2, Serie 2007 2, Classe A4, 5,719%, scadenza 25/01/2033 *	679	0,24
450	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd, Serie 2014 3RA, Classe E, 144A, 11,127%, scadenza 28/01/2031 *	416	0,15	1.302	National Collegiate V Commutation Trust, Serie 2007 33A6, Classe 10, 144A, 0,000%, scadenza 25/03/2038 *	309	0,11
480	Bain Capital Credit CLO 2022-2 Ltd, Serie 2022 2A, Classe D1, 144A, 8,996%, scadenza 22/04/2035 *	471	0,16	2.291	National Collegiate VI 2007-4 Classe A-3L Commutation Trust, Serie 2007 4VI, Classe O, 144A, 6,279%, scadenza 29/03/2038 *	409	0,14
660	Bain Capital Credit CLO 2023-1 Ltd, Serie 2023 1A, Classe AN, 144A, 6,573%, scadenza 16/04/2036 *	661	0,23	1.000	Ocean Trails CLO V, Serie 2014 5A, Classe DRR, 144A, 9,013%, scadenza 13/10/2031 *	903	0,32
1.380	Ballyrock CLO 19 Ltd, Serie 2022 19A, Classe D, 144A, 12,436%, scadenza 20/04/2035 *	1.307	0,46	600	Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Classe AR, 144A, 6,790%, scadenza 15/10/2034 *	592	0,21
1.225	Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Serie 2018 1A, Classe C, 144A, 8,738%, scadenza 20/04/2031 *	1.204	0,42	650	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, Serie 2018 1A, Classe C, 144A, 8,188%, scadenza 20/01/2031 *	607	0,21
720	Barings CLO Ltd 2016-II, Serie 2016 2A, Classe ER2, 144A, 12,088%, scadenza 20/01/2032 *	679	0,24	940	Option One Mortgage Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Classe M4, 6,359%, scadenza 25/08/2035 *	739	0,26
447	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Serie 2005 CL1, Classe A1, 3,646%, scadenza 25/09/2034 *	434	0,15	256	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Classe 1A1, 5,866%, scadenza 25/01/2037	205	0,07
520	Birch Grove CLO 6 Ltd, Serie 2023 6A, classe D, 144A, 11,119%, scadenza 20/07/2035 *	527	0,18	516	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Classe 2A1, 5,866%, scadenza 25/01/2037	425	0,15
500	Black Diamond Clo 2019-2 Ltd, serie 2019 2A, classe A1A, 144A, 7,037%, scadenza 23/07/2032 *	499	0,17	618	RAMP Serie 2006-NC3 Trust, Serie 2006 NC3, Classe M1, 5,939%, scadenza 25/03/2036 *	594	0,21
1.000	BlueMountain CLO XXII Ltd, Serie 2018 22A, Classe A1, 144A, 6,650%, scadenza 15/07/2031 *	995	0,35	1.320	Saranac CLO III Ltd, Serie 2014 3A, Classe DR, 144A, 8,770%, scadenza 22/06/2030 *	1.110	0,39
720	CarVal CLO VII-C Ltd, serie 2023 1A, classe A1, 144A, 7,526%, scadenza 20/01/2035 *	724	0,25	320	SMB Private Education Loan Trust 2015-C, Serie 2015 C, Classe C, 144A, 4,500%, scadenza 17/09/2046	296	0,10
850	CIFC Funding 2018-I Ltd, Serie 2018 1A, Classe C, 144A, 7,322%, scadenza 18/04/2031 *	835	0,29	1.153	Sunrun Athena Issuer 2018-1 LLC, Serie 2018 1, Classe A, 144A, 5,310%, scadenza 30/04/2049	1.075	0,38
17	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2005-D, Serie 2005 D, Classe 2A, 5,615%, scadenza 15/11/2035 *	17	0,01	540	Symphony CLO 37 Ltd, Serie 2022 37A, Classe A1A, 144A, 7,626%, scadenza 20/10/2034 *	542	0,19
493	Educational Funding Co LLC/The, Serie 2006 1A, Classe A3, 144A, 5,963%, scadenza 25/04/2033 *	338	0,12	750	Voya CLO 2016-3 Ltd, Serie 2016 3A, Classe A1R, 144A, 6,762%, scadenza 18/10/2031 *	749	0,26
660	Encore Credit Receivables Trust 2005-2, Serie 2005 2, Classe M4, 6,359%, scadenza 25/11/2035 *	604	0,21	639	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Serie 2007-HE4 Trust, Serie 2007 HE4, Classe 1A, 5,599%, scadenza 25/07/2047 *	446	0,16
74	First Franklin Mortgage Loan Trust 2003-FF4, Serie 2003 FF4, Classe M1, 7,233%, scadenza 25/10/2033 *	70	0,02	600	Warwick Capital CLO 1 Ltd, Serie 2023 1A, Classe D, 144A, 0,000%, scadenza 20/10/2036 *	600	0,21
1.125	FOCUS Brands Funding LLC, Serie 2017 1A, Classe A2II, 144A, 5,093%, scadenza 30/04/2047	1.051	0,37	Totale Titoli garantiti da attività (Costo 38.754\$)		36.735	12,81
540	FS Rialto 2022-FL6 Issuer LLC, Serie 2022 FL6, Classe A, 144A, 7,894%, scadenza 17/08/2037 *	542	0,19	Titoli garantiti da ipoteca — 11,72% (28 febbraio 2023: 12,42%)			
850	Goldentree Loan Management US Clo 3 Ltd, serie 2018 3A, classe D, 144A, 8,438%, scadenza 20/04/2030 *	839	0,29	271	Alternative Loan Trust 2007-4CB, Serie 2007 4CB, Classe 1A5, 5,750%, scadenza 25/04/2037	226	0,08
1.000	Golub Capital Partners CLO 21M Ltd, Serie 2014 21A, Classe CR, 144A, 8,063%, scadenza 25/01/2031 *	956	0,33	167	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Serie 2016 GG10, Classe AJA, 144A, 5,810%, scadenza 10/08/2045 *	36	0,01
1.000	Golub Capital Partners CLO 53B Ltd, Serie 2021 53A, Classe E, 144A, 12,288%, scadenza 20/07/2034 *	936	0,33	546	Banc of America Funding Corp, Serie 2015 R3, Classe 1A2, 144A, 2,951%, scadenza 27/03/2036 *	443	0,15
150	Golub Capital Partners CLO 66B Ltd, Serie 2023 66A, Classe A, 144A, 6,926%, scadenza 25/04/2036 *	150	0,05	780	BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Classe A4, 3,175%, scadenza 15/09/2060	716	0,25
132	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Serie 2021 4GS, Classe A, 144A, 1,930%, scadenza 20/07/2048	100	0,03	140	BBCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Classe D, 144A, 4,715%, scadenza 10/08/2033 *	111	0,04
250	Greenwood Park CLO Ltd, Serie 2018 1A, Classe E, 144A, 10,520%, scadenza 15/04/2031 *	207	0,07	840	BBSG 2016-MRP Mortgage Trust, Serie 2016 MRP, Classe A, 144A, 3,275%, scadenza 05/06/2036	683	0,24
1.000	Grippen Park CLO Ltd, Serie 2017 1A, Classe D, 144A, 8,888%, scadenza 20/01/2030 *	982	0,34	510	BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Classe C, 144A, 7,507%, scadenza 15/07/2035 *	490	0,17
1.400	Harriman Park CLO Ltd, Serie 2020 1A, Classe ER, 144A, 11,988%, scadenza 20/04/2034 *	1.309	0,46	520	BX Trust 2021-VIEW, Serie 2021 VIEW, Classe C, 144A, 7,774%, scadenza 15/06/2036 *	482	0,17
145	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Classe C, 144A, 7,127%, scadenza 16/06/2036 *	135	0,05	341	BXMT 2020-FL2 Ltd, Serie 2020 FL2, Classe A, 144A, 6,328%, scadenza 15/02/2038 *	329	0,11
170	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Classe D, 144A, 7,777%, scadenza 16/06/2036 *	157	0,05	430	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Serie 2014 GC23, Classe C, 4,572%, scadenza 10/07/2047 *	399	0,14
537	Home Equity Asset Trust 2006-4, Serie 2006 4, Classe 2A4, 5,989%, scadenza 25/08/2036 *	521	0,18	770	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Serie 2017 P8, Classe A3, 3,203%, scadenza 15/09/2050	706	0,25
703	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Serie INABS 2005-C, Serie 2005 C, Classe M2, 6,179%, scadenza 25/10/2035 *	681	0,24	11.041	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Serie 2017 P8, Classe XA, 1,010%, scadenza 15/09/2050 *	294	0,10
225	Long Beach Mortgage Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Classe M4, 6,704%, scadenza 25/02/2035 *	218	0,08	586	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C5, Serie 2018 C5, Classe A3, 3,963%, scadenza 10/06/2051	542	0,19
1.000	Magnetite XII Ltd, Serie 2015 12A, Classe ER, 144A, 11,250%, scadenza 15/10/2031 *	958	0,33	710	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Serie 2015 DC1, Classe C, 4,438%, scadenza 10/02/2048 *	585	0,20
1.270	Marble Point CLO XIV Ltd, Serie 2018 2A, Classe D, 144A, 9,118%, scadenza 20/01/2032 *	1.186	0,41	520	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R03, Serie 2019 R03, Classe 1B1, 144A, 9,502%, scadenza 25/09/2031 *	546	0,19
533	Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE2, Serie 2007 HE2, Classe A1, 6,579%, scadenza 25/08/2037 *	442	0,15	360	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Classe 1B1, 144A, 8,802%, scadenza 25/10/2039 *	366	0,13
322	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, Serie 2018 1A, Classe CERT, 144A, 0,000%, scadenza 22/06/2043 ∞	209	0,07	260	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Serie 2020 R01, Classe 1B1, 144A, 8,652%, scadenza 25/01/2040 *	261	0,09
1.243	Mosaic Solar Loan Trust 2022-1, Serie 2022 1A, Classe B, 144A, 3,160%, scadenza 20/01/2053	984	0,34	723	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Classe 1B1, 144A, 8,388%, scadenza 25/10/2041 *	721	0,25
				670	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Classe 1M2, 144A, 6,838%, scadenza 25/10/2041 *	661	0,23
				190	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Serie 2021 R03, Classe 1B1, 144A, 8,038%, scadenza 25/12/2041 *	188	0,07

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
700 Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Serie 2022 R04, Classe 1M2, 144A, 8,388%, scadenza 25/03/2042 *	711	0,25	220 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQ2R, Classe A3, 144A, 1,353%, scadenza 25/10/2058 *	196	0,07
250 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, Serie 2023 R05, Classe 1M2, 144A, 8,396%, scadenza 25/06/2043 *	255	0,09	419 Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Serie 2015 4R, Classe 2A2, 144A, 2,903%, scadenza 26/10/2036 *	359	0,12
940 CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust, Serie 2016 C5, Classe A5, 3,757%, scadenza 15/11/2048	895	0,31	242 PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 8,883%, scadenza 29/10/2024 *	238	0,08
360 CSAIL 2017-C8 Commercial Mortgage Trust, Serie 2017 C8, Classe C, 4,432%, scadenza 15/06/2050 *	294	0,10	391 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-1, Serie 2017 1, Classe M1, 144A, 4,000%, scadenza 25/01/2056 *	387	0,13
1.480 CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Classe F, 144A, 4,373%, scadenza 15/09/2037	582	0,20	1.141 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-1, Serie 2018 1, Classe M, 4,750%, scadenza 25/05/2057 *	1.059	0,37
630 CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Classe F, 144A, 9,794%, scadenza 15/07/2032 *	581	0,20	790 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-4, Serie 2018 4, Classe M, 144A, 4,750%, scadenza 25/03/2058	685	0,24
585 DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Classe 1A1B, 5,568%, scadenza 19/04/2047 *	484	0,17	422 Sequoia Mortgage Trust 2007-2, Serie 2007 2, Classe 1A3, 6,068%, scadenza 20/06/2036 *	389	0,14
630 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C07, Classe 1B1, 9,402%, scadenza 25/05/2030 *	673	0,23	250 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Classe C, 144A, 8,500%, scadenza 15/11/2027 *	26	0,01
556 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Classe 1B1, 8,952%, scadenza 25/07/2030 *	589	0,21	410 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Classe D, 144A, 8,500%, scadenza 15/11/2027 *	16	0,01
600 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 4,500% ±	569	0,20	370 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Classe E, 144A, 8,500%, scadenza 15/11/2027 *†	2	–
91 Fannie Mae Pool "CB3880", 5,000%, scadenza 01/06/2052	89	0,03	853 Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Serie 2018 THL, Classe D, 144A, 7,731%, scadenza 11/11/2034 *	831	0,29
520 Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, Serie 2020 DNA1, Classe B1, 144A, 7,702%, scadenza 25/01/2050 *	517	0,18	834 Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Serie 2018 THL, Classe E, 144A, 8,911%, scadenza 11/11/2034 *	808	0,28
500 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA5, Serie 2020 DNA5, Classe B1, 144A, 10,088%, scadenza 25/10/2050 *	541	0,19	891 Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Serie 2018 THL, Classe F, 144A, 9,684%, scadenza 11/11/2034 *	859	0,30
680 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, Serie 2020 DNA6, Classe B1, 144A, 8,288%, scadenza 25/12/2050 *	673	0,23	34 Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Serie 2007-C33, Serie 2007 C33, Classe AJ, 5,926%, scadenza 15/02/2051 *	30	0,01
580 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Serie 2021 DNA3, Classe B1, 144A, 8,788%, scadenza 25/10/2033 *	598	0,21	99 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR17 Trust, Serie 2005 AR17, Classe A1C3, 6,389%, scadenza 25/12/2045 *	64	0,02
600 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Serie 2021 DNA5, Classe B1, 144A, 8,338%, scadenza 25/01/2034 *	598	0,21	2.284 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR2 Trust, Serie 2005 AR2, Classe B1, 6,224%, scadenza 25/01/2045 *	1.858	0,65
290 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Classe B1, 144A, 8,688%, scadenza 25/10/2041 *	291	0,10	320 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2006-AR13 Trust, Serie 2006 AR13, Classe 2A, 5,930%, scadenza 25/10/2046 *	288	0,10
164 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 SP11, Classe B, 144A, 4,118%, scadenza 25/09/2047 *	109	0,04	127 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2006-AR3 Trust, Serie 2006 AR3, Classe A1B, 5,430%, scadenza 25/02/2046 *	111	0,04
356 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2021 DNA2, Classe M2, 144A, 7,588%, scadenza 25/08/2033 *	356	0,12	651 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Serie 2015 C28, Classe D, 4,216%, scadenza 15/05/2048 *	516	0,18
590 GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-375H, Serie 2017 375H, Classe A, 144A, 3,591%, scadenza 10/09/2037 *	524	0,18	724 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38, Serie 2017 C38, Classe A4, 3,190%, scadenza 15/07/2050	665	0,23
457 GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Classe C, 144A, 9,675%, scadenza 15/09/2031 *	167	0,06	Totale Titoli garantiti da ipoteca (Costo 37.9245)	33.630	11,72
750 GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30, Serie 2015 GC30, Classe D, 3,384%, scadenza 10/05/2050	602	0,21	Obbligazioni ed effetti societari — 60,62% (28 febbraio 2023: 59,17%)		
58 GSMPS Mortgage Loan Trust 2006-RP1, Serie 2006 RP1, Classe 1A2, 144A, 7,500%, scadenza 25/01/2036	51	0,02	Argentina — 0,35% (28 febbraio 2023: 0,35%)		
330 Hilton USA Trust 2016-HHV, Serie 2016 HHV, Classe D, 144A, 4,333%, scadenza 05/11/2038 *	303	0,11	410 Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750%, scadenza 02/05/2025	388	0,13
1.199 Impac Secured Assets Trust 2006-3, Serie 2006 3, Classe A7, 5,969%, scadenza 25/11/2036 *	957	0,33	290 YPF SA, 144A, 8,500%, scadenza 28/07/2025	274	0,10
340 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE, Serie 2016 NINE, Classe A, 144A, 2,949%, scadenza 06/09/2038 *	304	0,11	420 YPF SA, 144A, 6,950%, scadenza 21/07/2027	355	0,12
1.010 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Serie 2018 PHMZ, Classe M, 144A, 13,933%, scadenza 15/06/2035 *†	–	–		1.017	0,35
1 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12, Serie 2007 LD12, Classe AJ, 6,561%, scadenza 15/02/2051 *	1	–	Belgio — 0,37% (28 febbraio 2023: 0,37%)		
900 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Serie 2018 WPT, Classe FFL, 144A, 8,705%, scadenza 05/07/2033 *	725	0,25	EUR 1.000 Gruppo KBC NV, 4,750%, Perpetual *	1.068	0,37
280 JP Morgan Resecuritization Trust Serie 2009-10, Serie 2009 10, Classe 7A2, 144A, 5,018%, scadenza 26/02/2037 *	116	0,04	Bermuda — 0,39% (28 febbraio 2023: 0,38%)		
31 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Classe AJ, 5,450%, scadenza 12/08/2048 *	8	–	40 Aspen Insurance Holdings Ltd, 4,650%, scadenza 15/11/2023	40	0,02
31 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Classe AJFL, 144A, 5,450%, scadenza 12/08/2048 *	8	–	1.130 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625%, scadenza 15/10/2025	1.068	0,37
500 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C27, Serie 2015 C27, Classe A4, 3,753%, scadenza 15/12/2047	476	0,17		1.108	0,39
381 Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP, Serie 2018 MP, Classe A, 144A, 4,419%, scadenza 11/07/2040 *	312	0,11	Brasile — 0,88% (28 febbraio 2023: 1,03%)		
150 Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-2AR, Serie 2005 2AR, Classe B1, 5,929%, scadenza 25/04/2035 *	113	0,04	460 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125%, scadenza 20/09/2031	389	0,14
880 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Classe D, 144A, 4,544%, scadenza 15/08/2036 *	564	0,20	350 Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 4,500%, scadenza 10/01/2028	319	0,11
361 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Classe E, 144A, 4,544%, scadenza 15/08/2036 *	194	0,07	370 MercadoLibre Inc, 3,125%, scadenza 14/01/2031	297	0,10
687 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Serie 2016 3A, Classe B2, 144A, 4,250%, scadenza 25/09/2056 *	628	0,22	490 Petrobras Global Finance BV, 6,850%, scadenza 05/06/2115	430	0,15
			800 Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125%, scadenza 15/01/2032	633	0,22
			450 Vale Overseas Ltd, 6,875%, scadenza 10/11/2039	470	0,16
				2.538	0,88
			Canada — 2,90% (28 febbraio 2023: 2,18%)		
			780 Air Canada, 144A, 3,875%, scadenza 15/08/2026	721	0,25
			120 ATS Corp, 144A, 4,125%, scadenza 15/12/2028	107	0,04
			770 Bombardier Inc, 144A, 7,875%, scadenza 15/04/2027	769	0,27
			250 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375%, scadenza 15/01/2028	236	0,08
			CAD 420 Doman Building Materials Group Ltd, 144A, 5,250%, scadenza 15/05/2026	273	0,09
			600 GFL Environmental Inc, 144A, 5,125%, scadenza 15/12/2026	581	0,20
			1.300 GFL Environmental Inc, 144A, 4,750%, scadenza 15/06/2029	1.179	0,41
			280 Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500%, scadenza 01/04/2026	264	0,09
			390 Hudbay Minerals Inc, 144A, 6,125%, scadenza 01/04/2029	367	0,13

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Canada — (segue)					
440 MEG Energy Corp, 144A, 7,125%, scadenza 01/02/2027	446	0,16			
1.050 MEG Energy Corp, 144A, 5,875%, scadenza 01/02/2029	1.004	0,35			
500 Open Text Corp, 144A, 3,875%, scadenza 15/02/2028	445	0,15			
270 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125%, scadenza 15/02/2030	233	0,08			
250 Superior Plus LP / Superior General Partner Inc, 144A, 4,500%, scadenza 15/03/2029	220	0,08			
400 Toronto-Dominion Bank/The, 8,125%, scadenza 31/10/2082 *	403	0,14			
250 TransAlta Corp, 7,750%, scadenza 15/11/2029	259	0,09			
860 TransAlta Corp, 6,500%, scadenza 15/03/2040	823	0,29			
	8.330	2,90			
Isole Cayman — 0,42% (28 febbraio 2023: 0,42%)					
1.274 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500%, scadenza 15/09/2024	1.198	0,42			
Cile — 0,17% (28 febbraio 2023: 0,21%)					
803 VTR Comunicaciones SpA, 144A, 5,125%, scadenza 15/01/2028	498	0,17			
Cina — 0,18% (28 febbraio 2023: 0,30%)					
400 Country Garden Holdings Co Ltd, 8,000%, scadenza 27/01/2024	51	0,01			
200 Prosperous Ray Ltd, 4,625%, scadenza 12/11/2023	199	0,07			
370 Prosus NV, 144A, 3,061%, scadenza 13/07/2031	281	0,10			
	531	0,18			
Danimarca — 0,28% (28 febbraio 2023: 0,29%)					
800 Danske Bank A/S, 144A, 6,466%, scadenza 09/01/2026 *	801	0,28			
Francia — 0,76% (28 febbraio 2023: 0,74%)					
200 Altice France SA/France, 144A, 8,125%, scadenza 01/02/2027	169	0,06			
550 BNP Paribas SA, 144A, 7,750%, Perpetual *	536	0,19			
1.470 Credit Agricole SA, 144A, 8,125%, Perpetual *	1.469	0,51			
	2.174	0,76			
Germania — 0,75% (28 febbraio 2023: 0,78%)					
320 Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 144A, 5,500%, scadenza 15/01/2028	290	0,10			
620 Mercer International Inc, 5,125%, scadenza 01/02/2029	508	0,18			
EUR 100 Nidda BondCo GmbH, 5,000%, scadenza 30/09/2025	108	0,04			
800 ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750%, scadenza 29/04/2025	778	0,27			
460 ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125%, scadenza 14/04/2030	466	0,16			
	2.150	0,75			
Guatemala — 0,10% (28 febbraio 2023: 0,11%)					
363 Millicom International Cellular SA, 144A, 4,500%, scadenza 27/04/2031	287	0,10			
Hong Kong — 0,29% (28 febbraio 2023: 0,29%)					
230 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 4,875%, scadenza 06/06/2025	219	0,08			
730 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375%, scadenza 04/12/2029	613	0,21			
	832	0,29			
Irlanda — 0,32% (28 febbraio 2023: 0,33%)					
630 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300%, scadenza 30/01/2032	512	0,18			
420 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,250%, scadenza 15/04/2026	397	0,14			
	909	0,32			
Israele — 0,70% (28 febbraio 2023: 0,50%)					
1.030 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150%, scadenza 01/02/2036	950	0,33			
500 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750%, scadenza 09/05/2027	468	0,16			
550 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125%, scadenza 15/09/2031	584	0,21			
	2.002	0,70			
Italia — 0,45% (28 febbraio 2023: 0,46%)					
230 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710%, scadenza 15/01/2026	221	0,08			
530 UniCredit SpA, 144A, 7,296%, scadenza 02/04/2034 *	511	0,18			
640 UniCredit SpA, 144A, 5,459%, scadenza 30/06/2035 *	556	0,19			
	1.288	0,45			
Kazakistan — 0,20% (28 febbraio 2023: 0,20%)					
380 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 4,750%, scadenza 19/04/2027	358	0,13			
230 QazaqGaz NC JSC, 144A, 4,375%, scadenza 26/09/2027	212	0,07			
	570	0,20			
Kuwait — 0,19% (28 febbraio 2023: 0,27%)					
530 MEGlobal Canada ULC, 144A, 5,875%, scadenza 18/05/2030	536	0,19			
Lussemburgo — 0,98% (28 febbraio 2023: 0,94%)					
370 Altice Financing SA, 144A, 5,000%, scadenza 15/01/2028	301	0,11			
1.650 Altice France Holding SA, 144A, 10,500%, scadenza 15/05/2027	897	0,31			
500 ARD Finance SA, 144A, 6,500%, scadenza 30/06/2027	402	0,14			
570 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250%, scadenza 01/04/2028	636	0,22			
587 FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 144A, 5,625%, scadenza 15/08/2026	565	0,20			
	2.801	0,98			
Macao — 0,80% (28 febbraio 2023: 0,82%)					
270 Sands China Ltd, 5,375%, scadenza 08/08/2025	261	0,09			
200 Sands China Ltd, 5,650%, scadenza 08/08/2028	189	0,06			
200 Sands China Ltd, 3,100%, scadenza 08/03/2029	167	0,06			
200 Sands China Ltd, 3,500%, scadenza 08/08/2031	161	0,06			
1.550 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875%, scadenza 01/10/2024	1.515	0,53			
	2.293	0,80			
Malesia — 0,11% (28 febbraio 2023: 0,12%)					
490 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064%, scadenza 19/08/2050	327	0,11			
Messico — 0,32% (28 febbraio 2023: 0,35%)					
1.020 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,500%, Perpetual *	931	0,32			
Paesi Bassi — 0,46% (28 febbraio 2023: 0,48%)					
EUR 1.000 Cooperativa Rabobank UA, 4,625%, Perpetual *	993	0,35			
EUR 310 Stichting AK Rabobank Certificaten, 6,500%, Perpetual	314	0,11			
	1.307	0,46			
Singapore — 0,08% (28 febbraio 2023: 0,08%)					
220 Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250%, scadenza 19/06/2024	217	0,08			
Sudafrica — 0,09% (28 febbraio 2023: 0,09%)					
310 Sasol Financing USA LLC, 5,500%, scadenza 18/03/2031	248	0,09			
Svizzera — 1,53% (28 febbraio 2023: 1,75%)					
720 Credit Suisse AG/New York NY, 4,750%, scadenza 08/09/2024	710	0,25			
250 Credit Suisse AG/New York NY, 3,625%, scadenza 09/09/2024	243	0,08			
500 Credit Suisse AG/New York NY, 7,950%, scadenza 01/09/2025	510	0,18			
1.500 UBS Group AG, 144A, 7,000%, Perpetual *	1.491	0,52			
640 Vistajet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 7,875%, scadenza 01/05/2027	580	0,20			
920 Vistajet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 9,500%, scadenza 01/06/2028	850	0,30			
	4.384	1,53			
Emirati Arabi Uniti — 0,08% (28 febbraio 2023: 0,23%)					
260 DP World Ltd/Emirati Arabi Uniti, 144A, 5,625%, scadenza 25/09/2048	241	0,08			
Regno Unito — 2,01% (28 febbraio 2023: 1,64%)					
210 Barclays Plc, 7,750%, Perpetual *	211	0,07			
GBP 680 Gatwick Airport Finance Plc, 4,375%, scadenza 07/04/2026	791	0,28			
EUR 320 Lloyds Banking Group Plc, 4,947%, Perpetual *	324	0,11			
250 Lloyds Banking Group Plc, 7,500%, Perpetual *	244	0,08			
480 Lloyds Banking Group Plc, 8,000%, Perpetual *	436	0,15			
442 McLaren Finance Plc, 144A, 7,500%, scadenza 01/08/2026	392	0,14			
GBP 970 NatWest Group Plc, 4,500%, Perpetual *	937	0,33			
690 Neptune Energy Bondco Plc, 144A, 6,625%, scadenza 15/05/2025	687	0,24			
GBP 800 Saga Plc, 5,500%, scadenza 15/07/2026	775	0,27			
750 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500%, scadenza 15/05/2029	687	0,24			
330 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750%, scadenza 15/07/2031	276	0,10			
	5.760	2,01			
Stati Uniti — 43,34% (28 febbraio 2023: 42,60%)					
574 Abercrombie & Fitch Management Co., 144A, 8,750%, scadenza 15/07/2025	585	0,20			
1.103 Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000%, scadenza 01/03/2028	1.145	0,40			
330 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000%, scadenza 01/05/2028	268	0,09			
630 AdaptHealth LLC, 144A, 6,125%, scadenza 01/08/2028	569	0,20			
286 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500%, scadenza 01/03/2028	267	0,09			
690 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375%, scadenza 15/06/2030	680	0,24			
447 Akumin Escrow Inc, 144A, 7,500%, scadenza 01/08/2028	297	0,10			
300 Akumin Inc, 144A, 7,000%, scadenza 01/11/2025	227	0,08			
240 Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,125%, scadenza 15/05/2028	237	0,08			
1.310 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500%, scadenza 15/02/2028	751	0,26			
300 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625%, scadenza 15/07/2026	286	0,10			

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario		
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)			450	CommScope Inc, 144A, 6,000%, scadenza 01/03/2026	409	0,14	
Stati Uniti — (segue)			620	CommScope Inc, 144A, 4,750%, scadenza 01/09/2029	461	0,16	
340	Altria Group Inc, 5,950%, scadenza 14/02/2049	317	0,11	910	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750%, scadenza 15/01/2031	870	0,30
300	AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500%, scadenza 15/02/2029	205	0,07	910	CoreCivic Inc, 8,250%, scadenza 15/04/2026	914	0,32
293	American Airlines 2017-1 Class B Pass Through Trust, Series B, 4,950%, scadenza 15/02/2025	284	0,10	350	Crescent Energy Finance LLC, 144A, 9,250%, scadenza 15/02/2028	358	0,13
430	American Airlines Inc, 144A, 7,250%, scadenza 15/02/2028	423	0,15	310	Crowdstrike Holdings Inc, 3,000%, scadenza 15/02/2029	267	0,09
28	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500%, scadenza 20/04/2026	27	0,01	450	CSC Holdings LLC, 5,250%, scadenza 01/06/2024	427	0,15
720	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750%, scadenza 20/04/2029	689	0,24	1.260	CSC Holdings LLC, 144A, 7,500%, scadenza 01/04/2028	802	0,28
1.220	American News Co LLC, 144A, 8,500%, scadenza 01/09/2026	1.377	0,48	1.190	CSC Holdings LLC, 144A, 11,250%, scadenza 15/05/2028	1.175	0,41
190	Antero Resources Corp, 144A, 5,375%, scadenza 01/03/2030	178	0,06	470	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125%, scadenza 01/12/2030	478	0,17
210	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000%, scadenza 15/06/2027	205	0,07	300	Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875%, scadenza 01/09/2031	303	0,11
480	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000%, scadenza 01/09/2029	391	0,14	520	CVS Health Corp, 5,250%, scadenza 21/02/2033	509	0,18
740	AthenaHealth Group Inc, 144A, 6,500%, scadenza 15/02/2030	643	0,22	1.000	Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000%, scadenza 15/06/2030	978	0,34
90	Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,500%, scadenza 15/12/2024	89	0,03	470	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750%, scadenza 15/09/2037	497	0,17
350	Ball Corp, 2,875%, scadenza 15/08/2030	287	0,10	1.430	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875%, scadenza 15/08/2027	1.269	0,44
340	Ball Corp, 3,125%, scadenza 15/09/2031	276	0,10	800	DISH DBS Corp, 5,875%, scadenza 15/11/2024	745	0,26
320	Bath & Body Works Inc, 5,250%, scadenza 01/02/2028	307	0,11	400	DISH DBS Corp, 144A, 5,750%, scadenza 01/12/2028	311	0,11
510	Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625%, scadenza 01/10/2030	498	0,17	1.210	DISH Network Corp, zero coupon, scadenza 15/12/2025	785	0,27
340	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500%, scadenza 01/11/2025	307	0,11	116	Diversified Healthcare Trust, 9,750%, scadenza 15/06/2025	114	0,04
280	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125%, scadenza 01/02/2027	184	0,06	760	DraftKings Holdings Inc, zero coupon, scadenza 15/03/2028	583	0,20
140	Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000%, scadenza 15/01/2028	64	0,02	490	Earthstone Energy Holdings LLC, 144A, 9,875%, scadenza 15/07/2031	538	0,19
70	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,000%, scadenza 30/01/2028	30	0,01	623	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750%, scadenza 30/01/2028	610	0,21
280	Beacon Roofing Supply Inc, 144A, 6,500%, scadenza 01/08/2030	277	0,10	220	Energy Transfer LP, 5,350%, scadenza 15/05/2045	188	0,07
1.540	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000%, scadenza 15/02/2026	1.482	0,52	260	Energy Transfer LP, 6,250%, scadenza 15/04/2049	249	0,09
320	Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625%, scadenza 01/09/2028	297	0,10	320	Energy Transfer LP, Serie G, 7,125%, Perpetual *	284	0,10
1.140	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625%, scadenza 15/12/2025	1.144	0,40	260	Entegris Inc, 144A, 4,375%, scadenza 15/04/2028	237	0,08
360	Boeing Co/The, 3,250%, scadenza 01/02/2035	289	0,10	330	Enterprise Products Operating LLC, 5,375%, scadenza 15/02/2078 *	275	0,10
500	Boeing Co/The, 5,805%, scadenza 01/05/2050	487	0,17	170	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000%, scadenza 01/07/2025	169	0,06
480	Boyer USA Inc, 144A, 4,750%, scadenza 15/05/2029	434	0,15	190	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500%, scadenza 01/07/2027	189	0,07
520	Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250%, scadenza 01/02/2032	443	0,15	740	EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500%, scadenza 01/06/2030	760	0,27
480	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875%, scadenza 15/04/2030	441	0,15	360	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000%, scadenza 01/07/2025	360	0,13
370	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250%, scadenza 01/07/2031	375	0,13	80	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500%, scadenza 01/07/2027	84	0,03
1.220	Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000%, scadenza 15/02/2030	1.226	0,43	770	EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500%, scadenza 01/06/2030	700	0,24
1.160	Carnival Corp, 144A, 5,750%, scadenza 01/03/2027	1.093	0,38	80	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500%, scadenza 01/07/2027	84	0,03
290	Carnival Corp, 144A, 4,000%, scadenza 01/08/2028	260	0,09	190	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500%, scadenza 01/07/2027	189	0,07
180	Carnival Corp, 144A, 7,000%, scadenza 15/08/2029	183	0,06	740	EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500%, scadenza 01/06/2030	760	0,27
150	Carnival Corp, 144A, 10,500%, scadenza 01/06/2030	160	0,06	360	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000%, scadenza 01/07/2025	360	0,13
160	Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875%, scadenza 15/10/2029	120	0,04	80	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500%, scadenza 01/07/2027	84	0,03
460	Carriage Services Inc, 144A, 4,250%, scadenza 15/05/2029	400	0,14	770	EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500%, scadenza 01/06/2030	700	0,24
1.330	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 7,375%, scadenza 01/03/2031	1.323	0,46	250	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500%, scadenza 01/07/2027	236	0,08
870	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500%, scadenza 01/05/2032	706	0,25	220	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500%, scadenza 01/07/2027	185	0,06
120	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500%, scadenza 01/06/2033	95	0,03	426	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875%, scadenza 15/11/2025	398	0,14
380	CDW LLC / CDW Finance Corp, 4,125%, scadenza 01/05/2025	368	0,13	830	Foot Locker Inc, 144A, 4,000%, scadenza 01/10/2029	625	0,22
170	CDW LLC / CDW Finance Corp, 3,250%, scadenza 15/02/2029	148	0,05	1.300	Ford Motor Co, 3,250%, scadenza 12/02/2032	1.016	0,35
1.290	Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250%, scadenza 15/06/2029	1.274	0,44	1.780	Ford Motor Co, 6,100%, scadenza 19/08/2032	1.702	0,59
60	Charles Schwab Corp/The, 2,900%, scadenza 03/03/2032	50	0,02	450	Ford Motor Credit Co LLC, 5,125%, scadenza 16/06/2025	438	0,15
320	Charles Schwab Corp/The, 5,853%, scadenza 19/05/2034 *	321	0,11	200	Ford Motor Credit Co LLC, 3,625%, scadenza 17/06/2031	162	0,06
320	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200%, scadenza 15/03/2028	298	0,10	1.930	Freemont-McMoran Inc, 5,450%, scadenza 15/03/2043	1.734	0,60
680	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400%, scadenza 01/04/2033	599	0,21	1.370	Full House Resorts Inc, 144A, 8,250%, scadenza 15/02/2028	1.220	0,43
210	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, scadenza 01/04/2038	178	0,06	480	Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000%, scadenza 01/11/2026	412	0,14
420	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125%, scadenza 01/07/2049	323	0,11	220	Gartner Inc, 144A, 3,625%, scadenza 15/06/2029	193	0,07
1.020	Chord Energy Corp, 144A, 6,375%, scadenza 01/06/2026	1.006	0,35	1.440	Gen Digital Inc, 144A, 7,125%, scadenza 30/09/2030	1.451	0,51
430	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000%, scadenza 15/03/2026	420	0,15	540	GEO Group Inc/The, 10,500%, scadenza 30/06/2028	541	0,19
1.050	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125%, scadenza 01/04/2030	605	0,21	950	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875%, scadenza 15/12/2028	830	0,29
490	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 4,750%, scadenza 15/02/2031	365	0,13	440	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750%, scadenza 20/01/2026	408	0,14
470	Citigroup Inc, Serie W, 4,000%, Perpetual *	422	0,15	650	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 6,250%, scadenza 15/04/2032	597	0,21
610	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 144A, 8,500%, scadenza 15/05/2027	617	0,22	580	Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,750%, scadenza 15/01/2027	559	0,20
1.380	Comerica Bank, 2,500%, scadenza 23/07/2024	1.314	0,46	340	Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 8,875%, scadenza 15/07/2028	352	0,12
				500	Humana Inc, 5,875%, scadenza 01/03/2033	518	0,18
				1.120	IIP Operating Partnership LP, 5,500%, scadenza 25/05/2026	994	0,35
				1.380	Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 4,500%, scadenza 15/11/2029	1.213	0,42
				270	Jazz Securities DAC, 144A, 4,375%, scadenza 15/01/2029	242	0,08
				60	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,250%, scadenza 01/02/2027	54	0,02
				220	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,750%, scadenza 15/06/2029	185	0,06
				1.130	Las Vegas Sands Corp, 3,200%, scadenza 08/08/2024	1.095	0,38
				100	Las Vegas Sands Corp, 3,500%, scadenza 18/08/2026	93	0,03
				300	Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 4,375%, scadenza 15/02/2027	260	0,09
				620	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144A, 5,000%, scadenza 01/02/2026	583	0,20
				370	LifePoint Health Inc, 144A, 9,875%, scadenza 15/08/2030	366	0,13

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Stati Uniti — (segue)					
490 LPL Holdings Inc, 144A, 4,000%, scadenza 15/03/2029	436	0,15	550 Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 6,000%, scadenza 01/11/2028	529	0,18
290 Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,625%, scadenza 01/06/2028	268	0,09	1.240 Southwestern Energy Co, 8,375%, scadenza 15/09/2028	1.292	0,45
302 McClatchy Co LLC/The, 144A, 11,000%, scadenza 15/07/2027	334	0,12	880 Southwestern Energy Co, 4,750%, scadenza 01/02/2032	781	0,27
780 Medline Borrower LP, 144A, 5,250%, scadenza 01/10/2029	693	0,24	508 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000%, scadenza 20/09/2025	509	0,18
660 Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875%, scadenza 01/05/2029	458	0,16	610 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000%, scadenza 20/09/2025	611	0,21
560 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500%, scadenza 01/05/2028	499	0,17	500 Sprint Capital Corp, 8,750%, scadenza 15/03/2032	596	0,21
160 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500%, scadenza 20/06/2027	160	0,06	530 StoneMor Inc, 144A, 8,500%, scadenza 15/05/2029	443	0,15
300 Minerals Technologies Inc, 144A, 5,000%, scadenza 01/07/2028	276	0,10	565 StoneX Group Inc, 144A, 8,625%, scadenza 15/06/2025	573	0,20
930 Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 13,250%, scadenza 15/12/2027	990	0,35	320 Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp, 144A, 9,000%, scadenza 15/10/2026	309	0,11
670 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500%, scadenza 15/03/2031	435	0,15	490 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875%, scadenza 01/09/2026	432	0,15
90 MSCI Inc, 144A, 3,875%, scadenza 15/02/2031	79	0,03	260 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000%, scadenza 31/12/2030	233	0,08
1.480 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875%, scadenza 15/03/2026	1.397	0,49	1.010 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875%, scadenza 01/02/2031	929	0,32
410 NCR Corp, 144A, 5,125%, scadenza 15/04/2029	373	0,13	190 Tenet Healthcare Corp, 4,625%, scadenza 15/06/2028	175	0,06
300 Newell Brands Inc, 4,000%, scadenza 01/12/2024	292	0,10	310 Time Warner Cable LLC, 6,750%, scadenza 15/06/2039	300	0,10
410 Newell Brands Inc, 4,700%, scadenza 01/04/2026	393	0,14	260 Titan International Inc, 7,000%, scadenza 30/04/2028	1.450	0,51
250 Newell Brands Inc, 5,875%, scadenza 01/04/2036	222	0,08	120 TKC Holdings Inc, 144A, 6,875%, scadenza 15/05/2028	235	0,08
140 Newell Brands Inc, 6,000%, scadenza 01/04/2046	114	0,04	780 TopBuild Corp, 144A, 3,625%, scadenza 15/03/2029	672	0,23
570 NMI Holdings Inc, 144A, 7,375%, scadenza 01/06/2025	574	0,20	710 TransDigm Inc, 144A, 6,250%, scadenza 15/03/2026	704	0,25
300 Noble Finance II LLC, 144A, 8,000%, scadenza 15/04/2030	310	0,11	200 TransDigm Inc, 144A, 6,750%, scadenza 15/08/2028	201	0,07
900 Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125%, scadenza 01/03/2028	903	0,32	238 Transocean Inc, 144A, 8,750%, scadenza 15/02/2030	243	0,09
2.790 Northwest Acquisitions LLC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125%, scadenza 01/11/2022	—	—	1.220 Triumph Group Inc, 144A, 9,000%, scadenza 15/03/2028	1.230	0,43
390 Occidental Petroleum Corp, 7,150%, scadenza 15/05/2028	403	0,14	300 Truist Financial Corp, 5,122%, scadenza 26/01/2034 *	282	0,10
690 Occidental Petroleum Corp, 6,450%, scadenza 15/09/2036	706	0,25	410 Truist Financial Corp, 5,867%, scadenza 08/06/2034 *	406	0,14
1.380 Occidental Petroleum Corp, 7,950%, scadenza 15/06/2039	1.552	0,54	1.660 Tutor Perini Corp, 144A, 6,875%, scadenza 01/05/2025	1.503	0,52
140 Occidental Petroleum Corp, 4,400%, scadenza 15/08/2049	100	0,04	52 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875%, scadenza 15/01/2026	50	0,02
120 Olin Corp, 5,000%, scadenza 01/02/2030	110	0,04	80 United Airlines Inc, 144A, 4,375%, scadenza 15/04/2026	75	0,03
1.050 Option Care Health Inc, 144A, 4,375%, scadenza 31/10/2029	925	0,32	490 United Airlines Inc, 144A, 4,625%, scadenza 15/04/2029	1.327	0,46
210 Pactiv LLC, 8,375%, scadenza 15/04/2027	212	0,07	280 United Rentals North America Inc, 5,500%, scadenza 15/05/2027	275	0,10
1.104 Park-Ohio Industries Inc, 6,625%, scadenza 15/04/2027	959	0,33	170 United Rentals North America Inc, 4,875%, scadenza 15/01/2028	162	0,06
390 Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000%, scadenza 15/06/2029	331	0,12	520 United Rentals North America Inc, 144A, 6,000%, scadenza 15/12/2029	517	0,18
430 PECF USS Intermediate Holding III Corp, 144A, 8,000%, scadenza 15/11/2029	275	0,10	930 United Rentals North America Inc, 5,250%, scadenza 15/01/2030	885	0,31
1.580 Permian Resources Operating LLC, 144A, 5,875%, scadenza 01/07/2029	1.525	0,53	140 Upbound Group Inc, 144A, 6,375%, scadenza 15/02/2029	127	0,04
570 Plains All American Pipeline LP, Serie B, 9,736%, Perpetual *	526	0,18	310 US Bancorp, 4,839%, scadenza 01/02/2034 *	288	0,10
1.090 PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500%, scadenza 01/10/2028	1.051	0,37	430 US Bancorp, 5,836%, scadenza 12/06/2034 *	430	0,15
370 PNC Financial Services Group Inc/The, 6,037%, scadenza 28/10/2033 *	376	0,13	154 US Renal Care Inc, 144A, 10,625%, scadenza 28/06/2028	99	0,03
350 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,068%, scadenza 24/01/2034 *	332	0,12	970 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 6,250%, scadenza 15/01/2030	946	0,33
880 Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 3,375%, scadenza 31/08/2027	783	0,27	180 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 4,125%, scadenza 15/08/2031	153	0,05
350 QVC Inc, 4,850%, scadenza 01/04/2024	340	0,12	120 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875%, scadenza 01/11/2033	98	0,03
750 QVC Inc, 4,450%, scadenza 15/02/2025	675	0,24	410 Venture Global LNG Inc, 144A, 8,375%, scadenza 01/06/2031	414	0,14
310 QVC Inc, 4,375%, scadenza 01/09/2028	176	0,06	170 Vericast Corp, 144A, 11,000%, scadenza 15/09/2026	178	0,06
420 Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500%, scadenza 15/02/2028	200	0,07	200 Vericast Corp, 144A, 12,500%, scadenza 15/12/2027	227	0,08
370 Radiology Partners Inc, 144A, 9,250%, scadenza 01/02/2028	146	0,05	830 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125%, scadenza 15/11/2028	746	0,26
1.140 Range Resources Corp, 8,250%, scadenza 15/01/2029	1.185	0,41	160 Viavi Solutions Inc, 144A, 3,750%, scadenza 01/10/2029	133	0,05
30 Range Resources Corp, 144A, 4,750%, scadenza 15/02/2030	27	0,01	490 Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125%, scadenza 15/07/2031	507	0,18
1.580 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 3,625%, scadenza 01/03/2029	1.346	0,47	190 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625%, scadenza 15/02/2029	177	0,06
230 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 4,000%, scadenza 15/10/2033	182	0,06	880 Viper Energy Partners LP, 144A, 5,375%, scadenza 01/11/2027	849	0,30
590 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 7,500%, scadenza 15/07/2038	561	0,20	630 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000%, scadenza 15/02/2028	585	0,20
134 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,500%, scadenza 01/06/2025	142	0,05	340 Warnermedia Holdings Inc, 3,755%, scadenza 15/03/2027	319	0,11
490 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250%, scadenza 01/07/2026	457	0,16	450 Western Midstream Operating LP, 3,100%, scadenza 01/02/2025	431	0,15
310 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,625%, scadenza 15/08/2027	338	0,12	990 Western Midstream Operating LP, 5,450%, scadenza 01/04/2044	833	0,29
280 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 9,250%, scadenza 15/01/2029	299	0,10	1.000 Western Midstream Operating LP, 5,300%, scadenza 01/03/2048	821	0,29
240 RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,750%, scadenza 31/07/2028	240	0,08	170 Williams Cos Inc/The, 8,750%, scadenza 15/03/2032	199	0,07
970 Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 5,625%, scadenza 01/12/2025	964	0,34	490 Winnebago Industries Inc, 144A, 6,250%, scadenza 15/07/2028	477	0,17
200 Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US, 144A, 6,125%, scadenza 01/02/2028	197	0,07	400 WW International Inc, 144A, 4,500%, scadenza 15/04/2029	277	0,10
900 Service Properties Trust, 5,500%, scadenza 15/12/2027	798	0,28	217 XPO CNW Inc, 6,700%, scadenza 01/05/2034	216	0,08
530 Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144A, 4,625%, scadenza 01/11/2026	496	0,17	600 XPO Escrow Sub LLC, 144A, 7,500%, scadenza 15/11/2027	611	0,21
			290 XPO Inc, 144A, 6,250%, scadenza 01/06/2028	285	0,10
			710 Ziff Davis Inc, 144A, 4,625%, scadenza 15/10/2030	611	0,21
				124.303	43,34
			Zambia — 1,12% (28 febbraio 2023: 0,83%)		
			207 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500%, scadenza 01/04/2025	207	0,07
			610 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875%, scadenza 01/03/2026	601	0,21
			1.600 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875%, scadenza 15/10/2027	1.560	0,54

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Zambia — (segue)					
840	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625%, scadenza 01/06/2031	856	0,30		
		3.224	1,12		
Totale Obbligazioni ed effetti societari (Costo 186.150\$)		173.873	60,62		
Obbligazioni ed effetti governativi — 3,60% (28 febbraio 2023: 5,45%)					
Angola — 0,06% (28 febbraio 2023: 0,07%)					
210	Angolan Government International Bond, 144A, 8,750%, scadenza 14/04/2032	173	0,06		
Argentina — 0,59% (28 febbraio 2023: 0,68%)					
8	Argentine Republic Government International Bond, 1,000%, scadenza 09/07/2029	2	–		
47	Argentine Republic Government International Bond, 0,750%, scadenza 09/07/2030	16	–		
300	Ciudad Autonoma De Buenos Aires/Government Bonds, 7,500%, scadenza 01/06/2027	285	0,10		
2.248	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 6,375%, scadenza 01/09/2037	857	0,30		
665	Provincia de Cordoba, 144A, 6,990%, scadenza 01/06/2027	539	0,19		
		1.699	0,59		
Bahamas — 0,19% (28 febbraio 2023: 0,19%)					
550	Bahamas Government International Bond, 144A, 5,750%, scadenza 16/01/2024	544	0,19		
Costa d'Avorio — 0,19% (28 febbraio 2023: 0,26%)					
180	Ivory Coast Government International Bond, 144A, 4,875%, scadenza 30/01/2032	151	0,05		
460	Ivory Coast Government International Bond, 6,125%, scadenza 15/06/2033	395	0,14		
		546	0,19		
Repubblica Dominicana — 0,22% (28 febbraio 2023: 0,23%)					
740	Dominican Republic International Bond, 4,875%, scadenza 23/09/2032	630	0,22		
Indonesia — 1,15% (28 febbraio 2023: 1,35%)					
550	Indonesia Government International Bond, 3,500%, scadenza 11/01/2028	515	0,18		
IDR 25.412.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR59, 7,000%, scadenza 15/05/2027	1.710	0,59		
IDR 15.502.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR87, 6,500%, scadenza 15/02/2031	1.025	0,36		
IDR 721.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR68, 8,375%, scadenza 15/03/2034	54	0,02		
		3.304	1,15		
Giordania — 0,20% (28 febbraio 2023: 0,21%)					
560	Jordan Government International Bond, 144A, 7,750%, scadenza 15/01/2028	576	0,20		
Messico — 0,57% (28 febbraio 2023: 0,65%)					
MXN 8.010	Mexican Bonos, Serie M, 5,750%, scadenza 05/03/2026	425	0,15		
MXN 13.970	Mexican Bonos, Serie M, 8,500%, scadenza 31/05/2029	790	0,28		
480	Mexico Government International Bond, 4,750%, scadenza 08/03/2044	404	0,14		
		1.619	0,57		
Panama — 0,15% (28 febbraio 2023: 0,25%)					
580	Panama Government International Bond, 4,500%, scadenza 01/04/2056	422	0,15		
Perù — 0,20% (28 febbraio 2023: 0,21%)					
690	Peruvian Government International Bond, 2,783%, scadenza 23/01/2031	587	0,20		
Qatar — 0,08% (28 febbraio 2023: 0,20%)					
230	Qatar Government International Bond, 144A, 4,817%, scadenza 14/03/2049	215	0,08		
Totale Obbligazioni ed effetti governativi (Costo 11.237\$)		10.315	3,60		
Note di prestito — 7,03% (28 febbraio 2023: 5,09%)					
430	8th Avenue Food & Provisions Inc, 13,196%, scadenza 01/10/2026 *†	293	0,10		
458	Acrisure LLC, 11,121%, scadenza 15/02/2027 *	460	0,16		
440	Agility Health Inc, 8,247%, scadenza 01/05/2030 *	439	0,15		
113	Allen Media LLC, 10,892%, scadenza 10/02/2027 *	98	0,03		
320	Allied Universal Holdco LLC, 9,881%, scadenza 04/05/2028 *	318	0,11		
3	Allied Universal Holdco LLC, 9,181%, scadenza 14/05/2028 *	3	–		
52	API Group Inc, 7,946%, scadenza 01/10/2026 *	52	0,02		
67	Apollo Group CMR, 8,196%, scadenza 15/05/2026 *	63	0,02		
248	Ascensus Holdings Inc, 8,946%, scadenza 02/08/2028 *	245	0,09		
194	Asurion LLC, 9,431%, scadenza 17/08/2028 *	187	0,07		
192	Asurion LLC, 8,788%, scadenza 18/12/2026 *	187	0,07		
Contratti (in migliaia)					
Opzioni acquistate — 0,10% (28 febbraio 2023: 0,20%)					
	– Futures SOFR 3 mesi CME dicembre 2023 Call 99,25, scadenza 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch				
	– iShares Boxx USD High Yield Corporate Bond ETF settembre 2023 Put 73,00, scadenza 18/09/2023 – Goldman Sachs			2	–
	– S&P 500 E-mini dicembre 2023 Put 4.100,00, scadenza 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch			21	0,01
	– S&P 500 E-mini dicembre 2023 Put 4.200,00, scadenza 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch			48	0,02
Totale Titoli di credito (Costo 20.595\$)					
Azioni ordinarie — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
Svizzera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
	1310 Credit Suisse Group AG Escrow †			–	–
Totale Azioni ordinarie (Costo –\$)				–	–
Azioni privilegiate — 0,39% (28 febbraio 2023: 0,88%)					
Stati Uniti — 0,39% (28 febbraio 2023: 0,88%)					
	34 MPLX LP, Serie A ∞			1.116	0,39
Totale Azioni privilegiate (Costo 1.095\$)				1.116	0,39
Totale Investimenti al valore equo rilevato a conto economico (Costo 295.755\$)					
				275.837	96,17

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Contratti (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Contratti (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Opzioni acquistate — (continua)			Swaptions — (0,03%) (28 febbraio 2023: 0,00%)		
– S&P 500 E-mini dicembre 2023 Put 4.300,00, scadenza 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	44	0,02	Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(73)	(0,03)
– S&P 500 E-mini dicembre 2023 Put 4.400,00, scadenza 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	52	0,02	Contratti a termine in valuta estera — (0,82%) (28 febbraio 2023: (1,08%))		
– S&P 500 E-mini settembre 2023 Put 3.900,00, scadenza 15/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	1	–	Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(2.359)	(0,82)
– S&P 500 E-mini settembre 2023 Put 4.100,00, scadenza 15/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	2	–	Futures — (0,18%) (28 febbraio 2023: (0,32%))		
– S&P 500 E-mini W3 ottobre 2023 Put 4.300,00, scadenza 20/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	28	0,01	Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(504)	(0,18)
– U.S. 10 anni gennaio 2024 Call 118,50, scadenza 22/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	–	–	Totale Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
– U.S. 10 anni ottobre 2023 Call 112,00, scadenza 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	14	0,01	Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
– U.S. 5 anni ottobre 2023 Call 108,00, scadenza 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	7	–	Altre attività eccedenti le passività		
4.100 USD Call/GBP Put 1,2640, scadenza 13/10/2023 – JP Morgan	39	0,01	Patrimonio in gestione		
3.220 USD Put/CAD Call 1,3295, scadenza 09/11/2023 – BNP Paribas	12	–	275.528 96,06		
2.240 USD Put/CAD Call 1,3405, scadenza 18/10/2023 – BNP Paribas	10	–	11.281 3,94		
6.460 USD Put/EUR Call 1,16, scadenza 02/09/2023 – Goldman Sachs	–	–	286.809\$ 100,00		
Totale opzioni acquistate (Costo 589\$)	280	0,10	– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.		
Credit Default Swap — 0,05% (28 febbraio 2023: 0,06%)			144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 164.009.000\$, ovvero allo 57,15% dell'attivo netto.		
Apprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	150	0,05	* Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.		
Swap su indici — 0,20% (28 febbraio 2023: 0,32%)			† Illiquido.		
Apprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	575	0,20	∞ Il titolo è valutato in buona fede al valore equo o a discrezione del Comitato di valutazione.		
Swaptions — 0,02% (28 febbraio 2023: 0,00%)			ε Al 31 agosto 2023 il titolo (capitale e/o interessi) è insolvente.		
Apprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	47	0,02	± Titoli acquistati su base to be announced.		
Contratti a termine in valuta estera — 0,18% (28 febbraio 2023: 0,20%)			ABBREVIAZIONI:		
Apprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	536	0,18	ETF	– Fondo negoziato in borsa	
Futures — 0,51% (28 febbraio 2023: 0,02%)			Perpetual	– Obbligazione senza scadenza. Le obbligazioni perpetual non sono riscattabili ma garantiscono interessi costanti.	
Apprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	1448	0,51	REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.	
Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	278.873	97,23	TBA	– To Be Announced.	
Contratti			CAD	– Dollaro canadese	
(in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	EUR	– Euro	
Opzioni scritte — (0,02%) (28 febbraio 2023: (0,01%))			GBP	– Sterlina britannica	
– S&P 500 E-mini dicembre 2023 Put 3.700,00, scadenza 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(8)	–	IDR	– Rupia indonesiana	
– S&P 500 E-mini dicembre 2023 Put 4.000,00, scadenza 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(38)	(0,02)	MXN	– Peso messicano	
– S&P 500 E-mini settembre 2023 Put 3.500,00, scadenza 15/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	–	–	Analisi delle attività totali		
– S&P 500 E-mini settembre 2023 Put 3.700,00, scadenza 15/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(1)	–	Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato		
– S&P 500 E-mini W3 ottobre 2023 Put 4.000,00, scadenza 20/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(9)	–	Altri valori mobiliari negoziati su un altro mercato regolamentato		
Totale opzioni scritte (Costo \$(170))	(56)	(0,02)	Strumenti finanziari derivati		
Interest Rate Swap — (0,12%) (28 febbraio 2023: (0,28%))			Altre attività		
Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(353)	(0,12)	Totale Attività		
			100,00		

Prospetto dei Credit default swap

Controparte	Entità di riferimento – Protezione acquisto/vendita	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000% – Vendita	20-giu-2028	1.625	\$ 45
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000% – Vendita	20-giu-2028	6.779	105
Apprezzamento non realizzato di Credit default swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 155\$)				\$ 150
Deprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): –\$)				–
Apprezzamento netto dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 155\$)				\$ 150

Prospetto degli Interest Rate Swap

Controparte	Tasso	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,450%	18-lug-2029	80.214	\$ (290)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 10,230%	02-gen-2029	23.600	(63)
Apprezzamento non realizzato degli Interest Rate Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): –\$)				\$ –
Deprezzamento non realizzato degli Interest Rate Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (756\$))				(353)
Deprezzamento netto degli Interest Rate Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (756\$))				\$ (353)

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto degli Index Swaps

Controparte	Entità di riferimento	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,600%, Receive Floating USD SOFR Compound	15-feb-2048	663	\$ 112
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,050%, Receive Floating USD SOFR Compound	15-feb-2048	2.529	244
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,150%, Receive Floating USD SOFR Compound	15-mag-2048	2.739	219
Apprezzamento non realizzato di Index Swaps (28 febbraio 2023 (in migliaia): 878\$)				\$ 575
Deprezzamento non realizzato degli Index Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (5)\$)				–
Apprezzamento netto degli Index Swaps (28 febbraio 2023 (in migliaia): 873\$)				\$ 575

Prospetto degli swaption

Controparte	Descrizione	Data di efficacia	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
JP Morgan	Swaption Receiver Strike 0,70%	21-set-2023	27.567	\$ (73)
JP Morgan	Swaption Receiver Strike 1,02%	21-set-2023	5.513	47
Apprezzamento non realizzato di swaption (28 febbraio 2023 (in migliaia): –\$)				\$ 47
Deprezzamento non realizzato di swaption (28 febbraio 2023 (in migliaia): –\$)				(73)
Deprezzamento netto di swaption (28 febbraio 2023 (in migliaia): –\$)				\$ (26)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)		Valuta vendita (in migliaia)		Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)		
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	5	Vendita	GBP	4	\$ –
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	1	Vendita	USD	2	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	2.541	Vendita	USD	1.878	3
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1.878	Vendita	CAD	2.541	(3)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	45	Vendita	CHF	40	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	438	Vendita	EUR	402	1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	10	Vendita	GBP	8	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	905	Vendita	GBP	712	4
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	852	Vendita	USD	1.073	6
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	144.755	Vendita	USD	184.348	(960)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	55.940	Vendita	USD	61.545	(844)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CHF	3.846	Vendita	USD	4.403	(42)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	24.361	Vendita	USD	18.145	(111)
16-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	GBP	682	Vendita	USD	886	(22)
18-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD	784	Vendita	CAD	1.061	(2)
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD	659	Vendita	AUD	960	36
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD	3.042	Vendita	CAD	4.123	(11)
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD	1.138	Vendita	CAD	1.508	21
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD	741	Vendita	EUR	680	2
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD	2.498	Vendita	NOK	25.330	112
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	AUD	8.320	Vendita	USD	5.553	(151)
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	CAD	4.350	Vendita	USD	3.208	14
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	EUR	2.400	Vendita	USD	2.628	(19)
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	NOK	36.768	Vendita	USD	3.460	3
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	AUD	1.730	Vendita	USD	1.122	1
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	CAD	1.770	Vendita	USD	1.319	(7)
20-ott-2023	Citi	Acquisto	USD	8	Vendita	AUD	12	–
20-ott-2023	Citi	Acquisto	USD	387	Vendita	GBP	295	13
20-ott-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	1.569	Vendita	MXN	27.260	(16)
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	960	Vendita	AUD	1.420	38
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	778	Vendita	IDR	11.746.964	7
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	564	Vendita	NOK	5.720	25
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	–	Vendita	NZD	–	–
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	AUD	1.030	Vendita	USD	680	(11)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	5	Vendita	BRL	23	–
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	711	Vendita	CNH	5.070	13
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	7.955	Vendita	EUR	7.228	99
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	8.264	Vendita	GBP	6.436	110
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	388	Vendita	MXN	6.740	(4)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	GBP	128	Vendita	USD	166	(4)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	EUR	1.580	Vendita	USD	1.712	5
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	GBP	1.830	Vendita	USD	2.307	10
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	CNH	5.073	Vendita	USD	705	(6)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	CAD	3.348	Vendita	USD	2.499	(19)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	NOK	6.170	Vendita	USD	608	(27)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	MXN	6.740	Vendita	USD	383	9
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	JPY	404.154	Vendita	USD	2.900	(100)

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
09-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto	USD	1127	Vendita	CAD	1516	\$ 4
Apprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 536\$)								\$ 536
Deprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (2.965)\$)								(2.359)
Deprezzamento netto dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (2.429)\$)								\$ (1.823)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)				
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(91)	\$ (21.522)	\$ 128				
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	49	11.739	(101)				
Indice SOFR 3 mesi giugno 2023	Bank of America Merrill Lynch	49	11.608	(33)				
Australia 10 Year Bond settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	20	1.505	(18)				
Euro-Buxl 30 Year Bond dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(145)	(2)				
ICE 3 mesi SONIA dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	37	11.049	51				
ICE 3 mesi SONIA dicembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	1	300	-				
ICE 3 mesi SONIA giugno 2023	Bank of America Merrill Lynch	22	6.613	(57)				
ICE 3 mesi SONIA giugno 2024	Bank of America Merrill Lynch	38	11.360	2				
ICE 3 mesi SONIA settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	117	35.005	(293)				
Long Gilt dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	24	2.906	52				
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	468	51.963	539				
U.S. 10 Year Ultra Note dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	10	1.161	14				
U.S. 2 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	180	36.685	89				
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	121	12.938	80				
U.S. Long Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	18	2.190	40				
U.S. Ultra Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	166	21.492	453				
Apprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 53\$)								\$ 1448
Deprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (890)\$)								(504)
Apprezzamento netto di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (837)\$)								\$ 944

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario		
Titoli garantiti da attività — 12,13% (28 febbraio 2023: 12,60%)			Titoli garantiti da ipoteca — 79,99% (28 febbraio 2023: 80,10%)				
1.190	Mutuo ipotecario accreditato Trust 2005-1, Serie 2005 1, Classe M5, 5,460%, scadenza 25/04/2035 *	1.196	0,23	449	Alternative Loan Trust 2005-56, Serie 2005 56, Classe 4A1, 6,049%, scadenza 25/11/2035 *	404	0,08
2.390	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Serie 1996 1, Classe B1, 7,875%, scadenza 10/10/2026	75	0,02	1.135	Alternative Loan Trust 2005-80CB, Serie 2005 80CB, Classe 2A1, 6,000%, scadenza 25/02/2036	1.058	0,20
642	Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Serie 2007 B, Classe 1A2, 7,331%, scadenza 28/08/2047	534	0,10	2.116	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Classe A14, 6,000%, scadenza 25/08/2036	1.279	0,25
1.244	Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Serie 2007 B, Classe 1A3, 7,719%, scadenza 28/08/2047	333	0,06	538	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Classe A15, 6,000%, scadenza 25/08/2036	325	0,06
73	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Serie 2005 CL1, Classe A1, 3,646%, scadenza 25/09/2034 *	71	0,01	551	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Classe A16, 6,000%, scadenza 25/08/2036	333	0,06
3.660	Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Serie 2016 1A, Classe B, 144A, 5,682%, scadenza 16/12/2041	2.614	0,51	624	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Classe A20, 4,623%, scadenza 25/08/2036 *	405	0,08
5.526	Conseco Finance Securitizations Corp, Serie 2000 3, Classe A, 144A, 8,260%, scadenza 01/12/2030 *	1.397	0,27	603	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Classe A24, 6,000%, scadenza 25/08/2036	365	0,07
803	Countrywide Asset-Backed Certificates, Serie 2007 SD1, Classe A1, 144A, 6,329%, scadenza 25/03/2047 *	605	0,12	767	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Classe A3, 6,000%, scadenza 25/08/2036 *	464	0,09
764	Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC, Serie 2007 MX1, Classe A4, 144A, 6,231%, scadenza 25/12/2036	756	0,15	82	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Classe A7, 6,000%, scadenza 25/08/2036	49	0,01
1.888	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-9, Serie 2004 9, Classe MF2, 5,572%, scadenza 25/11/2034 *	1.736	0,34	366	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Classe A8, 6,000%, scadenza 25/08/2036	221	0,04
1.489	Dividend Solar Loans 2018-1 LLC, Serie 2018 1, Classe D, 144A, 6,390%, scadenza 20/07/2038	1.227	0,24	4.706	Alternative Loan Trust 2006-28CB, Serie 2006 28CB, Classe A12, 0,471%, scadenza 25/10/2036 *†	482	0,09
3.092	Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Serie 2018 2, Classe D, 144A, 5,910%, scadenza 20/12/2038	2.381	0,46	936	Alternative Loan Trust 2007-23CB, Serie 2007 23CB, Classe A8, 6,682%, scadenza 25/09/2037 *	737	0,14
4.869	Fieldstone Mortgage Investment Trust Serie 2005-2, Serie 2005 2, Classe M3, 6,209%, scadenza 25/12/2035 *	4.215	0,82	6.297	Alternative Loan Trust 2007-5CB, Serie 2007 5CB, Classe 1A20, 0,031%, scadenza 25/04/2037 *†	557	0,11
3	First Franklin Mortgage Loan Trust 2002-FF1, Serie 2002 FF1, Classe 1A2, 6,558%, scadenza 25/04/2032 *	3	–	2.477	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Serie 2016 GG10, Classe AJA, 144A, 5,810%, scadenza 10/08/2045 *	539	0,10
6.593	Fremont Home Loan Trust 2006-B, Serie 2006 B, Classe 1A, 5,729%, con scadenza 25/08/2036 *	2.750	0,53	374	Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Serie 2015 R4, Classe 4A2, 144A, 4,500%, scadenza 27/01/2030 *	371	0,07
2.311	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Serie 2021 4GS, Classe C, 144A, 3,500%, scadenza 20/07/2048	1.658	0,32	4.147	Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Serie 2015 R4, Classe 4A3, 144A, 7,382%, scadenza 27/01/2030 *	1.468	0,28
2.868	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-1, Serie 2022 1GS, Classe C, 144A, 3,500%, scadenza 20/12/2049	1.901	0,37	6.000	BCCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Classe F, 144A, 4,715%, scadenza 10/08/2033 *	4.169	0,81
2.827	HERO Funding Trust 2016-1, Serie 2016 1A, Classe R, 144A, 0,000%, scadenza 20/09/2041	378	0,07	5.404	BCAP LLC 2014-RR2, Serie 2014 RR2, Classe 10A2, 144A, 4,336%, scadenza 26/07/2046 *	4.444	0,86
500	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Classe E, 144A, 8,377%, scadenza 16/06/2036 *	458	0,09	819	BCAP LLC Trust 2007-AA3, Serie 2007 AA3, Classe 1A2, 5,969%, scadenza 25/04/2037 *	1.089	0,21
3.322	Home Partners of America 2021-2 Trust, Serie 2021 2, Classe F, 144A, 3,799%, scadenza 17/12/2026	2.870	0,56	1.248	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-AC6, Serie 2004 AC6, Classe A1, 5,750%, scadenza 25/11/2034	1.066	0,21
1.373	Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Serie 2021 1GS, Classe C, 144A, 3,500%, scadenza 20/01/2048	914	0,18	1.036	Bellemeade Re 2018-1 Ltd, Serie 2018 1A, Classe M2, 144A, 8,329%, con scadenza 25/04/2028 *	1.040	0,20
2.331	Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Serie 2021 2GS, Classe C, 144A, 3,500%, scadenza 20/03/2048	1.476	0,28	10.010	BHMS 2018-MZB, Serie 2018 MZB, Classe MZB, 144A, 12,244%, scadenza 15/07/2025 *	8.970	1,74
1.176	Loanpal Solar Loan Ltd, Serie 2020 3GS, Classe C, 144A, 3,500%, scadenza 20/12/2047	744	0,14	3.500	BX Trust 2018-GW MZ, Serie 2018 GWMZ, Classe MC, 144A, 11,095%, scadenza 15/05/2037 *	3.446	0,67
30	Long Beach Mortgage Loan Trust 2002-2, Serie 2002 2, Classe M2, 5,964%, scadenza 25/07/2032 *	29	0,01	1.750	BX Trust 2018-GW, Serie 2018 GW, Classe G, 144A, 8,528%, scadenza 15/05/2035 *	1.707	0,33
4.648	Magnolia Finance, 8,205%, scadenza 09/08/2024	4.493	0,87	870	BX Trust 2021-VIEW, Serie 2021 VIEW, Classe E, 144A, 9,024%, scadenza 15/06/2036 *	782	0,15
73	Mastr Specialized Loan Trust, Serie 2006 2, Classe A, 144A, 5,949%, scadenza 25/02/2036 *	70	0,01	3.431	Chase Mortgage Finance Trust Serie 2007-A1, Serie 2007 A1, Classe 11M1, 4,081%, scadenza 25/03/2037 *	3.202	0,62
3	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust Serie 2003-SD1, Serie 2003 SD1, Classe A1, 6,429%, scadenza 25/03/2033 *	3	–	869	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Serie 2004-4, Serie 2004 4A, Classe B1, 144A, 4,491%, scadenza 25/10/2035 *	643	0,12
1.244	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, Serie 2018 1A, Classe CERT, 144A, 0,000%, scadenza 22/06/2043 ∞	809	0,16	267	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Serie 2005-1, Serie 2005 1A, Classe A2, 144A, 5,629%, scadenza 25/01/2036 *	240	0,05
3.000	National Collegiate II Commutation Trust, Serie 2005 AR15, Classe AR15, 0,000%, scadenza 01/06/2045	337	0,07	454	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Serie 2005-B, Serie 2005 BA, Classe B1, 144A, 5,829%, scadenza 25/06/2036 *	370	0,07
7.796	National Collegiate Student Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Classe B, 5,929%, scadenza 27/07/2037 *	5.804	1,12	401	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2004-25, Serie 2004 25, Classe 2A1, 6,109%, scadenza 25/02/2035 *	338	0,07
5.987	National Collegiate V Commutation Trust, Serie 2007 33A5, Classe 10, 144A, 0,000%, scadenza 25/03/2038 *	1.551	0,30	346	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11, Serie 2005 11, Classe 3A3, 3,562%, scadenza 25/04/2035 *	256	0,05
6.140	National Collegiate V Commutation Trust, Serie 2007 33A6, Classe 10, 144A, 0,000%, scadenza 25/03/2038 *	1.460	0,28	214	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-25, Serie 2005 25, Classe A15, 2,713%, scadenza 25/11/2035 *	118	0,02
3.402	NRZ Excess Spread-Collateralized Notes, Serie 2021 FHT1, Classe A, 144A, 3,104%, scadenza 25/07/2026	3.039	0,59	771	Citicorp Mortgage Securities Trust Serie 2007-3, Serie 2007 3, Classe 1A4, 6,000%, scadenza 25/04/2037	706	0,14
2.543	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-2, Serie 2005 2, Classe M2, 5,717%, scadenza 25/04/2035	1.884	0,37	2.990	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Serie 2014 GC23, Classe C, 4,572%, scadenza 10/07/2047 *	2.772	0,54
2.352	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-5, Serie 2005 5, Classe MV2, 3,273%, scadenza 25/11/2035 *	2.082	0,40	9.200	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Serie 2006 AR6, Classe 2A4, 5,869%, scadenza 25/09/2036 *	2.884	0,56
120	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F LLC, Serie 2017 F, Classe R1, 144A, 0,000%, scadenza 25/01/2041	1.452	0,28	761	Citigroup Mortgage Loan Trust 2008-3, Serie 2008 3, Classe A3, 144A, 6,100%, scadenza 25/04/2037	342	0,07
–	Southern Pacific Secured Assets Corp, Serie 1998 1, Classe A7, 6,510%, scadenza 25/12/2027 *	–	–	3.529	Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-I2, Serie 2014 I2, Classe B5, 144A, 3,808%, scadenza 25/11/2044 *	1.956	0,38
569	Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Classe A, 144A, 2,675%, scadenza 28/02/2033	507	0,10	3.250	COLT 2021-RPL1 Trust, Serie 2021 RPL1, Classe B1, 144A, 4,796%, scadenza 25/09/2061 *	2.510	0,49
2.996	Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Classe B, 144A, 3,821%, scadenza 28/02/2033	2.541	0,49	1.908	Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, Serie 2014 UBS2, Classe E, 144A, 5,149%, scadenza 10/03/2047 *	1.595	0,31
3.363	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, Serie 2005 9XS, Classe M2, 6,404%, scadenza 25/06/2035 *	3.298	0,64	5.060	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Serie 2019 R05, Classe 1B1, 144A, 9,502%, scadenza 25/07/2039 *	5.216	1,01
1.397	Structured Asset Securities Corp Trust 2005-SC1, Serie 2005 SC1, Classe 1A1, 144A, 5,699%, scadenza 25/05/2031 *	1.006	0,20				
2.375	Sunnova Sol Issuer LLC, Serie 2020 1A, Classe B, 144A, 5,540%, scadenza 01/02/2055	1.926	0,37				
Totale Titoli garantiti da attività (Costo 84.570\$)	62.583	12,13					

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
8.330 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Classe 1B1, 144A, 8,802%, scadenza 25/10/2039 *	8.461	1,64	4.600 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Serie 2019 DNA3, Classe B1, 144A, 8,652%, scadenza 25/07/2049 *	4.789	0,93
5.760 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Classe 1B1, 144A, 8,388%, scadenza 25/10/2041 *	5.742	1,11	3.100 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Serie 2019 DNA3, Classe B2, 144A, 13,552%, scadenza 25/07/2049 *	3.394	0,66
67 Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Serie 2005 C2, Classe AMFX, 4,877%, scadenza 15/04/2037	66	0,01	5.550 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Serie 2019 DNA4, Classe B2, 144A, 11,652%, scadenza 25/10/2049 *	5.805	1,12
310 CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Serie 2004-AR5, Serie 2004 AR5, Classe CB2, 4,542%, scadenza 25/06/2034 *	248	0,05	4.000 Freddie Mac Stacr Trust 2019-FTR4, Serie 2019 FTR4, Classe B2, 144A, 10,402%, scadenza 25/11/2047 *	3.863	0,75
9.700 CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Classe E, 144A, 4,373%, scadenza 15/09/2037	5.089	0,99	4.925 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA1, Classe B, 15,402%, scadenza 25/07/2028 *	5.485	1,06
9.200 CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Classe F, 144A, 4,373%, scadenza 15/09/2037	3.618	0,70	2.507 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA2, Classe B, 15,902%, scadenza 25/10/2028 *	2.821	0,55
4.373 CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Classe B1, 144A, 2,963%, scadenza 25/07/2057 *	2.861	0,55	2.541 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA3, Classe B, 16,652%, scadenza 25/12/2028 *	2.912	0,56
5.017 CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Classe B2, 144A, 2,963%, scadenza 25/07/2057 *	3.188	0,62	5.482 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA4, Classe B, 14,002%, scadenza 25/03/2029 *	5.916	1,15
4.266 CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Classe B3, 144A, 2,963%, scadenza 25/07/2057 *	2.360	0,46	3.943 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 DNA2, Classe B2, 16,652%, scadenza 25/10/2029 *	4.578	0,89
4.329 CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Classe B4, 144A, 2,963%, scadenza 25/07/2057 *	806	0,16	6.304 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 HRP1, Classe B2D, 8,402%, scadenza 25/12/2042 *	4.615	0,89
2.143 CSMC 2017-RPL3 Trust, Serie 2017 RPL3, Classe B3, 144A, 4,464%, scadenza 01/08/2057 *	1.964	0,38	3.995 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2018 SPI1, Classe B, 144A, 3,784%, scadenza 25/02/2048 *	2.410	0,47
5.782 CSMC 2017-RPL3 Trust, Serie 2017 RPL3, Classe B4, 144A, 4,464%, scadenza 01/08/2057 *	5.246	1,02	5.873 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2018 SPI2, Classe B, 144A, 3,836%, scadenza 25/05/2048 *	3.715	0,72
7.888 CSMC Mortgage-Backed Trust 2006-7, Serie 2006 7, Classe 11A2, 1,071%, scadenza 25/08/2036 **	1.046	0,20	6.859 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2018 SPI3, Classe B, 144A, 4,159%, scadenza 25/08/2048 *	4.720	0,91
98 CSMC Resecuritization Trust 2006-1R, Serie 2006 1R, Classe 1A2, 144A, 4,580%, scadenza 27/07/2036 *	125	0,02	25.814 FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Serie 2018 SB48, Classe B, 144A, 4,285%, scadenza 25/02/2038 *	20.068	3,89
4.374 CSMC Serie 2015-2R, Serie 2015 2R, Classe 7A2, 144A, 4,259%, scadenza 27/08/2036 *	3.386	0,66	713 Government National Mortgage Association, Serie 2010 102, Classe IO, 0,010%, scadenza 16/06/2052 *	–	–
4.307 CSMC Trust 2013-IVR5, Serie 2013 IVR5, Classe B5, 144A, 3,622%, scadenza 25/10/2043 *	2.840	0,55	3.851 Government National Mortgage Association, Serie 2010 13, Classe IO, 0,000%, scadenza 16/11/2051 *	–	–
2.000 CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Classe H, 144A, 12,794%, scadenza 15/07/2032 *	1.838	0,36	497 Government National Mortgage Association, Serie 2011 127, Classe IO, 0,143%, scadenza 16/03/2047 *	–	–
307.495 CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Classe AX1, 144A, 0,086%, scadenza 25/02/2048 *	747	0,14	12.609 Government National Mortgage Association, Serie 2011 95, Classe IO, 0,007%, scadenza 16/04/2051 *	1	–
4.225 CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Classe B5, 144A, 3,586%, scadenza 25/02/2048 *	2.883	0,56	8.089 Government National Mortgage Association, Serie 2012 114, Classe IO, 0,620%, scadenza 16/01/2053 *	126	0,02
8.649 CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Classe B6, 144A, 3,586%, scadenza 25/02/2048 *	4.331	0,84	3.206 Government National Mortgage Association, Serie 2013 163, Classe IO, 1,012%, scadenza 16/02/2046 *	47	0,01
– CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Classe SA, 144A, 0,000%, scadenza 25/02/2048	–	–	5.581 Government National Mortgage Association, Serie 2014 16, Classe IO, 0,450%, scadenza 16/06/2055 *	77	0,01
4.000 CSWF 2018-TOP, Serie 2018 TOP, Classe H, 144A, 8,970%, scadenza 15/08/2035 *	3.634	0,70	7.212 Government National Mortgage Association, Serie 2014 171, Classe IO, 0,414%, scadenza 16/11/2055 *	64	0,01
581 DSLA Mortgage Loan Trust 2004-AR4, Serie 2004 AR4, Classe 2A2B, 6,268%, scadenza 19/01/2045 *	389	0,08	732 Government National Mortgage Association, Serie 2014 47, Classe IA, 0,148%, scadenza 16/02/2048 *	3	–
1.324 DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR3, Serie 2005 AR3, Classe 2A1B, 5,908%, scadenza 19/07/2045 *	1.235	0,24	3.538 Government National Mortgage Association, Serie 2014 50, Classe IO, 0,628%, scadenza 16/09/2055 *	89	0,02
2.350 DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR5, Serie 2005 AR5, Classe 2A1B, 6,108%, scadenza 19/09/2045 *	1.731	0,34	688 Government National Mortgage Association, Serie 2016 135, Classe SB, 0,673%, scadenza 16/10/2046 *	90	0,02
468 DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Classe 2A1B, 5,608%, scadenza 19/04/2047 *	497	0,10	653 Government National Mortgage Association, Serie 2016 51, Classe NS, 0,622%, scadenza 20/04/2046 *	65	0,01
5.323 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C01, Classe 1B, 17,152%, scadenza 25/08/2028 *	6.020	1,17	3.316 Government National Mortgage Association, Serie 2018 125, Classe HS, 0,822%, scadenza 20/09/2048 *	276	0,05
3.661 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C02, Classe 1B, 17,652%, scadenza 25/09/2028 *	4.249	0,82	4.456 Government National Mortgage Association, Serie 2022 202, Classe Z, 3,000%, scadenza 16/10/2063 *	2.569	0,50
2.937 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C03, Classe 1B, 17,152%, scadenza 25/10/2028 *	3.361	0,65	2.620 Government National Mortgage Association, Serie 2023 16, Classe Z, 3,500%, scadenza 16/07/2063 *	1.644	0,32
4.874 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C04, Classe 1B, 15,652%, scadenza 25/01/2029 *	5.374	1,04	25.698 GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Classe D, 144A, 11,925%, scadenza 15/09/2031 *	4.870	0,94
7.163 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C06, Classe 1B, 14,652%, scadenza 25/04/2029 *	7.720	1,50	1.250 GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26, Serie 2014 GC26, Classe D, 144A, 4,662%, scadenza 10/11/2047 *	821	0,16
3.875 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C06, Classe 1B1, 9,152%, scadenza 25/03/2031 *	4.139	0,80	3.200 GS Mortgage Securities Trust 2015-GC28, Serie 2015 GC28, Classe D, 144A, 4,452%, scadenza 10/02/2048 *	2.725	0,53
1.613 Fannie Mae REMICS, Serie 2017 85, Classe SC, 0,798%, scadenza 25/11/2047	131	0,03	1.500 GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32, Serie 2015 GC32, Classe D, 3,345%, scadenza 10/07/2048	1.261	0,24
3.590 Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Serie 2021 MN2, Classe M2, 144A, 8,638%, scadenza 25/07/2041 *	3.273	0,63	4.871 GSR Mortgage Loan Trust 2006-1F, Serie 2006 1F, Classe 6A1, 5,829%, scadenza 25/02/2036 *	501	0,10
6.605 Certificati Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through K038, Classe X3, 2,568%, scadenza 25/06/2042 *	93	0,02	78 HarborView Mortgage Loan Trust 2004-11, Serie 2004 11, Classe 3A3, 6,188%, scadenza 19/01/2035 *	71	0,01
19.370 Certificati Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through K052, Classe X3, 1,671%, scadenza 25/01/2044 *	590	0,11	47 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Classe 2A1A, 5,968%, scadenza 19/03/2035 *	46	0,01
6.000 Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, Serie 2020 DNA1, Classe B2, 144A, 10,652%, scadenza 25/01/2050 *	6.023	1,17	123 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-10, Serie 2005 10, Classe 2A1A, 6,048%, scadenza 19/11/2035 *	87	0,02
8.000 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Serie 2020 DNA2, Classe B2, 144A, 10,202%, scadenza 25/02/2050 *	7.856	1,52	415 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-2, Serie 2005 2, Classe 2A1A, 5,868%, scadenza 19/05/2035 *	378	0,07
530 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Serie 2021 DNA5, Classe B2, 144A, 10,788%, scadenza 25/01/2034 *	499	0,10	180 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Classe 2A1A, 5,908%, scadenza 19/06/2035 *	171	0,03
5.020 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Classe B2, 144A, 12,788%, scadenza 25/10/2041 *	5.150	1,00	1.880 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-8, Serie 2005 8, Classe 2A2, 5,930%, scadenza 19/09/2035 *	1.666	0,32
4.620 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA1, Serie 2019 DNA1, Classe B2, 144A, 16,152%, scadenza 25/01/2049 *	5.604	1,09	448 HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10, Serie 2006 10, Classe 2A1A, 5,608%, scadenza 19/11/2036 *	395	0,08
			744 Impac CMB Trust Serie 2005-1, Serie 2005 1, Classe M1, 6,119%, scadenza 25/04/2035 *	685	0,13

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
1.587 Impac CMB Trust Serie 2005-3, Serie 2005 3, Classe A2, 6,029%, scadenza 25/08/2035 *	1.464	0,28	480 Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Serie 2006 1, Classe M1, 5,984%, scadenza 25/04/2036 *	1.098	0,21
649 Impac CMB Trust Serie 2005-4, Serie 2005 4, Classe 1M1, 6,074%, scadenza 25/05/2035 *	587	0,11	3.481 PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Serie 2021 1R, Classe A, 144A, 8,343%, scadenza 27/02/2024 *	3.464	0,67
996 Impac CMB Trust Serie 2005-7, Serie 2005 7, Classe A1, 5,949%, scadenza 25/11/2035 *	870	0,17	2.910 PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 8,883%, scadenza 29/10/2024 *	2.866	0,56
1.268 Impac Secured Assets Trust 2006-2, Serie 2006 2, Classe 2B, 7,079%, scadenza 25/08/2036 *	1.256	0,24	3.191 PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 8,533%, scadenza 27/02/2025 *	3.103	0,60
33 Impac Secured Assets Trust 2006-2, Serie 2006 2, Classe 2M3, 7,079%, scadenza 25/08/2036 *	33	0,01	599 RALI Serie 2006-QA2 Trust, Serie 2006 QA2, Classe 1A1, 5,679%, scadenza 25/02/2036 *	385	0,07
623 IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR13, Serie 2005 AR13, Classe 1A1, 3,921%, scadenza 25/08/2035 *	315	0,06	12.658 Redwood Funding Trust 2019-1, Serie 2019 1, Classe PT, 144A, 4,968%, scadenza 27/09/2024	12.373	2,40
628 IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR2, Serie 2005 AR2, Classe 2A1B, 6,209%, scadenza 25/02/2035 *	449	0,09	1.024 Reperforming Loan REMIC Trust 2006-R2, Serie 2006 R2, Classe AF1, 144A, 5,849%, scadenza 25/07/2036 *	932	0,18
1.853 IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR6, Serie 2005 AR6, Classe 2A2, 6,089%, scadenza 25/04/2035 *	1.447	0,28	3.449 Residential Asset Securitization Trust 2006-A7CB, Serie 2006 A7CB, Classe 1A3, 6,250%, scadenza 25/07/2036	2.637	0,51
2.395 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Serie 2017 FL11, Classe E, 144A, 9,464%, scadenza 15/10/2032 *	2.392	0,46	12.928 Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Serie 2017 4, Classe B, 144A, 0,000%, scadenza 25/06/2057 †	1.624	0,31
2.250 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Serie 2017 FL11, Classe F, 144A, 10,764%, scadenza 15/10/2032 *	2.238	0,43	19.478 Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Serie 2017 4, Classe BIO, 144A, 1,677%, scadenza 25/06/2057 †	2.868	0,56
28.545 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Serie 2018 PHMZ, Classe M, 144A, 13,933%, scadenza 15/06/2035 *†‡	–	–	4.397 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Classe B, 144A, 0,000%, scadenza 25/09/2055 †	399	0,08
4.022 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-FL7, Serie 2015 FL7, Classe D, 144A, 9,193%, scadenza 15/05/2028 *	3.583	0,69	7.814 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Classe BIO, 144A, 0,809%, scadenza 25/09/2055 †	913	0,18
3.600 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1, Serie 2015 JP1, Classe C, 4,881%, scadenza 15/01/2049 *	3.029	0,59	3.394 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Classe M2, 144A, 3,750%, scadenza 25/09/2055 *	3.037	0,59
1.800 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Serie 2018 WPT, Classe GFL, 144A, 9,205%, scadenza 05/07/2033 *	1.342	0,26	50.342 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Classe XSIO, 144A, 0,075%, scadenza 25/09/2055 *†	222	0,04
6.574 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Serie 2020 MKST, Classe G, 144A, 9,924%, scadenza 15/12/2036 *	1.139	0,22	12.909 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-2, Serie 2017 2, Classe B, 144A, 0,000%, scadenza 25/08/2056 †	1.076	0,21
6.867 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Serie 2020 MKST, Classe H, 144A, 12,424%, scadenza 15/12/2036 *	727	0,14	20.889 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-2, Serie 2017 2, Classe BIO, 144A, 1,218%, scadenza 25/08/2056 *†	2.315	0,45
4.000 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2021-NYMZ, Serie 2021 NYMZ, Classe M, 144A, 12,675%, scadenza 15/06/2026 *	3.880	0,75	410.106 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-2, Serie 2017 2, Classe XSIO, 144A, 0,075%, scadenza 25/08/2056 *†	1.785	0,35
9.436 JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Serie 2018 4, Classe AX1, 144A, 0,214%, scadenza 25/10/2048 *†	43	0,01	2.539 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-1, Serie 2018 1, Classe M, 4,750%, scadenza 25/05/2057 *	2.356	0,46
10.471 JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Serie 2018 5, Classe AX1, 144A, 0,228%, scadenza 25/10/2048 *†	64	0,01	11.444 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-2, Serie 2018 2, Classe BX, 2,708%, scadenza 25/11/2057 *	3.360	0,65
1.952 JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Serie 2018 5, Classe B5, 144A, 3,728%, scadenza 25/10/2048 *	1.147	0,22	16.035 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-3, Serie 2018 3, Classe BX, 144A, 1,151%, scadenza 25/08/2057 *	4.864	0,94
2.632 JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Serie 2018 5, Classe B6, 144A, 3,728%, scadenza 25/10/2048 *	1.303	0,25	2.630 STACR Trust 2018-DNA3, Serie 2018 DNA3, Classe B1, 144A, 9,302%, scadenza 25/09/2048 *	2.818	0,55
5.420 JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C25, Serie 2014 C25, Classe D, 144A, 4,082%, scadenza 15/11/2047 *	2.290	0,44	3.000 STACR Trust 2018-DNA3, Serie 2018 DNA3, Classe B2, 144A, 13,152%, scadenza 25/09/2048 *	3.329	0,65
11 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-15, Serie 2004 15, Classe 6A1, 5,759%, scadenza 25/12/2034 *	10	–	650 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Classe D, 144A, 8,500%, scadenza 15/11/2027 *	26	0,01
1.657 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-6, Serie 2004 6, Classe B1, 5,252%, scadenza 25/07/2034 *	1.516	0,29	14.332 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Classe E, 144A, 8,500%, scadenza 15/11/2027 *†	72	0,01
1.206 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-8, Serie 2004 8, Classe B1, 5,292%, scadenza 25/09/2034 *	1.067	0,21	307 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Serie 2004 2, Classe 1A1, 4,953%, scadenza 25/03/2034 *	278	0,05
698 MASTR Reperforming Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Classe 1A1, 144A, 6,000%, scadenza 25/08/2034	447	0,09	49 Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR6, Serie 2006 AR6, Classe 1A1, 5,789%, scadenza 25/07/2046 *	40	0,01
825 MASTR Reperforming Loan Trust 2005-2, Serie 2005 2, Classe 1A1F, 144A, 5,779%, scadenza 25/05/2035 *	437	0,08	3.900 Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Serie 2018 2, Classe B2, 144A, 3,602%, scadenza 25/03/2058 *	2.968	0,58
377 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Classe AJ, 5,450%, scadenza 12/08/2048 *	95	0,02	7.118 Towd Point Mortgage Trust 2018-4, Serie 2018 4, Classe B2, 144A, 3,288%, scadenza 25/06/2058 *	4.509	0,87
186 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Classe AJFL, 144A, 5,450%, scadenza 12/08/2048 *	47	0,01	4.000 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-NYCH, Serie 2018 NYCH, Classe F, 144A, 9,179%, scadenza 15/02/2032 *	3.813	0,74
5.000 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32, Serie 2016 C32, Classe D, 144A, 3,396%, scadenza 15/12/2049 *	3.294	0,64	3.432 Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Classe A3, 144A, 6,319%, scadenza 25/05/2068	3.396	0,66
1.532 Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-11AR, Serie 2004 11AR, Classe 1B1, 6,029%, scadenza 25/01/2035 *	1.233	0,24	2.770 Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Classe B1, 144A, 8,239%, scadenza 25/05/2068 *	2.681	0,52
3.310 Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-8AR, Serie 2006 8AR, Classe 1A3, 5,749%, scadenza 25/06/2036 *	703	0,14	3.326 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR11 Trust, Serie 2005 AR11, Classe B1, 6,344%, scadenza 25/08/2045 *	2.790	0,54
515 Multifamily Trust 2016-1, Serie 2016 1, Classe B, 144A, 2,446%, scadenza 25/04/2046 *	515	0,10	983 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR9 Trust, Serie 2005 AR9, Classe B1, 6,374%, scadenza 25/07/2045 *	761	0,15
5.308 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Classe D, 144A, 4,544%, scadenza 15/08/2036 *	3.404	0,66	1.343 Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Serie 2015 SBC5, Classe B, 144A, 6,400%, scadenza 14/09/2022 *	1.162	0,23
4.870 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Classe E, 144A, 4,544%, scadenza 15/08/2036 *	2.614	0,51	2.500 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Serie 2015 C28, Classe D, 4,216%, scadenza 15/05/2048 *	1.982	0,38
3.000 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2022-JERI, Serie 2022 JERI, Classe G, 144A, 12,768%, scadenza 15/01/2039 *	2.474	0,48	1.252 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22, Serie 2014 C22, Classe D, 144A, 4,054%, scadenza 15/09/2057 *	819	0,16
3.539 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-4, Serie 2016 4A, Classe B5, 144A, 4,844%, scadenza 25/11/2056 *	3.154	0,61	Totale Titoli garantiti da ipoteca (Costo 560.346S)		
3.000 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Serie 2021 NQM3, Classe B2, 144A, 4,051%, scadenza 27/11/2056 *	1.935	0,37	Obbligazioni ed effetti societari — 0,72% (28 febbraio 2023: 0,48%)		
			Stati Uniti — 0,72% (28 febbraio 2023: 0,48%)		
			4.000 Two Harbors Investment Corp, 6,250%, scadenza 15/01/2026		
			Totale Obbligazioni ed effetti societari (Costo 3.587S)		
			Note di prestito — 3,49% (28 febbraio 2023: 3,29%)		
			30.000 American Dream, —, scadenza 29/06/2024 *†∞		
			1.613 Freehand Hotel, 9,267%, scadenza 17/12/2024 *∞		
			2.935 Freehand Hotel, 9,267%, scadenza 17/12/2024 *∞		

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Note di prestito — (segue)		
5.452 Freehand Hotel, 9,267%, scadenza 17/12/2024 *∞	5.337	1,03
5.551 Sono Retail Loan, 8,696%, scadenza 06/06/2024 *∞	5.514	1,07
Totale Note di prestito (Costo 45.454\$)	17.995	3,49
Organismi di investimento collettivo — 3,08% (28 febbraio 2023: 3,08%)		
15.887 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	15.887	3,08
Totale Organismi di investimento collettivo (Costo 15.887\$)	15.887	3,08
Totale Investimenti al valore equo rilevato a conto economico (Costo 709.844\$)		
	512.999	99,41
Contratti a termine in valuta estera — 0,11% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Apprezamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	577	0,11
Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	513.576	99,52
Contratti a termine in valuta estera — (0,13%) (28 febbraio 2023: (0,30%))		
Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(664)	(0,13)
Futures — (0,10%) (28 febbraio 2023: (0,01%))		
Deprezzamento non realizzato su contratti (vedere più avanti)	(538)	(0,10)
Totale Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(1.202)	(0,23)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	512.374	99,29
Altre attività eccedenti le passività	3.692	0,71
Patrimonio in gestione	516.066\$	100,00

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)	Valuta vendita (in migliaia)	Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto EUR 1	Vendita USD 1	\$ -
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 10	Vendita EUR 9	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 38.993	Vendita JPY 5.575.971	577
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto CHF 282	Vendita USD 323	(3)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto JPY 5.575.971	Vendita USD 38.998	(581)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto GBP 9	Vendita USD 11	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto EUR 5.242	Vendita USD 5.767	(80)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto GBP -	Vendita USD -	-
Apprezamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 8\$)				\$ 577
Deprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1.683)\$)				(664)
Deprezzamento netto dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1.675)\$)				\$ (87)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	(206)	\$ (49.353)	(91)
Indice SOFR a 3 mesi settembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	(204)	(48.697)	(67)
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(42)	(4.663)	(42)
U.S. 10 Year Ultra Note dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(84)	(9.753)	(144)
U.S. Long Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(112)	(13.629)	(194)
Apprezamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 317\$)				\$ -
Deprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (73)\$)				(538)
Deprezzamento netto dei Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 244\$)				\$ (538)

- Gli importi indicati con “-” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.
- 144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 324.155.000\$, ovvero allo 62,83% dell'attivo netto.
- * Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.
- † Illiquido.
- ∞ Il titolo è valutato in buona fede al valore equo o a discrezione del Comitato di valutazione.
- ∞ Al 31 agosto 2023 il titolo (capitale e/o interessi) è insolvente.

ABBREVIAZIONI:

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.

Analisi delle attività totali	% delle Attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	92,55
Altri valori mobiliari negoziati su un altro mercato regolamentato	3,48
Organismi di investimento collettivo	3,07
Strumenti finanziari derivati	0,11
Altre attività	0,79
Totale Attività	100,00

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

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

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da attività — 1,93% (28 febbraio 2023: 1,53%)					
1.208 DB Master Finance LLC, Serie 2021 1A, Classe A23, 144A, 2,791%, scadenza 20/11/2051	960	0,09	9 Fannie Mae Pool '745959', 5,500%, scadenza 01/11/2036	9	—
5.000 Goodleap Sustainable Home Solutions Trust 2023-3, Serie 2023 3C, Classe A, 144A, 6,500%, scadenza 20/07/2055	5.002	0,44	446 Fannie Mae Pool '836398', 6,089%, scadenza 01/10/2035 *	440	0,04
2.681 Hardee's Funding LLC, Serie 2020 1A, Classe A2, 144A, 3,981%, scadenza 20/12/2050	2.285	0,20	6 Fannie Mae Pool '836852', 5,986%, scadenza 01/10/2035 *	6	—
1.536 HGI CRE CLO 2021-FL2 Ltd, Serie 2021 FL2, Classe A, 144A, 6,427%, scadenza 17/09/2036 *	1.503	0,13	7 Fannie Mae Pool '843823', 6,144%, scadenza 01/11/2035 *	7	—
2.689 Home Partners of America 2021-3 Trust, Serie 2021 3, Classe A, 144A, 2,200%, scadenza 17/01/2041	2.301	0,20	80 Fannie Mae Pool '843997', 6,018%, scadenza 01/11/2035 *	78	0,01
2.212 Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Serie 2021 2GS, Classe B, 144A, 2,790%, scadenza 20/03/2048	1.506	0,13	19 Fannie Mae Pool '865915', 6,247%, scadenza 01/03/2036 *	19	—
1.487 MF1 2021-FL6 Ltd, Serie 2021 FL6, Classe A, 144A, 6,526%, scadenza 16/07/2036 *	1.459	0,13	538 Fannie Mae Pool '890604', 4,500%, scadenza 01/10/2044	521	0,05
2.570 MF1 2021-FL7 Ltd, Serie 2021 FL7, Classe A, 144A, 6,506%, scadenza 16/10/2036 *	2.522	0,23	15 Fannie Mae Pool '902663', 6,000%, scadenza 01/11/2036	15	—
541 SBA Small Business Investment Cos, Serie 2018 10B, Classe 1, 3,548%, scadenza 10/09/2028	504	0,05	3 Fannie Mae Pool '909856', 6,000%, scadenza 01/03/2037	3	—
2.000 SBA Small Business Investment Cos, Serie 2023 10A, Classe 1, 5,168%, scadenza 10/03/2033	1.982	0,18	1 Fannie Mae Pool '974763', 4,500%, scadenza 01/04/2038	1	—
500 SMB Private Education Loan Trust 2023-C, Serie 2023 C, Classe B, 144A, 6,360%, scadenza 15/11/2052	500	0,04	15 Fannie Mae Pool '981766', 4,500%, scadenza 01/04/2038	14	—
1.484 Store Master Funding I-VII XIV XIX XX, Serie 2021 1A, Classe A3, 144A, 2,860%, scadenza 20/06/2051	1.229	0,11	4 Fannie Mae Pool '995072', 5,500%, scadenza 01/08/2038	4	—
Totale Titoli garantiti da attività (Costo 23.988\$)	21.753	1,93	58 Fannie Mae Pool 'AA8438', 4,500%, scadenza 01/06/2039	57	—
Titoli garantiti da ipoteca — 97,30% (28 febbraio 2023: 98,53%)					
54.020 BANK 2017-BNK8, Serie 2017 BNK8, Classe XA, 0,848%, scadenza 15/11/2050 *	1.291	0,11	26 Fannie Mae Pool 'AB2725', 5,500%, scadenza 01/04/2041	26	—
2.400 BANK 2018-BNK10, Serie 2018 BN10, Classe A5, 3,688%, scadenza 15/02/2061	2.221	0,20	984 Fannie Mae Pool 'AB3882', 4,500%, scadenza 01/10/2041	959	0,08
2.210 Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Serie 2018 B1, Classe A5, 3,666%, scadenza 15/01/2051 *	2.022	0,18	375 Fannie Mae Pool 'AB5692', 4,000%, scadenza 01/06/2042	355	0,03
4.050 BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Classe A, 144A, 6,857%, scadenza 15/07/2035 *	3.982	0,35	30 Fannie Mae Pool 'AB7668', 3,000%, scadenza 01/01/2043	27	—
1.275 BXMT 2020-FL2 Ltd, Serie 2020 FL2, Classe A, 144A, 6,328%, scadenza 15/02/2038 *	1.232	0,11	195 Fannie Mae Pool 'AB9107', 3,500%, scadenza 01/04/2033	186	0,02
33.468 CD 2017-CD6 Mortgage Trust, Serie 2017 CD6, Classe XA, 1,015%, scadenza 13/11/2050 *	792	0,07	11 Fannie Mae Pool 'AD3336', 5,500%, scadenza 01/04/2040	11	—
1.000 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Serie 2017 P8, Classe A3, 3,203%, scadenza 15/09/2050	917	0,08	3 Fannie Mae Pool 'AD4567', 5,500%, scadenza 01/04/2040	3	—
1.470 COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Serie 2015 PC1, Classe A5, 3,902%, scadenza 10/07/2050	1.414	0,13	5 Fannie Mae Pool 'AD4598', 5,500%, scadenza 01/05/2040	5	—
2.063 CSMC 2021-NQM8, Serie 2021 NQM8, Classe A1, 144A, 1,841%, scadenza 25/10/2066 *	1.713	0,15	10 Fannie Mae Pool 'AD4614', 5,500%, scadenza 01/06/2040	10	—
1.148 Fannie Mae Interest Strip 406, Classe 2, 4,000%, scadenza 25/02/2041	195	0,02	6 Pool Fannie Mae 'AD8281', 5,500%, scadenza 01/07/2040	6	—
268 Fannie Mae Interest Strip 407, Classe 9, 5,000%, scadenza 25/02/2041 *	44	—	20 Fannie Mae Pool 'AD8326', 5,500%, scadenza 01/07/2040	20	—
587 Fannie Mae Interest Strip 407, Classe C10, 5,000%, scadenza 25/01/2038	99	0,01	74 Fannie Mae Pool 'AD8642', 5,500%, scadenza 01/08/2040	75	0,01
378 Fannie Mae Interest Strip 409, Classe C13, 3,500%, scadenza 25/11/2041	58	—	63 Fannie Mae Pool 'AD9893', 5,500%, scadenza 01/07/2040	63	0,01
2.105 Fannie Mae Interest Strip 417, Classe C5, 3,500%, scadenza 25/02/2043	346	0,03	10 Fannie Mae Pool 'AE0758', 7,000%, scadenza 01/02/2039	11	—
4.944 Fannie Mae Interest Strip 418, Classe C15, 3,500%, scadenza 25/08/2043	834	0,07	32 Fannie Mae Pool 'AH5036', 5,500%, scadenza 01/02/2041	32	—
16.933 Fannie Mae Interest Strip 427, Classe C73, 3,000%, scadenza 25/12/2048	2.726	0,24	15 Fannie Mae Pool 'AH9785', 5,500%, scadenza 01/04/2041	15	—
3.900 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 2,500% ±	3.232	0,29	25 Fannie Mae Pool 'AI9532', 5,500%, scadenza 01/09/2041	25	—
7.000 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 3,000% ±	6.032	0,54	15 Fannie Mae Pool 'AJ2033', 5,500%, scadenza 01/10/2041	15	—
3.100 Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 3,500% ±	2.771	0,25	27 Fannie Mae Pool 'AJ4713', 4,500%, scadenza 01/11/2041	26	—
— Fannie Mae Pool '252875', 8,000%, scadenza 01/11/2029	—	—	84 Fannie Mae Pool 'AL1051', 4,500%, scadenza 01/09/2041	82	0,01
— Fannie Mae Pool '253184', 8,000%, scadenza 01/04/2030	—	—	526 Fannie Mae Pool 'AL1469', 7,000%, scadenza 01/02/2039	557	0,05
— Fannie Mae Pool '253399', 8,500%, scadenza 01/08/2030	—	—	223 Fannie Mae Pool 'AL1470', 7,000%, scadenza 01/04/2037	233	0,02
— Fannie Mae Pool '253438', 8,500%, scadenza 01/09/2030	—	—	3.514 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500%, scadenza 01/01/2043	3.214	0,29
1 Fannie Mae Pool '253598', 8,500%, scadenza 01/12/2030	1	—	31 Fannie Mae Pool 'AL3026', 3,500%, scadenza 01/12/2042	29	—
5.310 Fannie Mae Pool '387771', 3,790%, scadenza 01/08/2028	5.026	0,45	1.234 Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500%, scadenza 01/05/2040	1.287	0,11
— Fannie Mae Pool '535270', 8,500%, scadenza 01/04/2030	—	—	112 Fannie Mae Pool 'AL4741', 4,500%, scadenza 01/01/2044	108	0,01
6 Fannie Mae Pool '535299', 7,500%, scadenza 01/05/2030	7	—	4.665 Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000%, scadenza 01/05/2045	4.434	0,39
1 Fannie Mae Pool '535332', 8,500%, scadenza 01/04/2030	1	—	846 Fannie Mae Pool 'AL7877', 4,000%, scadenza 01/12/2045	797	0,07
— Fannie Mae Pool '535351', 8,000%, scadenza 01/06/2030	—	—	840 Fannie Mae Pool 'AL8991', 3,000%, scadenza 01/08/2035	775	0,07
— Fannie Mae Pool '535435', 8,500%, scadenza 01/08/2030	—	—	100 Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500%, scadenza 01/11/2046	91	0,01
— Fannie Mae Pool '535608', 9,500%, scadenza 01/04/2030	—	—	469 Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930%, scadenza 01/06/2030	422	0,04
3 Fannie Mae Pool '535996', 7,500%, scadenza 01/06/2031	3	—	178 Fannie Mae Pool 'AN4677', 3,200%, scadenza 01/02/2029	165	0,01
— Fannie Mae Pool '537715', 8,500%, scadenza 01/09/2030	—	—	322 Fannie Mae Pool 'AN4927', 3,450%, scadenza 01/03/2029	302	0,03
19 Fannie Mae Pool '545189', 7,500%, scadenza 01/08/2031	19	—	328 Fannie Mae Pool 'AN5386', 3,250%, scadenza 01/05/2029	304	0,03
15 Fannie Mae Pool '545190', 7,500%, scadenza 01/08/2031	15	—	97 Fannie Mae Pool 'AQ4102', 4,000%, scadenza 01/06/2042	92	0,01
1 Fannie Mae Pool '545612', 8,000%, scadenza 01/04/2032	1	—	329 Fannie Mae Pool 'AP9766', 4,000%, scadenza 01/10/2042	311	0,03
2 Fannie Mae Pool '545990', 7,500%, scadenza 01/04/2031	2	—	994 Fannie Mae Pool 'AQ6295', 3,500%, scadenza 01/12/2032	940	0,08
— Fannie Mae Pool '546591', 8,500%, scadenza 01/06/2030	—	—	62 Fannie Mae Pool 'AQ7130', 3,500%, scadenza 01/12/2032	59	0,01
1 Fannie Mae Pool '548965', 8,500%, scadenza 01/07/2030	1	—	238 Fannie Mae Pool 'AQ7270', 3,500%, scadenza 01/12/2032	225	0,02
8 Fannie Mae Pool '555676', 7,500%, scadenza 01/12/2032	8	—	281 Fannie Mae Pool 'AQ7306', 3,000%, scadenza 01/01/2043	250	0,02
13 Fannie Mae Pool '745248', 7,500%, scadenza 01/08/2034	13	—	291 Fannie Mae Pool 'AQ7864', 3,500%, scadenza 01/12/2032	276	0,02
109 Fannie Mae Pool '745802', 6,000%, scadenza 01/07/2036	112	0,01	46 Fannie Mae Pool 'AQ7869', 3,500%, scadenza 01/11/2032	44	—
			129 Fannie Mae Pool 'AQ7913', 3,500%, scadenza 01/12/2032	122	0,01
			131 Fannie Mae Pool 'AQ8677', 3,500%, scadenza 01/12/2032	124	0,01
			85 Fannie Mae Pool 'AR1198', 3,000%, scadenza 01/01/2043	75	0,01
			283 Fannie Mae Pool 'AR1202', 3,000%, scadenza 01/01/2043	252	0,02
			145 Pool Fannie Mae 'AR7399', 3,000%, scadenza 01/06/2043	128	0,01
			339 Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000%, scadenza 01/07/2043	301	0,03
			536 Fannie Mae Pool 'AS0462', 3,500%, scadenza 01/09/2033	506	0,04
			188 Fannie Mae Pool 'AS0469', 4,000%, scadenza 01/09/2033	181	0,02
			103 Fannie Mae Pool 'AS1281', 3,500%, scadenza 01/12/2033	98	0,01
			3.299 Pool Fannie Mae 'AS4347', 4,000%, scadenza 01/01/2045	3.133	0,28
			1.467 Fannie Mae Pool 'AS4363', 4,500%, scadenza 01/02/2045	1.421	0,13
			402 Fannie Mae Pool 'AS6340', 3,500%, scadenza 01/12/2045	367	0,03
			269 Fannie Mae Pool 'AS6541', 3,500%, scadenza 01/01/2046	246	0,02
			219 Fannie Mae Pool 'AS6562', 3,500%, scadenza 01/01/2046	199	0,02
			239 Fannie Mae Pool 'AS9453', 4,000%, scadenza 01/04/2047	225	0,02
			153 Fannie Mae Pool 'AS9760', 4,500%, scadenza 01/06/2047	148	0,01
			207 Fannie Mae Pool 'AT2486', 3,500%, scadenza 01/06/2033	195	0,02
			3.129 Fannie Mae Pool 'AT3070', 3,500%, scadenza 01/04/2043	2.890	0,26
			69 Fannie Mae Pool 'AU4395', 4,000%, scadenza 01/10/2033	67	0,01
			32 Fannie Mae Pool 'AU4397', 4,000%, scadenza 01/10/2033	31	—
			325 Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000%, scadenza 01/10/2043	288	0,03
			72 Fannie Mae Pool 'AU7248', 4,000%, scadenza 01/10/2033	69	0,01
			80 Fannie Mae Pool 'AU9562', 4,000%, scadenza 01/10/2033	77	0,01
			107 Fannie Mae Pool 'AU9567', 4,000%, scadenza 01/10/2033	103	0,01
			81 Fannie Mae Pool 'AU9570', 4,000%, scadenza 01/10/2033	78	0,01
			21 Fannie Mae Pool 'AV7116', 4,500%, scadenza 01/03/2044	21	—
			74 Fannie Mae Pool 'AV7681', 3,500%, scadenza 01/01/2034	70	0,01

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
165 Fannie Mae Pool 'AV7683', 3,500%, scadenza 01/01/2034	157	0,01	84 Fannie Mae Pool 'BX6441', 6,500%, scadenza 01/02/2053	86	0,01
207 Fannie Mae Pool 'AV7694', 3,500%, scadenza 01/01/2034	195	0,02	1.028 Fannie Mae Pool 'BX7702', 6,500%, scadenza 01/02/2053	1.046	0,09
284 Fannie Mae Pool 'AV7696', 3,500%, scadenza 01/01/2034	270	0,02	133 Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500%, scadenza 01/12/2047	121	0,01
2.203 Fannie Mae Pool 'AZ9645', 4,000%, scadenza 01/09/2035	2.101	0,19	5.098 Fannie Mae Pool 'CA0917', 3,500%, scadenza 01/12/2047	4.637	0,41
2.460 Fannie Mae Pool 'BF0144', 3,500%, scadenza 01/10/2056	2.215	0,20	1.209 Fannie Mae Pool 'CA1902', 4,500%, scadenza 01/06/2048	1.168	0,10
684 Fannie Mae Pool 'BF0145', 3,500%, scadenza 01/03/2057	616	0,05	919 Fannie Mae Pool 'CA6000', 3,000%, scadenza 01/06/2050	798	0,07
1.887 Fannie Mae Pool 'BF0161', 5,000%, scadenza 01/10/2046	1.887	0,17	481 Fannie Mae Pool 'CA6053', 3,000%, scadenza 01/06/2050	418	0,04
3.892 Fannie Mae Pool 'BF0162', 5,000%, scadenza 01/11/2045	3.892	0,35	3.682 Fannie Mae Pool 'CA7257', 2,500%, scadenza 01/10/2050	3.097	0,27
897 Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000%, scadenza 01/06/2057	840	0,07	69 Fannie Mae Pool 'CA8955', 2,500%, scadenza 01/02/2051	58	-
1.676 Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500%, scadenza 01/09/2057	1.599	0,14	1.798 Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000%, scadenza 01/10/2051	1.558	0,14
1.114 Fannie Mae Pool 'BF0263', 3,500%, scadenza 01/05/2058	1.003	0,09	4.670 Fannie Mae Pool 'CB2164', 3,000%, scadenza 01/11/2051	4.063	0,36
2.051 Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500%, scadenza 01/08/2058	1.957	0,17	2.923 Fannie Mae Pool 'CB2292', 3,000%, scadenza 01/11/2051	2.553	0,23
700 Fannie Mae Pool 'BF0338', 4,500%, scadenza 01/01/2059	668	0,06	2.227 Fannie Mae Pool 'CB3044', 2,500%, scadenza 01/03/2052	1.866	0,17
1.965 Fannie Mae Pool 'BF0531', 2,500%, scadenza 01/05/2055	1.640	0,15	370 Fannie Mae Pool 'CB3833', 3,000%, scadenza 01/06/2052	320	0,03
177 Fannie Mae Pool 'BH6684', 4,000%, scadenza 01/08/2047	167	0,01	7.227 Fannie Mae Pool 'CB4898', 5,000%, scadenza 01/10/2052	7.017	0,62
84 Fannie Mae Pool 'BJ0685', 4,000%, scadenza 01/04/2048	79	0,01	931 Fannie Mae Pool 'CB5156', 6,500%, scadenza 01/11/2052	953	0,08
1.106 Fannie Mae Pool 'BJ2544', 4,500%, scadenza 01/12/2037	1.002	0,09	1.305 Fannie Mae Pool 'CB5497', 6,500%, scadenza 01/01/2053	1.337	0,12
293 Fannie Mae Pool 'BJ2763', 4,500%, scadenza 01/05/2048	284	0,03	1.704 Fannie Mae Pool 'FM1002', 3,500%, scadenza 01/01/2048	1.549	0,14
28 Fannie Mae Pool 'BK0751', 3,500%, scadenza 01/03/2048	25	-	69 Fannie Mae Pool 'FM1159', 4,500%, scadenza 01/02/2048	67	0,01
765 Fannie Mae Pool 'BK4770', 4,500%, scadenza 01/08/2048	736	0,07	864 Fannie Mae Pool 'FM1349', 3,500%, scadenza 01/03/2047	789	0,07
382 Fannie Mae Pool 'BM1660', 4,000%, scadenza 01/08/2047	359	0,03	64 Fannie Mae Pool 'FM1458', 4,500%, scadenza 01/04/2049	61	0,01
1.293 Fannie Mae Pool 'BM3929', 2,500%, scadenza 01/07/2032	1.230	0,11	6.337 Fannie Mae Pool 'FM1625', 4,000%, scadenza 01/09/2049	5.962	0,53
1.041 Fannie Mae Pool 'BM4696', 3,000%, scadenza 01/03/2047	923	0,08	1.931 Fannie Mae Pool 'FM1637', 4,500%, scadenza 01/05/2049	997	0,09
178 Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500%, scadenza 01/03/2043	165	0,01	201 Fannie Mae Pool 'FM2173', 4,000%, scadenza 01/09/2048	188	0,02
93 Fannie Mae Pool 'BM4781', 4,500%, scadenza 01/10/2048	90	0,01	1.980 Fannie Mae Pool 'FM2256', 4,500%, scadenza 01/10/2044	1.918	0,17
249 Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500%, scadenza 01/12/2046	230	0,02	431 Fannie Mae Pool 'FM2745', 4,500%, scadenza 01/03/2050	414	0,04
1.885 Fannie Mae Pool 'BM4951', 4,500%, scadenza 01/09/2048	1.825	0,16	70 Fannie Mae Pool 'FM3083', 4,500%, scadenza 01/10/2049	68	0,01
782 Fannie Mae Pool 'BM5073', 3,000%, scadenza 01/04/2048	687	0,06	256 Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000%, scadenza 01/11/2048	240	0,02
117 Fannie Mae Pool 'BM5119', 4,500%, scadenza 01/12/2048	113	0,01	1.933 Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000%, scadenza 01/09/2048	1.816	0,16
1.393 Fannie Mae Pool 'BM6898', 2,149%, scadenza 01/02/2032 *	1.139	0,10	74 Fannie Mae Pool 'FM3542', 4,000%, scadenza 01/05/2049	70	0,01
645 Fannie Mae Pool 'BM6912', 2,500%, scadenza 01/01/2052	520	0,05	190 Fannie Mae Pool 'FM3830', 3,000%, scadenza 01/04/2050	166	0,01
104 Fannie Mae Pool 'BO2878', 3,000%, scadenza 01/11/2049	90	0,01	97 Fannie Mae Pool 'FM4532', 3,000%, scadenza 01/09/2050	84	0,01
144 Fannie Mae Pool 'BO8932', 3,000%, scadenza 01/01/2050	126	0,01	643 Fannie Mae Pool 'FM4577', 2,500%, scadenza 01/10/2050	539	0,05
810 Fannie Mae Pool 'BP2319', 3,000%, scadenza 01/02/2050	705	0,06	364 Fannie Mae Pool 'FM5018', 2,500%, scadenza 01/12/2050	303	0,03
631 Fannie Mae Pool 'BP3484', 2,500%, scadenza 01/06/2051	530	0,05	1.194 Fannie Mae Pool 'FM5423', 2,500%, scadenza 01/01/2051	1.003	0,09
951 Fannie Mae Pool 'BP6171', 3,500%, scadenza 01/04/2050	866	0,08	3.030 Fannie Mae Pool 'FM5592', 4,000%, scadenza 01/12/2050	2.825	0,25
3.695 Fannie Mae Pool 'BP7395', 1,500%, scadenza 01/10/2040	3.004	0,27	62 Fannie Mae Pool 'FM5743', 2,500%, scadenza 01/02/2051	52	-
662 Fannie Mae Pool 'BP8713', 3,000%, scadenza 01/08/2050	573	0,05	117 Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500%, scadenza 01/02/2051	98	0,01
614 Pool Fannie Mae 'BQ1150', 2,500%, scadenza 01/10/2050	516	0,05	284 Fannie Mae Pool 'FM5931', 2,500%, scadenza 01/02/2051	237	0,02
947 Fannie Mae Pool 'BQ5815', 2,500%, scadenza 01/11/2050	793	0,07	269 Fannie Mae Pool 'FM6117', 3,000%, scadenza 01/11/2048	236	0,02
320 Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500%, scadenza 01/11/2050	269	0,02	152 Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500%, scadenza 01/03/2051	128	0,01
73 Fannie Mae Pool 'BR0001', 2,500%, scadenza 01/12/2050	62	0,01	249 Fannie Mae Pool 'FM6816', 2,500%, scadenza 01/04/2051	208	0,02
724 Fannie Mae Pool 'BR1001', 2,500%, scadenza 01/05/2051	613	0,05	2.506 Fannie Mae Pool 'FM7167', 4,500%, scadenza 01/08/2050	2.403	0,21
62 Fannie Mae Pool 'BR1823', 2,000%, scadenza 01/01/2051	66	0,01	15.118 Fannie Mae Pool 'FM7382', 3,000%, scadenza 01/05/2051	13.145	1,17
83 Fannie Mae Pool 'BR2303', 3,000%, scadenza 01/08/2051	72	0,01	6.838 Fannie Mae Pool 'FM7518', 2,500%, scadenza 01/06/2051	5.726	0,51
150 Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000%, scadenza 01/02/2051	121	0,01	244 Fannie Mae Pool 'FM7529', 3,000%, scadenza 01/05/2051	212	0,02
146 Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000%, scadenza 01/02/2051	118	0,01	274 Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500%, scadenza 01/06/2051	230	0,02
71 Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000%, scadenza 01/02/2051	59	-	85 Fannie Mae Pool 'FM7676', 2,500%, scadenza 01/06/2051	71	0,01
71 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000%, scadenza 01/02/2051	57	-	79 Fannie Mae Pool 'FM7694', 3,000%, scadenza 01/06/2051	68	0,01
227 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000%, scadenza 01/02/2051	186	0,02	240 Fannie Mae Pool 'FM7727', 2,500%, scadenza 01/06/2051	204	0,02
379 Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000%, scadenza 01/03/2051	307	0,03	864 Fannie Mae Pool 'FM7869', 2,500%, scadenza 01/01/2051	727	0,06
161 Fannie Mae Pool 'BR4035', 2,000%, scadenza 01/02/2051	129	0,01	1.054 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500%, scadenza 01/07/2051	885	0,08
4.321 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000%, scadenza 01/03/2051	3.458	0,31	845 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500%, scadenza 01/07/2051	714	0,06
364 Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000%, scadenza 01/03/2051	294	0,03	750 Fannie Mae Pool 'FM8025', 2,500%, scadenza 01/07/2051	634	0,06
322 Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000%, scadenza 01/03/2051	261	0,02	304 Fannie Mae Pool 'FM8166', 3,000%, scadenza 01/06/2051	268	0,02
639 Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000%, scadenza 01/03/2051	516	0,05	1.614 Fannie Mae Pool 'FM8188', 3,000%, scadenza 01/03/2040	1.472	0,13
316 Fannie Mae Pool 'BR5487', 2,000%, scadenza 01/03/2051	255	0,02	3.125 Fannie Mae Pool 'FM8189', 3,000%, scadenza 01/08/2038	2.883	0,26
563 Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000%, scadenza 01/03/2051	455	0,04	1.253 Fannie Mae Pool 'FM8210', 3,000%, scadenza 01/04/2050	1.095	0,10
896 Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000%, scadenza 01/03/2051	724	0,06	9.967 Fannie Mae Pool 'FM8415', 2,000%, scadenza 01/08/2051	7.946	0,71
154 Fannie Mae Pool 'BR6515', 2,000%, scadenza 01/04/2051	126	0,01	1.481 Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000%, scadenza 01/02/2050	1.304	0,12
412 Fannie Mae Pool 'BR6768', 2,500%, scadenza 01/06/2051	344	0,03	14.193 Fannie Mae Pool 'FM8685', 3,000%, scadenza 01/09/2051	12.311	1,09
76 Fannie Mae Pool 'BR7744', 2,000%, scadenza 01/04/2051	62	0,01	2.834 Fannie Mae Pool 'FM8786', 2,500%, scadenza 01/10/2051	2.377	0,21
74 Fannie Mae Pool 'BR7745', 2,000%, scadenza 01/04/2051	60	0,01	411 Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500%, scadenza 01/10/2051	345	0,03
203 Fannie Mae Pool 'BR8276', 2,500%, scadenza 01/04/2051	171	0,01	81 Fannie Mae Pool 'FM8977', 2,500%, scadenza 01/09/2051	69	0,01
80 Fannie Mae Pool 'BR8478', 2,000%, scadenza 01/04/2051	65	0,01	476 Fannie Mae Pool 'FM9044', 3,000%, scadenza 01/10/2051	414	0,04
76 Fannie Mae Pool 'BR8518', 2,000%, scadenza 01/04/2051	62	0,01	2.593 Fannie Mae Pool 'FM9264', 2,000%, scadenza 01/10/2041	2.158	0,19
284 Fannie Mae Pool 'BR9104', 2,500%, scadenza 01/05/2051	240	0,02	1.795 Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000%, scadenza 01/11/2051	1.566	0,14
927 Fannie Mae Pool 'BT0122', 2,500%, scadenza 01/06/2051	774	0,07	2.621 Fannie Mae Pool 'FM9362', 3,000%, scadenza 01/06/2038	2.446	0,22
497 Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500%, scadenza 01/07/2051	416	0,04	161 Fannie Mae Pool 'FM9412', 2,500%, scadenza 01/11/2051	135	0,01
689 Fannie Mae Pool 'BT3244', 2,500%, scadenza 01/07/2051	578	0,05	16.036 Fannie Mae Pool 'FM9434', 2,000%, scadenza 01/11/2051	12.962	1,15
600 Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500%, scadenza 01/08/2051	502	0,04	5.318 Fannie Mae Pool 'FM9456', 3,500%, scadenza 01/11/2051	4.834	0,43
353 Fannie Mae Pool 'BT3290', 2,500%, scadenza 01/08/2051	295	0,03	6.320 Fannie Mae Pool 'FM9507', 3,000%, scadenza 01/03/2037	5.898	0,52
247 Fannie Mae Pool 'BT3303', 2,500%, scadenza 01/08/2051	206	0,02	15.287 Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000%, scadenza 01/07/2051	12.237	1,09
3.019 Fannie Mae Pool 'BT9482', 2,500%, scadenza 01/12/2051	2.527	0,22	7.828 Fannie Mae Pool 'FM9733', 2,500%, scadenza 01/10/2051	6.553	0,58
15.894 Fannie Mae Pool 'BU0971', 2,000%, scadenza 01/11/2051	12.830	1,14	324 Fannie Mae Pool 'FM9867', 2,500%, scadenza 01/12/2051	272	0,02
879 Fannie Mae Pool 'BU2599', 2,500%, scadenza 01/01/2052	738	0,07	1.041 Fannie Mae Pool 'FS0028', 2,500%, scadenza 01/09/2051	873	0,08
3.163 Fannie Mae Pool 'BU2838', 2,500%, scadenza 01/11/2051	2.643	0,23	223 Fannie Mae Pool 'FS0041', 3,000%, scadenza 01/11/2050	196	0,02
75 Fannie Mae Pool 'BU3608', 3,000%, scadenza 01/11/2051	65	0,01	1.334 Fannie Mae Pool 'FS0316', 1,500%, scadenza 01/11/2041	1.071	0,09
81 Fannie Mae Pool 'BU5295', 3,000%, scadenza 01/12/2051	71	0,01	4.099 Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000%, scadenza 01/01/2052	3.545	0,31
1.583 Fannie Mae Pool 'BU8670', 4,500%, scadenza 01/05/2052	1.502	0,13	3.503 Fannie Mae Pool 'FS0352', 2,000%, scadenza 01/01/2052	2.809	0,25
3.790 Fannie Mae Pool 'BW5810', 5,000%, scadenza 01/08/2052	3.679	0,33	347 Fannie Mae Pool 'FS0408', 3,000%, scadenza 01/01/2052	305	0,03
			257 Fannie Mae Pool 'FS0464', 2,000%, scadenza 01/01/2052	205	0,02
			2.267 Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000%, scadenza 01/02/2052	1.971	0,17

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
445 Fannie Mae Pool 'FS0534', 2,500%, scadenza 01/07/2051	374	0,03	1.155 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 57, Classe NS, 0,598%, scadenza 25/10/2049	121	0,01
2.331 Fannie Mae Pool 'FS0551', 2,500%, scadenza 01/02/2052	1.957	0,17	1.414 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 58, Classe HS, 0,598%, scadenza 25/10/2049 *	144	0,01
1.609 Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500%, scadenza 01/02/2052	1.349	0,12	2.895 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 59, Classe SH, 0,598%, scadenza 25/10/2049 *	319	0,03
1.409 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000%, scadenza 01/02/2052	1.135	0,10	1.219 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 26, Classe SA, 0,548%, scadenza 25/05/2050	119	0,01
820 Fannie Mae Pool 'FS0612', 2,000%, scadenza 01/02/2052	662	0,06	959 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 47, Classe GZ, 2,000%, scadenza 25/07/2050	558	0,05
5.927 Fannie Mae Pool 'FS1107', 2,500%, scadenza 01/12/2051	4.971	0,44	1.651 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 62, Classe BI, 2,000%, scadenza 25/09/2050	198	0,02
530 Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000%, scadenza 01/03/2052	466	0,04	2.472 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 67, Classe IH, 2,000%, scadenza 25/09/2050	318	0,03
336 Fannie Mae Pool 'FS1403', 3,000%, scadenza 01/01/2045	297	0,03	151 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 74, Classe EI, 2,500%, scadenza 25/10/2050	24	–
433 Fannie Mae Pool 'FS1539', 3,000%, scadenza 01/11/2048	383	0,03	13.235 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 88, Classe GI, 2,500%, scadenza 25/12/2050	1.973	0,17
787 Fannie Mae Pool 'FS1553', 2,500%, scadenza 01/11/2050	662	0,06	1.055 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 89, Classe DI, 2,500%, scadenza 25/12/2050	159	0,01
1.281 Fannie Mae Pool 'FS1628', 2,500%, scadenza 01/04/2052	1.084	0,10	8.668 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 91, Classe IO, 2,500%, scadenza 25/12/2050	1.323	0,12
726 Fannie Mae Pool 'FS1938', 2,500%, scadenza 01/02/2052	606	0,05	6.250 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 93, Classe LI, 2,500%, scadenza 25/01/2051	891	0,08
6.813 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500%, scadenza 01/06/2049	6.196	0,55	24.912 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 42, Classe NI, 2,500%, scadenza 25/11/2048	3.235	0,29
656 Fannie Mae Pool 'FS3009', 2,000%, scadenza 01/05/2042	547	0,05	7.755 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 46, Classe BI, 2,500%, scadenza 25/12/2048	1.066	0,09
5.482 Fannie Mae Pool 'FS3191', 5,500%, scadenza 01/10/2052	5.415	0,48	5.153 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 49, Classe GI, 2,500%, scadenza 25/10/2048	677	0,06
1.738 Fannie Mae Pool 'FS3411', 6,000%, scadenza 01/01/2053	1.753	0,16	1.185 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 54, Classe KI, 2,500%, scadenza 25/05/2049	164	0,01
1.289 Fannie Mae Pool 'FS3589', 4,500%, scadenza 01/01/2050	1.257	0,11	9.457 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 59, Classe TI, 2,500%, scadenza 25/09/2051	1.432	0,13
7.086 Fannie Mae Pool 'FS4269', 2,000%, scadenza 01/10/2051	5.723	0,51	1.508 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 61, Classe KI, 2,500%, scadenza 25/04/2049	210	0,02
6.596 Fannie Mae Pool 'FS4270', 2,000%, scadenza 01/03/2052	5.298	0,47	5.825 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 85, Classe IN, 2,500%, scadenza 25/02/2050	946	0,08
2.465 Fannie Mae Pool 'FS4570', 5,000%, scadenza 01/12/2047	2.465	0,22	13.174 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 91, Classe IG, 2,500%, scadenza 25/01/2052	1.937	0,17
988 Fannie Mae Pool 'FS4933', 6,000%, scadenza 01/06/2053	991	0,09	11.514 Fannie Mae REMICS, Serie 2022 29, Classe KZ, 1,500%, scadenza 25/06/2042	7.975	0,71
2.643 Fannie Mae Pool 'FS5059', 3,500%, scadenza 01/11/2048	2.409	0,21	732 Fannie Mae REMICS, Serie 2022 57, Classe BC, 4,000%, scadenza 25/09/2052	689	0,06
9 Fannie Mae Pool 'MA0440', 5,500%, scadenza 01/05/2040	9	–	286 Fannie Mae-Aces, Serie 2016 M11, Classe AL, 2,944%, scadenza 25/07/2039	254	0,02
26 Fannie Mae Pool 'MA0619', 5,500%, scadenza 01/11/2040	26	–	15.530 Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M11, Classe X1, 1,187%, scadenza 25/06/2029 *	705	0,06
4 Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500%, scadenza 01/04/2031	4	–	14.864 Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M13, Classe X1, 0,940%, scadenza 25/06/2034 *	603	0,05
10 Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500%, scadenza 01/05/2031	10	–	37.401 Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M14, Classe X1, 0,671%, scadenza 25/06/2029 *	946	0,08
14 Fannie Mae Pool 'MA0766', 5,500%, scadenza 01/05/2041	14	–	5.450 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M11, Classe IO, 1,872%, scadenza 25/01/2029 *	397	0,04
5 Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500%, scadenza 01/06/2031	5	–	33.662 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M16, Classe X1, 0,538%, scadenza 25/04/2032 *	897	0,08
133 Fannie Mae Pool 'MA0823', 5,500%, scadenza 01/07/2041	135	0,01	4.471 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M24, Classe X1, 1,703%, scadenza 25/01/2037 *	412	0,04
64 Fannie Mae Pool 'MA0867', 5,500%, scadenza 01/09/2041	64	0,01	15.192 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M31, Classe X2, 1,333%, scadenza 25/12/2032 *	899	0,08
131 Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500%, scadenza 01/11/2031	128	0,01	36 Freddie Mac Gold Pool 'A29586', 5,000%, scadenza 01/01/2035	36	–
144 Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500%, scadenza 01/12/2031	140	0,01	9 Freddie Mac Gold Pool 'A30703', 5,500%, scadenza 01/12/2034	9	–
29 Fannie Mae Pool 'MA0968', 4,500%, scadenza 01/12/2031	28	–	96 Freddie Mac Gold Pool 'A35950', 5,000%, scadenza 01/07/2035	96	0,01
176 Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500%, scadenza 01/09/2042	161	0,01	12 Freddie Mac Gold Pool 'A36526', 5,000%, scadenza 01/08/2035	12	–
10 Fannie Mae Pool 'MA1221', 4,500%, scadenza 01/09/2042	10	–	37 Freddie Mac Gold Pool 'A39036', 5,000%, scadenza 01/05/2035	37	–
43 Fannie Mae Pool 'MA1363', 3,000%, scadenza 01/02/2043	38	–	6 Freddie Mac Gold Pool 'A39302', 5,500%, scadenza 01/11/2035	6	–
1.334 Fannie Mae Pool 'MA1393', 4,000%, scadenza 01/03/2043	1.265	0,11	– Freddie Mac Gold Pool 'A84166', 6,500%, scadenza 01/01/2039	–	–
297 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500%, scadenza 01/09/2043	288	0,03	1 Freddie Mac Gold Pool 'C00556', 8,000%, scadenza 01/10/2027	1	–
226 Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500%, scadenza 01/10/2043	219	0,02	– Freddie Mac Gold Pool 'C01025', 8,000%, scadenza 01/07/2030	–	–
144 Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500%, scadenza 01/11/2043	139	0,01	– Freddie Mac Gold Pool 'C01051', 8,000%, scadenza 01/09/2030	–	–
201 Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500%, scadenza 01/12/2043	194	0,02	1 Freddie Mac Gold Pool 'C46047', 8,000%, scadenza 01/12/2030	1	–
410 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000%, scadenza 01/07/2036	379	0,03	3 Freddie Mac Gold Pool 'C55319', 8,000%, scadenza 01/08/2031	3	–
396 Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000%, scadenza 01/12/2036	364	0,03	– Freddie Mac Gold Pool 'C57324', 8,000%, scadenza 01/09/2031	–	–
225 Fannie Mae Pool 'MA4175', 1,500%, scadenza 01/11/2040	183	0,02	2 Freddie Mac Gold Pool 'C91046', 6,500%, scadenza 01/05/2027	2	–
649 Fannie Mae Pool 'MA4204', 2,000%, scadenza 01/12/2040	546	0,05	1.014 Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000%, scadenza 01/02/2038	920	0,08
5.448 Fannie Mae Pool 'MA4208', 2,000%, scadenza 01/12/2050	4.367	0,39	– Freddie Mac Gold Pool 'G00556', 8,000%, scadenza 01/09/2026	–	–
7.728 Fannie Mae Pool 'MA4325', 2,000%, scadenza 01/05/2051	6.163	0,55	1 Freddie Mac Gold Pool 'G00726', 8,000%, scadenza 01/06/2027	1	–
464 Fannie Mae Pool 'MA4342', 1,500%, scadenza 01/05/2041	373	0,03	– Freddie Mac Gold Pool 'G00931', 8,000%, scadenza 01/11/2026	–	–
420 Fannie Mae Pool 'MA4387', 2,000%, scadenza 01/07/2041	353	0,03	5 Freddie Mac Gold Pool 'G02427', 5,500%, scadenza 01/12/2036	5	–
1.328 Fannie Mae Pool 'MA4500', 1,500%, scadenza 01/12/2041	1.066	0,09	26 Freddie Mac Gold Pool 'G04581', 6,500%, scadenza 01/08/2038	26	–
2.788 Fannie Mae Pool 'MA4570', 2,000%, scadenza 01/03/2042	2.318	0,21	1 Freddie Mac Gold Pool 'G04947', 6,500%, scadenza 01/04/2038	1	–
876 Fannie Mae REMICS, Serie 2010 2, Classe AL, 5,500%, scadenza 25/02/2040	147	0,01	4 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500%, scadenza 01/09/2039	4	–
910 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 124, Classe SD, 0,748%, scadenza 25/11/2042 *	93	0,01	94 Freddie Mac Gold Pool 'G07335', 7,000%, scadenza 01/03/2039	100	0,01
1.280 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 22, Classe SM, 1,098%, scadenza 25/03/2042 *	138	0,01	213 Freddie Mac Gold Pool 'G07509', 6,500%, scadenza 01/09/2039	219	0,02
587 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 9, Classe PT, 11,414%, scadenza 25/07/2036 *	694	0,06	903 Freddie Mac Gold Pool 'G08700', 4,500%, scadenza 01/03/2046	876	0,08
735 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Classe BC, 6,500%, scadenza 25/07/2042	775	0,07			
3.451 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Classe CB, 5,500%, scadenza 25/04/2042	3.487	0,31			
134 Fannie Mae REMICS, Serie 2015 39, Classe LZ, 3,000%, scadenza 25/06/2045	116	0,01			
5.604 Fannie Mae REMICS, Serie 2016 48, Classe IA, 4,500%, scadenza 25/06/2038	806	0,07			
2.091 Fannie Mae REMICS, Serie 2017 74, Classe PZ, 3,500%, scadenza 25/10/2047	1.647	0,15			
3.527 Fannie Mae REMICS, Serie 2018 3, Classe IO, 4,000%, scadenza 25/02/2048	680	0,06			
1.145 Fannie Mae REMICS, Serie 2018 74, Classe AB, 3,500%, scadenza 25/10/2048	1.040	0,09			
896 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 25, Classe PI, 5,000%, scadenza 25/05/2048	174	0,02			
3.882 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 38, Classe SH, 0,867%, scadenza 25/07/2049 *	357	0,03			
1.944 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 44, Classe SM, 0,648%, scadenza 25/08/2049 *	249	0,02			
2.106 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 45, Classe BS, 0,648%, scadenza 25/08/2049	228	0,02			
3.741 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 5, Classe IO, 4,500%, scadenza 25/03/2049	720	0,06			

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
151 Freddie Mac Gold Pool 'G16672', 3,000%, scadenza 01/03/2033	143	0,01	303 Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500%, scadenza 01/11/2050	254	0,02
1.179 Freddie Mac Gold Pool 'G60329', 5,500%, scadenza 01/06/2040	1.203	0,11	75 Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000%, scadenza 01/02/2051	61	0,01
3.502 Freddie Mac Gold Pool 'G60344', 4,000%, scadenza 01/12/2045	3.328	0,30	139 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000%, scadenza 01/02/2051	113	0,01
4.856 Freddie Mac Gold Pool 'G61814', 3,500%, scadenza 01/09/2048	4.426	0,39	71 Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000%, scadenza 01/02/2051	58	–
8.558 Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000%, scadenza 01/10/2046	7.559	0,67	76 Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000%, scadenza 01/03/2051	61	0,01
1 Freddie Mac Gold Pool 'H00790', 5,500%, scadenza 01/05/2037	1	–	223 Freddie Mac Pool 'QB9484', 2,000%, scadenza 01/03/2051	181	0,02
43 Freddie Mac Gold Pool 'H02425', 5,500%, scadenza 01/02/2038	43	–	152 Freddie Mac Pool 'QB9485', 2,000%, scadenza 01/03/2051	124	0,01
1 Freddie Mac Gold Pool 'H09170', 5,500%, scadenza 01/01/2038	1	–	84 Freddie Mac Pool 'QB9961', 2,000%, scadenza 01/03/2051	67	0,01
279 Freddie Mac Gold Pool 'J39722', 3,000%, scadenza 01/10/2033	261	0,02	66 Freddie Mac Pool 'QC0160', 2,000%, scadenza 01/03/2051	53	–
169 Freddie Mac Gold Pool 'J39962', 3,000%, scadenza 01/12/2033	158	0,01	78 Freddie Mac Pool 'QC0161', 2,000%, scadenza 01/03/2051	63	0,01
164 Freddie Mac Gold Pool 'Q26702', 4,000%, scadenza 01/06/2044	156	0,01	82 Freddie Mac Pool 'QC0885', 2,000%, scadenza 01/04/2051	67	0,01
1.298 Freddie Mac Gold Pool 'U69040', 4,000%, scadenza 01/05/2045	1.228	0,11	73 Freddie Mac Pool 'QC1164', 2,000%, scadenza 01/04/2051	59	0,01
59 Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000%, scadenza 01/10/2042	56	–	160 Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500%, scadenza 01/05/2051	136	0,01
360 Freddie Mac Gold Pool 'U90378', 4,000%, scadenza 01/11/2042	341	0,03	551 Freddie Mac Pool 'QC3242', 3,000%, scadenza 01/06/2051	481	0,04
306 Freddie Mac Gold Pool 'U90436', 4,000%, scadenza 01/11/2042	289	0,03	424 Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500%, scadenza 01/07/2051	356	0,03
32 Freddie Mac Gold Pool 'U90598', 3,500%, scadenza 01/12/2042	30	–	423 Freddie Mac Pool 'QC4689', 2,500%, scadenza 01/08/2051	355	0,03
79 Freddie Mac Gold Pool 'U90608', 3,500%, scadenza 01/12/2042	72	0,01	446 Freddie Mac Pool 'QC4690', 2,500%, scadenza 01/08/2051	374	0,03
31 Freddie Mac Gold Pool 'U90768', 3,500%, scadenza 01/01/2043	28	–	351 Freddie Mac Pool 'QC4818', 2,500%, scadenza 01/08/2051	294	0,03
63 Freddie Mac Gold Pool 'U90778', 3,500%, scadenza 01/01/2043	58	–	521 Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500%, scadenza 01/08/2051	437	0,04
78 Freddie Mac Gold Pool 'U90794', 3,500%, scadenza 01/01/2043	72	0,01	3.871 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500%, scadenza 01/08/2051	3.250	0,29
143 Freddie Mac Gold Pool 'U90828', 3,500%, scadenza 01/02/2043	131	0,01	1.861 Freddie Mac Pool 'QC7411', 2,500%, scadenza 01/09/2051	1.562	0,14
107 Freddie Mac Gold Pool 'U90879', 3,500%, scadenza 01/02/2043	98	0,01	3.690 Freddie Mac Pool 'QC8573', 2,500%, scadenza 01/10/2051	3.095	0,27
112 Freddie Mac Gold Pool 'U90903', 3,500%, scadenza 01/02/2043	103	0,01	944 Freddie Mac Pool 'QD1347', 2,500%, scadenza 01/11/2051	792	0,07
127 Freddie Mac Gold Pool 'U91027', 3,500%, scadenza 01/02/2043	116	0,01	3.998 Freddie Mac Pool 'QD1596', 2,000%, scadenza 01/12/2051	3.237	0,29
3.658 Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500%, scadenza 01/03/2045	3.349	0,30	89 Freddie Mac Pool 'QD1954', 3,000%, scadenza 01/11/2051	78	0,01
1.795 Freddie Mac Gold Pool 'U99135', 4,000%, scadenza 01/02/2044	1.700	0,15	84 Freddie Mac Pool 'QD2260', 3,000%, scadenza 01/12/2051	73	0,01
57.021 Certificati Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through K065, Classe X1, 0,804%, scadenza 25/04/2027 *	1.143	0,10	7.056 Freddie Mac Pool 'QD2419', 3,000%, scadenza 01/12/2051	6.175	0,55
82.417 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K069, Classe X1, 0,473%, scadenza 25/09/2027 *	1.024	0,09	254 Freddie Mac Pool 'QD4146', 2,500%, scadenza 01/01/2052	214	0,02
54.532 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K079, Classe XAM, 0,221%, scadenza 25/06/2028 *	301	0,03	548 Pool Freddie Mac 'QD5620', 2,000%, scadenza 01/02/2052	439	0,04
57.720 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K081, Classe XAM, 0,215%, scadenza 25/08/2028 *	298	0,03	654 Freddie Mac Pool 'QD5628', 2,000%, scadenza 01/02/2052	523	0,05
881 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K091, Classe X1, 0,706%, scadenza 25/03/2029 *	23	–	92 Freddie Mac Pool 'QD5827', 2,000%, scadenza 01/02/2052	74	0,01
6.975 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K105, Classe X1, 1,644%, scadenza 25/01/2030 *	533	0,05	842 Freddie Mac Pool 'QD5960', 2,000%, scadenza 01/02/2052	674	0,06
1.200 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K109, Classe A2, 1,558%, scadenza 25/04/2030	984	0,09	527 Freddie Mac Pool 'QD5961', 2,000%, scadenza 01/02/2052	421	0,04
9.945 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K110, Classe X1, 1,813%, scadenza 25/04/2030 *	841	0,07	3.315 Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500%, scadenza 01/02/2052	2.783	0,25
3.984 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K115, Classe X1, 1,428%, scadenza 25/06/2030 *	279	0,02	177 Freddie Mac Pool 'QD6142', 2,500%, scadenza 01/02/2052	233	0,02
7.951 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K116, Classe X1, 1,528%, scadenza 25/07/2030 *	588	0,05	281 Freddie Mac Pool 'QD6216', 3,000%, scadenza 01/02/2052	156	0,01
987 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K121, Classe X1, 1,119%, scadenza 25/10/2030 *	54	–	272 Freddie Mac Pool 'QD7365', 2,000%, scadenza 01/02/2052	220	0,02
85.160 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K123, Classe X1, 0,863%, scadenza 25/12/2030 *	3.670	0,33	195 Freddie Mac Pool 'QE5811', 4,000%, scadenza 01/07/2052	180	0,02
2.989 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K124, Classe X1, 0,810%, scadenza 25/12/2030 *	122	0,01	2.766 Freddie Mac Pool 'QE8530', 5,500%, scadenza 01/08/2052	2.770	0,25
12.496 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K132, Classe X1, 0,608%, scadenza 25/08/2031 *	405	0,04	2.810 Freddie Mac Pool 'QE8532', 5,500%, scadenza 01/08/2052	2.799	0,25
63.985 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K141, Classe X1, 0,407%, scadenza 25/02/2032 *	1.410	0,12	5.719 Freddie Mac Pool 'QE8537', 5,000%, scadenza 01/08/2052	5.549	0,49
61.465 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K142, Classe X1, 0,403%, scadenza 25/03/2032 *	1.313	0,12	1.968 Freddie Mac Pool 'QF3429', 5,500%, scadenza 01/11/2052	1.964	0,17
85.311 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K143, Classe X1, 0,450%, scadenza 25/04/2055 *	2.131	0,19	839 Freddie Mac Pool 'QF4924', 6,000%, scadenza 01/12/2052	849	0,08
17.889 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K148, Classe X1, 0,391%, scadenza 25/07/2032 *	374	0,03	178 Freddie Mac Pool 'QF6516', 6,500%, scadenza 01/01/2053	182	0,02
28.473 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates KG06, Classe X1, 0,626%, scadenza 25/10/2031 *	947	0,08	173 Freddie Mac Pool 'QF6690', 6,500%, scadenza 01/01/2053	176	0,02
4.173 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Serie K 1515, Classe X1, 1,636%, scadenza 25/02/2035 *	469	0,04	192 Freddie Mac Pool 'QF8222', 6,500%, scadenza 01/02/2053	195	0,02
6.499 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Serie K 154, Classe X1, 0,527%, scadenza 25/01/2033 *	194	0,02	299 Freddie Mac Pool 'QF8298', 6,500%, scadenza 01/03/2053	304	0,03
1.300 Freddie Mac Multifamily WI Certificates Serie WI-K159 K159, Classe A2, 4,500%, scadenza 25/11/2033	1.267	0,11	3.786 Freddie Mac Pool 'QF9586', 6,500%, scadenza 01/03/2053	3.850	0,34
5.243 Freddie Mac Non Gold Pool '841075', 3,265%, scadenza 01/01/2049 *	4.916	0,44	1.039 Freddie Mac Pool 'QG2834', 5,000%, scadenza 01/04/2053	1.009	0,09
2.428 Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,008%, scadenza 01/11/2048 *	2.273	0,20	1.175 Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000%, scadenza 01/09/2049	1.032	0,09
475 Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 2,871%, scadenza 01/11/2047 *	450	0,04	6.693 Freddie Mac Pool 'RA2194', 3,000%, scadenza 01/02/2050	5.874	0,52
825 Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,099%, scadenza 01/02/2050 *	782	0,07	367 Freddie Mac Pool 'RA2729', 2,500%, scadenza 01/06/2050	307	0,03
89 Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000%, scadenza 01/01/2050	78	0,01	394 Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000%, scadenza 01/11/2050	318	0,03
319 Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500%, scadenza 01/02/2050	289	0,03	5.594 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500%, scadenza 01/11/2050	4.711	0,42
2.972 Freddie Mac Pool 'QA7256', 3,000%, scadenza 01/02/2050	2.587	0,23	18.153 Freddie Mac Pool 'RA4142', 2,500%, scadenza 01/12/2050	15.282	1,36
118 Freddie Mac Pool 'QA9685', 3,000%, scadenza 01/05/2050	104	0,01	1.757 Freddie Mac Pool 'RA4175', 2,500%, scadenza 01/12/2050	1.475	0,13
190 Freddie Mac Pool 'QA9686', 3,000%, scadenza 01/05/2050	168	0,01	66 Freddie Mac Pool 'RA4349', 2,500%, scadenza 01/01/2051	55	–
444 Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500%, scadenza 01/11/2050	374	0,03	441 Freddie Mac Pool 'RA4414', 2,500%, scadenza 01/01/2051	369	0,03
			2.169 Freddie Mac Pool 'RA4526', 3,000%, scadenza 01/02/2051	1.892	0,17
			72 Freddie Mac Pool 'RA4532', 2,500%, scadenza 01/02/2051	60	0,01
			552 Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000%, scadenza 01/02/2051	445	0,04
			1.485 Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000%, scadenza 01/05/2051	1.193	0,11
			171 Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000%, scadenza 01/06/2051	137	0,01
			3.428 Freddie Mac Pool 'RA6685', 4,000%, scadenza 01/01/2052	3.171	0,28
			2.748 Freddie Mac Pool 'RA7184', 4,000%, scadenza 01/04/2052	2.545	0,23
			8.267 Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000%, scadenza 01/09/2041	6.903	0,61
			2.209 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500%, scadenza 01/10/2041	1.774	0,16
			281 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500%, scadenza 01/11/2041	226	0,02
			3.412 Freddie Mac Pool 'RB5138', 2,000%, scadenza 01/12/2041	2.827	0,25
			10.777 Freddie Mac Pool 'SC0190', 2,500%, scadenza 01/09/2041	9.300	0,83
			1.592 Freddie Mac Pool 'SC0319', 2,000%, scadenza 01/04/2042	1.329	0,12
			3.155 Freddie Mac Pool 'SC0399', 2,000%, scadenza 01/05/2042	2.644	0,23
			144 Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000%, scadenza 01/07/2047	136	0,01
			228 Freddie Mac Pool 'SD0422', 4,500%, scadenza 01/07/2045	217	0,02
			143 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000%, scadenza 01/04/2051	117	0,01
			336 Freddie Mac Pool 'SD0618', 3,000%, scadenza 01/02/2051	292	0,03
			4.744 Freddie Mac Pool 'SD0630', 4,000%, scadenza 01/02/2050	4.451	0,40
			5.054 Freddie Mac Pool 'SD0731', 2,000%, scadenza 01/05/2051	2.006	0,18
			7.705 Freddie Mac Pool 'SD0777', 2,500%, scadenza 01/11/2051	5.889	0,52
			3.684 Freddie Mac Pool 'SD0809', 3,000%, scadenza 01/01/2052	3.182	0,28
			877 Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500%, scadenza 01/01/2052	736	0,07
			376 Freddie Mac Pool 'SD0952', 3,000%, scadenza 01/04/2052	327	0,03

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)					
6.579 Freddie Mac Pool 'SD1070', 3,500%, scadenza 01/04/2052	5.954	0,53	9.330 Freddie Mac REMICS 5160, Classe IU, 2,500%, scadenza 25/11/2050	1.275	0,11
15.539 Freddie Mac Pool 'SD1143', 4,500%, scadenza 01/09/2050	14.955	1,33	9.576 Freddie Mac REMICS 5162, Classe DJ, 2,500%, scadenza 25/11/2051	1.284	0,11
13.668 Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000%, scadenza 01/07/2049	12.802	1,14	7.700 Freddie Mac REMICS 5169, Classe PW, 2,000%, scadenza 25/09/2051	5.015	0,45
3.718 Freddie Mac Pool 'SD1586', 3,500%, scadenza 01/08/2052	3.372	0,30	7.200 Freddie Mac REMICS 5178, Classe CY, 2,000%, scadenza 25/01/2042	4.791	0,43
4.473 Freddie Mac Pool 'SD1876', 5,500%, scadenza 01/11/2052	4.435	0,39	4.900 Freddie Mac REMICS 5209, Classe EQ, 3,000%, scadenza 25/04/2052	3.576	0,32
17.561 Freddie Mac Pool 'SD2245', 5,500%, scadenza 01/12/2052	17.371	1,54	1.901 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Serie 2022 DNA5, Classe M1A, 144A, 8,238%, scadenza 25/06/2042 *	1.944	0,17
6.913 Freddie Mac Pool 'SD2284', 6,000%, scadenza 01/12/2052	6.961	0,62	1.124 Freddie Mac Strips 312, Classe S1, 0,647%, scadenza 15/09/2043 *	109	0,01
954 Freddie Mac Pool 'SD2981', 6,500%, scadenza 01/05/2053	971	0,09	3.743 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2021 DNA2, Classe M2, 144A, 7,588%, scadenza 25/08/2033 *	3.753	0,33
4.072 Freddie Mac Pool 'SD3171', 5,500%, scadenza 01/06/2053	4.027	0,36	- Ginnie Mae I Pool '410304', 7,500%, scadenza 15/12/2025	-	-
3.960 Freddie Mac Pool 'SD3305', 1,500%, scadenza 01/08/2051	2.998	0,27	- Ginnie Mae I Pool '417463', 7,000%, scadenza 15/09/2025	-	-
6.991 Freddie Mac Pool 'SD3382', 5,000%, scadenza 01/06/2053	6.786	0,60	- Ginnie Mae I Pool '430208', 7,000%, scadenza 15/09/2027	-	-
2.986 Freddie Mac Pool 'SD3400', 4,500%, scadenza 01/10/2052	2.833	0,25	- Ginnie Mae I Pool '462669', 7,000%, scadenza 15/04/2028	-	-
606 Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000%, scadenza 01/11/2049	531	0,05	- Ginnie Mae I Pool '486470', 6,500%, scadenza 15/08/2028	-	-
4.412 Freddie Mac Pool 'SD7523', 2,500%, scadenza 01/08/2050	3.711	0,33	- Ginnie Mae I Pool '486516', 6,500%, scadenza 15/09/2028	-	-
211 Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500%, scadenza 01/10/2050	177	0,02	- Ginnie Mae I Pool '519569', 8,000%, scadenza 15/05/2030	-	-
3.743 Freddie Mac Pool 'SD7526', 2,500%, scadenza 01/10/2050	3.149	0,28	23 Ginnie Mae I Pool '646044', 6,500%, scadenza 15/10/2037	23	-
671 Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500%, scadenza 01/02/2051	569	0,05	1 Ginnie Mae I Pool '652203', 5,000%, scadenza 15/03/2036	1	-
23.062 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500%, scadenza 01/11/2051	19.365	1,72	3 Ginnie Mae I Pool '658182', 6,000%, scadenza 15/11/2036	3	-
4.735 Freddie Mac Pool 'SD8146', 2,000%, scadenza 01/05/2051	3.788	0,34	1 Ginnie Mae I Pool '675375', 5,000%, scadenza 15/05/2038	1	-
9.957 Freddie Mac Pool 'SI2048', 2,500%, scadenza 01/07/2050	8.333	0,74	1 Ginnie Mae I Pool '676940', 5,000%, scadenza 15/04/2038	1	-
1.132 Freddie Mac Pool 'ZA2343', 3,000%, scadenza 01/05/2034	1.076	0,10	4 Ginnie Mae I Pool '683926', 5,000%, scadenza 15/02/2038	4	-
1.528 Freddie Mac Pool 'ZA2415', 3,500%, scadenza 01/06/2036	1.409	0,12	6 Ginnie Mae I Pool '684334', 5,000%, scadenza 15/02/2038	6	-
251 Freddie Mac Pool 'ZA5297', 4,000%, scadenza 01/03/2048	236	0,02	2 Ginnie Mae I Pool '684754', 5,000%, scadenza 15/04/2038	2	-
229 Freddie Mac Pool 'Z19993', 5,000%, scadenza 01/05/2040	228	0,02	1 Ginnie Mae I Pool '684848', 5,000%, scadenza 15/04/2038	1	-
2.093 Freddie Mac Pool 'ZM1466', 3,500%, scadenza 01/07/2046	1.907	0,17	2 Ginnie Mae I Pool '686062', 5,000%, scadenza 15/05/2038	2	-
363 Freddie Mac Pool 'ZNO480', 3,500%, scadenza 01/10/2042	332	0,03	51 Ginnie Mae I Pool '698086', 6,000%, scadenza 15/04/2039	52	-
796 Freddie Mac Pool 'ZNO538', 3,500%, scadenza 01/11/2042	728	0,06	9 Ginnie Mae I Pool '701501', 5,000%, scadenza 15/12/2038	9	-
2.042 Freddie Mac Pool 'ZNO608', 3,500%, scadenza 01/02/2043	1.868	0,17	257 Ginnie Mae I Pool '701947', 5,000%, scadenza 15/06/2039	256	0,02
88 Freddie Mac Pool 'ZNO614', 3,500%, scadenza 01/02/2043	81	0,01	113 Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000%, scadenza 15/04/2040	112	0,01
83 Freddie Mac Pool 'ZNO628', 3,500%, scadenza 01/02/2043	76	0,01	250 Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000%, scadenza 15/05/2040	248	0,02
55 Freddie Mac Pool 'ZN2185', 4,500%, scadenza 01/12/2048	53	-	1 Ginnie Mae I Pool '780732', 7,000%, scadenza 15/03/2028	1	-
10 Freddie Mac Pool 'ZS0823', 5,000%, scadenza 01/12/2034	10	-	1 Ginnie Mae I Pool '781001', 7,500%, scadenza 15/03/2029	1	-
310 Freddie Mac Pool 'ZS1355', 6,000%, scadenza 01/03/2037	320	0,03	46 Ginnie Mae I Pool '781590', 5,500%, scadenza 15/04/2033	46	-
5 Freddie Mac Pool 'ZS1530', 5,500%, scadenza 01/07/2037	6	-	312 Ginnie Mae I Pool '781994', 5,500%, scadenza 15/11/2033	314	0,03
8 Freddie Mac Pool 'ZS1821', 5,500%, scadenza 01/11/2037	8	-	2 Ginnie Mae I Pool '782198', 6,000%, scadenza 15/10/2037	2	-
128 Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500%, scadenza 01/12/2038	130	0,01	279 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500%, scadenza 15/06/2048	260	0,02
9.877 Freddie Mac Pool 'ZS4751', 3,500%, scadenza 01/01/2048	8.903	0,79	122 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000%, scadenza 15/09/2042	110	0,01
141 Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000%, scadenza 01/10/2032	134	0,01	144 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000%, scadenza 15/09/2042	130	0,01
220 Freddie Mac Pool 'ZS9826', 3,000%, scadenza 01/10/2046	193	0,02	43 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000%, scadenza 15/10/2042	39	-
37 Freddie Mac Pool 'ZT0474', 4,500%, scadenza 01/08/2048	36	-	232 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000%, scadenza 15/10/2042	206	0,02
2.106 Freddie Mac Pool 'ZT1101', 3,000%, scadenza 01/01/2043	1.872	0,17	201 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000%, scadenza 15/11/2042	179	0,02
743 Freddie Mac Pool 'ZT1107', 3,500%, scadenza 01/03/2043	680	0,06	1.635 Ginnie Mae I Pool 'BS8462', 3,500%, scadenza 15/06/2050	1.511	0,13
132 Freddie Mac Pool 'ZT1159', 3,500%, scadenza 01/02/2044	121	0,01	7 Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500%, scadenza 20/10/2037	7	-
137 Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000%, scadenza 01/01/2046	122	0,01	9 Ginnie Mae II Pool '4170', 6,000%, scadenza 20/06/2038	9	-
34 Freddie Mac Pool 'ZT1854', 4,500%, scadenza 01/03/2049	33	-	633 Ginnie Mae II Pool '4245', 6,000%, scadenza 20/09/2038	665	0,06
137 Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500%, scadenza 01/04/2033	131	0,01	101 Ginnie Mae II Pool '4602', 6,000%, scadenza 20/12/2039	105	0,01
1.732 Freddie Mac Pool 'ZT2228', 3,500%, scadenza 01/06/2049	1.575	0,14	106 Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500%, scadenza 20/11/2040	103	0,01
4.600 Freddie Mac REMICS 3810, Classe WA, 5,405%, scadenza 15/06/2040 *	4.567	0,41	54 Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500%, scadenza 20/05/2040	52	-
2.806 Freddie Mac REMICS 3998, Classe DS, 1,197%, scadenza 15/02/2042 *	314	0,03	33 Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000%, scadenza 20/07/2040	33	-
2.085 Freddie Mac REMICS 4134, Classe IM, 3,500%, scadenza 15/11/2042	342	0,03	38 Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000%, scadenza 20/08/2040	38	-
607 Freddie Mac REMICS 4280, Classe AJ, 3,000%, scadenza 15/02/2028	10	-	4 Ginnie Mae II Pool '4774', 6,000%, scadenza 20/08/2040	4	-
4.800 Freddie Mac REMICS 4377, Classe UZ, 3,000%, scadenza 15/08/2044	3.740	0,33	80 Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000%, scadenza 20/09/2040	80	0,01
208 Freddie Mac REMICS 4403, Classe IG, 3,500%, scadenza 15/07/2032	6	-	34 Ginnie Mae II Pool '4855', 5,000%, scadenza 20/11/2040	34	-
1.140 Freddie Mac REMICS 4715, Classe JS, 0,847%, scadenza 15/08/2047 *	129	0,01	13 Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500%, scadenza 20/01/2041	12	-
284 Freddie Mac REMICS 4759, Classe MI, 4,000%, scadenza 15/09/2045	19	-	8 Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000%, scadenza 20/01/2041	8	-
1.234 Freddie Mac REMICS 4808, Classe SB, 0,897%, scadenza 15/07/2048 *	147	0,01	429 Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500%, scadenza 20/03/2041	419	0,04
181 Freddie Mac REMICS 4813, Classe CJ, 3,000%, scadenza 15/08/2048	178	0,01	943 Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000%, scadenza 20/07/2040	940	0,08
1.513 Freddie Mac REMICS 4856, Classe IO, 5,000%, scadenza 15/01/2049	256	0,02	696 Ginnie Mae II Pool '783298', 4,500%, scadenza 20/04/2041	681	0,06
807 Freddie Mac REMICS 4870, Classe ES, 0,697%, scadenza 15/04/2049 *	82	0,01	65 Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500%, scadenza 20/01/2046	60	0,01
1.656 Freddie Mac REMICS 4882, Classe S, 0,747%, scadenza 15/05/2049 *	171	0,02	1.986 Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000%, scadenza 20/07/2047	1.876	0,17
2.376 Freddie Mac REMICS 4921, Classe SN, 0,648%, scadenza 25/10/2049 *	254	0,02	60 Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000%, scadenza 20/01/2050	53	-
1.098 Freddie Mac REMICS 4936, Classe YZ, 2,500%, scadenza 25/12/2049	879	0,08	507 Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000%, scadenza 20/03/2051	406	0,04
1.278 Freddie Mac REMICS 4962, Classe SP, 0,648%, scadenza 25/03/2050 *	132	0,01	8.814 Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000%, scadenza 20/02/2052	7.783	0,69
2.876 Freddie Mac REMICS 4988, Classe AZ, 2,000%, scadenza 25/07/2050	1.678	0,15	2.107 Ginnie Mae II Pool '786077', 3,000%, scadenza 20/03/2052	1.856	0,16
2.226 Freddie Mac REMICS 4995, Classe IQ, 2,500%, scadenza 25/07/2050	327	0,03	2.934 Ginnie Mae II Pool '786082', 3,000%, scadenza 20/11/2051	2.594	0,23
9.646 Freddie Mac REMICS 4995, Classe QI, 2,500%, scadenza 25/07/2050	1.497	0,13	279 Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000%, scadenza 20/04/2052	240	0,02
4.900 Freddie Mac REMICS 5000, Classe IB, 2,500%, scadenza 25/07/2050	607	0,05	1.493 Ginnie Mae II Pool '786107', 3,000%, scadenza 20/03/2052	1.319	0,12
3.879 Freddie Mac REMICS 5000, Classe UI, 2,500%, scadenza 25/07/2050	672	0,06	1.335 Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500%, scadenza 20/03/2052	1.200	0,11
1.625 Freddie Mac REMICS 5027, Classe H, 2,000%, scadenza 25/10/2050	218	0,02	418 Ginnie Mae II Pool '786134', 3,000%, scadenza 20/04/2052	361	0,03
3.069 Freddie Mac REMICS 5038, Classe PJ, 0,750%, scadenza 25/10/2050	2.164	0,19	286 Ginnie Mae II Pool '786335', 4,500%, scadenza 20/09/2052	275	0,02
142 Freddie Mac REMICS 5040, Classe IB, 2,500%, scadenza 25/11/2050	25	-	8.783 Ginnie Mae II Pool '786348', 4,500%, scadenza 20/08/2052	8.391	0,74
2.233 Freddie Mac REMICS 5058, Classe IU, 2,500%, scadenza 25/01/2051	390	0,03	679 Ginnie Mae II Pool '786474', 5,000%, scadenza 20/01/2053	666	0,06
675 Freddie Mac REMICS 5059, Classe IB, 2,500%, scadenza 25/01/2051	107	0,01	1.549 Ginnie Mae II Pool '892346', 7,833%, scadenza 20/08/2059 *	1.567	0,14
5.069 Freddie Mac REMICS 5070, Classe NI, 2,000%, scadenza 25/02/2051	704	0,06	214 Ginnie Mae II Pool '892614', 7,225%, scadenza 20/08/2060 *	217	0,02
8.953 Freddie Mac REMICS 5078, Classe EI, 1,500%, scadenza 25/01/2051	881	0,08	863 Ginnie Mae II Pool 'AV0243', 3,500%, scadenza 20/08/2046	796	0,07
20.786 Freddie Mac REMICS 5085, Classe IK, 2,500%, scadenza 25/03/2051	3.361	0,30	1.048 Ginnie Mae II Pool 'AV8311', 3,500%, scadenza 20/08/2046	967	0,09
10.866 Freddie Mac REMICS 5092, Classe IL, 2,500%, scadenza 25/02/2051	1.274	0,11	1.121 Ginnie Mae II Pool 'AV8312', 3,500%, scadenza 20/08/2046	1.121	0,10
3.533 Freddie Mac REMICS 5113, Classe NI, 2,500%, scadenza 25/06/2051	437	0,04	406 Ginnie Mae II Pool 'AZ3074', 4,000%, scadenza 20/02/2047	383	0,03
11.609 Freddie Mac REMICS 5134, Classe KI, 2,500%, scadenza 25/07/2048	1.545	0,14	496 Ginnie Mae II Pool 'BC5293', 3,500%, scadenza 20/08/2047	457	0,04
10.811 Freddie Mac REMICS 5135, Classe DI, 2,500%, scadenza 25/05/2048	1.412	0,13	3.174 Ginnie Mae II Pool 'BC5429', 3,500%, scadenza 20/10/2047	2.924	0,26
1.432 Freddie Mac REMICS 5149, Classe NI, 2,500%, scadenza 25/01/2051	208	0,02	252 Ginnie Mae II Pool 'BD3554', 3,500%, scadenza 20/10/2047	232	0,02

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario		
Titoli garantiti da ipoteca — (segue)							
1.308	Ginnie Mae II Pool 'BD3636', 3,500%, scadenza 20/10/2047	1.205	0,11	620	Ginnie Mae II Pool 'MA8422', 2,000%, scadenza 20/11/2052	512	0,05
31	Ginnie Mae II Pool 'BG7951', 4,500%, scadenza 20/06/2048	29	–	1.836	Ginnie Mae II Pool 'MA8428', 5,000%, scadenza 20/11/2052	1.789	0,16
718	Ginnie Mae II Pool 'BH1521', 4,500%, scadenza 20/07/2048	689	0,06	1.340	Ginnie Mae II Pool 'MA8429', 5,500%, scadenza 20/11/2052	1.327	0,12
888	Ginnie Mae II Pool 'BH1870', 4,500%, scadenza 20/08/2048	857	0,08	2.592	Ginnie Mae II Pool 'MA8484', 2,000%, scadenza 20/12/2052	2.142	0,19
632	Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500%, scadenza 20/02/2050	574	0,05	2.894	Ginnie Mae II Pool 'MA8492', 6,000%, scadenza 20/12/2052	2.906	0,26
123	Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000%, scadenza 20/10/2049	117	0,01	4.711	Ginnie Mae II Pool 'MA8647', 5,000%, scadenza 20/02/2053	4.586	0,41
494	Ginnie Mae II Pool 'BS1728', 4,000%, scadenza 20/01/2050	473	0,04	3.353	Ginnie Mae II Pool 'MA8725', 5,000%, scadenza 20/03/2053	3.265	0,29
407	Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000%, scadenza 20/02/2050	389	0,03	1.180	Ginnie Mae II Pool 'MA8727', 6,000%, scadenza 20/03/2053	1.185	0,11
72	Ginnie Mae II Pool 'BS8546', 2,500%, scadenza 20/12/2050	60	0,01	2.154	Ginnie Mae II Pool 'MA8794', 2,000%, scadenza 20/03/2053	1.781	0,16
476	Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500%, scadenza 20/12/2050	405	0,04	98	Ginnie Mae II Pool 'MA8798', 4,000%, scadenza 20/04/2053	92	0,01
924	Ginnie Mae II Pool 'BT9472', 4,000%, scadenza 20/05/2050	876	0,08	1.925	Ginnie Mae II Pool 'MA8800', 5,000%, scadenza 20/04/2053	1.874	0,17
2.310	Ginnie Mae II Pool 'BU3196', 4,000%, scadenza 20/05/2050	2.154	0,19	6.300	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,000% ±	5.198	0,46
776	Ginnie Mae II Pool 'BW7380', 4,500%, scadenza 20/07/2050	744	0,07	100	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 4,500% ±	95	0,01
939	Ginnie Mae II Pool 'BW7384', 4,000%, scadenza 20/08/2050	880	0,08	5.000	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,500% ±	4.950	0,44
1.348	Ginnie Mae II Pool 'BX2423', 3,000%, scadenza 20/10/2050	1.189	0,11	1.000	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 6,000% ±	1.003	0,09
93	Ginnie Mae II Pool 'CK9592', 4,000%, scadenza 20/06/2052	87	0,01	645	Government National Mortgage Association, Serie 2004 81, Classe SK, 0,773%, scadenza 16/10/2034 *	23	–
88	Ginnie Mae II Pool 'CL5523', 3,000%, scadenza 20/04/2052	77	0,01	1.115	Government National Mortgage Association, Serie 2008 40, Classe SC, 0,923%, scadenza 16/05/2038 *	62	0,01
153	Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500%, scadenza 20/04/2046	141	0,01	1.386	Government National Mortgage Association, Serie 2008 79, Classe ID, 1,372%, scadenza 20/06/2035 *	82	0,01
84	Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500%, scadenza 20/05/2046	78	0,01	264	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H02, Classe FA, 6,110%, scadenza 20/02/2060 *	264	0,02
144	Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500%, scadenza 20/06/2046	133	0,01	599	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H20, Classe AF, 5,585%, scadenza 20/10/2060 *	595	0,05
87	Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500%, scadenza 20/07/2046	80	0,01	232	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H22, Classe FE, 5,605%, scadenza 20/05/2059 *	230	0,02
5.296	Ginnie Mae II Pool 'MA4003', 3,000%, scadenza 20/10/2046	4.736	0,42	287	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H28, Classe FE, 5,655%, scadenza 20/12/2060 *	286	0,03
744	Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000%, scadenza 20/02/2047	665	0,06	637	Government National Mortgage Association, Serie 2011 146, Classe KS, 0,673%, scadenza 16/11/2041 *	57	–
369	Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000%, scadenza 20/06/2047	350	0,03	856	Government National Mortgage Association, Serie 2011 79, Classe KS, 0,000%, scadenza 20/05/2041 *	55	–
2.107	Ginnie Mae II Pool 'MA4586', 4,000%, scadenza 20/07/2047	1.944	0,17	2.616	Government National Mortgage Association, Serie 2012 H21, Classe FA, 5,755%, scadenza 20/07/2062 *	2.603	0,23
76	Ginnie Mae II Pool 'MA4587', 4,000%, scadenza 20/07/2047	72	0,01	9.389	Government National Mortgage Association, Serie 2013 93, Classe SA, 0,773%, scadenza 16/06/2043 *	1.003	0,09
112	Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500%, scadenza 20/08/2047	109	0,01	514	Government National Mortgage Association, Serie 2014 118, Classe HS, 0,772%, scadenza 20/08/2044 *	53	–
151	Ginnie Mae II Pool 'MA4781', 5,000%, scadenza 20/10/2047	150	0,01	825	Government National Mortgage Association, Serie 2014 2, Classe CI, 4,500%, scadenza 20/01/2044	172	0,02
186	Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000%, scadenza 20/11/2047	176	0,02	2.367	Government National Mortgage Association, Serie 2014 60, Classe SA, 0,673%, scadenza 16/04/2044 *	201	0,02
169	Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000%, scadenza 20/12/2047	160	0,01	8.046	Government National Mortgage Association, Serie 2015 136, Classe IO, 0,409%, scadenza 16/08/2055 *	121	0,01
14.538	Ginnie Mae II Pool 'MA4961', 3,000%, scadenza 20/01/2048	12.973	1,15	3.666	Government National Mortgage Association, Serie 2015 177, Classe MI, 5,000%, scadenza 20/10/2044	746	0,07
52	Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000%, scadenza 20/02/2048	50	–	26.319	Government National Mortgage Association, Serie 2017 111, Classe IO, 0,526%, scadenza 16/02/2059 *	813	0,07
83	Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000%, scadenza 20/03/2048	78	0,01	1.843	Government National Mortgage Association, Serie 2017 19, Classe SE, 0,723%, scadenza 16/02/2047 *	159	0,01
168	Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500%, scadenza 20/04/2048	163	0,01	3.695	Government National Mortgage Association, Serie 2017 26, Classe IQ, 5,000%, scadenza 20/02/2040	749	0,07
124	Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500%, scadenza 20/05/2048	119	0,01	6.944	Government National Mortgage Association, Serie 2017 8, Classe IO, 0,448%, scadenza 16/08/2058 *	170	0,01
96	Ginnie Mae II Pool 'MA5194', 5,000%, scadenza 20/05/2048	95	0,01	508	Government National Mortgage Association, Serie 2017 H22, Classe JF, 3,925%, scadenza 20/10/2067 *	502	0,04
17	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500%, scadenza 20/06/2048	17	–	1.760	Government National Mortgage Association, Serie 2018 125, Classe HS, 0,822%, scadenza 20/09/2048 *	147	0,01
131	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500%, scadenza 20/07/2048	126	0,01	2.739	Government National Mortgage Association, Serie 2018 134, Classe SM, 0,772%, scadenza 20/10/2048 *	241	0,02
1.761	Ginnie Mae II Pool 'MA5399', 4,500%, scadenza 20/08/2048	1.700	0,15	789	Government National Mortgage Association, Serie 2018 168, Classe PA, 4,000%, scadenza 20/08/2048	745	0,07
39	Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500%, scadenza 20/09/2048	38	–	643	Government National Mortgage Association, Serie 2018 37, Classe QA, 2,750%, scadenza 20/03/2048	564	0,05
6.359	Ginnie Mae II Pool 'MA5530', 5,000%, scadenza 20/10/2048	6.281	0,56	550	Government National Mortgage Association, Serie 2018 H09, Classe FE, 5,495%, scadenza 20/06/2068 *	543	0,05
212	Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000%, scadenza 20/11/2048	209	0,02	580	Government National Mortgage Association, Serie 2018 H13, Classe DF, 5,401%, scadenza 20/07/2068 *	574	0,05
61	Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500%, scadenza 20/12/2048	59	–	500	Government National Mortgage Association, Serie 2019 128, Classe AL, 2,500%, scadenza 20/10/2049	343	0,03
285	Ginnie Mae II Pool 'MA5653', 5,000%, scadenza 20/12/2048	281	0,02	566	Government National Mortgage Association, Serie 2019 18, Classe TP, 3,500%, scadenza 20/02/2049	513	0,05
194	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500%, scadenza 20/01/2049	187	0,02	12.641	Government National Mortgage Association, Serie 2019 85, Classe LS, 0,000%, scadenza 20/07/2049 *	247	0,02
202	Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5,000%, scadenza 20/01/2049	199	0,02	244	Government National Mortgage Association, Serie 2019 H01, Classe FT, 5,618%, scadenza 20/10/2068 *	243	0,02
201	Ginnie Mae II Pool 'MA5713', 5,500%, scadenza 20/01/2049	202	0,02	271	Government National Mortgage Association, Serie 2019 H08, Classe FE, 3,869%, scadenza 20/01/2069 *	261	0,02
93	Ginnie Mae II Pool 'MA5764', 4,500%, scadenza 20/02/2049	90	0,01	302	Government National Mortgage Association, Serie 2019 H10, Classe FB, 4,874%, scadenza 20/06/2069 *	290	0,03
2.344	Ginnie Mae II Pool 'MA5766', 5,500%, scadenza 20/02/2049	2.360	0,21	5.198	Government National Mortgage Association, Serie 2020 116, Classe GI, 2,500%, scadenza 20/08/2050	707	0,06
126	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500%, scadenza 20/03/2049	122	0,01	1.807	Government National Mortgage Association, Serie 2020 122, Classe IM, 2,500%, scadenza 20/08/2050	247	0,02
513	Ginnie Mae II Pool 'MA5820', 5,500%, scadenza 20/03/2049	516	0,05				
11	Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500%, scadenza 20/04/2049	11	–				
135	Ginnie Mae II Pool 'MA5878', 5,000%, scadenza 20/04/2049	133	0,01				
494	Ginnie Mae II Pool 'MA5879', 5,500%, scadenza 20/04/2049	498	0,04				
375	Ginnie Mae II Pool 'MA5934', 5,500%, scadenza 20/05/2049	378	0,03				
3.372	Ginnie Mae II Pool 'MA5989', 5,500%, scadenza 20/06/2049	3.396	0,30				
3.693	Ginnie Mae II Pool 'MA6157', 5,000%, scadenza 20/09/2049	3.651	0,32				
202	Ginnie Mae II Pool 'MA6217', 2,500%, scadenza 20/10/2049	173	0,02				
116	Ginnie Mae II Pool 'MA6412', 4,500%, scadenza 20/01/2050	112	0,01				
81	Ginnie Mae II Pool 'MA6542', 3,500%, scadenza 20/03/2050	75	0,01				
119	Ginnie Mae II Pool 'MA6602', 4,500%, scadenza 20/04/2050	115	0,01				
4.646	Ginnie Mae II Pool 'MA6657', 3,500%, scadenza 20/05/2050	4.262	0,38				
3.936	Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000%, scadenza 20/05/2050	3.726	0,33				
1.925	Ginnie Mae II Pool 'MA6869', 4,500%, scadenza 20/09/2050	1.859	0,16				
2.473	Ginnie Mae II Pool 'MA6935', 4,500%, scadenza 20/10/2050	2.389	0,21				
104	Ginnie Mae II Pool 'MA7194', 3,000%, scadenza 20/02/2051	93	0,01				
15.743	Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500%, scadenza 20/04/2051	13.416	1,19				
2.195	Ginnie Mae II Pool 'MA7314', 3,500%, scadenza 20/04/2051	2.002	0,18				
4.723	Ginnie Mae II Pool 'MA7316', 4,500%, scadenza 20/04/2051	4.565	0,41				
4.625	Ginnie Mae II Pool 'MA7420', 3,500%, scadenza 20/06/2051	4.218	0,37				
3.769	Ginnie Mae II Pool 'MA7475', 4,000%, scadenza 20/07/2051	3.552	0,32				
5.426	Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000%, scadenza 20/09/2051	4.793	0,43				
18.018	Ginnie Mae II Pool 'MA7768', 3,000%, scadenza 20/12/2051	15.888	1,41				
3.777	Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500%, scadenza 20/02/2052	3.431	0,30				
3.286	Ginnie Mae II Pool 'MA8045', 4,000%, scadenza 20/05/2052	3.063	0,27				
2.887	Ginnie Mae II Pool 'MA8046', 4,500%, scadenza 20/05/2052	2.753	0,24				
1.130	Ginnie Mae II Pool 'MA8100', 4,000%, scadenza 20/06/2052	1.053	0,09				
15.557	Ginnie Mae II Pool 'MA8197', 2,500%, scadenza 20/08/2052	13.255	1,18				
118	Ginnie Mae II Pool 'MA8263', 2,000%, scadenza 20/09/2052	97	0,01				
671	Ginnie Mae II Pool 'MA8348', 5,000%, scadenza 20/10/2052	654	0,06				

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	(138)	\$ (33.061)	\$ 53
Indice SOFR a 3 mesi marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(276)	(65.412)	28
Indice SOFR a 3 mesi settembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	(223)	(53.233)	(9)
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(90)	(9.993)	(85)
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	543	58.058	359
U.S. Long Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	305	37.115	658
Apprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 353\$)				\$ 1.098
Deprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (731)\$)				(94)
Apprezzamento netto di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (378)\$)				\$ 1.004

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) £	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) £	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti societari — 92,45% (28 febbraio 2023: 94,04%)					
Australia — 1,00% (28 febbraio 2023: 0,98%)					
160 APA Infrastructure Ltd, 3,125%, scadenza 18/07/2031	128	0,29	680 European Investment Bank, 3,750%, scadenza 07/12/2027	649	1,45
380 National Australia Bank Ltd, 1,699%, scadenza 15/09/2031 *	320	0,71		1.414	3,15
	448	1,00	Svezia — 2,09% (28 febbraio 2023: 2,10%)		
Belgio — 0,56% (28 febbraio 2023: 0,56%)					
166 Anheuser-Busch InBev SA/NV, 4,000%, scadenza 24/09/2025	161	0,36	340 Svenska Handelsbanken AB, 4,625%, scadenza 23/08/2032 *	310	0,69
USD 110 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,800%, scadenza 23/01/2059	91	0,20	350 Swedbank AB, 1,375%, scadenza 08/12/2027 *	299	0,67
	252	0,56	410 Vattenfall AB, 2,500%, scadenza 29/06/2083 *	328	0,73
Canada — 1,32% (28 febbraio 2023: 1,29%)					
340 Royal Bank of Canada, 1,375%, scadenza 09/12/2024	321	0,72		937	2,09
300 Toronto-Dominion Bank/The, 2,875%, scadenza 05/04/2027	270	0,60	Svizzera — 3,09% (28 febbraio 2023: 2,89%)		
	591	1,32	350 UBS Group AG, 2,250%, scadenza 09/06/2028 *	302	0,67
Danimarca — 1,57% (28 febbraio 2023: 1,57%)					
220 Danske Bank A/S, 4,625%, scadenza 13/04/2027 *	212	0,47	130 UBS Group AG, 7,750%, scadenza 01/03/2029 *	126	0,28
350 Danske Bank A/S, 2,250%, scadenza 14/01/2028 *	302	0,68	650 UBS Group AG, 1,875%, scadenza 03/11/2029 *	531	1,18
250 Orsted AS, 2,500%, scadenza 16/05/2033	190	0,42	380 UBS Group AG, 2,125%, scadenza 15/11/2029 *	314	0,70
	704	1,57	130 Zurich Finance Ireland Designated Activity Co, 5,125%, scadenza 23/11/2052 *	115	0,26
Finlandia — 0,71% (28 febbraio 2023: 0,71%)					
400 Nordea Bank Abp, 1,625%, scadenza 09/12/2032 *	319	0,71		1.388	3,09
Francia — 5,76% (28 febbraio 2023: 5,69%)			Regno Unito — 40,79% (28 febbraio 2023: 42,05%)		
290 BNP Paribas SA, 3,375%, scadenza 23/01/2026	272	0,61	160 Anglian Water Osprey Financing Plc, 2,000%, scadenza 31/07/2028	122	0,27
300 BNP Paribas SA, 2,000%, scadenza 24/05/2031 *	258	0,58	220 Anglian Water Services Financing Plc, 1,625%, scadenza 10/08/2025	203	0,45
100 BNP Paribas SA, 5,750%, scadenza 13/06/2032	96	0,21	210 Annington Funding Plc, 2,308%, scadenza 06/10/2032	151	0,34
500 BPCE SA, 2,500%, scadenza 30/11/2032 *	408	0,91	520 Annington Funding Plc, 4,750%, scadenza 09/08/2033	444	0,99
400 Credit Agricole SA, 4,875%, scadenza 23/10/2029	378	0,84	355 Aspire Defence Finance Plc, Serie A, 4,674%, scadenza 31/03/2040	327	0,73
220 Credit Agricole SA, 7,500%, Perpetual *	209	0,46	230 Associated British Foods Plc, 2,500%, scadenza 16/06/2034	178	0,40
EUR 300 Electricite de France SA, 1,000%, scadenza 29/11/2033	190	0,42	280 Assura Financing Plc, 3,000%, scadenza 19/07/2028	243	0,54
100 Electricite de France SA, 5,500%, scadenza 27/03/2037	90	0,20	270 Assura Financing Plc, 1,625%, scadenza 30/06/2033	181	0,40
100 Electricite de France SA, 5,500%, scadenza 17/10/2041	88	0,20	117 Aviva Plc, 5,125%, scadenza 04/06/2050 *	104	0,23
100 Electricite de France SA, 6,000%, scadenza 23/01/2114	86	0,19	190 Aviva Plc, 6,875%, scadenza 20/05/2058 *	185	0,41
300 Engie SA, 5,625%, scadenza 03/04/2053	287	0,64	260 Barclays Plc, 1,700%, scadenza 03/11/2026 *	234	0,52
300 TotalEnergies Capital International SA, 1,405%, scadenza 03/09/2031	225	0,50	493 Barclays Plc, 3,250%, scadenza 12/02/2027	443	0,99
	2.587	5,76	200 BP Capital Markets Plc, 2,274%, scadenza 03/07/2026	184	0,41
Germania — 5,01% (28 febbraio 2023: 5,43%)					
190 Deutsche Telekom AG, 3,125%, scadenza 06/02/2034	156	0,35	570 British Land Co Plc/The, 2,375%, scadenza 14/09/2029	447	1,00
400 E.ON International Finance BV, 6,125%, scadenza 06/07/2039	404	0,90	240 British Telecommunications Plc, 3,125%, scadenza 21/11/2031	198	0,44
940 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 6,000%, scadenza 07/12/2028	989	2,20	130 Burberry Group Plc, 1,125%, scadenza 21/09/2025	118	0,26
200 Volkswagen Financial Services NV, 2,125%, scadenza 27/06/2024	194	0,43	150 Cadent Finance Plc, 5,750%, scadenza 14/03/2034	147	0,33
400 Volkswagen International Finance NV, 3,375%, scadenza 16/11/2026	368	0,82	250 Cadent Finance Plc, 2,625%, scadenza 22/09/2038	163	0,36
EUR 200 Vonovia SE, 2,375%, scadenza 25/03/2032	139	0,31	100 Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge/The, 2,350%, scadenza 27/06/2078	56	0,12
	2.250	5,01	300 Clarion Funding Plc, 1,250%, scadenza 13/11/2032	207	0,46
Italia — 1,81% (28 febbraio 2023: 1,73%)					
341 Enel Finance International NV, 5,750%, scadenza 14/09/2040	327	0,73	200 Clarion Funding Plc, 1,875%, scadenza 22/01/2035	136	0,30
360 Intesa Sanpaolo SpA, 6,500%, scadenza 14/03/2029 *	346	0,77	150 Clarion Funding Plc, 3,125%, scadenza 19/04/2048	98	0,22
210 Intesa Sanpaolo SpA, 2,625%, scadenza 11/03/2036	138	0,31	300 Coventry Building Society, 2,000%, scadenza 20/12/2030	225	0,50
	811	1,81	190 CPUK Finance Ltd, 5,876%, scadenza 28/08/2027	184	0,41
Lussemburgo — 1,20% (28 febbraio 2023: 1,21%)					
240 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,625%, scadenza 20/10/2028	184	0,41	115 Crh Finance UK Plc, 4,125%, scadenza 02/12/2029	105	0,23
190 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, scadenza 29/04/2032	147	0,33	92 Derwent London Plc, 1,875%, scadenza 17/11/2031	383	0,85
260 Prologis International Funding II SA, 2,750%, scadenza 22/02/2032	207	0,46	50 Eastern Power Networks Plc, 6,250%, scadenza 12/11/2036	96	0,21
	538	1,20	220 Folio Residential Finance NO 1 Plc, 1,246%, scadenza 31/10/2027	183	0,41
Paesi Bassi — 2,39% (28 febbraio 2023: 1,95%)					
200 ABN AMRO Bank NV, 5,250%, scadenza 26/05/2026	197	0,44	278 Gatwick Funding Ltd, 6,125%, scadenza 02/03/2026	278	0,62
400 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625%, scadenza 23/05/2029	361	0,80	100 Gatwick Funding Ltd, 2,500%, scadenza 15/04/2030	81	0,18
300 ING Groep NV, 3,000%, scadenza 18/02/2026	279	0,62	100 Gatwick Funding Ltd, 3,250%, scadenza 26/02/2048	64	0,14
240 Koninklijke KPN NV, 5,750%, scadenza 17/09/2029	236	0,53	190 GlaxoSmithKline Capital Plc, 6,375%, scadenza 09/03/2039	207	0,46
	1.073	2,39	100 Grainger Plc, 3,375%, scadenza 24/04/2028	86	0,19
Norvegia — 1,50% (28 febbraio 2023: 1,49%)					
240 DNB Bank ASA, 2,625%, scadenza 10/06/2026 *	226	0,50	190 Grainger Plc, 3,000%, scadenza 03/07/2030	149	0,33
480 DNB Bank ASA, 4,000%, scadenza 17/08/2027 *	449	1,00	149 Greene King Finance Plc, Serie A2, 5,318%, scadenza 15/09/2031	138	0,31
	675	1,50	110 Greene King Finance Plc, serie B1, 6,903%, scadenza 15/12/2034 *	88	0,20
Sudafrica — 0,33% (28 febbraio 2023: 0,33%)					
170 Anglo American Capital Plc, 3,375%, scadenza 11/03/2029	148	0,33	210 Guinness Partnership Ltd/The, 2,000%, scadenza 22/04/2055	101	0,22
Spagna — 2,10% (28 febbraio 2023: 2,08%)					
800 Banco Santander SA, 2,250%, scadenza 04/10/2032 *	652	1,45	127 HSBC Holdings Plc, 6,000%, scadenza 29/03/2040	112	0,25
100 CaixaBank SA, 6,875%, scadenza 25/10/2033 *	95	0,21	200 HSBC Holdings Plc, 6,332%, scadenza 09/03/2044 *	159	0,35
200 Telefonica Emisiones SA, 5,445%, scadenza 08/10/2029	195	0,44	50 Hutchison Whampoa Finance UK Plc, Serie B, 5,625%, scadenza 24/11/2026	50	0,11
	942	2,10	210 Land Securities Capital Markets Plc, 2,399%, scadenza 08/02/2029	179	0,40
Sovranazionale — 3,15% (28 febbraio 2023: 3,11%)					
810 European Investment Bank, 1,375%, scadenza 07/03/2025	765	1,70	100 Land Securities Capital Markets Plc, 2,625%, scadenza 22/09/2037	71	0,16
			520 Leeds Building Society, 1,375%, scadenza 06/10/2027	431	0,96
			190 Leeds Building Society, 3,750%, scadenza 25/04/2029 *	164	0,37
			120 Legal & General Group Plc, 3,750%, scadenza 26/11/2049 *	99	0,22
			190 Legal & General Group Plc, 4,500%, scadenza 01/11/2050 *	162	0,36
			230 Liberty Living Finance Plc, 3,375%, scadenza 28/11/2029	193	0,43
			120 LiveWest Treasury Plc, 2,250%, scadenza 10/10/2043	74	0,16
			510 Lloyds Bank Plc, 7,625%, scadenza 22/04/2025	520	1,16
			230 Lloyds Banking Group Plc, 6,625%, scadenza 02/06/2033 *	224	0,50
			340 Lloyds Banking Group Plc, 5,125%, Perpetual *	311	0,69
			350 Logisor 2019-1 UK Plc, 1,875%, scadenza 17/11/2026	306	0,68
			180 London Stock Exchange Group Plc, 1,625%, scadenza 06/04/2030	144	0,32
			177 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,125%, scadenza 02/04/2024	175	0,39
			240 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,750%, scadenza 31/03/2034	220	0,49
			160 Manchester Airport Group Funding Plc, 2,875%, scadenza 30/09/2044	102	0,23
			185 Marston's Issuer Plc, Serie A3, 5,177%, scadenza 15/07/2032 *	161	0,36
			108 Marston's Issuer Plc, Serie B1, 7,819%, scadenza 16/07/2035 *	77	0,17
			85 Mitchells & Butlers Finance Plc, Serie B2, 6,013%, scadenza 15/12/2028	78	0,17

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) £	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) £	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Regno Unito — (segue)					
360	Motability Operations Group Plc, Serie EMTN, 4,875%, scadenza 17/01/2043	336	0,75		
310	National Gas Transmission Plc, 1,375%, scadenza 07/02/2031	225	0,50		
100	National Gas Transmission Plc, 5,750%, scadenza 05/04/2035	97	0,22		
275	National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc, 6,250%, scadenza 10/12/2040	283	0,63		
250	National Grid Electricity Transmission Plc, 2,000%, scadenza 17/04/2040	149	0,33		
100	Nationwide Building Society, 3,000%, scadenza 06/05/2026	93	0,21		
150	Nationwide Building Society, 6,178%, scadenza 07/12/2027 *	148	0,33		
206	Nationwide Building Society, 3,250%, scadenza 20/01/2028	186	0,41		
230	NatWest Group Plc, 3,125%, scadenza 28/03/2027 *	211	0,47		
270	NatWest Group Plc, 3,619%, scadenza 29/03/2029 *	238	0,53		
190	NatWest Group Plc, 2,105%, scadenza 28/11/2031 *	161	0,36		
190	NatWest Markets Plc, 6,375%, scadenza 08/11/2027	191	0,42		
180	Northern Gas Networks Finance Plc, 6,125%, scadenza 02/06/2033	181	0,40		
110	Northern Powergrid Northeast Plc, 3,250%, scadenza 01/04/2052	74	0,17		
120	Notting Hill Genesis, 2,875%, scadenza 31/01/2029	104	0,23		
140	Onward Homes Ltd, 2,125%, scadenza 25/03/2053	70	0,16		
240	Paragon Treasury Plc, 2,000%, scadenza 07/05/2036	157	0,35		
170	Rentokil Initial Plc, 5,000%, scadenza 27/06/2032	160	0,36		
190	Sanctuary Capital Plc, 2,375%, scadenza 14/04/2050	107	0,24		
440	Santander UK Group Holdings Plc, 2,920%, scadenza 08/05/2026 *	411	0,92		
170	Santander UK Plc, 5,750%, scadenza 02/03/2026	171	0,38		
198	Scottish Widows Ltd, 7,000%, scadenza 16/06/2043	193	0,43		
350	Segro Plc, 2,875%, scadenza 11/10/2037	250	0,56		
140	Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,625%, scadenza 22/02/2033	108	0,24		
120	Severn Trent Utilities Finance Plc, 4,625%, scadenza 30/11/2034	108	0,24		
180	Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,000%, scadenza 02/06/2040	105	0,23		
191	Southern Gas Networks Plc, 2,500%, scadenza 03/02/2025	182	0,41		
430	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875%, scadenza 02/11/2028	354	0,79		
170	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 5,500%, scadenza 27/02/2035	159	0,35		
199	Tesco Property Finance 3 Plc, 5,744%, scadenza 13/04/2040	186	0,41		
324	Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411%, scadenza 13/07/2044	292	0,65		
190	UNITE Group Plc/The, 3,500%, scadenza 15/10/2028	166	0,37		
250	UNITE USAF II Plc, 3,921%, scadenza 30/06/2025	238	0,53		
140	United Utilities Water Finance Plc, 5,125%, scadenza 06/10/2038	129	0,29		
170	University of Oxford, 2,544%, scadenza 08/12/2117	86	0,19		
210	Vodafone Group Plc, 5,125%, scadenza 02/12/2052	178	0,40		
110	Weir Group Plc/The, 6,875%, scadenza 14/06/2028	111	0,25		
160	Wellcome Trust Ltd/The, 2,517%, scadenza 07/02/2118	81	0,18		
470	Whitbread Group Plc, 2,375%, scadenza 31/05/2027	403	0,90		
180	Yorkshire Building Society, 3,500%, scadenza 21/04/2026	169	0,38		
140	Yorkshire Building Society, 3,511%, scadenza 11/10/2030 *	117	0,26		
		18.317	40,79		
Stati Uniti — 18,07% (28 febbraio 2023: 18,87%)					
USD	100 Apache Corp, 4,750%, scadenza 15/04/2043	60	0,13		
	383 AT&T Inc, 4,250%, scadenza 01/06/2043	290	0,65		
USD	450 Bank of America Corp, 4,948%, scadenza 22/07/2028 *	348	0,78		
	360 Bank of America Corp, 3,584%, scadenza 27/04/2031 *	310	0,69		
	180 Becton Dickinson & Co, 3,020%, scadenza 24/05/2025	172	0,38		
	260 Berkshire Hathaway Finance Corp, 2,625%, scadenza 19/06/2059	150	0,33		
	329 Citigroup Inc, 7,375%, scadenza 01/09/2039	380	0,85		
	170 Comcast Corp, 1,500%, scadenza 20/02/2029	140	0,31		
USD	60 CVS Health Corp, 4,125%, scadenza 01/04/2040	39	0,09		
	220 Experian Finance Plc, 0,739%, scadenza 29/10/2025	198	0,44		
	170 Experian Finance Plc, 3,250%, scadenza 07/04/2032	144	0,32		
	240 GE Capital UK Funding Unlimited Co, 5,875%, scadenza 18/01/2033	237	0,53		
	400 General Motors Financial Co Inc, 2,350%, scadenza 03/09/2025	371	0,83		
	309 Goldman Sachs Group Inc/The, 7,125%, scadenza 07/08/2025	314	0,70		
	280 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,125%, scadenza 25/07/2029	240	0,54		
	110 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,875%, scadenza 18/01/2038	110	0,24		
	210 Haleon UK Capital Plc, 3,375%, scadenza 29/03/2038	161	0,36		
USD	310 JPMorgan Chase & Co, 4,912%, scadenza 25/07/2033	236	0,52		
	100 McDonald's Corp, 2,950%, scadenza 15/03/2034	80	0,18		
	180 McDonald's Corp, Serie gmtn, 3,750%, scadenza 31/05/2038	145	0,32		
	92 MetLife Inc, 5,375%, scadenza 09/12/2024	91	0,20		
	230 Metropolitan Life Global Funding I, 5,000%, scadenza 10/01/2030	222	0,49		
	120 Mondelez International Inc, 4,500%, scadenza 03/12/2035	104	0,23		
USD	320 Morgan Stanley, 4,210%, scadenza 20/04/2028 *	242	0,54		
	250 Morgan Stanley, 5,789%, scadenza 18/11/2033 *	243	0,54		
EUR	280 Netflix Inc, 3,875%, scadenza 15/11/2029	237	0,53		
	290 New York Life Global Funding, 4,350%, scadenza 16/09/2025	281	0,63		
	290 Omnicom Capital Holdings Plc, 2,250%, scadenza 22/11/2033	212	0,47		
	210 PepsiCo Inc, 3,200%, scadenza 22/07/2029	189	0,42		
	100 PepsiCo Inc, 3,550%, scadenza 22/07/2034	87	0,19		
	190 Realty Income Corp, 1,875%, scadenza 14/01/2027	165	0,37		
	265 Time Warner Cable LLC, 5,750%, scadenza 02/06/2031	247	0,55		
	200 Toyota Motor Credit Corp, 0,750%, scadenza 19/11/2026	173	0,38		
	590 Verizon Communications Inc, 1,875%, scadenza 19/09/2030	458	1,02		
				88	0,20
				26	0,06
				369	0,82
				556	1,24
				8.115	18,07
Totale Obbligazioni ed effetti societari (Costo £49.272)				41.509	92,45
Obbligazioni ed effetti governativi — 3,42% (28 febbraio 2023: 1,62%)					
Regno Unito — 3,38% (28 febbraio 2023: 0,87%)					
				193	0,43
				202	0,45
				267	0,59
				133	0,30
				122	0,27
				178	0,40
				182	0,40
				243	0,54
				1.520	3,38
Stati Uniti — 0,04% (28 febbraio 2023: 0,75%)					
USD	30 United States Treasury Note/Bond, 2,000%, scadenza 15/11/2041	17	0,04		
Totale Obbligazioni ed effetti governativi (Costo £1.589)				1.537	3,42
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (Costo £50.861)					
Contratti a termine in valuta estera — 0,02% (28 febbraio 2023: 0,06%)					
				8	0,02
Futures — 0,20% (28 febbraio 2023: 0,10%)					
				90	0,20
Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico				43.144	96,09
Contratti a termine in valuta estera — (0,03%) (28 febbraio 2023: (0,02%))					
				(11)	(0,03)
Futures — (0,05%) (28 febbraio 2023: (0,07%))					
				(24)	(0,05)
Totale Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico				(35)	(0,08)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico				43.109	96,01
Altre attività eccedenti le passività				1.792	3,99
Patrimonio in gestione				44.901£	100,00
— Gli importi indicati con “-” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.					
* Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.					
ABBREVIAZIONI:					
Perpetual	— Obbligazione senza scadenza. Le obbligazioni perpetual non sono riscattabili ma garantiscono interessi costanti.				
EUR	— Euro				
USD	— Dollaro statunitense				
Analisi delle attività totali					
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato				95,68	
Strumenti finanziari derivati				0,22	
Altre attività				4,10	
Totale Attività				100,00	

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
16-nov-2023	Citi	Acquisto	GBP	99	Vendita	JPY	17.754	£ 2
16-nov-2023	Citi	Acquisto	GBP	62	Vendita	USD	80	–
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto	GBP	1.195	Vendita	USD	1.525	(9)
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	GBP	204	Vendita	USD	260	(2)
16-nov-2023	UBS	Acquisto	GBP	831	Vendita	EUR	960	6
16-nov-2023	UBS	Acquisto	GBP	24	Vendita	USD	30	–
Apprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 27£)								£ 8
Deprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (7)£)								(11)
Deprezzamento netto dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 20£)								£ (3)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
Euro-Bund dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	10	£ 1.135	£ 11
Japan 10 Year Bond (OSE) settembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(2)	(1.593)	12
Long Gilt dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	19	1.816	33
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(23)	(2.016)	(17)
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	44	3.714	22
U.S. Long Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	7	672	12
U.S. Ultra Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(3)	(306)	(7)
Apprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 45£)				£ 90
Deprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (29)£)				(24)
Apprezzamento netto di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 16£)				£ 66

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da attività - 0,70% (28 febbraio 2023: 0,19%)			Germania — 1,52% (28 febbraio 2023: 0,89%)		
175 SMB Private Education Loan Trust 2020-A, Serie 2020 A, Classe A2A, 144A, 2,230%, scadenza 15/09/2037	161	0,29	20 Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750%, scadenza 15/06/2030	24	0,04
230 Texas Natural Gas Securitization Finance Corp, Serie 2023 1, Classe A1, 5,102%, scadenza 01/04/2035	229	0,41	840 ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750%, scadenza 29/04/2025	818	1,48
Totale titoli garantiti da attività (Costo 4105)	390	0,70		842	1,52
Obbligazioni ed effetti societari — 102,56% (28 febbraio 2023: 96,16%)			Irlanda — 0,62% (28 febbraio 2023: 1,18%)		
Australia — 0,35% (28 febbraio 2023: 0,59%)			150 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,500%, scadenza 15/09/2023		
60 CSL Finance Plc, 144A, 4,050%, scadenza 27/04/2029	57	0,10	180 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,850%, scadenza 29/10/2041	132	0,24
40 Westpac Banking Corp, 2,668%, scadenza 15/11/2035 *	31	0,06	60 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 5,125%, scadenza 01/10/2023	60	0,11
60 Westpac Banking Corp, 3,020%, scadenza 18/11/2036 *	46	0,08		342	0,62
90 Westpac Banking Corp, 3,133%, scadenza 18/11/2041	58	0,11			
	192	0,35	Israele — 0,10% (28 febbraio 2023: 0,15%)		
Belgio — 0,40% (28 febbraio 2023: 0,22%)			60 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, scadenza 01/10/2026		
240 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600%, scadenza 15/04/2048	214	0,38		54	0,10
10 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550%, scadenza 23/01/2049	10	0,02	Italia — 1,64% (28 febbraio 2023: 1,76%)		
	224	0,40	240 Enel Finance International NV, 144A, 6,800%, scadenza 14/10/2025		
Bermuda — 0,55% (28 febbraio 2023: 0,49%)			260 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017%, scadenza 26/06/2024		
290 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625%, scadenza 15/10/2025	275	0,50	200 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 7,000%, scadenza 21/11/2025	203	0,37
30 RenaissanceRe Holdings Ltd, 5,750%, scadenza 05/06/2033	29	0,05	310 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,950%, scadenza 01/06/2042 *	205	0,37
	304	0,55		907	1,64
Brasile — 0,13% (28 febbraio 2023: 0,16%)			Giappone — 1,32% (28 febbraio 2023: 1,86%)		
90 Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125%, scadenza 15/01/2032	71	0,13	550 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,043%, scadenza 15/09/2023		
Canada — 2,79% (28 febbraio 2023: 2,80%)			200 NTT Finance Corp, 144A, 1,162%, scadenza 03/04/2026		
59 Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust, 144A, 5,000%, scadenza 15/12/2023	59	0,11		730	1,32
100 Bank of Nova Scotia/The, 3,450%, scadenza 04/11/2025	97	0,17	Kazakistan — 0,27% (28 febbraio 2023: 0,16%)		
20 Bank of Nova Scotia/The, 4,588%, scadenza 04/05/2037 *	17	0,03	200 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500%, scadenza 14/04/2033		
200 Bank of Nova Scotia/The, 8,625%, scadenza 27/10/2082 *	203	0,37		151	0,27
80 Barrick North America Finance LLC, 5,700%, scadenza 30/05/2041	79	0,14	Lussemburgo — 0,17% (28 febbraio 2023: 0,15%)		
70 Canadian Pacific Railway Co, 3,100%, scadenza 02/12/2051	47	0,08	60 ArcelorMittal SA, 6,550%, scadenza 29/11/2027		
320 CI Financial Corp, 3,200%, scadenza 17/12/2030	246	0,44	30 ArcelorMittal SA, 7,000%, scadenza 15/10/2039	31	0,06
60 Element Fleet Management Corp, 144A, 1,600%, scadenza 06/04/2024	58	0,11		92	0,17
40 GFL Environmental Inc, 144A, 5,125%, scadenza 15/12/2026	39	0,07	Macao — 2,35% (28 febbraio 2023: 2,59%)		
30 MEG Energy Corp, 144A, 7,125%, scadenza 01/02/2027	30	0,06	200 Sands China Ltd, 4,300%, scadenza 08/01/2026		
300 Royal Bank of Canada, 1,150%, scadenza 14/07/2026	267	0,48	200 Sands China Ltd, 5,650%, scadenza 08/08/2028	190	0,34
30 Teck Resources Ltd, 3,900%, scadenza 15/07/2030	27	0,05	270 Sands China Ltd, 3,100%, scadenza 08/03/2029	225	0,41
120 Teck Resources Ltd, 6,250%, scadenza 15/07/2041	116	0,21	200 Sands China Ltd, 4,875%, scadenza 18/06/2030	176	0,32
20 TransAlta Corp, 6,500%, scadenza 15/03/2040	19	0,03	200 Sands China Ltd, 4,875%, scadenza 18/06/2030	176	0,32
140 Yamana Gold Inc, 4,625%, scadenza 15/12/2027	132	0,24	350 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875%, scadenza 01/10/2024	343	0,62
140 Yamana Gold Inc, 2,630%, scadenza 15/08/2031	110	0,20		1.298	2,35
	1.546	2,79	Messico — 0,68% (28 febbraio 2023: 0,62%)		
Cina — 1,00% (28 febbraio 2023: 0,77%)			200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 8,375%, Perpetual *		
240 Alibaba Group Holding Ltd, 3,150%, scadenza 02/09/2051	144	0,26	220 Fresnillo Plc, 144A, 4,250%, scadenza 02/10/2050	161	0,29
240 BOC Aviation USA Corp, 144A, 1,625%, scadenza 29/04/2024	233	0,42	20 Southern Copper Corp, 5,250%, scadenza 08/11/2042	18	0,04
260 Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,840%, scadenza 22/04/2051	176	0,32		374	0,68
	553	1,00	Paesi Bassi — 1,22% (28 febbraio 2023: 1,13%)		
Danimarca — 2,08% (28 febbraio 2023: 1,82%)			250 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375%, scadenza 04/08/2025		
200 Danske Bank A/S, 144A, 0,976%, scadenza 10/09/2025 *	189	0,34	440 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,758%, scadenza 06/04/2033 *	377	0,68
200 Danske Bank A/S, 144A, 3,244%, scadenza 20/12/2025 *	191	0,35	50 Shell International Finance BV, 4,375%, scadenza 11/05/2045	43	0,08
200 Danske Bank A/S, 144A, 6,466%, scadenza 09/01/2026 *	200	0,36	20 Shell International Finance BV, 3,250%, scadenza 06/04/2050	14	0,02
200 Danske Bank A/S, 144A, 1,549%, scadenza 10/09/2027 *	176	0,32		676	1,22
420 Danske Bank A/S, 144A, 4,298%, scadenza 01/04/2028 *	395	0,71	Sudafrica — 1,12% (28 febbraio 2023: 0,44%)		
	1.151	2,08	200 Anglo American Capital Plc, 144A, 3,625%, scadenza 11/09/2024		
Francia — 6,58% (28 febbraio 2023: 4,69%)			240 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,500%, scadenza 15/03/2028		
200 BNP Paribas SA, 144A, 2,219%, scadenza 09/06/2026 *	187	0,34	200 Sasol Financing USA LLC, 144A, 8,750%, scadenza 03/05/2029	196	0,36
370 BNP Paribas SA, 144A, 1,675%, scadenza 30/06/2027 *	330	0,60		620	1,12
340 BNP Paribas SA, 144A, 2,159%, scadenza 15/09/2029 *	284	0,51	Spagna — 1,01% (28 febbraio 2023: 0,56%)		
200 BNP Paribas SA, 144A, 8,500%, Perpetual *	200	0,36	200 Banco Santander SA, 1,722%, scadenza 14/09/2027 *		
520 BNP Paribas SA, 144A, 7,750%, Perpetual *	504	0,91	200 Banco Santander SA, 4,175%, scadenza 24/03/2028 *	187	0,34
200 BNP Paribas SA, 144A, 9,250%, Perpetual *	206	0,37	200 Banco Santander SA, 6,921%, scadenza 08/08/2033	199	0,36
200 BPCE SA, 144A, 5,700%, scadenza 22/10/2023	199	0,36		562	1,01
370 BPCE SA, 144A, 3,116%, scadenza 19/10/2032 *	285	0,52	Sovranazionale — 0,33% (28 febbraio 2023: 0,19%)		
250 Credit Agricole SA, 144A, 5,589%, scadenza 05/07/2026	250	0,45	200 African Export-Import Bank/The, 144A, 2,634%, scadenza 17/05/2026		
250 Credit Agricole SA, 144A, 5,514%, scadenza 05/07/2033	247	0,45		180	0,33
400 Credit Agricole SA, 144A, 8,125%, Perpetual *	400	0,72	Svezia — 0,44% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
430 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 3,750%, scadenza 17/09/2024	410	0,74	250 Svenska Handelsbanken AB, 144A, 3,650%, scadenza 10/06/2025		
200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750%, scadenza 17/09/2044	135	0,25		241	0,44
	3.637	6,58	Svizzera — 1,61% (28 febbraio 2023: 5,06%)		
			300 UBS Group AG, 144A, 4,751%, scadenza 12/05/2028 *		
			250 UBS Group AG, 144A, 9,016%, scadenza 15/11/2033 *		
			200 UBS Group AG, 144A, 3,179%, scadenza 11/02/2043 *		
			200 UBS Group AG, 144A, 4,875%, Perpetual *		
				893	1,61

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Taiwan — 0,42% (28 febbraio 2023: 0,41%)					
280 TSMC Arizona Corp, 2,500%, scadenza 25/10/2031	232	0,42			
Emirati Arabi Uniti — 0,50% (28 febbraio 2023: 0,29%)					
290 DAE Funding LLC, 144A, 1,550%, scadenza 01/08/2024	276	0,50			
Regno Unito — 2,66% (28 febbraio 2023: 2,38%)					
60 British Airways 2019-1 Classe A Pass Through Trust, 144A, 3,350%, scadenza 15/06/2029	54	0,10	90 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625%, scadenza 15/12/2025	90	0,16
30 British Telecommunications Plc, 9,625%, scadenza 15/12/2030	36	0,07	80 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625%, scadenza 15/07/2026	79	0,14
210 HSBC Holdings Plc, 1,589%, scadenza 24/05/2027	187	0,34	50 Bon Secours Mercy Health Inc, 3,464%, scadenza 01/06/2030	45	0,08
60 HSBC Holdings Plc, 7,625%, scadenza 17/05/2032	64	0,12	50 BP Capital Markets America Inc, 3,000%, scadenza 24/02/2050	33	0,06
200 HSBC Holdings Plc, 6,254%, scadenza 09/03/2034 *	202	0,36	80 Bristol-Myers Squibb Co, 2,350%, scadenza 13/11/2040	53	0,10
200 Lloyds Banking Group Plc, 3,511%, scadenza 18/03/2026 *	192	0,35	30 Bristol-Myers Squibb Co, 4,250%, scadenza 26/10/2049	25	0,05
200 Lloyds Banking Group Plc, 4,375%, scadenza 22/03/2028	189	0,34	144 Broadcom Inc, 144A, 3,187%, scadenza 15/11/2036	107	0,19
210 Lloyds Banking Group Plc, 8,000%, Perpetual *	191	0,34	50 Burlington Northern Santa Fe LLC, 4,400%, scadenza 15/03/2042	44	0,08
340 NatWest Group Plc, 3,754%, scadenza 01/11/2029 *	324	0,59	60 California Institute of Technology, 3,650%, scadenza 01/09/2119	38	0,07
30 Vodafone Group Plc, 6,150%, scadenza 27/02/2037	30	0,05	20 Cameron LNG LLC, 144A, 3,701%, scadenza 15/01/2039	16	0,03
	1.469	2,66	50 Carlyle Finance LLC, 144A, 5,650%, scadenza 15/09/2048	43	0,08
Stati Uniti — 70,33% (28 febbraio 2023: 63,41%)					
310 AbbVie Inc, 3,200%, scadenza 21/11/2029	279	0,50	120 Centene Corp, 3,000%, scadenza 15/10/2030	100	0,18
20 AbbVie Inc, 4,550%, scadenza 15/03/2035	19	0,03	50 CenterPoint Energy Houston Electric LLC, 4,950%, scadenza 01/04/2033	49	0,09
210 AbbVie Inc, 4,050%, scadenza 21/11/2039	178	0,32	90 Charles Schwab Corp/The, 5,643%, scadenza 19/05/2029 *	90	0,16
60 AbbVie Inc, 4,250%, scadenza 21/11/2049	50	0,09	70 Charles Schwab Corp/The, 5,853%, scadenza 19/05/2034 *	70	0,13
70 Air Lease Corp, 1,875%, scadenza 15/08/2026	63	0,11	130 Charles Schwab Corp/The, 6,136%, scadenza 24/08/2034 *	131	0,24
240 Air Lease Corp, 5,850%, scadenza 15/12/2027	240	0,43	160 Charles Schwab Corp/The, Serie H, 4,000%, Perpetual *	120	0,22
252 Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 4,800%, scadenza 15/08/2027	244	0,44	110 Charles Schwab Corp/The, Serie G, 5,375%, Perpetual *	107	0,19
200 Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 5,500%, scadenza 15/12/2027	194	0,35	50 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200%, scadenza 15/03/2028	46	0,08
90 Alexandria Real Estate Equities Inc, 2,000%, scadenza 18/05/2032	68	0,12	60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 2,250%, scadenza 15/01/2029	50	0,09
110 Alexandria Real Estate Equities Inc, 3,000%, scadenza 18/05/2051	66	0,12	190 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500%, scadenza 01/06/2041	124	0,22
40 Amazon.com Inc, 2,100%, scadenza 12/05/2031	33	0,06	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500%, scadenza 01/03/2042	26	0,05
60 Amazon.com Inc, 3,600%, scadenza 13/04/2032	55	0,10	80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,850%, scadenza 01/04/2061	47	0,09
50 Amazon.com Inc, 3,875%, scadenza 22/08/2037	45	0,08	20 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,950%, scadenza 30/06/2062	12	0,02
40 Amazon.com Inc, 3,100%, scadenza 12/05/2051	28	0,05	200 Chesapeake Energy Corp, 144A, 5,500%, scadenza 01/02/2026	196	0,35
50 Amazon.com Inc, 3,950%, scadenza 13/04/2052	41	0,07	90 Chesapeake Energy Corp, 144A, 6,750%, scadenza 15/04/2029	90	0,16
12 American Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust, 3,375%, scadenza 01/05/2027	11	0,02	30 Cigna Group/The, 4,375%, scadenza 15/10/2028	29	0,05
145 American Airlines 2017-1 Class B Pass Through Trust, Series B, 4,950%, scadenza 15/02/2025	140	0,25	160 Cigna Group/The, 2,400%, scadenza 15/03/2030	134	0,24
240 American Airlines Inc, 144A, 11,750%, scadenza 15/07/2025	263	0,48	60 Cigna Group/The, 3,200%, scadenza 15/03/2040	44	0,08
90 American Airlines Inc, 144A, 7,250%, scadenza 15/02/2028	88	0,16	150 Cimarex Energy Co, 4,375%, scadenza 15/03/2029	121	0,22
55 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500%, scadenza 20/04/2026	54	0,10	480 Citigroup Inc, 0,981%, scadenza 01/05/2025 *	464	0,84
40 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750%, scadenza 20/04/2029	38	0,07	50 Citigroup Inc, 3,980%, scadenza 20/03/2030 *	46	0,08
130 American Express Co, 4,050%, scadenza 03/05/2029	123	0,22	230 Citigroup Inc, 2,976%, scadenza 05/11/2030 *	197	0,36
70 American Express Co, 3,550%, Perpetual *	58	0,11	150 Citigroup Inc, 2,561%, scadenza 01/05/2032 *	120	0,22
60 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650%, scadenza 15/01/2032	49	0,09	190 Citigroup Inc, 3,785%, scadenza 17/03/2033 *	164	0,30
Americo Life Inc, 144A, 3,450%, scadenza 15/04/2031	44	0,08	50 Citigroup Inc, 6,174%, scadenza 25/05/2034 *	50	0,09
150 Ameriprise Financial Inc, 5,150%, scadenza 15/05/2033	146	0,26	160 Citigroup Inc, 8,125%, scadenza 15/07/2039	198	0,36
60 AmFam Holdings Inc, 144A, 2,805%, scadenza 11/03/2031	45	0,08	30 Citigroup Inc, 4,650%, scadenza 23/07/2048	26	0,05
90 AmFam Holdings Inc, 144A, 3,833%, scadenza 11/03/2051	53	0,10	50 Clorox Co/The, 1,800%, scadenza 15/05/2030	40	0,07
30 Amgen Inc, 4,400%, scadenza 01/05/2045	25	0,05	30 Coca-Cola Co/The, 2,500%, scadenza 01/06/2040	21	0,04
50 Amgen Inc, 4,663%, scadenza 15/06/2051	43	0,08	20 Columbia Pipelines Holding Co LLC, 144A, 6,055%, scadenza 15/08/2026	20	0,04
40 Amgen Inc, 5,650%, scadenza 02/03/2053	39	0,07	80 Columbia Pipelines Holding Co LLC, 144A, 6,042%, scadenza 15/08/2028	81	0,15
20 Amgen Inc, 5,750%, scadenza 02/03/2063	19	0,04	90 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036%, scadenza 15/11/2033	90	0,16
70 Apple Inc, 2,650%, scadenza 11/05/2050	46	0,08	40 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,544%, scadenza 15/11/2053	40	0,07
500 AT&T Inc, 6,950%, scadenza 15/01/2028	505	0,91	10 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,714%, scadenza 15/08/2063	10	0,02
80 AT&T Inc, 4,300%, scadenza 15/02/2030	74	0,13	80 Comcast Corp, 4,250%, scadenza 15/10/2030	76	0,14
100 AT&T Inc, 2,550%, scadenza 01/12/2033	76	0,14	230 Comcast Corp, 4,650%, scadenza 15/02/2033	223	0,40
100 AT&T Inc, 4,500%, scadenza 15/05/2035	88	0,16	40 Comcast Corp, 7,050%, scadenza 15/03/2033	45	0,08
50 AT&T Inc, 6,375%, scadenza 01/03/2041	51	0,09	91 Comcast Corp, 6,500%, scadenza 15/11/2035	100	0,18
63 AT&T Inc, 3,550%, scadenza 15/09/2055	40	0,07	30 Comcast Corp, 3,750%, scadenza 01/04/2040	24	0,04
100 AT&T Inc, 3,800%, scadenza 01/12/2057	66	0,12	30 Comcast Corp, 3,969%, scadenza 01/11/2047	24	0,04
50 Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,500%, scadenza 15/12/2024	49	0,09	122 Comcast Corp, 2,887%, scadenza 01/11/2051	77	0,14
550 Bank of America Corp, 0,981%, scadenza 25/09/2025 *	521	0,94	60 Comcast Corp, 4,950%, scadenza 15/10/2058	55	0,10
50 Bank of America Corp, 4,376%, scadenza 27/04/2028 *	48	0,09	50 CommonSpirit Health, 2,782%, scadenza 01/10/2030	42	0,08
132 Bank of America Corp, 3,419%, scadenza 20/12/2028 *	121	0,22	60 CommonSpirit Health, 3,910%, scadenza 01/10/2050	45	0,08
70 Bank of America Corp, 3,974%, scadenza 07/02/2030 *	64	0,12	170 ConocoPhillips Co, 5,050%, scadenza 15/09/2033	168	0,30
80 Bank of America Corp, 2,884%, scadenza 22/10/2030 *	68	0,12	70 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,268%, scadenza 15/11/2026	62	0,11
200 Bank of America Corp, 2,687%, scadenza 22/04/2032 *	163	0,29	140 Continental Resources Inc/OK, 4,375%, scadenza 15/01/2028	131	0,24
130 Bank of America Corp, 2,572%, scadenza 20/10/2032 *	104	0,19	60 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,875%, scadenza 01/04/2032	46	0,08
310 Bank of America Corp, 2,972%, scadenza 04/02/2033 *	254	0,46	70 CVS Health Corp, 3,250%, scadenza 15/08/2029	62	0,11
240 Bank of America Corp, 4,571%, scadenza 27/04/2033 *	221	0,40	70 CVS Health Corp, 5,250%, scadenza 30/01/2031	69	0,12
250 Bank of America Corp, 2,482%, scadenza 21/09/2036 *	189	0,34	130 CVS Health Corp, 2,125%, scadenza 15/09/2031	102	0,18
40 Bank of America Corp, 2,676%, scadenza 19/06/2041 *	27	0,05	10 CVS Health Corp, 4,780%, scadenza 25/03/2038	9	0,02
70 Bank of America Corp, 3,311%, scadenza 22/04/2042 *	52	0,09			
20 Bank of America Corp, 4,443%, scadenza 20/01/2048 *	17	0,03			
10 Bank of America Corp, 4,330%, scadenza 15/03/2050 *	8	0,02			
30 Bank of America Corp, 2,831%, scadenza 24/10/2051 *	19	0,03			

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Stati Uniti — (segue)					
170	CVS Health Corp, 2,700%, scadenza 21/08/2040	113	0,20		
150	CVS Health Corp, 5,050%, scadenza 25/03/2048	130	0,24		
100	DCP Midstream Operating LP, 3,250%, scadenza 15/02/2032	83	0,15		
30	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450%, scadenza 03/11/2036	31	0,06		
62	Dell International LLC / EMC Corp, 8,100%, scadenza 15/07/2036	71	0,13		
10	Delta Air Lines Inc, 7,375%, scadenza 15/01/2026	10	0,02		
210	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500%, scadenza 20/10/2025	205	0,37		
210	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750%, scadenza 20/10/2028	202	0,36		
60	Devon Energy Corp, 5,850%, scadenza 15/12/2025	60	0,11		
62	Devon Energy Corp, 5,875%, scadenza 15/06/2028	62	0,11		
114	Devon Energy Corp, 4,500%, scadenza 15/01/2030	106	0,19		
50	Devon Energy Corp, 7,950%, scadenza 15/04/2032	57	0,10		
50	Devon Energy Corp, 5,600%, scadenza 15/07/2041	46	0,08		
90	Devon Energy Corp, 5,000%, scadenza 15/06/2045	76	0,14		
260	Devon OEI Operating LLC, 7,500%, scadenza 15/09/2027	275	0,50		
150	Diamondback Energy Inc, 3,500%, scadenza 01/12/2029	135	0,24		
60	Diamondback Energy Inc, 4,400%, scadenza 24/03/2051	46	0,08		
100	Diamondback Energy Inc, 6,250%, scadenza 15/03/2053	98	0,18		
90	DISH DBS Corp, 5,875%, scadenza 15/11/2024	84	0,15		
120	DISH DBS Corp, 144A, 5,750%, scadenza 01/12/2028	93	0,17		
90	Duke Energy Carolinas LLC, 4,950%, scadenza 15/01/2033	88	0,16		
100	Edison International, 4,950%, scadenza 15/04/2025	98	0,18		
70	Edison International, Serie A, 5,375%, Perpetual *	62	0,11		
130	Edison International, Serie B, 5,000%, Perpetual *	111	0,20		
280	El Paso Natural Gas Co LLC, 7,500%, scadenza 15/11/2026	297	0,54		
20	Elevance Health Inc, 4,100%, scadenza 15/05/2032	18	0,03		
240	Elevance Health Inc, 5,500%, scadenza 15/10/2032	243	0,44		
50	Elevance Health Inc, 4,375%, scadenza 01/12/2047	42	0,08		
30	Eli Lilly & Co, 4,950%, scadenza 27/02/2063	29	0,05		
40	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750%, scadenza 30/01/2028	39	0,07		
50	Enterprise Products Operating LLC, Serie D, 6,875%, scadenza 01/03/2033	55	0,10		
190	Enterprise Products Operating LLC, 4,250%, scadenza 15/02/2048	153	0,28		
80	Enterprise Products Operating LLC, 3,300%, scadenza 15/02/2053	54	0,10		
50	Enterprise Products Operating LLC, 3,950%, scadenza 31/01/2060	36	0,07		
230	Enterprise Products Operating LLC, 5,375%, scadenza 15/02/2078 *	191	0,35		
90	EOG Resources Inc, 4,375%, scadenza 15/04/2030	87	0,16		
60	EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500%, scadenza 01/06/2027	61	0,11		
66	EQT Corp, 6,125%, scadenza 01/02/2025	66	0,12		
30	EQT Corp, 144A, 3,125%, scadenza 15/05/2026	28	0,05		
60	EQT Corp, 3,900%, scadenza 01/10/2027	56	0,10		
20	EQT Corp, 144A, 3,625%, scadenza 15/05/2031	17	0,03		
30	Equifax Inc, 2,350%, scadenza 15/09/2031	23	0,04		
30	Extra Space Storage LP, 3,900%, scadenza 01/04/2029	27	0,05		
20	Exxon Mobil Corp, 2,995%, scadenza 16/08/2039	15	0,03		
100	First Third Bancorp, 6,339%, scadenza 27/07/2029 *	101	0,18		
30	FirstEnergy Corp, Serie C, 5,100%, scadenza 15/07/2047	26	0,05		
260	Florida Gas Transmission Co LLC, 144A, 2,300%, scadenza 01/10/2031	203	0,37		
20	Ford Motor Co, 4,750%, scadenza 15/01/2043	15	0,03		
200	Ford Motor Credit Co LLC, 2,300%, scadenza 10/02/2025	188	0,34		
200	Ford Motor Credit Co LLC, 6,950%, scadenza 06/03/2026	201	0,36		
300	Ford Motor Credit Co LLC, 2,700%, scadenza 10/08/2026	269	0,49		
120	Freeport-McMoRan Inc, 4,550%, scadenza 14/11/2024	118	0,21		
200	Freeport-McMoRan Inc, 5,400%, scadenza 14/11/2034	189	0,34		
EUR	40 GE Capital European Funding Unlimited Co, 6,025%, scadenza 01/03/2038	51	0,09		
GBP	20 GE Capital UK Funding Unlimited Co, 8,000%, scadenza 14/01/2039	29	0,05		
300	General Electric Co, 6,750%, scadenza 15/03/2032	333	0,60		
170	General Motors Co, 6,125%, scadenza 01/10/2025	171	0,31		
40	General Motors Co, 5,600%, scadenza 15/10/2032	38	0,07		
60	General Motors Co, 6,600%, scadenza 01/04/2036	60	0,11		
40	General Motors Co, 5,950%, scadenza 01/04/2049	35	0,06		
630	Genting New York LLC / GENNY Capital Inc, 144A, 3,300%, scadenza 15/02/2026	562	1,02		
40	Gilead Sciences Inc, 4,000%, scadenza 01/09/2036	35	0,06		
630	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855%, scadenza 12/02/2026 *	585	1,06		
280	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500%, scadenza 16/11/2026	263	0,48		
350	Goldman Sachs Group Inc/The, Serie VAR, 1,093%, scadenza 09/12/2026 *	314	0,57		
130	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615%, scadenza 15/03/2028 *	121	0,22		
70	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800%, scadenza 15/03/2030	63	0,11		
150	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,650%, scadenza 21/10/2032 *	120	0,22		
30	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150%, scadenza 22/05/2045	27	0,05		
70	Goldman Sachs Group Inc/The, Serie W, 7,500%, Perpetual *	71	0,13		
60	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750%, scadenza 20/01/2026	55	0,10		
240	HCA Inc, 5,500%, scadenza 01/06/2033	234	0,42		
40	HCA Inc, 5,125%, scadenza 15/06/2039	36	0,07		
270	HEICO Corp, 5,250%, scadenza 01/08/2028	267	0,48		
100	Humana Inc, 5,875%, scadenza 01/03/2033	103	0,19		
50	Humana Inc, 4,950%, scadenza 01/10/2044	44	0,08		
110	Huntington Bancshares Inc/OH, 6,208%, scadenza 21/08/2029 *	110	0,20		
190	ILFC E-Capital Trust I, 144A, 7,064%, scadenza 21/12/2065 *	138	0,25		
100	ILFC E-Capital Trust II, 144A, 7,314%, scadenza 21/12/2065 *	74	0,13		
40	Ingersoll Rand Inc, 5,400%, scadenza 14/08/2028	40	0,07		
110	Ingersoll Rand Inc, 5,700%, scadenza 14/08/2033	111	0,20		
60	Intel Corp, 2,800%, scadenza 12/08/2041	41	0,07		
30	Intel Corp, 4,900%, scadenza 05/08/2052	27	0,05		
60	Intel Corp, 3,200%, scadenza 12/08/2061	37	0,07		
110	Intercontinental Exchange Inc, 4,600%, scadenza 15/03/2033	105	0,19		
10	Intercontinental Exchange Inc, 4,950%, scadenza 15/06/2052	9	0,02		
33	Invitation Homes Operating Partnership LP, 4,150%, scadenza 15/04/2032	29	0,05		
60	Jabil Inc, 5,450%, scadenza 01/02/2029	59	0,11		
40	Jersey Central Power & Light Co, 144A, 4,300%, scadenza 15/01/2026	39	0,07		
20	Johnson & Johnson, 2,100%, scadenza 01/09/2040	14	0,02		
30	Johnson & Johnson, 2,450%, scadenza 01/09/2060	18	0,03		
150	JPMorgan Chase & Co, 2,005%, scadenza 13/03/2026	142	0,26		
70	JPMorgan Chase & Co, 2,739%, scadenza 15/10/2030	60	0,11		
20	JPMorgan Chase & Co, 2,522%, scadenza 22/04/2031	17	0,03		
170	JPMorgan Chase & Co, 2,956%, scadenza 13/05/2031	144	0,26		
260	JPMorgan Chase & Co, 2,580%, scadenza 22/04/2032	211	0,38		
50	JPMorgan Chase & Co, 2,545%, scadenza 08/11/2032	40	0,07		
170	JPMorgan Chase & Co, 4,586%, scadenza 26/04/2033	158	0,29		
80	JPMorgan Chase & Co, 4,260%, scadenza 22/02/2048	66	0,12		
50	JPMorgan Chase & Co, 3,897%, scadenza 23/01/2049	39	0,07		
10	JPMorgan Chase & Co, 3,328%, scadenza 22/04/2052	7	0,01		
90	JPMorgan Chase & Co, Serie KK, 3,650%, Perpetual *	80	0,15		
60	Kaiser Foundation Hospitals, Serie 2021, 2,810%, scadenza 01/06/2041	42	0,08		
70	Kaiser Foundation Hospitals, Serie 2019, 3,266%, scadenza 01/11/2049	50	0,09		
20	Kaiser Foundation Hospitals, Serie 2021, 3,002%, scadenza 01/06/2051	13	0,02		
30	Kenvue Inc, 144A, 5,050%, scadenza 22/03/2053	29	0,05		
30	Kenvue Inc, 144A, 5,200%, scadenza 22/03/2063	29	0,05		
110	Kimco Realty OP LLC, 2,250%, scadenza 01/12/2031	85	0,15		
20	Kinder Morgan Energy Partners LP, 7,300%, scadenza 15/08/2033	22	0,04		
40	Kinder Morgan Inc, 5,300%, scadenza 01/12/2034	38	0,07		
30	Kinder Morgan Inc, 5,200%, scadenza 01/03/2048	26	0,05		
70	KKR Group Finance Co III LLC, 144A, 5,125%, scadenza 01/06/2044	60	0,11		
60	KLA Corp, 4,650%, scadenza 15/07/2032	59	0,11		
20	KLA Corp, 4,950%, scadenza 15/07/2052	19	0,03		
160	Kyndryl Holdings Inc, 3,150%, scadenza 15/10/2031	124	0,22		
110	Kyndryl Holdings Inc, 4,100%, scadenza 15/10/2041	75	0,14		
50	Lam Research Corp, 1,900%, scadenza 15/06/2030	41	0,07		
40	Lennox International Inc, 1,700%, scadenza 01/08/2027	35	0,06		
30	Lithia Motors Inc, 144A, 4,625%, scadenza 15/12/2027	28	0,05		
50	Lowe's Cos Inc, 2,800%, scadenza 15/09/2041	34	0,06		
60	Lowe's Cos Inc, 3,000%, scadenza 15/10/2050	38	0,07		
80	Mars Inc, 144A, 2,375%, scadenza 16/07/2040	53	0,10		
110	Marsh & McLennan Cos Inc, 2,375%, scadenza 15/12/2031	89	0,16		
30	Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375%, scadenza 15/04/2050	20	0,04		
100	Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 4,900%, scadenza 01/04/2077	81	0,15		
60	Mastercard Inc, 3,350%, scadenza 26/03/2030	55	0,10		
30	Mastercard Inc, 3,850%, scadenza 26/03/2050	24	0,04		
50	McDonald's Corp, 4,450%, scadenza 01/03/2047	43	0,08		
30	McDonald's Corp, 4,450%, scadenza 01/09/2048	26	0,05		
100	McKesson Corp, 4,900%, scadenza 15/07/2028	99	0,18		
80	MDC Holdings Inc, 2,500%, scadenza 15/01/2031	62	0,11		
30	MDC Holdings Inc, 6,000%, scadenza 15/01/2043	26	0,05		
40	Merck & Co Inc, 2,350%, scadenza 24/06/2040	28	0,05		
110	Metropolitan Edison Co, 144A, 5,200%, scadenza 01/04/2028	108	0,20		
240	Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 5,150%, scadenza 28/03/2033	233	0,42		
110	Micron Technology Inc, 2,703%, scadenza 15/04/2032	86	0,16		
40	Micron Technology Inc, 5,875%, scadenza 09/02/2033	39	0,07		
44	Microsoft Corp, 3,450%, scadenza 08/08/2036	39	0,07		
39	Microsoft Corp, 2,921%, scadenza 17/03/2052	27	0,05		
184	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500%, scadenza 20/06/2027	183	0,33		
20	Molson Coors Beverage Co, 3,000%, scadenza 15/07/2026	19	0,03		
30	Molson Coors Beverage Co, 4,200%, scadenza 15/07/2046	23	0,04		
20	Mondelez International Inc, 2,625%, scadenza 04/09/2050	12	0,02		
570	Morgan Stanley, Serie I, 0,864%, scadenza 21/10/2025 *	536	0,97		
130	Morgan Stanley, 2,188%, scadenza 28/04/2026 *	123	0,22		
390	Morgan Stanley, 0,985%, scadenza 10/12/2026 *	350	0,63		
30	Morgan Stanley, 1,593%, scadenza 04/05/2027 *	27	0,05		

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Stati Uniti — (segue)					
150 Morgan Stanley, 5,449%, scadenza 20/07/2029 *	149	0,27	30 QUALCOMM Inc, 4,500%, scadenza 20/05/2052	26	0,05
50 Morgan Stanley, 1,794%, scadenza 13/02/2032 *	38	0,07	210 QVC Inc, 4,850%, scadenza 01/04/2024	204	0,37
90 Morgan Stanley, 2,239%, scadenza 21/07/2032 *	70	0,13	61 Range Resources Corp, 4,875%, scadenza 15/05/2025	60	0,11
50 Morgan Stanley, 6,342%, scadenza 18/10/2033 *	52	0,09	80 Range Resources Corp, 8,250%, scadenza 15/01/2029	83	0,15
100 Morgan Stanley, 2,484%, scadenza 16/09/2036 *	75	0,14	50 Raymond James Financial Inc, 4,950%, scadenza 15/07/2046	43	0,08
110 Morgan Stanley, 5,297%, scadenza 20/04/2037 *	102	0,18	350 Regal Rexnord Corp, 144A, 6,050%, scadenza 15/02/2026	348	0,63
100 Morgan Stanley, 5,948%, scadenza 19/01/2038 *	97	0,18	50 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875%, scadenza 15/10/2026	45	0,08
20 MPLX LP, 4,800%, scadenza 15/02/2029	19	0,03	30 S&P Global Inc, 1,250%, scadenza 15/08/2030	23	0,04
120 MPLX LP, 5,000%, scadenza 01/03/2033	112	0,20	20 S&P Global Inc, 3,250%, scadenza 01/12/2049	14	0,03
170 MPLX LP, 4,500%, scadenza 15/04/2038	143	0,26	60 Salesforce Inc, 1,500%, scadenza 15/07/2028	52	0,09
290 National General Holdings Corp, Serie 0000, 144A, 6,750%, scadenza 15/05/2024	289	0,52	80 San Diego Gas & Electric Co, Serie VVV, 1,700%, scadenza 01/10/2030	63	0,11
60 New York Life Global Funding, 144A, 4,550%, scadenza 28/01/2033	57	0,10	80 San Diego Gas & Electric Co, Serie RRR, 3,750%, scadenza 01/06/2047	60	0,11
60 New York Life Insurance Co, 144A, 3,750%, scadenza 15/05/2050	44	0,08	170 SCE Recovery Funding LLC, Serie A-1, 4,697%, scadenza 15/06/2040	163	0,30
140 Newell Brands Inc, 4,000%, scadenza 01/12/2024	136	0,25	90 Southern California Edison Co, 2,250%, scadenza 01/06/2030	74	0,13
30 NextEra Energy Operating Partners LP, 144A, 4,250%, scadenza 15/07/2024	29	0,05	90 Southern California Edison Co, Serie G, 2,500%, scadenza 01/06/2031	74	0,13
170 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 1,050%, scadenza 08/03/2024	165	0,30	10 Southern California Edison Co, 4,000%, scadenza 01/04/2047	8	0,01
60 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750%, scadenza 09/03/2028	51	0,09	180 Southern California Edison Co, Serie C, 4,125%, scadenza 01/03/2048	140	0,25
180 Nordstrom Inc, 2,300%, scadenza 08/04/2024	175	0,32	70 Southern California Edison Co, 3,650%, scadenza 01/02/2050	50	0,09
120 Norfolk Southern Railway Co, 7,875%, scadenza 15/05/2043	143	0,26	40 Southwestern Energy Co, 8,375%, scadenza 15/09/2028	42	0,08
80 Northwest Pipeline LLC, 7,125%, scadenza 01/12/2025	82	0,15	150 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000%, scadenza 20/09/2025	150	0,27
260 Northwest Pipeline LLC, 4,000%, scadenza 01/04/2027	247	0,45	110 Targa Resources Corp, 5,200%, scadenza 01/07/2027	109	0,20
60 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,850%, scadenza 30/09/2047	45	0,08	70 Targa Resources Corp, 4,200%, scadenza 01/02/2033	61	0,11
10 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,625%, scadenza 30/09/2059	7	0,01	90 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 6,875%, scadenza 15/01/2029	91	0,16
90 Nuveen LLC, 144A, 4,000%, scadenza 01/11/2028	84	0,15	70 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875%, scadenza 01/02/2031	64	0,12
20 NVIDIA Corp, 3,500%, scadenza 01/04/2040	16	0,03	120 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000%, scadenza 15/01/2032	104	0,19
20 NVIDIA Corp, 3,700%, scadenza 01/04/2060	16	0,03	260 TD SYNEX Corp, 1,250%, scadenza 09/08/2024	248	0,45
50 Occidental Petroleum Corp, 3,400%, scadenza 15/04/2026	47	0,09	70 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,270%, scadenza 15/05/2047	56	0,10
90 Occidental Petroleum Corp, 7,875%, scadenza 15/09/2031	99	0,18	190 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000%, scadenza 15/03/2027	198	0,36
50 Occidental Petroleum Corp, 7,950%, scadenza 15/06/2039	56	0,10	240 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000%, scadenza 15/10/2028	254	0,46
30 Occidental Petroleum Corp, 4,400%, scadenza 15/04/2046	23	0,04	20 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900%, scadenza 01/03/2030	17	0,03
100 Ohio Edison Co, 144A, 5,500%, scadenza 15/01/2033	98	0,18	40 Texas Instruments Inc, 2,250%, scadenza 04/09/2029	35	0,06
110 Ohio Edison Co, 6,875%, scadenza 15/07/2036	119	0,22	120 Texas Instruments Inc, 3,875%, scadenza 15/03/2039	103	0,19
30 Oncor Electric Delivery Co LLC, 4,150%, scadenza 01/06/2032	28	0,05	144 Time Warner Cable Enterprises LLC, 8,375%, scadenza 15/07/2033	160	0,29
10 Oncor Electric Delivery Co LLC, 3,100%, scadenza 15/09/2049	7	0,01	150 Time Warner Cable LLC, 7,300%, scadenza 01/07/2038	151	0,27
190 ONEOK Inc, 6,050%, scadenza 01/09/2033	191	0,34	90 Time Warner Cable LLC, 6,750%, scadenza 15/06/2039	86	0,16
150 ONEOK Inc, 6,625%, scadenza 01/09/2053	150	0,27	20 T-Mobile USA Inc, 2,625%, scadenza 15/02/2029	17	0,03
160 Oracle Corp, 6,250%, scadenza 09/11/2032	166	0,30	110 T-Mobile USA Inc, 2,550%, scadenza 15/02/2031	90	0,16
140 Oracle Corp, 4,000%, scadenza 15/07/2046	104	0,19	70 T-Mobile USA Inc, 2,250%, scadenza 15/11/2031	55	0,10
40 Oracle Corp, 6,900%, scadenza 09/11/2052	43	0,08	280 T-Mobile USA Inc, 2,700%, scadenza 15/03/2032	226	0,41
140 Oracle Corp, 5,550%, scadenza 06/02/2053	129	0,23	20 T-Mobile USA Inc, 4,375%, scadenza 15/04/2040	17	0,03
210 Pacific Gas and Electric Co, 3,150%, scadenza 01/01/2026	196	0,35	80 T-Mobile USA Inc, 3,000%, scadenza 15/02/2041	56	0,10
70 Pacific Gas and Electric Co, 2,100%, scadenza 01/08/2027	60	0,11	60 T-Mobile USA Inc, 3,300%, scadenza 15/02/2051	40	0,07
100 Pacific Gas and Electric Co, 3,300%, scadenza 01/12/2027	89	0,16	270 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,250%, scadenza 01/12/2026	277	0,50
30 Pacific Gas and Electric Co, 2,500%, scadenza 01/02/2031	23	0,04	30 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 4,450%, scadenza 01/08/2042	25	0,04
10 Pacific Gas and Electric Co, 3,300%, scadenza 01/08/2040	7	0,01	60 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950%, scadenza 15/05/2050	44	0,08
60 Pacific Gas and Electric Co, 4,750%, scadenza 15/02/2044	45	0,08	130 Truist Financial Corp, 1,267%, scadenza 02/03/2027 *	116	0,21
40 Pacific Gas and Electric Co, 4,950%, scadenza 01/07/2050	31	0,06	70 Truist Financial Corp, 6,047%, scadenza 08/06/2027 *	70	0,13
80 Pacific Gas and Electric Co, 6,700%, scadenza 01/04/2053	77	0,14	60 Truist Financial Corp, 5,867%, scadenza 08/06/2034 *	59	0,11
170 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125%, scadenza 15/02/2028	159	0,29	40 Union Pacific Corp, 2,973%, scadenza 16/09/2062	24	0,04
120 PayPal Holdings Inc, 2,300%, scadenza 01/06/2030	100	0,18	30 Union Pacific Corp, 3,750%, scadenza 05/02/2070	22	0,04
10 PayPal Holdings Inc, 4,400%, scadenza 01/06/2032	9	0,02	129 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875%, scadenza 15/01/2026	126	0,23
10 PayPal Holdings Inc, 3,250%, scadenza 01/06/2050	7	0,01	230 United Airlines 2023-1 Class A Pass Through Trust, 5,800%, scadenza 15/01/2036	229	0,41
20 PayPal Holdings Inc, 5,250%, scadenza 01/06/2062	19	0,03	50 UnitedHealth Group Inc, 2,000%, scadenza 15/05/2030	41	0,08
40 Pennsylvania Electric Co, 144A, 5,150%, scadenza 30/03/2026	39	0,07	310 UnitedHealth Group Inc, 5,350%, scadenza 15/02/2033	316	0,57
40 Pfizer Inc, 2,550%, scadenza 28/05/2040	28	0,05	90 UnitedHealth Group Inc, 2,750%, scadenza 15/05/2040	64	0,12
30 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,450%, scadenza 19/05/2028	29	0,05	40 UnitedHealth Group Inc, 4,750%, scadenza 15/07/2045	37	0,07
60 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,650%, scadenza 19/05/2030	59	0,11	30 UnitedHealth Group Inc, 4,450%, scadenza 15/12/2048	26	0,05
220 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750%, scadenza 19/05/2033	215	0,39	40 UnitedHealth Group Inc, 5,875%, scadenza 15/02/2053	42	0,08
190 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,110%, scadenza 19/05/2043	183	0,33	171 US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust, 4,625%, scadenza 03/06/2025	165	0,30
100 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,300%, scadenza 19/05/2053	99	0,18	80 US Bancorp, 5,775%, scadenza 12/06/2029 *	80	0,14
20 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,340%, scadenza 19/05/2063	19	0,04	90 Verizon Communications Inc, 1,500%, scadenza 18/09/2030	70	0,13
90 Pilgrim's Pride Corp, 144A, 5,875%, scadenza 30/09/2027	89	0,16	30 Verizon Communications Inc, 2,650%, scadenza 20/11/2040	20	0,04
50 Pioneer Natural Resources Co, 5,100%, scadenza 29/03/2026	50	0,09	40 Verizon Communications Inc, 6,550%, scadenza 15/09/2043	44	0,08
60 Pioneer Natural Resources Co, 2,150%, scadenza 15/01/2031	48	0,09	30 Verizon Communications Inc, 4,000%, scadenza 22/03/2050	23	0,04
50 Plains All American Pipeline LP, Serie B, 9,736%, Perpetual *	46	0,08	30 Verizon Communications Inc, 2,987%, scadenza 30/10/2056	18	0,03
40 Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700%, scadenza 15/05/2036	39	0,07	30 Visa Inc, 2,700%, scadenza 15/04/2040	22	0,04
120 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812%, scadenza 12/06/2026 *	120	0,22	90 Vontier Corp, 1,800%, scadenza 01/04/2026	81	0,15
30 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582%, scadenza 12/06/2029 *	30	0,05	180 Vontier Corp, 2,400%, scadenza 01/04/2028	150	0,27
110 PNC Financial Services Group Inc/The, Serie W, 6,250%, Perpetual *	97	0,18	60 Walmart Inc, 2,650%, scadenza 22/09/2051	40	0,07
70 Prologis LP, 1,250%, scadenza 15/10/2030	54	0,10	20 Walt Disney Co/The, 6,200%, scadenza 15/12/2034	22	0,04
10 Prudential Financial Inc, 6,750%, scadenza 01/03/2053 *	10	0,02	23 Walt Disney Co/The, 6,400%, scadenza 15/12/2035	25	0,05
			20 Walt Disney Co/The, 6,650%, scadenza 15/11/2037	22	0,04

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Credit default swap

Controparte	Entità di riferimento – Protezione acquisto/vendita	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000% – Acquisto	20-giu-2028	870	\$ (25)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000% – Acquisto	20-giu-2028	1.673	(26)
Apprezamento non realizzato di Credit default swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): –\$)				\$ –
Deprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (74)\$)				(51)
Ammortamento netto dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (74)\$)				\$ (51)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)		Valuta vendita (in migliaia)		Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)	
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	31.800	Vendita	USD 40.285	\$ (120)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	42.061	Vendita	GBP 33.194	135
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	64.458	Vendita	USD 82.087	(669)
20-ott-2023	Goldman Sachs	Acquisto	MXN	3.333	Vendita	USD 192	1
20-ott-2023	Goldman Sachs	Acquisto	JPY	35.284	Vendita	USD 249	(6)
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	BRL	388	Vendita	USD 79	(1)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	191	Vendita	BRL 951	(1)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	298	Vendita	EUR 274	1
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	450	Vendita	GBP 350	7
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	289	Vendita	JPY 41.766	2
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	146	Vendita	MXN 2.507	1
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	JPY	64.420	Vendita	USD 462	(19)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	EUR	417	Vendita	USD 460	(9)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	BRL	1.950	Vendita	USD 394	(2)
Apprezamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 35\$)						\$ 147	
Deprezzamento non realizzato dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (404)\$)						(827)	
Deprezzamento netto dei Forward Foreign Currency Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (369)\$)						\$ (680)	

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	6	\$ 664	\$ 4
U.S. 10 Year Ultra Note dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(8)	(923)	(9)
U.S. 2 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(16)	(3.260)	(8)
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	46	4909	25
U.S. Long Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	20	2407	16
U.S. Ultra Bond (CBT) dicembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	27	3450	5
Apprezamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): 4\$)				\$ 50
Deprezzamento non realizzato di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (103)\$)				(17)
Apprezamento netto di Futures Contracts (28 febbraio 2023 (in migliaia): (99)\$)				\$ 33

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

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da attività — 0,42% (28 febbraio 2023: 2,61%)			Canada — 1,00% (28 febbraio 2023: 1,11%)		
80 Soundview Home Loan Trust, serie 20062, M2, 5,954% 2006-2-, 25/03/36*	78	0,42	30 Bank of Montreal, 1,850%, scadenza 01/05/2025	28	0,15
Totale titoli garantiti da attività (costo 78 dollari)	78	0,42	20 Bank of Nova Scotia/The, 1,300%, scadenza 11/06/2025	18	0,10
Titoli garantiti da ipoteca — 20,74% (28 febbraio 2023: 19,86%)			20 Barrick North America Finance LLC, 5,700%, scadenza 30/05/2041	20	0,10
100 BANK 2017-BNK7, serie 2017 BNK7, classe C, 4,145%, scadenza 15/09/2060 *	81	0,43	10 MEG Energy Corp, 144A, 5,875%, scadenza 01/02/2029	10	0,05
7.555 Benchmark 2018-B7 Mortgage Trust, serie 2018 B7, classe XA, 0,565%, scadenza 15/05/2053 *	116	0,62	40 Royal Bank of Canada, 1,150%, scadenza 10/06/2025	37	0,20
100 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, serie 2021 R01, classe 1B1, 144A, 8,388%, scadenza 25/10/2041 *	100	0,53	10 Teck Resources Ltd, 3,900%, scadenza 15/07/2030	9	0,05
100 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, serie 2021 R03, classe 1B1, 144A, 8,038%, scadenza 25/12/2041 *	99	0,53	70 Toronto-Dominion Bank/The, 1,150%, scadenza 12/06/2025	65	0,35
121 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, serie 2015 C03, classe 1M2, 10,402%, scadenza 25/07/2025 *	127	0,68		187	1,00
19 Pool Fannie Mae 'AM8700', 2,930%, scadenza 01/06/2030	17	0,09	Colombia — 0,38% (28 febbraio 2023: 0,36%)		
19 Pool Fannie Mae 'AN5386', 3,250%, scadenza 01/05/2029	18	0,10	100 Ecopetrol SA, 5,875%, scadenza 28/05/2045	71	0,38
20 Pool Fannie Mae 'AS0038', 3,000%, scadenza 01/07/2043	18	0,10	Francia — 1,02% (28 febbraio 2023: 1,03%)		
40 Pool Fannie Mae 'BM6898', 2,149%, scadenza 01/02/2032 *	32	0,17	200 BNP Paribas SA, 144A, 4,400%, scadenza 14/08/2028	189	1,02
83 Pool Fannie Mae 'BR4393', 2,000%, scadenza 01/03/2051	66	0,36	Irlanda — 0,31% (28 febbraio 2023: 0,32%)		
126 Pool Fannie Mae 'CA5220', 3,000%, scadenza 01/02/2050	109	0,59	59 Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 7,664%, scadenza 01/12/2027 *	58	0,31
86 Pool Fannie Mae 'CB1878', 3,000%, scadenza 01/10/2051	74	0,40	Israele — 0,58% (28 febbraio 2023: 1,21%)		
173 Pool Fannie Mae 'CB2164', 3,000%, scadenza 01/11/2051	150	0,81	120 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, scadenza 01/10/2026	109	0,58
89 Pool Fannie Mae 'CB2375', 2,500%, scadenza 01/12/2051	75	0,40	Macao — 0,95% (28 febbraio 2023: 0,93%)		
276 Pool Fannie Mae 'FM3445', 4,000%, scadenza 01/09/2048	259	1,39	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625%, scadenza 26/08/2028	177	0,95
86 Pool Fannie Mae 'FM9195', 2,500%, scadenza 01/10/2051	72	0,39	Messico — 0,50% (28 febbraio 2023: 0,51%)		
85 Pool Fannie Mae 'FM9292', 3,000%, scadenza 01/11/2051	75	0,40	100 Southern Copper Corp, 5,250%, scadenza 08/11/2042	92	0,50
87 Pool Fannie Mae 'FM9579', 2,000%, scadenza 01/07/2051	69	0,37	Regno Unito — 1,11% (28 febbraio 2023: 1,25%)		
88 Pool Fannie Mae 'FS0584', 2,000%, scadenza 01/02/2052	71	0,38	11 BAT Capital Corp, 3,557%, scadenza 15/08/2027	10	0,05
86 Pool Fannie Mae 'FS1107', 2,500%, scadenza 01/12/2051	72	0,39	40 BAT Capital Corp, 4,540%, scadenza 15/08/2047	29	0,16
179 Pool Fannie Mae 'FS2740', 3,500%, scadenza 01/06/2049	163	0,87	200 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750%, scadenza 15/07/2031	168	0,90
73 Pool Fannie Mae 'MA4158', 2,000%, scadenza 01/10/2050	58	0,31		207	1,11
82 Pool Fannie Mae 'MA4305', 2,000%, scadenza 01/04/2051	66	0,35	Stati Uniti — 23,01% (28 febbraio 2023: 22,39%)		
73 Pool Freddie Mac 'RA3913', 3,000%, scadenza 01/11/2050	61	0,33	10 Abbott Laboratories, 3,750%, scadenza 30/11/2026	10	0,05
83 Pool Freddie Mac 'RA5921', 2,500%, scadenza 01/09/2051	69	0,37	10 Abbott Laboratories, 4,750%, scadenza 30/11/2036	10	0,05
70 Pool Freddie Mac 'RB5130', 1,500%, scadenza 01/10/2041	56	0,30	20 Abbott Laboratories, 4,900%, scadenza 30/11/2046	20	0,11
18 Pool Freddie Mac 'RB5134', 1,500%, scadenza 01/11/2041	14	0,08	100 AbbVie Inc, 3,600%, scadenza 14/05/2025	97	0,52
329 Pool Freddie Mac 'SD0176', 3,500%, scadenza 01/12/2049	298	1,60	80 AbbVie Inc, 3,200%, scadenza 21/11/2029	72	0,39
88 Pool Freddie Mac 'SD0777', 2,500%, scadenza 01/11/2051	74	0,40	20 AbbVie Inc, 4,250%, scadenza 21/11/2049	17	0,09
82 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, serie 2020 DNA2, classe M2, 144A, 7,252%, scadenza 25/02/2050 *	82	0,44	10 Air Lease Corp, 5,300%, scadenza 01/02/2028	10	0,05
90 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, serie 2021 DNA5, classe M2, 144A, 6,938%, scadenza 25/01/2034 *	90	0,48	20 Alphabet Inc, 1,100%, scadenza 15/08/2030	16	0,09
100 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, serie 2022 DNA3, classe B1, 144A, 10,938%, scadenza 25/04/2042 *	105	0,57	20 Alphabet Inc, 2,050%, scadenza 15/08/2050	12	0,06
135 Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000%, scadenza 20/05/2050	128	0,68	32 Altria Group Inc, 4,400%, scadenza 14/02/2026	31	0,17
221 Ginnie Mae II Pool 'MA7473', 3,000%, scadenza 20/07/2051	196	1,05	8 Altria Group Inc, 4,800%, scadenza 14/02/2029	8	0,04
236 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000%, scadenza 20/09/2051	208	1,12	20 Altria Group Inc, 5,800%, scadenza 14/02/2039	20	0,11
90 Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500%, scadenza 20/02/2052	82	0,44	30 Altria Group Inc, 5,950%, scadenza 14/02/2049	28	0,15
100 Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,000% ±	97	0,52	40 Amazon.com Inc, 1,500%, scadenza 03/06/2030	33	0,18
97 Government National Mortgage Association, serie 2022 3, classe IO, 0,640%, scadenza 16/02/2061 *	5	0,03	50 Amazon.com Inc, 2,500%, scadenza 03/06/2050	32	0,17
31 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, serie 2021 NQ2R, classe A3, 144A, 1,353%, scadenza 25/10/2058 *	28	0,15	50 AT&T Inc, 1,650%, scadenza 01/12/2028	43	0,23
250 Towd Point Mortgage Trust 2017-4, serie 2017 4, classe B2, 144A, 3,574%, scadenza 25/06/2057 *	191	1,02	10 Ball Corp, 3,125%, scadenza 15/09/2031	8	0,04
95 Verus Securitization Trust 2023-4, serie 2023 4, classe A1, 144A, 5,811%, scadenza 25/05/2068	94	0,50	20 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250%, scadenza 15/01/2049	18	0,09
Totale titoli garantiti da ipoteca (costo 4.319 dollari)	3.865	20,74	40 Boeing Co/The, 4,875%, scadenza 01/05/2025	39	0,21
Obbligazioni ed effetti societari — 30,95% (28 febbraio 2023: 31,20%)			50 Boeing Co/The, 5,150%, scadenza 01/05/2030	49	0,26
Australia — 0,41% (28 febbraio 2023: 0,42%)			40 Boeing Co/The, 5,705%, scadenza 01/05/2040	39	0,21
20 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000%, scadenza 30/09/2043	20	0,10	50 Boeing Co/The, 5,805%, scadenza 01/05/2050	49	0,26
20 Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 6,000%, scadenza 15/11/2041	19	0,10	40 BP Capital Markets America Inc, 3,119%, scadenza 04/05/2026	38	0,20
40 Glencore Funding LLC, 144A, 4,000%, scadenza 27/03/2023	38	0,21	20 BP Capital Markets America Inc, 3,633%, scadenza 06/04/2030	19	0,10
	77	0,41	20 BP Capital Markets America Inc, 3,000%, scadenza 24/02/2050	13	0,07
Belgio — 0,29% (28 febbraio 2023: 0,29%)			13 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400%, scadenza 26/07/2029	12	0,07
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500%, scadenza 01/06/2030	37	0,20	260 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500%, scadenza 01/05/2032	211	1,13
20 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350%, scadenza 01/06/2040	18	0,09	10 Centene Corp, 4,250%, scadenza 15/12/2027	9	0,05
	55	0,29	10 Centene Corp, 4,625%, scadenza 15/12/2029	9	0,05
Brasile — 1,39% (28 febbraio 2023: 1,38%)			20 Charles Schwab Corp/The, 5,875%, scadenza 24/08/2026	20	0,11
110 Petrobras Global Finance BV, 5,750%, 01/02/2029	107	0,58	10 Charles Schwab Corp/The, 6,136%, scadenza 24/08/2034 *	10	0,06
60 Suzano Austria GmbH, serie DM3N, 3,125%, scadenza 15/01/2032	48	0,25	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908%, scadenza 23/07/2025	39	0,21
100 Vale Overseas Ltd, 6,875%, scadenza 21/11/2036	104	0,56	80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200%, scadenza 15/03/2028	75	0,40
	259	1,39	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, scadenza 01/04/2038	34	0,18
			10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125%, scadenza 01/07/2049	8	0,04
			40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800%, scadenza 01/03/2050	30	0,16
			10 Cheniere Energy Partners LP, 3,250%, scadenza 31/01/2032	8	0,04
			40 Cigna Group/The, 4,375%, scadenza 15/10/2028	39	0,21

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)					
Stati Uniti — (segue)					
20 Cigna Group/The, 4,800%, scadenza 15/08/2038	18	0,10	10 United Airlines Inc, 144A, 4,375%, scadenza 15/04/2026	9	0,05
20 Cigna Group/The, 4,900%, scadenza 15/12/2048	18	0,10	20 United Airlines Inc, 144A, 4,625%, scadenza 15/04/2029	18	0,10
150 Citigroup Inc, 5,500%, scadenza 13/09/2025	149	0,80	40 UnitedHealth Group Inc, 2,000%, scadenza 15/05/2030	33	0,18
200 Citigroup Inc, 2,572%, scadenza 03/06/2031 *	165	0,89	20 UnitedHealth Group Inc, 2,750%, scadenza 15/05/2040	14	0,08
10 Citigroup Inc, 8,125%, scadenza 15/07/2039	12	0,07	20 UnitedHealth Group Inc, 3,700%, scadenza 15/08/2049	16	0,08
50 Citigroup Inc, 4,650%, scadenza 23/07/2048	43	0,23	40 US Bancorp, 1,450%, scadenza 12/05/2025	37	0,20
50 Coca-Cola Co/The, 2,500%, scadenza 15/03/2051	32	0,17	10 US Bancorp, 5,775%, scadenza 12/06/2029 *	10	0,05
30 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036%, scadenza 15/11/2033	30	0,16	10 US Bancorp, 5,836%, scadenza 12/06/2034 *	10	0,05
40 Comcast Corp, 4,150%, scadenza 15/10/2028	39	0,21	10 Verizon Communications Inc, 4,500%, scadenza 10/08/2033	9	0,05
10 Consolidated Edison Co of New York Inc, serie 20A, 3,350%, scadenza 01/04/2030	9	0,05	20 Visa Inc, 2,050%, scadenza 15/04/2030	17	0,09
60 Coterra Energy Inc, 4,375%, scadenza 15/03/2029	57	0,30	30 Visa Inc, 4,300%, scadenza 14/12/2045	27	0,15
30 Deere & Co, 3,750%, scadenza 15/04/2050	26	0,14	10 Warnernmedia Holdings Inc, 6,412%, scadenza 15/03/2026	10	0,05
150 Delta Air Lines Inc, 3,735%, scadenza 15/01/2026	155	0,83	140 Western Midstream Operating LP, 5,250%, scadenza 01/02/2050	113	0,61
160 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750%, scadenza 20/10/2028	154	0,83	20 Williams Cos Inc/The, 4,850%, scadenza 01/03/2048	17	0,09
40 Devon Energy Corp, 5,850%, scadenza 15/12/2025	40	0,22		4.288	23,01
40 Devon Energy Corp, 5,000%, scadenza 15/06/2045	34	0,18	Totale Obbligazioni ed effetti societari (costo 6.911 dollari)	5.769	30,95
20 Diamondback Energy Inc, 3,500%, scadenza 01/12/2029	18	0,10	Obbligazioni ed effetti governativi — 40,39% (28 febbraio 2023: 27,36%)		
10 DISH DBS Corp, 144A, 5,250%, scadenza 01/12/2026	8	0,05	Brasile — 1,43% (28 febbraio 2023: 1,33%)		
30 Elevance Health Inc, 3,650%, scadenza 01/12/2027	28	0,15	BRL 579 Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTNF, 10,000%, scadenza 01/01/2033	110	0,59
20 Energy Transfer LP, 5,250%, scadenza 15/04/2029	20	0,11	200 Brazilian Government International Bond, 5,000%, scadenza 27/01/2045	156	0,84
19 Energy Transfer LP, 6,250%, scadenza 15/04/2049	19	0,10		266	1,43
10 Energy Transfer LP, serie G, 7,125%, perpetuo *	9	0,05	Indonesia — 2,35% (28 febbraio 2023: 2,35%)		
20 EOG Resources Inc, 4,375%, scadenza 15/04/2030	19	0,10	200 Indonesia Government International Bond, 4,625%, scadenza 15/04/2043	184	0,99
20 EOG Resources Inc, 4,950%, scadenza 15/04/2050	19	0,10	IDR 1.145.000 Indonesia Treasury Bond, serie FR59, 7,000%, scadenza 15/05/2027	77	0,41
150 EQT Corp, 5,000%, scadenza 15/01/2029	142	0,76	IDR 2.677.000 Indonesia Treasury Bond, serie FR87, 6,500%, scadenza 15/02/2031	177	0,95
10 Exelon Corp, 5,625%, scadenza 15/06/2035	10	0,05		438	2,35
10 Ford Motor Co, 6,100%, scadenza 19/08/2032	10	0,05	Messico — 7,80% (28 febbraio 2023: 7,42%)		
230 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950%, scadenza 28/05/2027	216	1,16	MXN 25.890 Mexican Bonos, serie M, 7,750%, scadenza 13/11/2042	1.298	6,96
220 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000%, scadenza 13/11/2030	186	1,00	200 Mexico Government International Bond, 4,350%, scadenza 15/01/2047	156	0,84
20 General Motors Co, 5,950%, scadenza 01/04/2049	18	0,10		1.454	7,80
20 Home Depot Inc/The, 3,250%, scadenza 15/04/2032	18	0,10	Perù — 0,18% (28 febbraio 2023: 0,17%)		
40 Home Depot Inc/The, 3,300%, scadenza 15/04/2040	32	0,17	30 Peruvian Government International Bond, 6,550%, scadenza 14/03/2037	33	0,18
20 Humana Inc, 3,700%, scadenza 23/03/2029	19	0,10	Russia — 0,57% (28 febbraio 2023: 0,12%)		
10 Intel Corp, 5,125%, scadenza 10/02/2030	10	0,05	RUB 33.741 Russian Federal Bond – OFZ, 0,000%, scadenza 23/05/2029†y	106	0,57
10 JPMorgan Chase & Co, 3,897%, scadenza 23/01/2049 *	8	0,04	Stati Uniti — 28,06% (28 febbraio 2023: 19,97%)		
10 Kenvue Inc, 144A, 4,900%, scadenza 22/03/2033	10	0,05	490 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125%, scadenza 15/01/2033 β	468	2,51
20 Kinder Morgan Inc, 5,200%, scadenza 01/03/2048	17	0,09	60 United States Treasury Note/Bond, 0,375%, scadenza 31/12/2025	54	0,29
40 Las Vegas Sands Corp, 3,200%, scadenza 08/08/2024	39	0,21	10 United States Treasury Note/Bond, 2,750%, scadenza 30/04/2027	9	0,05
10 MDC Holdings Inc, 6,000%, scadenza 15/01/2043	9	0,05	280 United States Treasury Note/Bond, 0,625%, scadenza 31/12/2027	239	1,28
30 Merck & Co Inc, 1,450%, scadenza 24/06/2030	24	0,13	210 United States Treasury Note/Bond, 1,125%, scadenza 29/02/2028	183	0,98
88 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500%, scadenza 20/06/2027	88	0,47	280 United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/03/2028	272	1,46
40 Mondelez International Inc, 1,500%, scadenza 04/05/2025	37	0,20	250 United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/03/2030	242	1,30
110 Morgan Stanley, 2,188%, scadenza 28/04/2026 *	104	0,56	120 United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 31/07/2030	119	0,64
70 Morgan Stanley, 3,622%, scadenza 01/04/2031 *	62	0,33	690 United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/08/2030	687	3,69
20 MPLX LP, 4,800%, scadenza 15/02/2029	19	0,10	10 United States Treasury Note/Bond, 1,875%, scadenza 15/02/2032	8	0,05
20 MPLX LP, 5,500%, scadenza 15/02/2049	18	0,10	230 United States Treasury Note/Bond, 1,750%, scadenza 15/08/2041	155	0,83
20 NIKE Inc, 3,375%, scadenza 27/03/2050	15	0,08	10 United States Treasury Note/Bond, 2,375%, scadenza 15/02/2042	8	0,04
40 Northrop Grumman Corp, 3,250%, scadenza 15/01/2028	37	0,20	90 United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 15/11/2042	85	0,46
20 Northrop Grumman Corp, 5,250%, scadenza 01/05/2050	20	0,11	80 United States Treasury Note/Bond, 3,875%, scadenza 15/05/2043	74	0,40
10 ONEOK Inc, 5,550%, scadenza 01/11/2026	10	0,05	160 United States Treasury Note/Bond, 4,375%, scadenza 15/08/2043	160	0,86
20 ONEOK Inc, 5,650%, scadenza 01/11/2028	20	0,11	110 United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/02/2049	87	0,47
20 PepsiCo Inc, 1,625%, scadenza 01/05/2030	17	0,09	50 United States Treasury Note/Bond, 2,875%, scadenza 15/05/2049	39	0,21
20 Philip Morris International Inc, 2,100%, scadenza 01/05/2030	16	0,09	50 United States Treasury Note/Bond, 2,250%, scadenza 15/08/2049	34	0,18
20 Philip Morris International Inc, 4,500%, scadenza 20/03/2042	17	0,09	200 United States Treasury Note/Bond, 1,375%, scadenza 15/08/2050	108	0,58
10 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812%, scadenza 12/06/2026 *	10	0,05			
10 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582%, scadenza 12/06/2029 *	10	0,05			
40 RTX Corp, 2,250%, scadenza 01/07/2030	33	0,18			
10 RTX Corp, 4,500%, scadenza 01/06/2042	9	0,05			
60 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000%, scadenza 20/09/2025	60	0,32			
10 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875%, scadenza 01/02/2031	9	0,05			
10 T-Mobile USA Inc, 2,250%, scadenza 15/02/2026	9	0,05			
10 T-Mobile USA Inc, 2,625%, scadenza 15/02/2029	9	0,05			
10 T-Mobile USA Inc, 3,875%, scadenza 15/04/2030	9	0,05			
70 T-Mobile USA Inc, 2,550%, scadenza 15/02/2031	58	0,31			
10 T-Mobile USA Inc, 2,875%, scadenza 15/02/2031	8	0,05			
20 T-Mobile USA Inc, 3,500%, scadenza 15/04/2031	18	0,09			
20 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850%, scadenza 01/02/2026	21	0,11			
10 Truist Financial Corp, 6,047%, scadenza 08/06/2027 *	10	0,05			
50 Union Pacific Corp, 2,891%, scadenza 06/04/2036	40	0,21			
40 Union Pacific Corp, 3,839%, scadenza 20/03/2060	31	0,17			

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Contratti (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti governativi — (segue)					
Stati Uniti — (segue)					
230 United States Treasury Note/Bond, 1,625%, scadenza 15/11/2050	133	0,71	Swap indicizzati — 2,37% (28 febbraio 2023: 4,56%)		
230 United States Treasury Note/Bond, 1,875%, scadenza 15/02/2051	142	0,76	Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)		
710 United States Treasury Note/Bond, 2,375%, scadenza 15/05/2051	494	2,65	441 2,37		
50 United States Treasury Note/Bond, 2,000%, scadenza 15/08/2051	32	0,17	Contratti a termine in valuta estera — 0,10% (28 febbraio 2023: 0,06%)		
370 United States Treasury Note/Bond, 1,875%, scadenza 15/11/2051	227	1,22	Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)		
152 United States Treasury Note/Bond, 2,250%, scadenza 15/02/2052	103	0,55	18 0,10		
257 United States Treasury Note/Bond, 2,875%, scadenza 15/05/2052	200	1,07	Futures — 1,15% (28 febbraio 2023: 0,85%)		
128 United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/08/2052	128	0,68	Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)		
40 United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 15/11/2052	39	0,21	215 1,15		
158 United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/02/2053	142	0,76	Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
610 United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/05/2053	550	2,95	19.170 102,87		
10 United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 15/08/2053	10	0,05			
	5.231	28,06	Contratti (in migliaia)		
Totale Obbligazioni ed effetti governativi (costo 9165 dollari)	7.528	40,39	Opzioni scritte — (0,53%) (28 febbraio 2023: (0,21%))		
Titoli di prestito — 5,19% (28 febbraio 2023: 5,39%)			– Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi dicembre 2023 Put 95.25, scadenza 15/12/2023 - Morgan Stanley (4) (0,02)		
51 1011778 BC ULC, 7,196%, scadenza 14/11/2026 *	51	0,27	– Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi dicembre 2023 Put 95.3750, scadenza 15/12/2023 - Morgan Stanley (11) (0,06)		
59 Allied Universal Holdco LLC, 9,181%, scadenza 14/05/2028 *	57	0,31	– Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi ottobre 2023 Put 96,25, scadenza 13/10/2023 - Morgan Stanley (21) (0,11)		
10 AmWINS Group, Inc., 7,696%, scadenza 17/02/2028 *	10	0,05	– Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi ottobre 2023 Put 96,50, scadenza 13/10/2023 - Morgan Stanley (30) (0,16)		
20 Brown Group Holding LLC, 7,820%, scadenza 07/06/2028 *	19	0,10	– U.S. 10 Year novembre 2023 call 111.00, scadenza 27/10/2023 - Morgan Stanley (1) (0,01)		
68 Charter Communications Operating LLC, 7,116%, scadenza 30/04/2025 *	68	0,37	– U.S. 10 Year novembre 2023 call 112.50, scadenza 27/10/2023 - Morgan Stanley (1) –		
49 Citadel Securities, 7,888%, scadenza 25/07/2030 *	49	0,26	– U.S. 10 Year novembre 2023 call 113.00, scadenza 27/10/2023 - Morgan Stanley –		
10 DCert Buyer, Inc., 9,331%, scadenza 16/10/2026 *	10	0,05	– U.S. 10 Year ottobre 2023 call 111.75, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley (1) (0,01)		
41 Energizer Holdings Inc., 7,679%, scadenza 16/12/2027 *	41	0,22	– U.S. 10 Year ottobre 2023 call 112.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley (1) –		
20 Gainwell Acquisition Corp., 9,342%, scadenza 01/10/2027 *	19	0,10	– U.S. 10 Year ottobre 2023 call 112.50, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley (1) (0,01)		
68 Genesee & Wyoming Inc, 7,342%, scadenza 30/12/2026 *	68	0,37	– U.S. 10 Year ottobre 2023 call 113.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley (1) (0,01)		
65 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 7,414%, scadenza 15/11/2027 *	65	0,35	– U.S. 10 Year ottobre 2023 put 110.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley (1) –		
10 GVC Holdings Gibraltar Ltd, 7,437%, scadenza 16/03/2027 *	10	0,05	– U.S. 10 Year ottobre 2023 put 111.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley (1) –		
58 Harbor Freight Tools USA Inc, 8,183%, scadenza 19/10/2027 *	58	0,31	– U.S. 10 Year W1 settembre 2023 call 110.00, scadenza 01/09/2023 - Morgan Stanley (2) (0,01)		
50 Hunter Douglas Inc, 8,891%, scadenza 09/02/2029 *	48	0,26	– U.S. 5 Year novembre 2023 call 107.50, scadenza 27/10/2023 - Morgan Stanley (1) (0,01)		
22 ICON Luxembourg S.a.r.l., 7,753%, scadenza 01/07/2028 *	22	0,12	– U.S. 5 Year ottobre 2023 call 108.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley (1) –		
5 Indigo Merger Sub, Inc., 7,753%, scadenza 01/07/2028 *	5	0,03	– U.S. 5 Year ottobre 2023 call 109.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley –		
35 Jazz Financing Lux S.a.r.l., 8,946%, scadenza 22/04/2028 *	35	0,19	– U.S. 5 Year ottobre 2023 put 105.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley –		
35 Nexstar Broadcasting Inc, 7,946%, scadenza 19/09/2026 *	36	0,19	– U.S. 5 Year ottobre 2023 put 106.50, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley (3) (0,02)		
20 Quikrete Holdings, Inc., 8,320%, scadenza 11/06/2028 *	20	0,11	– U.S. 5 Year W1 settembre 2023 call 106,00, scadenza 01/09/2023 - Morgan Stanley (8) (0,05)		
8 Rackspace Technology Global, Inc, 8,177%, scadenza 09/02/2028 *	4	0,02	– U.S. Bond ottobre 2023 call 123.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley (3) (0,02)		
60 Sotera Health, 8,196%, scadenza 13/12/2026 *	60	0,32	– U.S. Bond ottobre 2023 call 124.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley (1) –		
29 Station Casinos LLC, 7,681%, scadenza 08/02/2027 *	29	0,16	– U.S. Bond ottobre 2023 call 125.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley (1) (0,01)		
18 UFC Holding LLC, 8,369%, scadenza 29/04/2026 *	18	0,09	– U.S. Bond ottobre 2023 put 118.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley (1) –		
23 United Airlines Inc, 9,292%, scadenza 14/04/2028 *	23	0,13	– U.S. Bond ottobre 2023 put 120.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley (1) (0,01)		
68 Verscend Holding Corp., 9,446%, scadenza 27/08/2025 *	69	0,37	– U.S. Bond ottobre 2023 put 121.00, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley (2) (0,01)		
60 Virgin Media Bristol LLC, 7,925%, scadenza 01/04/2028 *	58	0,31	Totale opzioni scritte (costo (74) dollari)		
15 Zebra Buyer LLC, 8,753%, scadenza 22/04/2028 *	15	0,08	Interest Rate Swap — (0,05%) (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Totale titoli di prestito (costo 978 dollari)	967	5,19	Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto) (9) (0,05)		
Organismi di investimento collettivo — 0,70% (28 febbraio 2023: 7,28%)			Contratti a termine in valuta estera — (0,35%) (28 febbraio 2023: (0,31%))		
130 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	130	0,70	Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto) (64) (0,35)		
Totale Organismi di investimento collettivo (costo 1305)	130	0,70	Futures — (0,40%) (28 febbraio 2023: (0,65%))		
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 21.581 dollari)	18.337	98,39	Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto) (74) (0,40)		
			Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
Contratti (in migliaia)			18.925 101,54		
Opzioni acquistate — 0,47% (28 febbraio 2023: 0,11%)			Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
– Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi dicembre 2023 Put 95.8750, scadenza 15/12/2023 - Morgan Stanley	6	0,03	18.925 101,54		
– Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi dicembre 2023 Put 96.00, scadenza 15/12/2023 - Morgan Stanley	18	0,10	Passività in eccesso rispetto ad altre attività		
– Curva media 1 anno future SOFR a 3 mesi ottobre 2023 Put 97,00, scadenza 13/10/2023 - Morgan Stanley	50	0,27	(288) (1,54)		
– U.S. 10 Year W1 settembre 2023 call 109,75, scadenza 01/09/2023 - Morgan Stanley	4	0,02	Patrimonio in gestione		
– U.S. 10 Year W1 settembre 2023 call 110,25, scadenza 01/09/2023 - Morgan Stanley	1	–	18.637\$ 100,00		
– U.S. 5 Year ottobre 2023 call 106,25, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	4	0,02			
– U.S. 5 Year ottobre 2023 call 106,75, scadenza 22/09/2023 - Morgan Stanley	2	0,01			
– U.S. 5 Year W1 settembre 2023 call 106,25, scadenza 01/09/2023 - Morgan Stanley	1	0,01			
210 PutUSD/call AUD 0,67, scadenza 03/11/2023 - JP Morgan	1	0,01			
Totale opzioni acquistate (costo 50 dollari)	87	0,47			
Credit Default Swap — 0,39% (28 febbraio 2023: 0,31%)					
Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	72	0,39			

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

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

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

- Gli importi indicati con “-” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.
- 144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell’ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 1.767.000 dollari ovvero al 9,48% dell’attivo netto.
- * Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.
- † Illiquido.
- ± Titoli acquistati su base non definitiva.
- β Il tasso di interesse di questo tipo di titoli è legato all’indice dei prezzi al consumo (CPI)/indice dei prezzi al dettaglio (RPI). Il tasso cedolare è quello del 31 agosto 2023.
- γ Titolo che non matura più reddito durante e/o dopo il periodo finanziario chiuso al 31 agosto 2023 a causa dell’incertezza dei pagamenti degli interessi.

ABBREVIAZIONI:

Perpetual	– Un’obbligazione senza data di scadenza. Le obbligazioni perpetue non sono rimborsabili, ma pagano un flusso costante di interessi.
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.
TBA	– Da annunciare.
BRL	– Real brasiliano
IDR	– Rupia indonesiana
MXN	– Peso messicano
RUB	– Rublo russo

	% delle attività totali
Analisi delle attività totali	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	86,34
Altri valori mobiliari negoziati in un altro mercato regolamentato	4,84
Organismi di investimento collettivo	0,65
Strumenti finanziari derivati	4,17
Altre attività	4,00
Totale Attività	100,00

Prospetto dei Credit Default Swap

Controparte	Entità di riferimento – Protezione di acquisto/vendita	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5,000% - Vendita	20-giu-2028	490	\$ 14
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000% - Vendita	20-giu-2028	3.776	58
Apprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 57\$)				\$ 72
Deprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				-
Apprezzamento netto dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 57\$)				\$ 72

Prospetto degli Interest Rate Swap

Controparte	Tasso	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
JP Morgan	Tasso variabile di pagamento SOFR in BRL, tasso di credito fisso 10,230%	02-gen-2029	3.440	\$ (9)
Apprezzamento non realizzato degli Interest Rate Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				\$ -
Ammortamento non realizzato degli Interest Rate Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				(9)
Ammortamento netto degli Interest Rate Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				\$ (9)

Prospetto degli swap indicizzati

Controparte	Entità di riferimento	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Morgan Stanley	Tasso fisso di pagamento 1,520%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	15-feb-2047	325	\$ 109
Morgan Stanley	Tasso fisso di pagamento 2,500%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	21-apr-2052	150	28
Morgan Stanley	Tasso fisso di pagamento 2,600%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	15-feb-2048	285	48
Morgan Stanley	Tasso fisso di pagamento 2,850%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	15-feb-2029	377	21
Morgan Stanley	Tasso fisso di pagamento 3,050%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	15-feb-2048	1.466	141
Morgan Stanley	Tasso fisso di pagamento 3,250%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	30-set-2029	568	21
Morgan Stanley	Tasso fisso di pagamento 3,270%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	30-apr-2029	1.901	67
Morgan Stanley	Tasso fisso di pagamento 3,850%, tasso variabile di credito SOFR composto in USD	30-giu-2029	1.002	5
Morgan Stanley	Tasso fisso di pagamento 5,410%, tasso variabile di credito fondi federali in USD	31-gen-2024	4.468	-
Morgan Stanley	Tasso variabile di pagamento SOFR composto in USD, tasso di credito fisso 4,000%	29-feb-2028	2.170	1
Apprezzamento non realizzato degli swap indicizzati (28 febbraio 2023 (in migliaia): 842\$)				\$ 441
Ammortamento non realizzato degli swap indicizzati (28 febbraio 2023 (in migliaia): (2)\$)				-
Apprezzamento netto degli swap indicizzati (28 febbraio 2023 (in migliaia): 840\$)				\$ 441

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)	Valuta vendita (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	NOK 1.919	Vendita EUR 166 \$ 1
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	CAD 1.012	Vendita USD 764 (14)
20-ott-2023	BNP Paribas	Acquisto	AUD 971	Vendita USD 648 (18)
20-ott-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD 197	Vendita MXN 3.418 (2)
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD 258	Vendita CNH 1.846 4
20-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	IDR 439.327	Vendita USD 29 -
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD 436	Vendita CNH 3.125 4

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	189	Vendita	EUR	171	\$ 3
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	352	Vendita	GBP	274	5
20-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	JPY	119.577	Vendita	USD	858	(29)
06-novembre 2023	JP Morgan	Acquisto	USD	79	Vendita	AUD	120	1
06-novembre 2023	Morgan Stanley	Acquisto	AUD	120	Vendita	USD	79	(1)
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 11\$)								\$ 18
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (58)\$)								(64)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (47)\$)								\$ (46)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2023	Morgan Stanley	(40)	\$ (9.460)	\$ 88
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2024	Morgan Stanley	20	4.792	(2)
Indice SOFR a 3 mesi dicembre 2025	Morgan Stanley	4	964	-
Indice SOFR a 3 mesi giugno 2023	Morgan Stanley	(1)	(237)	-
Indice SOFR a 3 mesi settembre 2023	Morgan Stanley	(19)	(4.493)	12
Australia 10 Year Bond settembre 2023	Morgan Stanley	5	376	(5)
Valuta Dollaro australiano settembre 2023	Morgan Stanley	3	194	(7)
Euro-Bund dicembre 2023	Morgan Stanley	1	144	2
Euro-Buxl 30 Year Bond dicembre 2023	Morgan Stanley	(1)	(145)	(2)
Euro-OAT dicembre 2023	Morgan Stanley	2	276	3
Fed Fund 30 Day agosto 2023	Morgan Stanley	(5)	(1.972)	-
Fed Fund 30 Day settembre 2023	Morgan Stanley	(14)	(5.522)	-
Valuta yen giapponese settembre 2023	Morgan Stanley	6	517	(25)
Long Gilt dicembre 2023	Morgan Stanley	2	242	4
Valuta peso messicano settembre 2023	Morgan Stanley	7	206	7
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	8	888	8
U.S. 10 Year Ultra Note dicembre 2023	Morgan Stanley	(10)	(1.161)	(16)
U.S. 2 Year Note (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	(16)	(3.261)	(6)
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	72	7.698	47
U.S. Long Bond (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	(7)	(852)	(11)
U.S. Ultra Bond (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	16	2.072	44
Apprezzamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 156\$)				\$ 215
Ammortamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (120)\$)				(74)
Apprezzamento netto dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 36\$)				\$ 141

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti societari — 85,78% (28 febbraio 2023: 86,70%)			Stati Uniti — 30,15% (28 febbraio 2023: 27,59%)		
Australia — 1,19% (28 febbraio 2023: 1,16%)					
EUR 100	AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1,625%, scadenza 11/03/2081 *	95	1,02		
20	Westpac Banking Corp, 2,668%, scadenza 15/11/2035 *	15	0,17		
		110	1,19		
Belgio — 1,16% (28 febbraio 2023: 2,09%)					
EUR 100	Elia Transmission Belgium SA, 3,625%, scadenza 18/01/2033	107	1,16		
Canada — 0,91% (28 febbraio 2023: 0,94%)					
90	Toronto-Dominion Bank/The, 4,456%, scadenza 08/06/2032	84	0,91		
Danimarca — 2,36% (28 febbraio 2023: 3,39%)					
EUR 100	Danske Bank A/S, 4,750%, scadenza 21/06/2030 *	110	1,19		
EUR 100	Orsted AS, 3,625%, scadenza 01/03/2026	108	1,17		
		218	2,36		
Finlandia — 1,03% (28 febbraio 2023: 1,01%)					
EUR 100	Neste Oyj, 0,750%, scadenza 25/03/2028	95	1,03		
Francia — 6,15% (28 febbraio 2023: 8,18%)					
EUR 100	Bouygues SA, 3,875%, scadenza 17/07/2031	108	1,17		
EUR 100	Engie SA, 0,500%, scadenza 24/10/2030	87	0,94		
EUR 200	GELF Bond Issuer I SA, 1,125%, scadenza 18/07/2029	177	1,92		
EUR 100	Orange SA, 5,000%, perpetuo *	108	1,18		
EUR 100	Terega SA, 0,875%, scadenza 17/09/2030	86	0,94		
		566	6,15		
Germania — 10,04% (28 febbraio 2023: 9,60%)					
200	Allianz SE, 3,200%, perpetuo *	152	1,65		
EUR 100	alstria office REIT-AG, 1,500%, scadenza 15/11/2027	78	0,85		
EUR 100	Amprion GmbH, 3,971%, scadenza 22/09/2032	108	1,18		
60	Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750%, scadenza 15/06/2030	71	0,77		
EUR 100	E.ON SE, 3,750%, scadenza 01/03/2029	109	1,18		
EUR 100	Hannover Rueck SE, 1,125%, scadenza 09/10/2039 *	87	0,94		
EUR 100	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250%, scadenza 26/05/2049 *	100	1,08		
EUR 100	Sirius Real Estate Ltd, 1,125%, scadenza 22/06/2026	93	1,01		
EUR 120	Volkswagen Financial Services AG, 1,500%, scadenza 01/10/2024	127	1,38		
		925	10,04		
Irlanda — 1,33% (28 febbraio 2023: 1,33%)					
150	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300%, scadenza 30/01/2032	122	1,33		
Italia — 2,58% (28 febbraio 2023: 4,25%)					
150	Enel Finance International NV, 144A, 6,000%, scadenza 07/10/2039	144	1,56		
EUR 100	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 2,375%, perpetuo *	93	1,02		
		237	2,58		
Paesi Bassi — 4,04% (28 febbraio 2023: 4,04%)					
EUR 80	ABN AMRO Bank NV, 1,000%, scadenza 16/04/2025	83	0,90		
EUR 200	Cooperatieve Rabobank UA, 3,250%, perpetuo *	182	1,98		
EUR 100	ING Groep NV, 2,500%, scadenza 15/02/2029 *	107	1,16		
		372	4,04		
Portogallo — 1,05% (28 febbraio 2023: 1,02%)					
EUR 100	EDP - Energias de Portugal SA, 1,875%, scadenza 02/08/2081 *	97	1,05		
Africa del Sud — 2,11% (28 febbraio 2023: 2,16%)					
200	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750%, scadenza 10/04/2027	194	2,11		
Spagna — 0,70% (28 febbraio 2023: 1,67%)					
60	Telefonica Emisiones SA, 7,045%, scadenza 20/06/2036	64	0,70		
Sovranazionale — 7,58% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
EUR 440	Banca europea degli investimenti, 0,050%, scadenza 15/11/2029	399	4,34		
310	Banca europea degli investimenti, 3,750%, scadenza 14/02/2033	299	3,24		
		698	7,58		
Svizzera — 2,33% (28 febbraio 2023: 3,93%)					
EUR 200	UBS Group AG, 1,500%, scadenza 30/11/2024	214	2,33		
Regno Unito — 11,07% (28 febbraio 2023: 13,16%)					
EUR 100	Annington Funding Plc, 1,650%, scadenza 12/07/2024	105	1,14		
GBP 100	Associated British Foods Plc, 2,500%, scadenza 16/06/2034	98	1,06		
EUR 100	Barclays Plc, 3,375%, scadenza 02/04/2025 *	108	1,17		
GBP 100	Barclays Plc, 1,700%, scadenza 03/11/2026 *	114	1,24		
GBP 100	Lloyds Banking Group Plc, 1,985%, scadenza 15/12/2031 *	108	1,17		
EUR 100	Segro Capital Sarl, 1,875%, scadenza 23/03/2030	93	1,02		
EUR 100	SSE Plc, 4,000%, perpetuo *	100	1,09		
200	Standard Chartered Plc, 144A, 2,608%, scadenza 12/01/2028 *	179	1,94		
GBP 110	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875%, scadenza 02/11/2028	115	1,24		
		1.020	11,07		
				2.777	30,15
Totale Obbligazioni ed effetti societari (costo 9.039 dollari)				7.900	85,78
Obbligazioni ed effetti governativi — 6,91% (28 febbraio 2023: 8,26%)			Germania — 2,07% (28 febbraio 2023: 3,90%)		
EUR 110	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, scadenza 15/08/2031	99	1,07		
EUR 70	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, serie 2007, 4,250%, scadenza 04/07/2039	92	1,00		
		191	2,07		
Stati Uniti — 4,84% (28 febbraio 2023: 4,36%)					
140	United States Treasury Note/Bond, 2,000%, scadenza 15/02/2025	134	1,45		
140	United States Treasury Note/Bond, 3,375%, scadenza 15/05/2033	132	1,43		
112	United States Treasury Note/Bond, 2,250%, scadenza 15/02/2052	76	0,82		
40	United States Treasury Note/Bond, 2,875%, scadenza 15/05/2052	31	0,34		
20	United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 15/11/2052	19	0,21		
60	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/02/2053	54	0,59		
		446	4,84		
Totale Obbligazioni ed effetti governativi (costo 679 dollari)				637	6,91
Organismi di investimento collettivo — 3,96% (28 febbraio 2023: 0,33%)			Germania — 2,07% (28 febbraio 2023: 3,90%)		
365	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	365	3,96		
Totale Organismi di investimento collettivo (costo 365\$)				365	3,96
Azioni ordinarie — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)			Svizzera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
200	Credit Suisse Group AG Escrow t	-	-		
Totale azioni ordinarie (costo - dollari)				-	-
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 10.083 dollari)				8.902	96,65

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Contratti a termine in valuta estera — 0,83% (28 febbraio 2023: 1,02%)		
Apprezamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	77	0,83
Futures — 0,29% (28 febbraio 2023: 0,66%)		
Apprezamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	26	0,29
Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	9.005	97,77
Contratti a termine in valuta estera — (1,74%) (28 febbraio 2023: (1,18%))		
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	(161)	(1,74)
Futures — (0,14%) (28 febbraio 2023: (0,05%))		
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	(13)	(0,14)
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(174)	(1,88)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	8.831	95,89
Altre attività eccedenti le passività	380	4,11
Patrimonio in gestione	9.211\$	100,00

– Gli importi indicati con “-” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 517.000 dollari ovvero al 5,61% dell'attivo netto.

* Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.

† Illiquido.

ABBREVIAZIONI:

Perpetual	– Un'obbligazione senza data di scadenza. Le obbligazioni perpetue non sono rimborsabili, ma pagano un flusso costante di interessi.
EUR	– Euro
GBP	– Sterlina britannica

Analisi delle attività totali

	% delle attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	90,29
Organismi di investimento collettivo	3,86
Strumenti finanziari derivati	1,09
Altre attività	4,76
Totale Attività	100,00

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)	Valuta vendita (in migliaia)	Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 36	Vendita BRL 178	\$ –
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 2.779	Vendita BRL 13.605	33
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto BRL 13.782	Vendita USD 2.904	(124)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 2	Vendita EUR 2	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD –	Vendita GBP –	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto GBP –	Vendita USD –	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto GBP 32	Vendita USD 40	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto EUR 74	Vendita USD 82	(2)
03-ott-2023	BNY Mellon	Acquisto BRL 13.529	Vendita USD 2.752	(34)
16-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto USD 207	Vendita EUR 191	(1)
16-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto USD 155	Vendita EUR 141	2
16-nov-2023	BNP Paribas	Acquisto USD 6	Vendita GBP 5	–
16-nov-2023	Citi	Acquisto USD 1.948	Vendita EUR 1.773	19
16-nov-2023	Citi	Acquisto USD 468	Vendita GBP 368	1
16-nov-2023	Citi	Acquisto EUR 14	Vendita USD 15	–
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto USD 2.027	Vendita EUR 1.844	20
16-nov-2023	Goldman Sachs	Acquisto USD 4	Vendita GBP 3	–
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto USD 100	Vendita EUR 91	1
16-nov-2023	JP Morgan	Acquisto GBP 4	Vendita USD 5	–
16-nov-2023	Morgan Stanley	Acquisto USD 113	Vendita EUR 103	1
16-nov-2023	Morgan Stanley	Acquisto USD 30	Vendita GBP 24	–
Apprezamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 92\$)				\$ 77
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (107)\$)				(161)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (15)\$)				(84)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
Euro-Bobl dicembre 2023	Morgan Stanley	(8)	\$(1.019)	(6)
Euro-BTP dicembre 2023	Morgan Stanley	(2)	(250)	(2)
Euro-Bund dicembre 2023	Morgan Stanley	2	288	3
Euro-Buxl 30 Year Bond dicembre 2023	Morgan Stanley	(1)	(145)	(2)
Long Gilt dicembre 2023	Morgan Stanley	2	242	4
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	4	444	5
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	8	855	5
U.S. Long Bond (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	4	487	9
U.S. Ultra Bond (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	(1)	(130)	(3)
Apprezamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 59\$)				\$ 26
Ammortamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (5)\$)				(13)
Apprezamento netto dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 54\$)				\$ 13

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario		
Obbligazioni ed effetti societari — 9,01% (28 febbraio 2023: 14,55%)							
Sovranazionale — 9,01% (28 febbraio 2023: 9,22%)							
RUB 368.000	International Bank for Reconstruction & Development, 4,250%, scadenza 22/01/2026	2.670	1,73	17.160	United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 15/02/2033	16.345	10,61
ZAR 56.200	International Bank for Reconstruction & Development, 6,500%, scadenza 21/01/2027	2.804	1,82	18.830	United States Treasury Note/Bond, 1,875%, scadenza 15/11/2051	11.574	7,51
RUB 349.000	International Bank for Reconstruction & Development, 6,750%, scadenza 21/01/2027	2.481	1,61	14.050	United States Treasury Note/Bond, 2,250%, scadenza 15/02/2052	9.482	6,15
MXN 51.300	International Bank for Reconstruction & Development, 7,250%, scadenza 21/01/2027	2.761	1,79	11.640	United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/08/2052	9.280	6,02
BRL 15.600	International Bank for Reconstruction & Development, 9,500%, scadenza 09/02/2029	3.168	2,06			49.443	32,08
		13.884	9,01			133.758	86,78
Totale Obbligazioni ed effetti societari (costo 17.969 dollari)		13.884	9,01				
Obbligazioni ed effetti governativi — 86,78% (28 febbraio 2023: 84,35%)							
Australia — 3,30% (28 febbraio 2023: 0,00%)							
AUD 7.900	Australia Government Bond, serie 137, 2,750%, scadenza 21/04/2024	5.078	3,30				
Brasile — 4,99% (28 febbraio 2023: 4,34%)							
BRL 38.410	Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTN, 10,000%, scadenza 01/01/2025	7.695	4,99				
Canada — 3,00% (28 febbraio 2023: 2,83%)							
CAD 6.500	Province of Manitoba Canada, 2,450%, scadenza 02/06/2025	4.617	3,00				
Cile — 3,02% (28 febbraio 2023: 0,87%)							
4.813	Chile Government International Bond, 4,950%, scadenza 05/01/2036	4.650	3,02				
Colombia — 5,97% (28 febbraio 2023: 4,89%)							
COP 43.330.000	TES colombiano, serie B, 9,250%, scadenza 28/05/2042	9.205	5,97				
Germania — 3,48% (28 febbraio 2023: 5,44%)							
EUR 4.960	German Treasury Bill, zero coupon, scadenza 20/09/2023	5.370	3,48				
Messico — 12,19% (28 febbraio 2023: 13,18%)							
MXN 92.200	Mexican Bonos, serie MS, 8,000%, scadenza 24/05/2035	4.933	3,20				
MXN 93.400	Mexican Bonos, serie M, 7,750%, scadenza 13/11/2042	4.681	3,04				
MXN 137.000	Mexican Bonos, serie M, 8,000%, scadenza 07/11/2047	6.991	4,54				
MXN 43.000	Mexican Bonos, serie M, 8,000%, scadenza 31/07/2053	2.176	1,41				
		18.781	12,19				
Nuova Zelanda — 1,24% (28 febbraio 2023: 1,27%)							
NZD 2.370	New Zealand Government Bond, serie 0534, 4,250%, scadenza 15/05/2034	1.337	0,87				
NZD 1.480	New Zealand Government Bond, serie 0551, 2,750%, scadenza 15/05/2051	581	0,37				
		1.918	1,24				
Norvegia — 3,44% (28 febbraio 2023: 3,78%)							
NOK 56.800	Norway Government Bond, serie 476, 144A, 3,000%, scadenza 14/03/2024	5.308	3,44				
Africa del Sud — 3,75% (28 febbraio 2023: 4,06%)							
ZAR 87.700	Republic of South Africa Government Bond, serie R214, 6,500%, scadenza 28/02/2041	2.741	1,78				
ZAR 79.600	Republic of South Africa Government Bond, serie 2048, 8,750%, scadenza 28/02/2048	3.046	1,97				
		5.787	3,75				
Regno Unito — 10,32% (28 febbraio 2023: 4,35%)							
GBP 7.230	United Kingdom Gilt, 3,250%, scadenza 31/01/2033	8.388	5,44				
GBP 12.350	United Kingdom Gilt, 1,250%, scadenza 31/07/2051	7.518	4,88				
		15.906	10,32				
Stati Uniti — 32,08% (28 febbraio 2023: 29,58%)							
1.880	Obbligazione a tasso variabile United States Treasury – quando emesso, 4,931%, scadenza 31/01/2025 *	1.883	1,22				
880	Obbligazione a tasso variabile United States Treasury – quando emesso, 5,498%, scadenza 31/07/2025 *	879	0,57				

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)	Valuta vendita (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)		
01-set-2023	JP Morgan	Acquisto	USD 8.457	Vendita	GBP 6.790	\$ (145)
01-set-2023	JP Morgan	Acquisto	USD 12.857	Vendita	GBP 10.050	126
01-set-2023	JP Morgan	Acquisto	GBP 5.550	Vendita	USD 6.899	132
01-set-2023	JP Morgan	Acquisto	GBP 550	Vendita	USD 699	(2)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 6	Vendita	EUR 5	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD –	Vendita	EUR –	–

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

Data di scadenza	Controparte		Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)		Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	33	Vendita	GBP	25	\$ -
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	-	Vendita	GBP	-	-
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	30	Vendita	USD	33	-
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	-	Vendita	USD	-	-
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	-	Vendita	USD	-	-
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	24	Vendita	USD	33	-
11-set-2023	Barclays	Acquisto	INR	306.000	Vendita	USD	3.715	(18)
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	467	Vendita	AUD	708	8
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	299	Vendita	AUD	497	1
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	-	Vendita	AUD	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	82	Vendita	AUD	158	2
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	-	Vendita	AUD	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	110	Vendita	CAD	189	2
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	638	Vendita	CAD	850	8
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	-	Vendita	CAD	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	-	Vendita	CAD	1	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	408	Vendita	CAD	598	1
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	340	Vendita	CNY	3.093	4
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	1.130	Vendita	CNY	8.854	6
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	-	Vendita	CNY	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	107	Vendita	CNY	859	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1.936	Vendita	CNY	13.811	33
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	-	Vendita	DKK	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	68	Vendita	DKK	495	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	18	Vendita	DKK	159	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	104	Vendita	DKK	707	1
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	4	Vendita	EUR	4	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NOK	14	Vendita	EUR	1	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	32	Vendita	EUR	38	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	1.830	Vendita	EUR	2.122	15
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	-	Vendita	EUR	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	2	Vendita	EUR	1	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NZD	3	Vendita	EUR	1	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	JPY	1.713	Vendita	EUR	10	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	4	Vendita	EUR	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	17	Vendita	EUR	1	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NOK	2	Vendita	EUR	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	JPY	16.065	Vendita	EUR	103	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	ILS	-	Vendita	EUR	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	MXN	13	Vendita	EUR	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	MXN	153	Vendita	EUR	8	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	ILS	10	Vendita	EUR	1	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	5	Vendita	EUR	4	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	PLN	4	Vendita	EUR	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNY	361	Vendita	EUR	46	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	10.817	Vendita	EUR	9.855	124
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NZD	-	Vendita	EUR	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	DKK	-	Vendita	EUR	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNY	52	Vendita	EUR	7	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	DKK	21	Vendita	EUR	2	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	3	Vendita	EUR	1	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	4	Vendita	EUR	2	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	2	Vendita	EUR	1	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	PLN	6	Vendita	EUR	2	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNY	16	Vendita	GBP	1	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NZD	-	Vendita	GBP	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NZD	-	Vendita	GBP	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	-	Vendita	GBP	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	PLN	-	Vendita	GBP	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	-	Vendita	GBP	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NOK	-	Vendita	GBP	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	ILS	-	Vendita	GBP	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	5	Vendita	GBP	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	-	Vendita	GBP	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	1.024	Vendita	GBP	883	(7)
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	38	Vendita	GBP	32	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	MXN	2	Vendita	GBP	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NOK	4	Vendita	GBP	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	MXN	50	Vendita	GBP	2	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	-	Vendita	GBP	-	-
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	-	Vendita	GBP	-	-

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	2	Vendita	GBP	–	\$ –
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNY	115	Vendita	GBP	12	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	DKK	–	Vendita	GBP	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	ILS	2	Vendita	GBP	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	–	Vendita	GBP	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1.721	Vendita	GBP	1.349	9
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	–	Vendita	GBP	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	DKK	5	Vendita	GBP	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	PLN	4	Vendita	GBP	1	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	JPY	746	Vendita	GBP	4	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	JPY	5.493	Vendita	GBP	30	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	–	Vendita	ILS	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	–	Vendita	ILS	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	64	Vendita	ILS	250	1
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	97	Vendita	ILS	356	3
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	15	Vendita	ILS	79	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	4.514	Vendita	JPY	640.363	105
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	3	Vendita	JPY	352	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	2.887	Vendita	JPY	449.408	38
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	789	Vendita	JPY	142.727	19
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	2	Vendita	JPY	476	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	56	Vendita	MXN	1.255	(2)
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	208	Vendita	MXN	3.954	(7)
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	323	Vendita	MXN	5.633	(6)
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	–	Vendita	MXN	2	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	–	Vendita	MXN	3	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	–	Vendita	NOK	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	54	Vendita	NOK	550	2
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	35	Vendita	NOK	386	1
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	9	Vendita	NOK	122	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	–	Vendita	NOK	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	–	Vendita	NZD	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	72	Vendita	NZD	118	2
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	47	Vendita	NZD	84	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	–	Vendita	NZD	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	12	Vendita	NZD	27	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	162	Vendita	PLN	658	2
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	102	Vendita	PLN	454	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	27	Vendita	PLN	146	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	–	Vendita	PLN	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	–	Vendita	PLN	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	–	Vendita	SEK	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	65	Vendita	SEK	687	2
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	42	Vendita	SEK	484	1
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	11	Vendita	SEK	153	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	–	Vendita	SEK	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	144	Vendita	SGD	192	2
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	–	Vendita	SGD	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	–	Vendita	SGD	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	25	Vendita	SGD	44	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	93	Vendita	SGD	136	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	43	Vendita	USD	54	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	11	Vendita	USD	9	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NZD	7	Vendita	USD	4	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNY	828	Vendita	USD	115	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NOK	18	Vendita	USD	2	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	DKK	22	Vendita	USD	3	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	24	Vendita	USD	18	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	JPY	39.306	Vendita	USD	270	2
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	MXN	324	Vendita	USD	19	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	9.708	Vendita	USD	10.658	(125)
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	2.695	Vendita	USD	3.429	(19)
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	PLN	40	Vendita	USD	10	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	21	Vendita	USD	13	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NOK	16	Vendita	USD	2	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	268	Vendita	USD	291	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	DKK	20	Vendita	USD	3	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	ILS	22	Vendita	USD	6	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	42	Vendita	USD	4	–
13-set-2023	Citi	Acquisto	USD	154	Vendita	KRW	200.000	3
13-set-2023	Citi	Acquisto	USD	7.706	Vendita	KRW	10.300.000	(83)
13-set-2023	Citi	Acquisto	KRW	10.500.000	Vendita	USD	8.094	(153)

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	7	Vendita	AUD	10	\$ –
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	2	Vendita	EUR	1	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	104	Vendita	EUR	95	1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	60	Vendita	GBP	48	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	561	Vendita	GBP	441	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	2.635	Vendita	USD	2.898	(40)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	1	Vendita	USD	1	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	288	Vendita	USD	188	(2)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	9.125	Vendita	USD	11.620	(61)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	9	Vendita	USD	11	–
19-set-2023	JP Morgan	Acquisto	JPY	4.729.000	Vendita	USD	34.400	(1.798)
19-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	802	Vendita	JPY	113.000	23
19-set-2023	UBS	Acquisto	USD	332	Vendita	JPY	47.000	8
22-set-2023	Citi	Acquisto	USD	795	Vendita	NOK	8.000	43
22-set-2023	JP Morgan	Acquisto	NOK	40.200	Vendita	USD	3.800	(17)
22-set-2023	JP Morgan	Acquisto	NOK	26.600	Vendita	USD	2.474	30
22-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	168	Vendita	NOK	1.800	(1)
22-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	2.563	Vendita	NOK	25.600	153
26-set-2023	Barclays	Acquisto	USD	2.060	Vendita	NZD	3.390	39
26-set-2023	Barclays	Acquisto	NZD	1.040	Vendita	USD	645	(25)
26-set-2023	UBS	Acquisto	USD	160	Vendita	NZD	260	5
17-ott-2023	Goldman Sachs	Acquisto	MYR	29.500	Vendita	USD	6.529	(147)
19-ott-2023	HSBC	Acquisto	USD	6.626	Vendita	BRL	32.300	151
25-ott-2023	Citi	Acquisto	USD	3.987	Vendita	CAD	5.240	106
27-ott-2023	Citi	Acquisto	USD	21.376	Vendita	MXN	365.200	181
27-ott-2023	Goldman Sachs	Acquisto	MXN	5.300	Vendita	USD	309	(1)
27-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	MXN	49.100	Vendita	USD	2.867	(17)
30-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	1.915	Vendita	COP	7.820.000	36
30-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	4.473	Vendita	COP	18.960.000	(82)
07-nov-2023	HSBC	Acquisto	EUR	3.400	Vendita	USD	3.696	3
07-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	EUR	20.460	Vendita	USD	22.634	(374)
07-nov-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	621	Vendita	EUR	560	12
10-nov-2023	HSBC	Acquisto	USD	1.254	Vendita	THB	44.400	(23)
10-nov-2023	HSBC	Acquisto	THB	44.400	Vendita	USD	1.292	(15)
15-nov-2023	HSBC	Acquisto	USD	8.503	Vendita	ZAR	162.900	(65)
17-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	CNH	15.530	Vendita	USD	2.157	(13)
06-dic-2023	JP Morgan	Acquisto	AUD	1.530	Vendita	USD	987	8
08-dic-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	13.705	Vendita	GBP	10.900	(105)
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 3.132\$)								\$ 1.454
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (3.966)\$)								(3.353)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (834)\$)								\$ (1.899)

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da ipoteca — 22,12% (28 febbraio 2023: 21,89%)			Stati Uniti — 38,05% (28 febbraio 2023: 32,72%)		
4.950	COMM 2017-PANW Mortgage Trust, serie 2017 PANW, classe D, 144A, 4,343%, scadenza 10/10/2029 *	4.347	5.250	Obbligazione a tasso variabile United States Treasury – quando emesso, 4,931%, scadenza 31/01/2025 *	5.258
5.039	Pool Fannie Mae 'MA4733', 4,500%, scadenza 01/09/2052	4.781	17.130	Obbligazione a tasso variabile United States Treasury – quando emesso, 5,418%, scadenza 30/04/2025 *	17.138
2.618	Pool Fannie Mae 'MA4785', 5,000%, scadenza 01/10/2052	2.541	83.550	United States Treasury Note/Bond, 2,750%, scadenza 15/08/2032	75.009
4.797	Pool Fannie Mae 'MA4841', 5,000%, scadenza 01/12/2052	4.655			97.405
4.957	Pool Fannie Mae 'MA4842', 5,500%, scadenza 01/12/2052	4.901			38,05
2.201	Pool Freddie Mac 'RA7790', 5,000%, scadenza 01/08/2052	2.137			
3.679	Pool Freddie Mac 'SD8245', 4,500%, scadenza 01/09/2052	3.490			
3.269	Pool Freddie Mac 'SD8257', 4,500%, scadenza 01/10/2052	3.102			
2.735	Pool Freddie Mac 'SD8267', 5,000%, scadenza 01/11/2052	2.654			
7.021	Pool Freddie Mac 'SD8277', 5,500%, scadenza 01/12/2052	6.941			
2.598	Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500%, scadenza 20/02/2053	2.573			
4.899	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500%, scadenza 20/04/2053	4.852			
3.356	Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500%, scadenza 20/05/2053	3.324			
3.845	Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000%, scadenza 20/06/2053	3.743			
2.608	Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500%, scadenza 20/06/2053	2.583			
	Totale titoli garantiti da ipoteca (costo 58.067 dollari)	56.624			22,12
Obbligazioni ed effetti societari — 8,26% (28 febbraio 2023: 7,26%)			Totale Obbligazioni ed effetti governativi (costo 175.791 dollari)		
Australia — 2,46% (28 febbraio 2023: 4,87%)			Organismi di investimento collettivo — 3,01% (28 febbraio 2023: 5,67%)		
6.280	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,955%, scadenza 14/03/2025 *	6.291	7.710	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	7.710
		2,46			3,01
Messico — 0,96% (28 febbraio 2023: 0,00%)			Totale Organismi di investimento collettivo (costo 7.710\$)		
3.990	Petroleos Mexicanos, 6,950%, scadenza 28/01/2060	2.472			7,710
		0,96			
Stati Uniti — 4,84% (28 febbraio 2023: 2,39%)			Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 263.137 dollari)		
5.600	General Motors Financial Co Inc, 5,400%, scadenza 06/04/2026	5.533			260,160
1.905	Jabil Inc, 3,000%, scadenza 15/01/2031	1.593			101,62
5.340	Toyota Motor Credit Corp, 4,450%, scadenza 18/05/2026	5.268			
		4,84			
	Totale Obbligazioni ed effetti societari (costo 21.569 dollari)	21.157			8,26
Obbligazioni ed effetti governativi — 68,23% (28 febbraio 2023: 65,08%)			Contratti a termine in valuta estera — 2,94% (28 febbraio 2023: 2,41%)		
Brasile — 4,74% (28 febbraio 2023: 7,30%)			Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)		
BRL	64.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2033	12.138	4,74	7.522
Colombia — 6,70% (28 febbraio 2023: 5,75%)			Futures — 0,20% (28 febbraio 2023: 0,41%)		
COP	29.810.000	TES colombiano, serie B, 9,250%, scadenza 28/05/2042	6.333	2,47	512
COP	64.550.000	TES colombiano, serie B, 7,250%, scadenza 26/10/2050	10.832	4,23	0,20
		6,70			
Messico — 6,13% (28 febbraio 2023: 5,75%)			Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
MXN	88.900	Mexican Bonos, serie M, 8,000%, scadenza 07/11/2047	4.537	1,77	268,194
MXN	220.200	Mexican Bonos, serie M, 8,000%, scadenza 31/07/2053	11.144	4,36	
		6,13			
Nuova Zelanda — 2,44% (28 febbraio 2023: 2,68%)			Contratti a termine in valuta estera — (6,46%) (28 febbraio 2023: (4,38%))		
NZD	15.920	New Zealand Government Bond, serie 0551, 2,750%, scadenza 15/05/2051	6.251	2,44	(16,536)
		2,44			(6,46)
Perù — 4,10% (28 febbraio 2023: 3,69%)			Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
PEN	39.970	Peru Government Bond, 6,150%, scadenza 12/08/2032	10.491	4,10	(16,536)
		4,10			(6,46)
Africa del Sud — 3,74% (28 febbraio 2023: 2,91%)			Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
ZAR	250.300	Republic of South Africa Government Bond, serie 2048, 8,750%, scadenza 28/02/2048	9.578	3,74	251,658
		3,74			98,30
Regno Unito — 2,33% (28 febbraio 2023: 0,00%)			Altre attività eccedenti le passività		
GBP	9.790	United Kingdom Gilt, 1,250%, scadenza 31/07/2051	5.960	2,33	4.352
		2,33			1,70
			Patrimonio in gestione		
			256,010\$ 100,00		

– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 10.638.000 dollari ovvero al 4,16% dell'attivo netto.

* Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.

ABBREVIAZIONI:

BRL	– Real brasiliano
COP	– Peso colombiano
GBP	– Sterlina britannica
MXN	– Peso messicano
NZD	– Nuovo dollaro neozelandese
PEN	– Nuovo Sol peruviano
ZAR	– Rand sudafricano

Analisi delle attività totali

Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	% delle attività totali
Organismi di investimento collettivo	92,12
Strumenti finanziari derivati	2,81
Altre attività	2,93
Totale Attività	100,00

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)	Valuta vendita (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
01-set-2023	JP Morgan	Acquisto	USD 35.208	Vendita GBP 27.410 \$ 485
01-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	GBP 10.570	Vendita USD 13.537 (147)
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD 74	Vendita USD 55 –
11-set-2023	Barclays	Acquisto	USD 9.374	Vendita CHF 8.420 (169)
11-set-2023	Barclays	Acquisto	USD 4.369	Vendita INR 362.000 (4)
11-set-2023	Barclays	Acquisto	USD 5.385	Vendita INR 444.000 20
11-set-2023	Barclays	Acquisto	INR 1.903.000	Vendita USD 23.102 (110)
11-set-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD 83.623	Vendita CHF 74.550 (872)
11-set-2023	HSBC	Acquisto	CHF 1.050	Vendita USD 1.200 (10)
11-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	CHF 4.270	Vendita USD 4.821 19
11-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	CHF 14.900	Vendita USD 17.037 (149)

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

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

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
Japan 10 Year Bond (OSE) settembre 2023	Morgan Stanley	(37)	\$ (37.337)	\$ 326
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Morgan Stanley	195	21.651	186
Apprezzamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 2.190\$)				\$ 512
Ammortamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				-
Apprezzamento netto dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 2.190\$)				\$ 512

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Obbligazioni ed effetti societari — 94,90% (28 febbraio 2023: 95,87%)					
Austria — 0,83% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
200 Benteler International AG, 144A, 10,500%, scadenza 15/05/2028	202	0,83	270 Home BancShares Inc/AR, 3,125%, scadenza 30/01/2032 *	223	0,92
Canada — 6,54% (28 febbraio 2023: 3,28%)					
576 Athabasca Oil Corp, 144A, 9,750%, scadenza 01/11/2026	594	2,44	225 Horizon Therapeutics USA Inc, 144A, 5,500%, scadenza 01/08/2027	230	0,95
310 Baytex Energy Corp, 144A, 8,750%, scadenza 01/04/2027	318	1,31	375 IRB Holding Corp, 144A, 7,000%, scadenza 15/06/2025	375	1,54
515 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000%, scadenza 15/02/2026	476	1,95	445 LCP SR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750%, scadenza 15/10/2027	419	1,72
220 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875%, scadenza 15/04/2029	204	0,84	275 Liberty Interactive LLC, 8,250%, scadenza 01/02/2030	107	0,44
	1.592	6,54	165 Lindblad Expeditions LLC, 144A, 6,750%, scadenza 15/02/2027	159	0,66
Colombia — 1,10% (28 febbraio 2023: 1,29%)					
200 Ecopetrol SA, 8,625%, scadenza 19/01/2029	204	0,84	610 Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875%, scadenza 01/10/2026	553	2,27
80 Ecopetrol SA, 4,625%, scadenza 02/11/2031	63	0,26	425 Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875%, scadenza 01/05/2029	370	1,52
	267	1,10	100 New York Community Bancorp Inc, 5,900%, scadenza 06/11/2028 *	96	0,40
Repubblica Ceca — 2,62% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
EUR 575 Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 7,250%, scadenza 30/04/2030	637	2,62	145 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 3,875%, scadenza 21/09/2023	145	0,60
Finlandia — 1,47% (28 febbraio 2023: 0,28%)					
374 Nokia Oyj, 6,625%, scadenza 15/05/2039	356	1,47	175 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125%, scadenza 15/02/2028	164	0,68
Francia — 0,36% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
EUR 100 Altice France SA/Francia, 5,875%, scadenza 01/02/2027	88	0,36	320 PDC Energy Inc, 5,750%, scadenza 15/05/2026	319	1,31
Israele — 7,58% (28 febbraio 2023: 3,42%)					
370 Delek Overriding Royalty Leviathan Ltd, 144A, 7,494%, scadenza 30/12/2023	368	1,51	150 PennyMac Financial Services Inc, 144A, 4,250%, scadenza 15/02/2029	124	0,51
440 Energian Israel Finance Ltd, 144A, 4,500%, scadenza 30/03/2024	436	1,79	70 PennyMac Financial Services Inc, 144A, 5,750%, scadenza 15/09/2031	59	0,24
400 Energian Israel Finance Ltd, 144A, 4,875%, scadenza 30/03/2026	376	1,55	20 PRA Group Inc, 144A, 8,375%, scadenza 01/02/2028	18	0,07
150 Energian Israel Finance Ltd, 144A, 5,375%, scadenza 30/03/2028	137	0,56	400 PRA Group Inc, 144A, 5,000%, scadenza 01/10/2029	302	1,24
150 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,125%, scadenza 30/06/2025	147	0,61	225 PROG Holdings Inc, 144A, 6,000%, scadenza 15/11/2029	202	0,83
160 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,500%, scadenza 30/06/2027	155	0,64	145 QVC Inc, 4,750%, scadenza 15/02/2027	96	0,39
239 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750%, scadenza 30/06/2030	225	0,92	405 QVC Inc, 4,375%, scadenza 01/09/2028	230	0,94
	1.844	7,58	70 Radian Group Inc, 4,500%, scadenza 01/10/2024	68	0,28
Italia — 0,42% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
EUR 100 Itelyum Regeneration Spa, 4,625%, scadenza 01/10/2026	102	0,42	95 Rocket Mortgage LLC, 144A, 5,250%, scadenza 15/01/2028	89	0,37
Giappone — 0,82% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
200 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,043%, scadenza 15/09/2023	200	0,82	440 Sabre GBL Inc, 144A, 9,250%, scadenza 15/04/2025	434	1,78
Messico — 3,15% (28 febbraio 2023: 1,49%)					
370 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450%, scadenza 15/11/2029	235	0,97	150 Signature Bank/New York NY, 4,000%, scadenza 15/10/2030 *	2	0,01
300 Petroleos Mexicanos, 5,950%, scadenza 28/01/2031	217	0,89	50 Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625%, scadenza 01/04/2026	49	0,20
415 Petroleos Mexicanos, 6,700%, scadenza 16/02/2032	314	1,29	EUR 400 Standard Industries Inc/NJ, 2,250%, scadenza 21/11/2026	385	1,58
	766	3,15	405 Station Casinos LLC, 144A, 4,625%, scadenza 01/12/2031	334	1,37
Nigeria — 0,67% (28 febbraio 2023: 1,58%)					
200 IHS Holding Ltd, 144A, 6,250%, scadenza 29/11/2028	162	0,67	55 Synchrony Financial, 7,250%, scadenza 02/02/2033	51	0,21
Corea del Sud — 0,74% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
200 SK Hynix Inc, 144A, 1,500%, scadenza 19/01/2026	180	0,74	95 Texas Capital Bancshares Inc, 4,000%, scadenza 06/05/2031 *	79	0,32
Regno Unito — 1,74% (28 febbraio 2023: 2,55%)					
150 BAT Capital Corp, 7,079%, scadenza 02/08/2043	149	0,61	160 TransDigm Inc, 144A, 6,250%, scadenza 15/03/2026	159	0,65
138 British Airways 2019-1 classe AA Pass Through Trust, 144A, 3,300%, scadenza 15/12/2032	121	0,50	249 Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625%, scadenza 15/02/2026	233	0,96
160 Connect Finco SARRL / Connect US Finco LLC, 6,750%, scadenza 01/10/2026	152	0,63	515 Uber Technologies Inc, 144A, 7,500%, scadenza 15/05/2025	520	2,14
	422	1,74	376 Uber Technologies Inc, 144A, 8,000%, scadenza 01/11/2026	383	1,58
Stati Uniti — 65,22% (28 febbraio 2023: 77,01%)					
150 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500%, scadenza 01/03/2028	140	0,57	100 United States Cellular Corp, 6,700%, scadenza 15/12/2033	98	0,40
50 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250%, scadenza 15/02/2026	50	0,21	450 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500%, scadenza 15/04/2029	391	1,61
700 Affinity Interactive, 144A, 6,875%, scadenza 15/12/2027	621	2,55	600 Valvoline Inc, 144A, 4,250%, scadenza 15/02/2030	590	2,43
275 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250%, scadenza 15/08/2027	269	1,11	755 Vector Group Ltd, 144A, 5,750%, scadenza 01/02/2029	658	2,70
445 ANGI Group LLC, 144A, 3,875%, scadenza 15/08/2028	358	1,47	200 Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125%, scadenza 01/06/2028	202	0,83
250 Arko Corp, 144A, 5,125%, scadenza 15/11/2029	206	0,84	325 Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250%, scadenza 15/05/2025	320	1,32
240 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000%, scadenza 01/02/2026	231	0,95	200 WESCO Distribution Inc, 144A, 7,125%, scadenza 15/06/2025	201	0,83
385 Burford Capital Finance LLC, 6,125%, scadenza 12/08/2025	371	1,53	150 Western Alliance Bancorp, 3,000%, scadenza 15/06/2031 *	119	0,49
620 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875%, scadenza 15/04/2030	569	2,34	EUR 200 WMG Acquisition Corp, 2,250%, scadenza 15/08/2031	175	0,72
200 Capital One Financial Corp, 1,343%, scadenza 06/12/2024 *	197	0,81	100 World Acceptance Corp, 144A, 7,000%, scadenza 01/11/2026	87	0,36
150 Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750%, scadenza 01/02/2028	136	0,56		15.864	65,22
475 Cimarex Energy Co, 3,900%, scadenza 15/05/2027	417	1,71	Zambia — 1,64% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
280 Cimarex Energy Co, 4,375%, scadenza 15/03/2029	226	0,93	400 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500%, scadenza 01/04/2025	400	1,64
175 Concentrix Corp, 6,850%, scadenza 02/08/2033	168	0,69	Totale Obbligazioni ed effetti societari (costo 23.138 dollari)		
200 Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125%, scadenza 31/12/2024	195	0,80		23.082	94,90
235 Credit Acceptance Corp, 6,625%, scadenza 15/03/2026	229	0,94	Organismi di investimento collettivo — 3,48% (28 febbraio 2023: 3,81%)		
150 Crocs Inc, 144A, 4,125%, scadenza 15/08/2031	119	0,49	846 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	846	3,48
150 Dream Finders Homes Inc, 144A, 8,250%, scadenza 15/08/2028	152	0,63	Totale Organismi di investimento collettivo (costo 846\$)		
50 FirstCash Inc, 144A, 4,625%, scadenza 01/09/2028	45	0,18		846	3,48
510 FirstCash Inc, 144A, 5,625%, scadenza 01/01/2030	464	1,91	Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 23.984 dollari)		
100 Freedom Mortgage Corp, 144A, 8,125%, scadenza 15/11/2024	100	0,41		23.928	98,38
380 Freedom Mortgage Corp, 7,625%, scadenza 01/05/2026	350	1,44	Contratti a termine in valuta estera — 0,05% (28 febbraio 2023: 0,10%)		
625 GrubHub Holdings Inc, 144A, 5,500%, scadenza 01/07/2027	433	1,78	Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)		
				12	0,05
			Futures — 0,17% (28 febbraio 2023: 0,01%)		
			Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)		
				42	0,17
			Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
				23.982	98,60
			Contratti di cambio a termine: (1,01%) (28 febbraio 2023: (1,94%))		
			Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)		
				(245)	(1,01)
			Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
				(245)	(1,01)
			Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
				23.737	97,59
			Altre attività eccedenti le passività		
				585	2,41
			Patrimonio in gestione		
				24.322\$	100,00
			– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.		
			144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 16.794.000 dollari ovvero al 69,05% dell'attivo netto.		
			* Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.		

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

ABBREVIAZIONI:

EUR – Euro

	% delle attività totali
Analisi delle attività totali	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	92,00
Organismi di investimento collettivo	3,37
Strumenti finanziari derivati	0,22
Altre attività	4,41
Totale Attività	100,00

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)		Valuta vendita (in migliaia)		Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)		
01-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	GBP	330	Vendita	USD	410	\$ 8
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	1	Vendita	CHF	2	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	3	Vendita	CHF	2	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	–	Vendita	CHF	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	2.456	Vendita	EUR	1.678	(3)
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	10	Vendita	EUR	12	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	26	Vendita	EUR	17	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	268	Vendita	GBP	158	(2)
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	146	Vendita	GBP	125	(1)
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	3	Vendita	GBP	2	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	2	Vendita	SEK	18	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	–	Vendita	SEK	–	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	3	Vendita	SEK	22	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	6.137	Vendita	USD	6.737	(79)
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	11.297	Vendita	USD	8.474	(111)
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	118	Vendita	USD	87	–
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	46	Vendita	USD	60	–
07-nov-2023	HSBC	Acquisto	EUR	60	Vendita	USD	66	–
07-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	EUR	2.670	Vendita	USD	2.954	(49)
07-nov-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	87	Vendita	EUR	80	–
08-dic-2023	JP Morgan	Acquisto	GBP	370	Vendita	USD	465	4
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 10\$)							\$	12
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (202)\$)								(245)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (192)\$)							\$	(233)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
U.S. 10 Year Note (CBT) dicembre 2023	Citi	44	\$ 4.885	\$ 42
Apprezzamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 2\$)				\$ 42
Ammortamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): –\$)				–
Apprezzamento netto dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 2\$)				\$ 42

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	
Titoli garantiti da ipoteca — 13,61% (28 febbraio 2023: 13,19%)						
1.015	Pool Fannie Mae 'MA4733', 4,500%, scadenza 01/09/2052	0,46	12.050	United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/08/2052	4,62	
1.561	Pool Fannie Mae 'MA4785', 5,000%, scadenza 01/10/2052	0,73	64.225		30,91	
3.312	Pool Fannie Mae 'MA4841', 5,000%, scadenza 01/12/2052	1,55	Totale Obbligazioni ed effetti governativi (costo 183.459 dollari)			
3.725	Pool Fannie Mae 'MA4842', 5,500%, scadenza 01/12/2052	1,77	168.807		81,25	
1.502	Pool Freddie Mac 'RA7790', 5,000%, scadenza 01/08/2052	0,70	Organismi di investimento collettivo — 4,27% (28 febbraio 2023: 1,99%)			
1.871	Pool Freddie Mac 'SD8257', 4,500%, scadenza 01/10/2052	0,85	8.871	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	4,27	
1.845	Pool Freddie Mac 'SD8267', 5,000%, scadenza 01/11/2052	0,86	Totale Organismi di investimento collettivo (costo 8.871\$)			
4.493	Pool Freddie Mac 'SD8277', 5,500%, scadenza 01/12/2052	2,14	Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 222.833 dollari)			
9.137	Ginnie Mae II Pool 'MA8348', 5,000%, scadenza 20/10/2052	4,29	207.895		100,06	
546	Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500%, scadenza 20/05/2053	0,26	Contratti a termine in valuta estera — 0,56% (28 febbraio 2023: 0,71%)			
Totale Titoli garantiti da ipoteca (costo 28.546 dollari)		28.290	13,61	Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto) 1.150 0,56		
Obbligazioni ed effetti societari — 0,93% (28 febbraio 2023: 6,05%)						
Messico — 0,93% (28 febbraio 2023: 0,00%)						
3.110	Petroleos Mexicanos, 6,950%, scadenza 28/01/2060	0,93	Contratti a termine in valuta estera — (2,23%) (28 febbraio 2023: (2,07%))			
Totale Obbligazioni ed effetti societari (costo 1.957 dollari)		1.927	0,93	Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto) (4.628) (2,23)		
Obbligazioni ed effetti governativi — 81,25% (28 febbraio 2023: 78,56%)						
Australia — 3,97% (28 febbraio 2023: 0,00%)						
AUD 12.830	Australia Government Bond, serie 137, 2,750%, scadenza 21/04/2024	3,97	Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico			
		8.247	3,97	(4.628) (2,23)		
Brasile — 4,97% (28 febbraio 2023: 5,44%)						
BRL 17.220	Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTN-F, 10,000%, scadenza 01/01/2027	1,66	Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico			
BRL 8.110	Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTN-F, 10,000%, scadenza 01/01/2029	0,76	204.417		98,39	
BRL 9.230	Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTN-F, 10,000%, scadenza 01/01/2031	0,85	Altre attività eccedenti le passività			
BRL 18.590	Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTN-F, 10,000%, scadenza 01/01/2033	1,70	3.357		1,61	
		10.332	4,97	Patrimonio in gestione		
		12.164	5,85	207.774\$ 100,00		
Colombia — 5,85% (28 febbraio 2023: 5,87%)						
COP 14.690.000	TES colombiano, serie B, 7,000%, scadenza 26/03/2031	1,43	– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.			
COP 37.980.000	TES colombiano, serie B, 9,250%, scadenza 28/05/2042	3,88	144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 8.860.000 dollari ovvero al 4,26% dell'attivo netto.			
COP 6.640.000	TES colombiano, serie B, 7,250%, scadenza 26/10/2050	0,54	* Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.			
		12.164	5,85	† Illiquido.		
		12.164	5,85	‡ Titolo che non matura più reddito durante e/o dopo il periodo finanziario chiuso al 31 agosto 2023 a causa dell'incertezza dei pagamenti degli interessi.		
Germania — 3,93% (28 febbraio 2023: 5,84%)						
EUR 7.540	German Treasury Bill, zero coupon, scadenza 20/09/2023	3,93	ABBREVIAZIONI:			
		8.163	3,93	AUD – Dollaro australiano		
Messico — 11,81% (28 febbraio 2023: 12,40%)						
MXN 120.200	Mexican Bonos, serie M, 8,500%, scadenza 18/11/2038	3,15	BRL – Real brasiliano			
MXN 120.900	Mexican Bonos, serie M, 7,750%, scadenza 13/11/2042	2,92	COP – Peso colombiano			
MXN 84.600	Mexican Bonos, serie M, 8,000%, scadenza 07/11/2047	2,08	EUR – Euro			
MXN 150.200	Mexican Bonos, serie M, 8,000%, scadenza 31/07/2053	3,66	GBP – Sterlina britannica			
		24.528	11,81	MXN – Peso messicano		
Nuova Zelanda — 0,73% (28 febbraio 2023: 0,82%)						
NZD 3.860	New Zealand Government Bond, serie 0551, 2,750%, scadenza 15/05/2051	0,73	NOK – Corona norvegese			
		1.516	0,73	NZD – Nuovo dollaro neozelandese		
Norvegia — 4,26% (28 febbraio 2023: 0,74%)						
NOK 94.800	Norway Government Bond, serie 476, 144A, 3,000%, scadenza 14/03/2024	4,26	RUB – Rublo russo			
		8.860	4,26	ZAR – Rand sudafricano		
Russia — 0,13% (28 febbraio 2023: 0,03%)						
RUB 83.000	Russian Federal Bond – OFZ, 0,000%, scadenza 10/04/2030†‡	0,13				
		260	0,13			
Africa del Sud — 4,55% (28 febbraio 2023: 3,69%)						
ZAR 108.600	Republic of South Africa Government Bond, serie R214, 6,500%, scadenza 28/02/2041	1,64				
ZAR 158.100	Republic of South Africa Government Bond, serie 2048, 8,750%, scadenza 28/02/2048	2,91				
		9.444	4,55			
Regno Unito — 10,14% (28 febbraio 2023: 0,76%)						
GBP 9.560	United Kingdom Gilt, 3,250%, scadenza 31/01/2033	5,34				
GBP 16.390	United Kingdom Gilt, 1,250%, scadenza 31/07/2051	4,80				
		21.068	10,14			
Stati Uniti — 30,91% (28 febbraio 2023: 28,57%)						
2.460	Obbligazione a tasso variabile United States Treasury – quando emesso, 4,931%, scadenza 31/01/2025 *	1,19				
4.840	Obbligazione a tasso variabile United States Treasury – quando emesso, 5,498%, scadenza 31/07/2025 *	2,33				
5.860	United States Treasury Note/Bond, 1,875%, scadenza 15/02/2032	2,37				
26.690	United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 15/02/2033	12,24				
9.140	United States Treasury Note/Bond, 1,875%, scadenza 15/11/2051	2,70				
16.820	United States Treasury Note/Bond, 2,250%, scadenza 15/02/2052	5,46				

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

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

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

Data di scadenza	Controparte		Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NZD	101	Vendita	SGD	82	\$ –	
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	NZD	10.687	Vendita	USD	6.517	(144)	
12-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	1.012	Vendita	USD	1.288	(8)	
13-set-2023	Citi	Acquisto	USD	13.380	Vendita	KRW	17.882.700	(145)	
13-set-2023	Citi	Acquisto	KRW	17.882.700	Vendita	USD	13.781	(257)	
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	–	Vendita	EUR	–	–	
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	7	Vendita	GBP	5	–	
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	–	Vendita	USD	–	–	
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	1	Vendita	USD	1	–	
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	36	Vendita	USD	46	–	
19-set-2023	Goldman Sachs	Acquisto	JPY	124.000	Vendita	USD	892	(37)	
19-set-2023	JP Morgan	Acquisto	JPY	6.546.000	Vendita	USD	47.617	(2.489)	
19-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	JPY	160.000	Vendita	USD	1.164	(61)	
19-set-2023	UBS	Acquisto	JPY	122.000	Vendita	USD	853	(12)	
22-set-2023	HSBC	Acquisto	USD	2.353	Vendita	NOK	25.200	(18)	
22-set-2023	HSBC	Acquisto	USD	1.794	Vendita	NOK	18.800	25	
22-set-2023	JP Morgan	Acquisto	NOK	43.600	Vendita	USD	4.055	49	
22-set-2023	JP Morgan	Acquisto	NOK	66.300	Vendita	USD	6.268	(27)	
22-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	4.690	Vendita	NOK	46.900	276	
22-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	NOK	3.100	Vendita	USD	300	(8)	
26-set-2023	Barclays	Acquisto	USD	3.756	Vendita	NZD	6.180	70	
26-set-2023	Barclays	Acquisto	NZD	4.490	Vendita	USD	2.784	(106)	
29-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	NOK	6.100	Vendita	USD	567	8	
29-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	NOK	34.500	Vendita	USD	3.321	(72)	
17-ott-2023	Goldman Sachs	Acquisto	MYR	30.300	Vendita	USD	6.706	(151)	
19-ott-2023	HSBC	Acquisto	USD	4.938	Vendita	BRL	24.070	113	
19-ott-2023	HSBC	Acquisto	BRL	12.330	Vendita	USD	2.571	(99)	
27-ott-2023	Citi	Acquisto	USD	22.072	Vendita	MXN	377.100	187	
27-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	MXN	62.400	Vendita	USD	3.653	(32)	
30-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	2.532	Vendita	COP	10.340.000	48	
30-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	4.380	Vendita	COP	18.570.000	(81)	
07-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	EUR	17.710	Vendita	USD	19.592	(324)	
07-nov-2023	Standard Chartered Bank	Acquisto	EUR	6.600	Vendita	USD	7.202	(21)	
10-nov-2023	HSBC	Acquisto	USD	2.310	Vendita	THB	81.800	(42)	
10-nov-2023	HSBC	Acquisto	THB	81.800	Vendita	USD	2.380	(28)	
15-nov-2023	HSBC	Acquisto	USD	1.065	Vendita	ZAR	20.400	(8)	
06-dic-2023	JP Morgan	Acquisto	AUD	2.100	Vendita	USD	1.355	11	
08-dic-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	20.281	Vendita	GBP	16.130	(155)	
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 1.448\$)								\$ 1,150	
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (4.239)\$)								(4.628)	
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (2.791)\$)								\$ (3.478)	

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da ipoteca — 9,94% (28 febbraio 2023: 17,87%)			Cina — 0,05% (28 febbraio 2023: 1,27%)		
1.945 Bellemeade Re 2020-3 Ltd, serie 2020 3A, classe M1C, 144A, 9,129%, scadenza 25/10/2030 *	1.966	0,17	705 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 3,400%, scadenza 01/05/2030	620	0,05
6.100 Bellemeade Re 2020-3 Ltd, serie 2020 3A, classe M2, 144A, 10,279%, scadenza 25/10/2030 *	6.363	0,54	Colombia — 1,00% (28 febbraio 2023: 0,95%)		
3.429 Bellemeade Re Ltd, serie 2021 2A, classe M1A, 144A, 6,488%, scadenza 25/06/2031 *	3.422	0,29	3.715 Ecopetrol SA, 4,125%, scadenza 16/01/2025	3.604	0,30
220 COMM 2017-PANW Mortgage Trust, serie 2017 PANW, classe D, 144A, 4,343%, scadenza 10/10/2029 *	193	0,02	3.100 Ecopetrol SA, 8,875%, scadenza 13/01/2033	3.145	0,27
11.135 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, serie 2020 SBT1, classe 1M2, 144A, 9,052%, scadenza 25/02/2040 *	11.529	0,97	1.860 Ecopetrol SA, 5,875%, scadenza 28/05/2045	1.313	0,11
12.085 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, serie 2020 SBT1, classe 2M2, 144A, 9,052%, scadenza 25/02/2040 *	12.522	1,06	4.420 Geopark Ltd, 144A, 5,500%, scadenza 17/01/2027	3.825	0,32
227 Eagle RE 2021-1 Ltd, serie 2021 1, classe M1C, 144A, 7,988%, scadenza 25/10/2033 *	228	0,02	Repubblica Ceca — 0,42% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
7.602 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, serie 2017 CO2, classe 2M2C, 9,052%, scadenza 25/09/2029 *	7.884	0,67	4.850 Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 144A, 7,875%, scadenza 30/04/2029	4.947	0,42
2.349 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, serie 2017 CO6, classe 2M2, 8,202%, scadenza 25/02/2030 *	2.413	0,20	Germania — 6,81% (28 febbraio 2023: 0,35%)		
2.518 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA4, serie 2020 HQA4, classe B1, 144A, 10,652%, scadenza 25/09/2050 *	2.700	0,23	19.300 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2,625%, scadenza 28/02/2024	19.036	1,61
3.000 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA2, serie 2021 HQA2, classe B1, 144A, 8,438%, scadenza 25/12/2033 *	2.954	0,25	20.000 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250%, scadenza 08/03/2024	19.481	1,64
1.666 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, serie 2019 DNA3, classe M2, 144A, 7,452%, scadenza 25/07/2049 *	1.673	0,14	41.200 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,375%, scadenza 18/07/2025	37.870	3,19
5.855 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, serie 2020 HQA5, classe B1, 144A, 9,288%, scadenza 25/11/2050 *	6.098	0,51	4.485 Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A, 0,650%, scadenza 11/03/2024	4.372	0,37
11.538 Ginnie Mae II Pool 'MA8645', 4,000%, scadenza 20/02/2053	10.755	0,91	Irlanda — 1,34% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
24.124 Ginnie Mae II Pool 'MA8646', 4,500%, scadenza 20/02/2053	23.001	1,94	4.670 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,250%, scadenza 15/04/2026	4.407	0,37
20.742 Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500%, scadenza 20/04/2053	20.542	1,73	2.540 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 6,375%, scadenza 04/05/2028	2.522	0,21
29 Home RE 2021-1 Ltd, serie 2021 1, classe M1B, 144A, 6,979%, scadenza 25/07/2033 *	29	-	8.900 GGAM Finance Ltd, 144A, 7,750%, scadenza 15/05/2026	8.928	0,76
3.232 STACR Trust 2018-HRP2, serie 2018 HRP2, classe B1, 144A, 9,602%, scadenza 25/02/2047 *	3.439	0,29	Israele — 1,35% (28 febbraio 2023: 0,76%)		
Totale titoli garantiti da ipoteca (costo 118.663 dollari)	117.711	9,94	6.120 Energian Israel Finance Ltd, 144A, 4,500%, scadenza 30/03/2024	6.068	0,51
Obbligazioni ed effetti societari — 62,96% (28 febbraio 2023: 58,40%)			6.925 Energian Israel Finance Ltd, 144A, 4,875%, scadenza 30/03/2026	6.512	0,55
Argentina — 0,22% (28 febbraio 2023: 0,00%)			3.490 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,125%, scadenza 30/06/2025	3.425	0,29
2.662 YPF SA, 9,000%, scadenza 12/02/2026	2.627	0,22	Giappone — 0,75% (28 febbraio 2023: 0,73%)		
Australia — 0,03% (28 febbraio 2023: 0,40%)			9.715 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345%, scadenza 17/09/2027	8.908	0,75
AUD 730 NBN Co Ltd, 2,200%, scadenza 16/12/2030	380	0,03	Lussemburgo — 0,57% (28 febbraio 2023: 0,79%)		
Bermuda — 0,20% (28 febbraio 2023: 0,00%)			2.535 Altice Financing SA, 144A, 5,750%, scadenza 15/08/2029	2.011	0,17
2.460 RenaissanceRe Holdings Ltd, 5,750%, scadenza 05/06/2033	2.392	0,20	10.770 Altice France Holding SA, 144A, 6,000%, scadenza 15/02/2028	4.763	0,40
Brasile — 2,13% (28 febbraio 2023: 2,47%)			Messico — 0,20% (28 febbraio 2023: 0,24%)		
1.880 Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250%, scadenza 28/01/2028	1.715	0,14	3.770 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450%, scadenza 15/11/2029	2.390	0,20
4.710 Banco do Brasil SA/Cayman, 144A, 3,250%, scadenza 30/09/2026	4.340	0,37	Norvegia — 0,39% (28 febbraio 2023: 0,37%)		
1.200 Banco do Brasil SA/Cayman, 144A, 6,250%, scadenza 18/04/2030	1.192	0,10	1.410 Var Energi ASA, 144A, 7,500%, scadenza 15/01/2028	1.466	0,13
6.645 Rumo Luxembourg Sarl, 144A, 4,200%, scadenza 18/01/2032	5.401	0,46	2.915 Var Energi ASA, 144A, 8,000%, scadenza 15/11/2032	3.109	0,26
13.775 XP Inc, 144A, 3,250%, scadenza 01/07/2026	12.544	1,06	Panama — 0,29% (28 febbraio 2023: 0,29%)		
	25.192	2,13	3.920 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375%, scadenza 31/05/2030	3.393	0,29
Canada — 3,90% (28 febbraio 2023: 2,19%)			Sovranazionale — 0,53% (28 febbraio 2023: 1,11%)		
3.479 Air Canada 2015-1 classe A Pass Through Trust, 144A, 3,600%, scadenza 15/03/2027	3.248	0,27	MXN 61.000 International Bank for Reconstruction & Development, scadenza 22/01/2026	3.117	0,26
7.349 Air Canada 2020-2 classe A Pass Through Trust, 144A, 5,250%, scadenza 01/04/2029	7.162	0,61	BRL 17.100 International Bank for Reconstruction & Development, scadenza 22/01/2026	3.172	0,27
5.590 Antares Holdings LP, 144A, 2,750%, scadenza 15/01/2027	4.741	0,40	Svizzera — 0,95% (28 febbraio 2023: 0,15%)		
6.000 Baytex Energy Corp, 144A, 8,500%, scadenza 30/04/2030	6.089	0,51	1.930 UBS AG/Londra, 144A, 0,700%, scadenza 09/08/2024	1.841	0,16
11.190 Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500%, scadenza 01/04/2026	10.573	0,89	9.040 UBS Group AG, 144A, 6,537%, scadenza 12/08/2033 *	9.393	0,79
8.930 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000%, scadenza 15/02/2026	8.245	0,70	Regno Unito — 1,15% (28 febbraio 2023: 1,17%)		
6.600 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875%, scadenza 15/04/2029	6.134	0,52	2.220 Ashtead Capital Inc, 144A, 5,500%, scadenza 11/08/2032	2.117	0,18
	46.192	3,90	5.610 HSBC Holdings Plc, 4,292%, scadenza 12/09/2026 *	5.413	0,46
Cile — 0,79% (28 febbraio 2023: 0,99%)			1.075 Nationwide Building Society, 5,750%, perpetuo *	1.178	0,10
6.680 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050%, scadenza 27/04/2026	5.851	0,49	3.625 NatWest Group Plc, 4,600%, perpetuo *	2.477	0,21
4.219 Kenbourne Invest SA, 6,875%, scadenza 26/11/2024	3.551	0,30	2.900 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750%, scadenza 15/07/2031	2.427	0,20
	9.402	0,79	Stati Uniti — 38,11% (28 febbraio 2023: 42,28%)		
			3.665 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250%, scadenza 15/02/2026	3.687	0,31

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario			
Obbligazioni ed effetti societari — (segue)			18.660	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750%, scadenza 15/09/2025	18.054	1,52		
Stati Uniti — (segue)			4.880	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500%, scadenza 30/09/2026	4.540	0,38		
5.100	Air Lease Corp, 0,800%, scadenza 18/08/2024	4.853	0,41	3.830	Nexstar Media Inc, 144A, 4,750%, scadenza 01/11/2028	3.364	0,28	
6.857	Alaska Airlines 2020-1 classe A Pass Through Trust, 144A, 4,800%, scadenza 15/08/2027	6.639	0,56	1.705	Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750%, scadenza 09/03/2028	1.442	0,12	
5.515	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,125%, scadenza 15/08/2026	5.163	0,44	3.255	Nordstrom Inc, 2,300%, scadenza 08/04/2024	3.155	0,27	
435	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250%, scadenza 15/08/2027	373	0,03	5.345	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC, 144A, 4,000%, scadenza 15/10/2027	4.812	0,41	
1.890	Ares Capital Corp, 3,250%, scadenza 15/07/2025	1.774	0,15	7.265	PRA Group Inc, 144A, 5,000%, scadenza 01/10/2029	5.486	0,46	
9.063	Ares Capital Corp, 2,150%, scadenza 15/07/2026	7.972	0,67	1.640	Regal Rexnord Corp, 144A, 6,300%, scadenza 15/02/2030	1.634	0,14	
2.530	Ares Capital Corp, 2,875%, scadenza 15/06/2028	2.136	0,18	1.640	Regal Rexnord Corp, 144A, 6,400%, scadenza 15/04/2033	1.626	0,14	
11.980	Athene Global Funding, 144A, 0,914%, scadenza 19/08/2024	11.384	0,96	4.430	ROBLOX Corp, 144A, 3,875%, scadenza 01/05/2030	3.659	0,31	
7.945	Bain Capital Specialty Finance Inc, 2,950%, scadenza 10/03/2026	7.118	0,60	890	Seagate HDD Cayman, 4,125%, scadenza 15/01/2031	728	0,06	
9.170	Blackstone Secured Lending Fund, 2,125%, scadenza 15/02/2027	7.785	0,66	12.350	Sealed Air Corp, 144A, 1,573%, scadenza 15/10/2026	10.861	0,92	
2.645	Blackstone Secured Lending Fund, 2,850%, scadenza 30/09/2028	2.188	0,19	11.638	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC, 144A, 5,152%, scadenza 20/03/2028	11.541	0,97	
4.645	Block Financial LLC, 3,875%, scadenza 15/08/2030	4.106	0,35	4.870	Stellantis Finance US Inc, 144A, 6,375%, scadenza 12/09/2032	4.875	0,41	
1.160	Blue Owl Capital Corp, 4,000%, scadenza 30/03/2025	1.104	0,09	5.954	Synchrony Bank, 5,625%, scadenza 23/08/2027	5.637	0,48	
4.330	Blue Owl Capital Corp, 2,625%, scadenza 15/01/2027	3.757	0,32	987	Synchrony Financial, 4,250%, scadenza 15/08/2024	962	0,08	
5.515	Blue Owl Credit Income Corp, 3,125%, scadenza 23/09/2026	4.865	0,41	4.515	Synchrony Financial, 4,875%, scadenza 13/06/2025	4.357	0,37	
2.550	Blue Owl Credit Income Corp, 7,750%, scadenza 16/09/2027	2.537	0,21	4.065	Synchrony Financial, 7,250%, scadenza 02/02/2033	3.741	0,32	
4.040	Blue Owl Technology Finance Corp, 144A, 4,750%, scadenza 15/12/2025	3.741	0,32	2.282	Syneos Health Inc, 144A, 3,625%, scadenza 15/01/2029	2.278	0,19	
10.861	Blue Owl Technology Finance Corp, 144A, 3,750%, scadenza 17/06/2026	9.617	0,81	5.600	Talos Production Inc, 12,000%, scadenza 15/01/2026	5.844	0,49	
4.105	Broadcom Inc, 144A, 1,950%, scadenza 15/02/2028	3.563	0,30	4.315	Travel + Leisure Co, 144A, 6,625%, scadenza 31/07/2026	4.286	0,36	
2.170	Capital One Financial Corp, 6,312%, scadenza 08/06/2029 *	2.170	0,18	3.399	Uber Technologies Inc, 144A, 8,000%, scadenza 01/11/2026	3.464	0,29	
4.350	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742%, scadenza 31/12/2039	3.373	0,29	4.080	Univision Communications Inc, 144A, 6,625%, scadenza 01/06/2027	3.954	0,33	
7.540	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000%, scadenza 15/03/2026	7.369	0,62	8.100	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125%, scadenza 01/06/2028	8.178	0,69	
2.310	Citigroup Inc, 6,174%, scadenza 25/05/2034 *	2.303	0,19	7.940	Viasat Inc, 144A, 5,625%, scadenza 15/04/2027	7.101	0,60	
4.900	Civitas Resources Inc, 144A, 8,375%, scadenza 01/07/2028	5.053	0,43	4.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 4,625%, scadenza 15/06/2025	3.875	0,33	
11.635	CommScope Inc, 144A, 7,125%, scadenza 01/07/2028	6.494	0,55	7.500	Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250%, scadenza 15/05/2025	7.394	0,62	
6.860	Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000%, scadenza 01/10/2028	5.147	0,43	5.955	Vontier Corp, 1,800%, scadenza 01/04/2026	5.354	0,45	
1.800	Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125%, scadenza 31/12/2024	1.755	0,15	5.240	Vontier Corp, 2,400%, scadenza 01/04/2028	4.375	0,37	
10.105	Credit Acceptance Corp, 6,625%, scadenza 15/03/2026	9.847	0,83	13.920	Vontier Corp, 2,950%, scadenza 01/04/2031	11.044	0,93	
813	Dell International LLC / EMC Corp, 6,020%, scadenza 15/06/2026	822	0,07	2.531	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500%, scadenza 01/03/2025	2.503	0,21	
3.761	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500%, scadenza 20/10/2025	3.678	0,31			451.531	38,11	
12.530	Devon Energy Corp, 5,600%, scadenza 15/07/2041	11.650	0,98	Zambia — 1,78% (28 febbraio 2023: 1,50%)				
27.582	DISH Network Corp, 3,375%, scadenza 15/08/2026	16.825	1,42	5.970	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875%, scadenza 01/03/2026	5.890	0,50	
2.670	Enviri Corp, 144A, 5,750%, scadenza 31/07/2027	2.318	0,20	15.590	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875%, scadenza 15/10/2027	15.198	1,28	
2.530	FedEx Corp, 0,450%, scadenza 04/05/2029	2.263	0,19			21.088	1,78	
2.390	Ford Motor Credit Co LLC, 3,664%, scadenza 08/09/2024	2.321	0,20	Totale Obbligazioni ed effetti societari (costo 819.427 dollari)				
3.411	Ford Motor Credit Co LLC, 2,300%, scadenza 10/02/2025	3.208	0,27			746.054	62,96	
5.010	Ford Motor Credit Co LLC, 6,950%, scadenza 10/06/2026	5.021	0,42	Obbligazioni ed effetti governativi — 19,05% (28 febbraio 2023: 11,58%)				
6.000	Freedom Mortgage Corp, 144A, 8,250%, scadenza 15/04/2025	5.919	0,50	Brasile — 4,88% (28 febbraio 2023: 3,45%)				
5.215	FS KKR Capital Corp, 3,125%, scadenza 12/10/2028	4.265	0,36	BRL	305.120	Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTN-F, 10,000%, scadenza 01/01/2033	57.868	4,88
3.545	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855%, scadenza 12/02/2026 *	3.291	0,28	Colombia — 4,77% (28 febbraio 2023: 2,95%)				
7.270	Golub Capital BDC Inc, 2,500%, scadenza 24/08/2026	6.395	0,54	COP	278.653.000	TES colombiano, serie B, 7,000%, scadenza 26/03/2031	56.547	4,77
6.560	Golub Capital BDC Inc, 2,050%, scadenza 15/02/2027	5.552	0,47	Perù — 1,92% (28 febbraio 2023: 0,00%)				
13.773	Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125%, scadenza 15/08/2028	12.026	1,02	PEN	86.490	Peru Government Bond, 6,150%, scadenza 12/08/2032	22.700	1,92
4.090	HCA Inc, 5,000%, scadenza 15/03/2024	4.067	0,34	Stati Uniti — 7,48% (28 febbraio 2023: 0,56%)				
11.040	Hyundai Capital America, 144A, 2,000%, scadenza 15/06/2028	9.322	0,79	53.100	Obbligazione a tasso variabile United States Treasury – quando emesso, 4,931%, scadenza 31/01/2025 *	53.183	4,49	
2.247	IRB Holding Corp, 144A, 7,000%, scadenza 15/06/2025	2.249	0,19	37.200	United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 15/02/2033	35.433	2,99	
7.470	KeyBank NA/Cleveland OH, serie BKNT, 5,535%, scadenza 14/06/2024 *	7.320	0,62			88.616	7,48	
6.580	Level 3 Financing Inc, 144A, 3,750%, scadenza 15/07/2029	3.932	0,33	Totale Obbligazioni ed effetti governativi (costo 207.635 dollari)				
1.025	Liberty Interactive LLC, 8,250%, scadenza 01/02/2030	399	0,03	Titoli di prestito — 0,44% (28 febbraio 2023: 0,43%)				
12.100	Main Street Capital Corp, 3,000%, scadenza 14/07/2026	10.741	0,91	5.211	Flutter Financing BV, 8,753%, scadenza 04/07/2028 *	5.221	0,44	
4.633	MasTec Inc, 144A, 4,500%, scadenza 15/08/2028	4.232	0,36	Totale titoli di prestito (costo 5.109 dollari)				
6.945	MicroStrategy Inc, 144A, 6,125%, scadenza 15/06/2028	6.224	0,53			5.221	0,44	
11.300	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500%, scadenza 20/06/2027	11.272	0,95	Organismi di investimento collettivo — 5,18% (28 febbraio 2023: 7,05%)				
8.820	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 8,000%, scadenza 01/02/2026	8.222	0,69	61.400	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	61.400	5,18	
				Totale Organismi di investimento collettivo (costo 61.400\$)				
				Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 1.212.234 dollari)				
						1.156.117	97,57	
				Contratti a termine in valuta estera — 0,22% (28 febbraio 2023: 0,29%)				
				Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)				
						2.658	0,22	

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Futures — 0,52% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	6.156	0,52
Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	1.164.931	98,31
Credit Default Swap — (0,82%) (28 febbraio 2023: (0,07%))		
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	(9.769)	(0,82)
Contratti a termine in valuta estera — (0,95%) (28 febbraio 2023: (1,02%))		
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	(11.294)	(0,95)
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(21.063)	(1,77)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	1.143.868	96,54
Altre attività eccedenti le passività	41.085	3,46
Patrimonio in gestione	1.184.953\$	100,00

– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 481.610.000 dollari ovvero al 40,66% dell'attivo netto.

* Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.

ABBREVIAZIONI:

Perpetual	– Un'obbligazione senza data di scadenza. Le obbligazioni perpetue non sono rimborsabili, ma pagano un flusso costante di interessi.
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.
AUD	– Dollaro australiano
BRL	– Real brasiliano
COP	– Peso colombiano
EUR	– Euro
GBP	– Sterlina britannica
MXN	– Peso messicano
PEN	– Nuovo Sol peruviano

Analisi delle attività totali	% delle attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	89,91
Altri valori mobiliari negoziati in un altro mercato regolamentato	0,43
Organismi di investimento collettivo	5,07
Strumenti finanziari derivati	0,73
Altre attività	3,86
Totale Attività	100,00

Prospetto dei Credit default swap

Controparte	Entità di riferimento – Protezione acquisto/vendita	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Citi	iTraxx Europe, 5,000% - Acquisto	20-giu-2028	104.320	\$ (4.546)
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000% - Vendita	20-giu-2026	15.700	(2.211)
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000% - Vendita	20-dic-2025	3.390	(379)
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000% - Vendita	20-dic-2025	1.605	(179)
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000% - Vendita	20-dic-2025	1.605	(772)
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000% - Vendita	20-dic-2025	3.495	(1.682)
Apprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 1.309\$)				\$ –
Deprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (878\$))				(9.769)
Deprezzamento netto dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 431\$)				\$ (9.769)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)	Valuta vendita (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 2.425	Vendita BRL 11.875	\$ 30
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 64	Vendita EUR 59	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 204	Vendita GBP 160	1
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 13	Vendita HKD 100	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 78	Vendita SGD 105	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto HKD –	Vendita USD –	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto BRL 11.875	Vendita USD 2.503	(107)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto GBP 9	Vendita USD 12	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto EUR 18	Vendita USD 18	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto SGD 147	Vendita USD 109	–
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 9	Vendita SGD 12	–
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto SGD 51	Vendita USD 39	–
13-set-2023	Citi	Acquisto USD 24.086	Vendita KRW 30.900.000	718
13-set-2023	Citi	Acquisto KRW 30.900.000	Vendita USD 23.819	(451)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 822	Vendita EUR 759	(3)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 3.301	Vendita EUR 3.025	19
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD –	Vendita GBP –	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 13	Vendita GBP 10	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 516	Vendita SGD 700	(2)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto USD 466	Vendita SGD 626	1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto SGD 461	Vendita USD 341	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto CNH 10.176	Vendita USD 1.412	(12)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto CZK 710	Vendita USD 32	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto EUR 321	Vendita USD 347	1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto AUD 8.711	Vendita USD 5.695	(48)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto GBP 32.035	Vendita USD 40.791	(209)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto SGD 82.168	Vendita USD 61.146	(304)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto SEK 25.741	Vendita USD 2.414	(61)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto EUR 385.707	Vendita USD 424.345	(5.799)
19-set-2023	Barclays	Acquisto JPY 5.335.000	Vendita USD 37.488	(708)
19-set-2023	JP Morgan	Acquisto JPY 4.938.000	Vendita USD 35.920	(1.877)

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
03-ott-2023	BNY Mellon	Acquisto	BRL	11.655	Vendita	USD	2.370	\$ (29)
19-ott-2023	HSBC	Acquisto	USD	62.800	Vendita	BRL	307.530	1.156
19-ott-2023	HSBC	Acquisto	BRL	110.290	Vendita	USD	22.315	(207)
27-ott-2023	Citi	Acquisto	USD	3.149	Vendita	MXN	53.800	27
27-ott-2023	HSBC	Acquisto	USD	22.525	Vendita	MXN	396.200	(469)
27-ott-2023	HSBC	Acquisto	USD	26.825	Vendita	MXN	460.400	105
27-ott-2023	HSBC	Acquisto	MXN	495.600	Vendita	USD	28.892	(129)
27-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	MXN	414.800	Vendita	USD	24.111	(38)
30-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	12.971	Vendita	COP	55.490.000	(360)
30-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	COP	55.490.000	Vendita	USD	13.700	(369)
07-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	36.319	Vendita	EUR	32.830	600
07-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	EUR	32.830	Vendita	USD	35.831	(112)
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 3.510\$)								\$ 2.658
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (12.389)\$)								(11.294)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (8.879)\$)								\$ (8.636)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
Japan 10 Year Bond (OSE) settembre 2023	Citi	(125)	\$ (126.138)	\$ 1.104
U.S. 10 Year Ultra Note dicembre 2023	Citi	1.933	224.439	2.591
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Citi	1.371	146.590	1.053
U.S. Ultra Bond (CBT) dicembre 2023	Citi	831	107.588	1.408
Apprezzamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				\$ 6.156
Ammortamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (3.704)\$)				-
Apprezzamento netto dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (3.704)\$)				\$ 6.156

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Credit Default Swap

Controparte	Entità di riferimento – Protezione di acquisto/vendita	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Citi	iTraxx Europe, 1,000% – acquisto	20-giu-2028	3.030	\$ 68
Apprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): –\$)				\$ 68
Deprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (37)\$)				–
Apprezzamento netto dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): (37)\$)				\$ 68

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
01-set-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	1.206	Vendita	GBP	970	\$ (23)
01-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	51	Vendita	GBP	40	–
01-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	GBP	780	Vendita	USD	994	(5)
01-set-2023	UBS	Acquisto	GBP	230	Vendita	USD	286	5
11-set-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	460	Vendita	CHF	410	(5)
19-set-2023	Barclays	Acquisto	USD	1.655	Vendita	JPY	231.000	62
19-set-2023	JP Morgan	Acquisto	JPY	231.000	Vendita	USD	1.680	(88)
17-ott-2023	Goldman Sachs	Acquisto	USD	795	Vendita	SEK	8.500	17
17-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	USD	385	Vendita	SEK	4.200	1
17-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	SEK	16.900	Vendita	USD	1.657	(110)
19-ott-2023	HSBC	Acquisto	USD	603	Vendita	BRL	2.940	14
19-ott-2023	HSBC	Acquisto	BRL	1.390	Vendita	USD	276	2
27-ott-2023	Citi	Acquisto	USD	638	Vendita	MXN	10.900	5
27-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	MXN	5.700	Vendita	USD	331	(1)
27-ott-2023	Morgan Stanley	Acquisto	MXN	5.200	Vendita	USD	301	1
30-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	659	Vendita	COP	2.690.000	13
30-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	COP	1.280.000	Vendita	USD	307	1
07-novembre 2023	JP Morgan	Acquisto	USD	1.836	Vendita	EUR	1.660	30
17-novembre 2023	JP Morgan	Acquisto	USD	1.016	Vendita	CNH	7.320	6
17-novembre 2023	National Australia Bank	Acquisto	USD	662	Vendita	CNH	4.830	(4)
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 403\$)								\$ 157
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (379)\$)								(236)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 24\$)								\$ (79)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
E-Mini Nasdaq 100 Index settembre 2023	Citi	(11)	\$ (3.419)	\$ (97)
Euro-Bobl settembre 2023	Citi	15	1.889	(10)
Japan 10 Year Bond (OSE) settembre 2023	Citi	(2)	(2.018)	18
S&P 500 Index settembre 2023	Citi	(14)	(3.161)	(70)
Apprezzamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): 69\$)				\$ 18
Ammortamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (175)\$)				(177)
Deprezzamento netto dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (106)\$)				\$ (159)

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario
Titoli garantiti da ipoteca — 21,15% (28 febbraio 2023: 13,31%)			Stati Uniti — 8,61% (28 febbraio 2023: 12,74%)		
1.551 Pool Fannie Mae 'MA4733', 4,500%, scadenza 01/09/2052	1.472	2,12	5.960 Obbligazione a tasso variabile United States Treasury – quando emesso, 4,931%, scadenza 31/01/2025 *	5.969	8,61
477 Pool Fannie Mae 'MA4785', 5,000%, scadenza 01/10/2052	463	0,67	Totale Obbligazioni ed effetti governativi (costo 43.849 dollari)	42.194	60,90
1.142 Pool Fannie Mae 'MA4841', 5,000%, scadenza 01/12/2052	1.108	1,60	Organismi di investimento collettivo — 5,46% (28 febbraio 2023: 5,60%)		
1.289 Pool Fannie Mae 'MA4842', 5,500%, scadenza 01/12/2052	1.274	1,84	30 Franklin Templeton Global Funds Plc – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund – LM Class US\$ Accumulating	3.787	5,46
548 Pool Freddie Mac 'RA7790', 5,000%, scadenza 01/08/2052	532	0,77	Totale Organismi di investimento collettivo (costo 3.500\$)	3.787	5,46
1.120 Pool Freddie Mac 'SD8245', 4,500%, scadenza 01/09/2052	1.062	1,53	Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 68.855 dollari)	67.273	97,09
728 Pool Freddie Mac 'SD8257', 4,500%, scadenza 01/10/2052	690	1,00	Contratti a termine in valuta estera — 0,38% (28 febbraio 2023: 0,36%)		
587 Pool Freddie Mac 'SD8267', 5,000%, scadenza 01/11/2052	569	0,82	Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	266	0,38
1.795 Pool Freddie Mac 'SD8277', 5,500%, scadenza 01/12/2052	1.775	2,56	Futures — 0,08% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
882 Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500%, scadenza 20/02/2053	874	1,26	Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	55	0,08
1.590 Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500%, scadenza 20/04/2053	1.575	2,27	Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	67.594	97,55
1.102 Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500%, scadenza 20/05/2053	1.092	1,58	Contratti a termine in valuta estera — (3,67%) (28 febbraio 2023: (5,02%))		
1.305 Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000%, scadenza 20/06/2053	1.270	1,83	Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	(2.543)	(3,67)
906 Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500%, scadenza 20/06/2053	897	1,30	Futures — (0,19%) (28 febbraio 2023: (0,41%))		
Totale Titoli garantiti da ipoteca (costo 14.820 dollari)	14.653	21,15	Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	(130)	(0,19)
Obbligazioni ed effetti societari — 9,58% (28 febbraio 2023: 7,90%)			Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(2.673)	(3,86)
Australia — 2,13% (28 febbraio 2023: 4,12%)			Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	64.921	93,69
1.470 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,955%, scadenza 14/03/2025 *	1.473	2,13	Altre attività eccedenti le passività	4.366	6,31
Messico — 3,03% (28 febbraio 2023: 0,00%)			Patrimonio in gestione	69.287\$	100,00
3.390 Petroleos Mexicanos, 6,950%, scadenza 28/01/2060	2.100	3,03			
Stati Uniti — 4,42% (28 febbraio 2023: 3,78%)					
1.420 General Motors Financial Co Inc, 5,400%, scadenza 06/04/2026	1.403	2,02			
370 Guardian Life Global Funding, 144A, 6,403%, scadenza 28/06/2024 *	370	0,53			
1.310 Chevron Corp, 4,450%, scadenza 18/05/2026	1.293	1,87			
Totale Obbligazioni ed effetti societari (costo 84.963 dollari)	6.639	9,58			
Obbligazioni ed effetti governativi — 60,90% (28 febbraio 2023: 73,60%)					
Brasile — 12,72% (28 febbraio 2023: 11,00%)					
BRL 25.420 Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2029	4.976	7,18			
BRL 19.930 Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2031	3.835	5,54			
	8.811	12,72			
Colombia — 9,64% (28 febbraio 2023: 7,24%)					
COP 11.660.000 Colombian TES, serie B, 6,000%, scadenza 28/04/2028	2.442	3,53			
COP 21.610.000 Colombian TES, serie B, 7,000%, scadenza 30/06/2032	4.235	6,11			
	6.677	9,64			
Repubblica Ceca — 5,01% (28 febbraio 2023: 4,84%)					
CZK 94.610 Czech Republic Government Bond, serie 138, 1,750%, scadenza 23/06/2032	3.472	5,01			
Messico — 17,35% (28 febbraio 2023: 20,07%)					
MXN 36.400 Mexican Bonos, serie M, 8,500%, scadenza 18/11/2038	1.983	2,86			
MXN 160.700 Mexican Bonos, serie M, 7,750%, scadenza 13/11/2042	8.055	11,63			
MXN 38.800 Mexican Bonos, serie M, 8,000%, scadenza 07/11/2047	1.980	2,86			
	12.018	17,35			
Africa del Sud — 7,57% (28 febbraio 2023: 8,58%)					
ZAR 33.800 Republic of South Africa Government Bond, serie R214, 6,500%, scadenza 28/02/2041	1.056	1,52			
ZAR 109.500 Republic of South Africa Government Bond, serie 2048, 8,750%, scadenza 28/02/2048	4.191	6,05			
	5.247	7,57			

– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 1.843.000 dollari ovvero allo 2,66% dell'attivo netto.

* Titolo a tasso variabile. Il tasso di interesse evidenziato si riferisce al tasso in vigore al 31 agosto 2023.

ABBREVIAZIONI:

BRL	– Real brasiliano
COP	– Peso colombiano
CZK	– Corona ceca
MXN	– Peso messicano
ZAR	– Rand sudafricano

Analisi delle attività totali

	% delle attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	87,35
Organismi di investimento collettivo	5,21
Strumenti finanziari derivati	0,44
Altre attività	7,00
Totale Attività	100,00

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)	Valuta vendita (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)	
01-set-2023	JP Morgan	Acquisto	GBP 5.650	Vendita USD 7.023	\$ 134
11-set-2023	Barclays	Acquisto	USD 18.456	Vendita CHF 16.610	(369)
11-set-2023	Barclays	Acquisto	INR 182.000	Vendita USD 2.210	(11)
13-set-2023	Citi	Acquisto	KRW 3.060.000	Vendita USD 2.359	(45)
14-set-2023	HSBC	Acquisto	THB 80.700	Vendita USD 2.338	(30)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 2.387	Vendita AUD 3.702	(13)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD –	Vendita GBP –	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 3	Vendita SGD 4	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD 109.084	Vendita USD 71.318	(598)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP 3	Vendita USD 4	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD 103	Vendita USD 76	–
19-set-2023	JP Morgan	Acquisto	JPY 2.584.000	Vendita USD 18.797	(982)

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)		Valuta vendita (in migliaia)		Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)		
25-set-2023	Barclays	Acquisto	MYR	7.900	Vendita	USD	1.710	\$ (4)
26-set-2023	Barclays	Acquisto	NZD	6.690	Vendita	USD	4.148	(158)
29-set-2023	Morgan Stanley	Acquisto	NOK	33.500	Vendita	USD	3.205	(52)
23-ott-2023	Citi	Acquisto	MXN	34.800	Vendita	USD	2.038	(17)
25-ott-2023	Citi	Acquisto	CAD	9.670	Vendita	USD	7.357	(195)
30-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	2.148	Vendita	COP	8.770.000	41
08-novembre 2023	HSBC	Acquisto	CLP	5.440.000	Vendita	USD	6.402	(65)
15-novembre 2023	HSBC	Acquisto	USD	538	Vendita	ZAR	10.300	(4)
16-novembre 2023	HSBC	Acquisto	USD	3.389	Vendita	CZK	74.900	25
06-dic-2023	JP Morgan	Acquisto	AUD	2.460	Vendita	USD	1.587	12
08-dic-2023	JP Morgan	Acquisto	GBP	5.650	Vendita	USD	7.104	54
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 249\$)							\$	266
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (3.482)\$)								(2.543)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (3.233)\$)							\$	(2.277)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
Euro-Buxl 30 Year Bond settembre 2023	Morgan Stanley	70	\$ 10.156	\$ (130)
Long Gilt dicembre 2023	Morgan Stanley	41	4.964	55
Apprezzamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				\$ 55
Ammortamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (283)\$)				(130)
Deprezzamento netto dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (283)\$)				\$ (75)

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del valore netto d'inventario				
Titoli garantiti da ipoteca — 8,32% (28 febbraio 2023: 18,58%)									
329	Pool Fannie Mae 'MA4733', 4,500%, scadenza 01/09/2052	312	2,04	60	Civitas Resources Inc, 144A, 8,375%, scadenza 01/07/2028	62	0,40		
235	Pool Freddie Mac 'SD8245', 4,500%, scadenza 01/09/2052	223	1,46	150	CNX Resources Corp, 144A, 7,250%, scadenza 14/03/2027	150	0,98		
161	Pool Freddie Mac 'SD8257', 4,500%, scadenza 01/10/2052	153	0,99	155	Ecopetrol SA, 4,125%, scadenza 16/01/2025	151	0,98		
600	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, serie 2021 DNA7, classe M2, 144A, 7,088%, scadenza 25/11/2041 *	587	3,83	120	Energion Israel Finance Ltd, 144A, 4,875%, scadenza 30/03/2026	113	0,74		
Totale titoli garantiti da ipoteca (costo 1.271 dollari)		1.275	8,32	40	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,125%, scadenza 30/06/2025	39	0,26		
Obbligazioni ed effetti societari — 46,48% (28 febbraio 2023: 59,55%)									
Compagnie aeree — 1,56% (28 febbraio 2023: 1,76%)									
122	Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 4,800%, scadenza 15/08/2027	118	0,78	140	Occidental Petroleum Corp, 6,125%, scadenza 01/01/2031	141	0,92		
120	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500%, scadenza 20/06/2027	120	0,78	140	Talos Production Inc, 12,000%, scadenza 15/01/2026	146	0,95		
		238	1,56	165	Teine Energy Ltd, 144A, 6,875%, scadenza 15/04/2029	153	1,00		
Case automobilistiche — 3,47% (28 febbraio 2023: 4,84%)									
190	General Motors Co, 5,600%, scadenza 15/10/2032	183	1,20			1.106	7,22		
185	Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750%, scadenza 09/03/2028	156	1,02	Imballaggi e contenitori — 2,02% (28 febbraio 2023: 2,04%)					
EUR 195	Volvo Car AB, 2,500%, scadenza 07/10/2027	192	1,25	90	Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125%, scadenza 15/08/2028	79	0,51		
		531	3,47	85	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC, 144A, 4,000%, scadenza 15/10/2027	76	0,50		
Banche — 7,45% (28 febbraio 2023: 7,54%)									
200	Banco do Brasil SA/Cayman, 144A, 6,250%, scadenza 18/04/2030	199	1,30	175	Sealed Air Corp, 144A, 1,573%, scadenza 15/10/2026	154	1,01		
155	Bank of America Corp, 2,456%, scadenza 22/10/2025 *	149	0,97			309	2,02		
EUR 200	BNP Paribas SA, 0,375%, scadenza 14/10/2027 *	193	1,26	Gasdotti — 1,91% (28 febbraio 2023: 1,98%)					
220	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855%, scadenza 12/02/2026 *	204	1,34	55	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742%, scadenza 31/12/2039	43	0,28		
200	JPMorgan Chase & Co, 0,768%, scadenza 09/08/2025 *	190	1,24	155	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500%, scadenza 30/09/2026	144	0,94		
215	UBS AG/Londra, 144A, 0,700%, scadenza 09/08/2024	205	1,34	105	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125%, scadenza 01/06/2028	106	0,69		
		1.140	7,45			293	1,91		
Servizi finanziari diversificati — 2,33% (28 febbraio 2023: 3,70%)									
160	Air Lease Corp, 0,800%, scadenza 18/08/2024	152	0,99	Semiconduttori — 1,21% (28 febbraio 2023: 1,21%)					
225	XP Inc, 144A, 3,250%, scadenza 01/07/2026	205	1,34	235	Micron Technology Inc, 2,703%, scadenza 15/04/2032	186	1,21		
		357	2,33	Trasporti — 1,29% (28 febbraio 2023: 1,25%)					
Ambito elettrico — 1,35% (28 febbraio 2023: 1,42%)									
238	AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375%, scadenza 31/05/2030	206	1,35	EUR 220	FedEx Corp, 0,450%, scadenza 04/05/2029	197	1,29		
Elettronica — 2,03% (28 febbraio 2023: 2,06%)									
170	Jabil Inc, 3,600%, scadenza 15/01/2030	152	0,99	Acqua — 0,96% (28 febbraio 2023: 1,00%)					
190	Vontier Corp, 2,400%, scadenza 01/04/2028	159	1,04	150	Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625%, scadenza 01/04/2026	148	0,96		
		311	2,03			7.118	46,48		
Energia — Fonti alternative — 1,20% (28 febbraio 2023: 1,17%)									
EUR 205	Vestas Wind Systems Finance BV, 2,000%, scadenza 15/06/2034	184	1,20	Totale Obbligazioni ed effetti societari (costo 7.101 dollari)					
Ingegneria ed edilizia — 0,75% (28 febbraio 2023: 0,75%)									
120	Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000%, scadenza 01/02/2026	115	0,75	Obbligazioni ed effetti governativi — 35,85% (28 febbraio 2023: 10,56%)					
Alimentari — 2,09% (28 febbraio 2023: 3,42%)									
135	Co-Operative Group Ltd, 5,125%, scadenza 17/05/2024	169	1,11	Sovrano — 35,85% (28 febbraio 2023: 10,56%)					
155	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc, 5,125%, scadenza 01/02/2028	151	0,98	BRL 640	Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTNF, 10,000%, scadenza 01/01/2031	123	0,80		
		320	2,09	BRL 3.370	Brazil Notas do Tesouro Nacional serie F, serie NTNF, 10,000%, scadenza 01/01/2033	639	4,17		
Servizi sanitari: 1,96% (28 febbraio 2023: 2,03%)									
160	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000%, scadenza 15/03/2026	156	1,02	COP 3.623.000	TES colombiano, serie B, 7,000%, scadenza 26/03/2031	736	4,80		
145	HCA Inc, 5,000%, scadenza 15/03/2024	144	0,94	200	Export-Import Bank of India, 144A, 5,500%, scadenza 18/01/2033	197	1,29		
		300	1,96	3.790	Obbligazione a tasso variabile United States Treasury – quando emesso, 4,931%, scadenza 31/01/2025 *	3.796	24,79		
Società di investimento — 1,53% (28 febbraio 2023: 2,59%)									
135	Ares Capital Corp, 2,150%, scadenza 15/07/2026	119	0,78			5.491	35,85		
130	Main Street Capital Corp, 3,000%, scadenza 14/07/2026	115	0,75	Totale Obbligazioni ed effetti governativi (costo 5.238 dollari)					
		234	1,53	Organismi di investimento collettivo — 6,08% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
Estrazione — 3,41% (28 febbraio 2023: 3,46%)									
220	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875%, scadenza 15/10/2027	214	1,40	931	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	931	6,08		
175	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375%, scadenza 01/04/2031	147	0,96	Totale Organismi di investimento collettivo (costo 931\$)					
175	Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000%, scadenza 15/02/2026	162	1,05	Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 14.541 dollari)					
		523	3,41	Credit Default Swap — 0,03% (28 febbraio 2023: 0,22%)					
Multinazionale — 2,74% (28 febbraio 2023: 3,87%)									
MXN 4.040	International Bank for Reconstruction & Development, 4,250%, scadenza 22/01/2026	207	1,35			4	0,03		
BRL 1.150	International Bank for Reconstruction & Development, 5,000%, scadenza 22/01/2026	213	1,39	Contratti a termine in valuta estera — 0,25% (28 febbraio 2023: 0,58%)					
		420	2,74			38	0,25		
Petrolio e gas — 7,22% (28 febbraio 2023: 8,11%)									
150	Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250%, scadenza 15/02/2026	151	0,99	Futures — 0,43% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
						66	0,43		
Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico						14.923	97,44		
Credit Default Swap — (0,27%) (28 febbraio 2023: 0,00%)						(41)	(0,27)		
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)						(74)	(0,49)		
Contratti a termine in valuta estera — (0,49%) (28 febbraio 2023: (0,43%))						(115)	(0,76)		
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)						14.808	96,68		
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico						508	3,32		
Altre attività eccedenti le passività						15.316\$	100,00		
Patrimonio in gestione									

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

ABBREVIAZIONI:

REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.
BRL	– Real brasiliano
COP	– Peso colombiano
EUR	– Euro
GBP	– Sterlina britannica
MXN	– Peso messicano

Analisi delle attività totali

Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	89,56
Organismi di investimento collettivo	6,01
Strumenti finanziari derivati	0,70
Altre attività	3,73
Totale Attività	100,00

Prospetto dei Credit Default Swap

Controparte	Entità di riferimento – Protezione di acquisto/vendita	Data di scadenza	Importo nozionale (in migliaia)	Valore (in migliaia)
Citi	CDX.NA.HY, 5,000% - Acquisto	20-giu-2028	1.480	\$ (41)
Citi	CDX.NA.HY, 5,000% - Vendita	20-dic-2023	1.350	4
Apprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 33\$)				\$ 4
Deprezzamento non realizzato dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				(41)
Deprezzamento netto dei Credit Default Swap (28 febbraio 2023 (in migliaia): 33\$)				\$ (37)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)		Valuta vendita (in migliaia)		Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
01-set-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	149	Vendita	GBP 120 \$ (3)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	98	Vendita	USD 108 (1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	20	Vendita	USD 26 –
19-set-2023	Barclays	Acquisto	JPY	14.000	Vendita	USD 98 (2)
19-set-2023	Citi	Acquisto	JPY	53.000	Vendita	USD 388 (22)
19-set-2023	JP Morgan	Acquisto	JPY	64.000	Vendita	USD 466 (24)
19-ott-2023	HSBC	Acquisto	USD	1.008	Vendita	BRL 4.930 19
19-ott-2023	HSBC	Acquisto	BRL	1.410	Vendita	USD 285 (3)
27-ott-2023	Citi	Acquisto	USD	211	Vendita	MXN 3.600 2
27-ott-2023	HSBC	Acquisto	USD	344	Vendita	MXN 5.900 1
27-ott-2023	HSBC	Acquisto	USD	290	Vendita	MXN 5.100 (6)
27-ott-2023	HSBC	Acquisto	MXN	6.200	Vendita	USD 361 (1)
27-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	MXN	5.300	Vendita	USD 308 –
30-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	171	Vendita	COP 730.000 (5)
30-ott-2023	JP Morgan	Acquisto	COP	730.000	Vendita	USD 180 (5)
07-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	940	Vendita	EUR 850 16
07-nov-2023	JP Morgan	Acquisto	EUR	180	Vendita	USD 196 (1)
08-dic-2023	JP Morgan	Acquisto	USD	138	Vendita	GBP 110 (1)
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 86\$)						\$ 38
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (64)\$)						(74)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 22\$)						\$ (36)

Prospetto dei contratti futures

	Controparte	Valore nominale	Valore nozionale (in migliaia)	Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
U.S. 10 Year Ultra Note dicembre 2023	Citi	29	\$ 3.367	\$ 34
U.S. 5 Year Note (CBT) dicembre 2023	Citi	18	1.925	14
U.S. Ultra Bond (CBT) dicembre 2023	Citi	11	1.424	18
Apprezzamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)				\$ 66
Ammortamento non realizzato dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (123)\$)				–
Apprezzamento netto dei contratti futures (28 febbraio 2023 (in migliaia): (123)\$)				\$ 66

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF ClearBridge Value Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario
Azioni ordinarie — 93,83% (28 febbraio 2023: 99,17%)		
Compagnie aeree — 1,29% (28 febbraio 2023: 0,82%)		
248 United Airlines Holdings Inc	12.344	1,29
Banche — 5,21% (28 febbraio 2023: 10,33%)		
1.210 First Horizon Corp	15.175	1,58
51 Goldman Sachs Group Inc/The	16.768	1,75
437 Wells Fargo & Co	18.045	1,88
	49.988	5,21
Bevande — 1,32% (28 febbraio 2023: 1,17%)		
48 Constellation Brands Inc 'A'	12.631	1,32
Biotecnologie — 4,38% (28 febbraio 2023: 5,57%)		
57 Biogen Inc	15.137	1,58
100 BioNTech SE ADR	12.129	1,26
193 Gilead Sciences Inc	14.770	1,54
	42.036	4,38
Prodotti chimici — 2,62% (28 febbraio 2023: 2,02%)		
EUR 51 Air Liquide SA	9.266	0,97
186 Eastman Chemical Co	15.816	1,65
	25.082	2,62
Carbone — 0,66% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
152 Teck Resources Ltd	6.298	0,66
Servizi commerciali — 1,09% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
182 Block Inc	10.490	1,09
Cosmetici e cura della persona — 1,90% (28 febbraio 2023: 2,71%)		
868 Coty Inc 'A'	10.046	1,05
GBP 1.992 Haleon Plc	8.158	0,85
	18.204	1,90
Distribuzione e commercio all'ingrosso — 1,36% (28 febbraio 2023: 1,10%)		
JPY 799 Marubeni Corp	13.023	1,36
Servizi finanziari diversificati — 3,43% (28 febbraio 2023: 2,60%)		
200 Apollo Global Management Inc	17.473	1,82
151 Capital One Financial Corp	15.464	1,61
	32.937	3,43
Ambito elettrico — 6,89% (28 febbraio 2023: 6,47%)		
840 AES Corp/The	15.070	1,57
154 American Electric Power Co Inc	12.098	1,26
197 Constellation Energy Corp	20.555	2,14
585 Vistra Corp	18.374	1,92
	66.097	6,89
Elettronica — 0,95% (28 febbraio 2023: 1,32%)		
242 Sensata Technologies Holding Plc	9.110	0,95
Energia — Fonti alternative — 1,09% (28 febbraio 2023: 1,79%)		
399 Fluence Energy Inc	10.502	1,09
Controllo ambientale — 1,01% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
57 Clean Harbors Inc	9.686	1,01
Servizi sanitari — 2,42% (28 febbraio 2023: 2,09%)		
49 UnitedHealth Group Inc	23.204	2,42
Assicurazioni — 8,14% (28 febbraio 2023: 7,60%)		
476 American International Group Inc	27.844	2,90
582 Equitable Holdings Inc	16.751	1,75
47 Everest Group Ltd	16.911	1,76
943 MGIC Investment Corp	16.566	1,73
	78.072	8,14
Internet — 5,79% (28 febbraio 2023: 6,89%)		
HKD 760 Alibaba Group Holding Ltd	8.828	0,92
103 Expedia Group Inc	11.176	1,16
47 Meta Platforms Inc 'A'	13.970	1,46
456 Uber Technologies Inc	21.540	2,25
	55.514	5,79
Ricettività — 2,01% (28 febbraio 2023: 2,97%)		
196 Las Vegas Sands Corp	10.737	1,12
193 MGM Resorts International	8.498	0,89
	19.235	2,01
Macchinari — Diversificati — 1,65% (28 febbraio 2023: 1,57%)		
570 CNH Industrial NV	7.852	0,82
201 Flowserve Corp	7.945	0,83
	15.797	1,65
Estrazione — 3,86% (28 febbraio 2023: 5,43%)		
595 Freeport-McMoRan Inc	23.757	2,48

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario
118 Royal Gold Inc	13.219	1,38
	36.976	3,86
Produzione varia — 1,57% (28 febbraio 2023: 1,21%)		
EUR 100 Siemens AG	15.074	1,57
Petrolio e gas — 10,54% (28 febbraio 2023: 9,97%)		
408 APA Corp	17.856	1,86
487 EQT Corp	21.055	2,20
497 Noble Corp Plc	26.220	2,73
110 Pioneer Natural Resources Co	26.044	2,72
157 TotalEnergies SE ADR	9.892	1,03
	101.067	10,54
Servizi petroliferi e del gas — 3,03% (28 febbraio 2023: 3,46%)		
481 Baker Hughes Co 'A'	17.401	1,81
198 Schlumberger NV	11.682	1,22
	29.083	3,03
Farmaceutici — 6,26% (28 febbraio 2023: 4,16%)		
74 AbbVie Inc	10.932	1,14
197 AstraZeneca Plc ADR	13.351	1,39
221 Johnson & Johnson	35.785	3,73
	60.068	6,26
Gasdotti — 1,88% (28 febbraio 2023: 1,90%)		
515 Enbridge Inc	18.070	1,88
Immobili — 0,79% (28 febbraio 2023: 0,86%)		
97 Howard Hughes Holdings Inc	7.596	0,79
Vendita al dettaglio — 1,25% (28 febbraio 2023: 0,78%)		
168 Bloomin' Brands Inc	4.725	0,49
59 Ross Stores Inc	7.222	0,76
	11.947	1,25
Semiconduttori — 3,29% (28 febbraio 2023: 2,44%)		
252 Micron Technology Inc	17.640	1,84
149 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	13.957	1,45
	31.597	3,29
Software — 5,49% (28 febbraio 2023: 5,91%)		
147 Fiserv Inc	17.853	1,86
34 Microsoft Corp	11.177	1,16
197 Oracle Corp	23.658	2,47
	52.688	5,49
Trasporti — 2,66% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
140 Canadian Pacific Kansas City Ltd	11.100	1,16
65 Union Pacific Corp	14.381	1,50
	25.481	2,66
Totale azioni ordinarie (costo 793.686 dollari)	899.897	93,83
Fondi di investimento immobiliare — 1,48% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
REITS — 1,48% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
78 American Tower Corp	14.176	1,48
Totale fondi di investimento immobiliare (costo 14.643 dollari)	14.176	1,48
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 808.329 dollari)	914.073	95,31
Contratti a termine in valuta estera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	28	—
Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	914.101	95,31
Contratti a termine in valuta estera — (0,16%) (28 febbraio 2023: (0,10%))		
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	(1.547)	(0,16)
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(1.547)	(0,16)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	912.554	95,15
Altre attività eccedenti le passività	46.519	4,85
Patrimonio in gestione	959.073\$	100,00

— Gli importi indicati con “—” sono pari a 0\$, inferiori a 1.000\$, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

ABBREVIAZIONI:

ADR	— Ricevuta di deposito americana
EUR	— Euro
GBP	— Sterlina britannica
HKD	— Dollaro di Hong Kong
JPY	— Yen giapponese

FTGF ClearBridge Value Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

	% delle attività totali
Analisi delle attività totali	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	94,97
Strumenti finanziari derivati	–
Altre attività	5,03
Totale Attività	100,00

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	81	Vendita	EUR	75	\$ 1
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	183	Vendita	SGD	247	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	24	Vendita	USD	26	–
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	47	Vendita	SGD	63	–
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	–	Vendita	USD	–	–
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	–	Vendita	USD	–	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	5.179	Vendita	EUR	4.749	25
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	13	Vendita	EUR	12	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	58	Vendita	SGD	78	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	5	Vendita	USD	4	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	1.991	Vendita	USD	1.482	(7)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	102.031	Vendita	USD	112.257	(1.540)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	528	Vendita	USD	571	2
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 10\$)							\$	28
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (976)\$)								(1.547)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (966)\$)							\$	(1.519)

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario	Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario
Azioni ordinarie — 98,22% (28 febbraio 2023: 93,97%)			Produzione varia — 1,12% (28 febbraio 2023: 1,03%)		
Banche — 4,04% (28 febbraio 2023: 5,28%)			10 Eaton Corp Plc	2.229	1,12
60 Bank of America Corp	1.708	0,86	Petrolio e gas — 1,43% (28 febbraio 2023: 1,53%)		
32 JPMorgan Chase & Co	4.643	2,34	12 Pioneer Natural Resources Co	2.841	1,43
46 US Bancorp	1.667	0,84	Imballaggi e contenitori — 0,58% (28 febbraio 2023: 0,65%)		
	8.018	4,04	21 Ball Corp	1.150	0,58
Bevande — 2,67% (28 febbraio 2023: 2,85%)			Farmaceutici — 9,91% (28 febbraio 2023: 9,05%)		
39 Coca-Cola Co/The	2.324	1,17	12 AbbVie Inc	1.708	0,86
17 PepsiCo Inc	2.982	1,50	12 Becton Dickinson & Co	3.260	1,64
	5.306	2,67	7 Eli Lilly & Co	3.664	1,84
Materiali da costruzione — 0,95% (28 febbraio 2023: 0,85%)			26 Johnson & Johnson	4.279	2,16
9 Vulcan Materials Co	1.880	0,95	48 Merck & Co Inc	5.250	2,64
Prodotti chimici — 4,54% (28 febbraio 2023: 4,64%)			43 Pfizer Inc	1.528	0,77
11 Air Products & Chemicals Inc	3.116	1,57		19.689	9,91
8 Ecolab Inc	1.520	0,77	Gasdotti — 0,68% (28 febbraio 2023: 0,73%)		
19 PPG Industries Inc	2.747	1,38	78 Kinder Morgan Inc	1.348	0,68
6 Sherwin-Williams Co/The	1.639	0,82	Vendita al dettaglio — 6,03% (28 febbraio 2023: 5,87%)		
	9.022	4,54	2 Costco Wholesale Corp	1.243	0,62
Servizi commerciali — 2,29% (28 febbraio 2023: 2,23%)			9 Home Depot Inc/The	2.914	1,47
16 Automatic Data Processing Inc	4.116	2,07	57 TJX Cos Inc/The	5.258	2,65
7 PayPal Holdings Inc	436	0,22	16 Walmart Inc	2.569	1,29
	4.552	2,29		11.984	6,03
Computer — 6,69% (28 febbraio 2023: 5,41%)			Semiconduttori — 3,60% (28 febbraio 2023: 1,79%)		
71 Apple Inc	13.285	6,69	3 ASML Holding NV	1.961	0,99
Cosmetici e cura della persona — 1,52% (28 febbraio 2023: 1,47%)			13 Marvell Technology Inc	738	0,37
20 Procter & Gamble Co/The	3.019	1,52	9 NVIDIA Corp	4.444	2,24
Servizi finanziari diversificati — 4,83% (28 febbraio 2023: 4,58%)				7.143	3,60
9 CME Group Inc	1.851	0,93	Software — 11,69% (28 febbraio 2023: 9,29%)		
15 Intercontinental Exchange Inc	1.809	0,91	6 Adobe Inc	3.469	1,75
24 Visa Inc 'A'	5.940	2,99	50 Microsoft Corp	16.408	8,26
	9.600	4,83	28 Oracle Corp	3.339	1,68
Ambito elettrico — 1,18% (28 febbraio 2023: 1,27%)				23.216	11,69
16 NextEra Energy Inc	1.101	0,56	Telecomunicazioni — 1,20% (28 febbraio 2023: 2,55%)		
18 Sempra	1.233	0,62	7 Arista Networks Inc	1.387	0,70
	2.334	1,18	7 T-Mobile US Inc	992	0,50
Componenti elettrici e apparecchiature — 1,27% (28 febbraio 2023: 0,89%)				2.379	1,20
26 Emerson Electric Co	2.524	1,27	Trasporti — 2,50% (28 febbraio 2023: 2,88%)		
Elettronica — 2,22% (28 febbraio 2023: 2,46%)			17 Canadian Pacific Kansas City Ltd	1.362	0,69
23 Honeywell International Inc	4.411	2,22	4 Union Pacific Corp	915	0,46
Controllo ambientale — 1,62% (28 febbraio 2023: 1,68%)			16 United Parcel Service Inc 'B'	2.685	1,35
20 Waste Management Inc	3.210	1,62		4.962	2,50
Alimentari — 1,30% (28 febbraio 2023: 1,29%)			Totale azioni ordinarie (costo 141.191 dollari)	195.077	98,22
4 McCormick & Co Inc/MD	355	0,18	Fondi di investimento immobiliare — 1,11% (28 febbraio 2023: 1,32%)		
31 Mondelez International Inc	2.224	1,12	REITS — 1,11% (28 febbraio 2023: 1,32%)		
	2.579	1,30	12 American Tower Corp	2002	1,11
Prodotti sanitari — 2,79% (28 febbraio 2023: 3,08%)			Totale Società d'investimento immobiliare (costo \$2.146)	2002	1,11
7 Stryker Corp	1.886	0,95	Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 143.337 dollari)	197.279	99,33
7 Thermo Fisher Scientific Inc	3.658	1,84	Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	197.279	99,33
	5.544	2,79	Contratti a termine in valuta estera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Servizi sanitari — 2,58% (28 febbraio 2023: 3,11%)			Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	—	—
11 UnitedHealth Group Inc	5.133	2,58	Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	—	—
Assicurazioni — 7,64% (28 febbraio 2023: 7,66%)			Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	197.279	99,33
— Berkshire Hathaway Inc	7.647	3,85	Altre attività eccedenti le passività	1.325	0,67
16 Hartford Financial Services Group Inc/The	1.126	0,56	Patrimonio in gestione	198.604\$	100,00
21 Progressive Corp/The	2.739	1,38			
23 Travelers Cos Inc/The	3.669	1,85			
	15.181	7,64			
Internet — 8,95% (28 febbraio 2023: 5,69%)					
25 Alphabet Inc	3.377	1,70			
29 Alphabet Inc 'A'	4.006	2,02			
43 Amazon.com Inc	5.943	2,99			
8 Meta Platforms Inc 'A'	2.267	1,14			
5 Netflix Inc	2.179	1,10			
	17.772	8,95			
Ferro/Acciaio — 0,71% (28 febbraio 2023: 1,09%)					
53 ArcelorMittal SA	1.415	0,71			
Media — 1,69% (28 febbraio 2023: 1,98%)					
56 Comcast Corp	2.612	1,32			
9 Walt Disney Co/The	739	0,37			
	3.351	1,69			

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)		Valuta vendita (in migliaia)		Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)			
		Acquisto	EUR	Vendita	USD				
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	20	Vendita	USD	22	\$	–
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): –\$)								\$	–
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): –\$)								\$	–
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): –\$)								\$	–

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario
Azioni ordinarie — 96,57% (28 febbraio 2023: 94,00%)		
Abbigliamento — 1,50% (28 febbraio 2023: 2,34%)		
227 NIKE Inc	23.055	1,50
Case automobilistiche — 0,82% (28 febbraio 2023: 0,78%)		
49 Tesla Inc	12.569	0,82
Componenti per auto e apparecchiature — 1,16% (28 febbraio 2023: 1,59%)		
176 Aptiv Plc	17.893	1,16
Bevande — 2,19% (28 febbraio 2023: 2,54%)		
586 Monster Beverage Corp	33.651	2,19
Prodotti chimici — 1,76% (28 febbraio 2023: 1,40%)		
100 Sherwin-Williams Co/The	27.062	1,76
Servizi commerciali — 3,49% (28 febbraio 2023: 4,38%)		
307 PayPal Holdings Inc	19.168	1,25
88 S&P Global Inc	34.504	2,24
	53.672	3,49
Computer — 4,92% (28 febbraio 2023: 4,50%)		
403 Apple Inc	75.784	4,92
Cosmetici e cura della persona — 1,15% (28 febbraio 2023: 1,77%)		
110 Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	17.692	1,15
Distribuzione e commercio all'ingrosso — 2,23% (28 febbraio 2023: 2,87%)		
48 WW Grainger Inc	34.348	2,23
Servizi finanziari diversificati — 4,84% (28 febbraio 2023: 5,87%)		
303 Visa Inc 'A'	74.558	4,84
Ambito elettrico — 1,04% (28 febbraio 2023: 0,97%)		
241 NextEra Energy Inc	16.075	1,04
Elettronica — 1,43% (28 febbraio 2023: 2,13%)		
117 Honeywell International Inc	21.978	1,43
Prodotti sanitari — 7,45% (28 febbraio 2023: 8,51%)		
342 Alcon Inc	28.353	1,84
102 Intuitive Surgical Inc	31.839	2,07
83 Stryker Corp	23.420	1,52
56 Thermo Fisher Scientific Inc	31.163	2,02
	114.775	7,45
Servizi sanitari — 3,15% (28 febbraio 2023: 3,99%)		
102 UnitedHealth Group Inc	48.503	3,15
Assicurazioni — 1,65% (28 febbraio 2023: 1,78%)		
131 Marsh & McLennan Cos Inc	25.459	1,65
Internet — 19,28% (28 febbraio 2023: 16,25%)		
822 Amazon.com Inc	113.424	7,36
217 Meta Platforms Inc 'A'	64.159	4,17
116 Netflix Inc	50.226	3,26
148 Palo Alto Networks Inc	36.037	2,34
92 Sea Ltd ADR	3.466	0,22
629 Uber Technologies Inc	29.720	1,93
	297.032	19,28
Produzione varia — 2,26% (28 febbraio 2023: 2,55%)		
151 Eaton Corp Plc	34.801	2,26
Farmaceutici — 4,33% (28 febbraio 2023: 4,30%)		
219 Dexcom Inc	22.114	1,43
31 Eli Lilly & Co	17.129	1,11
144 Zoetis Inc	27.510	1,79
	66.753	4,33
Vendita al dettaglio — 0,22% (28 febbraio 2023: 1,08%)		
27 Target Corp	3.429	0,22
Semiconduttori — 10,51% (28 febbraio 2023: 7,23%)		
40 ASML Holding NV	26.703	1,73
354 Intel Corp	12.427	0,81
249 NVIDIA Corp	122.825	7,97
	161.955	10,51
Software — 18,70% (28 febbraio 2023: 15,08%)		
69 Adobe Inc	38.604	2,51
96 Atlassian Corp	19.645	1,28
39 Intuit Inc	20.856	1,35
371 Microsoft Corp	121.584	7,89
164 Salesforce Inc	36.248	2,35
179 Splunk Inc	21.704	1,41
129 Unity Software Inc	4.778	0,31
101 Workday Inc 'A'	24.670	1,60
	288.089	18,70

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario
Trasporti — 2,49% (28 febbraio 2023: 2,09%)		
72 Union Pacific Corp	15.815	1,03
133 United Parcel Service Inc 'B'	22.554	1,46
	38.369	2,49
Totale azioni ordinarie (costo 1.082.310 dollari)	1.487.502	96,57
Fondi di investimento immobiliare — 1,59% (28 febbraio 2023: 1,68%)		
REITS — 1,59% (28 febbraio 2023: 1,68%)		
31 Equinix Inc	24.592	1,59
Totale Società d'investimento immobiliare (costo 15.492\$)	24.592	1,59
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 1.097.802 dollari)	1.512.094	98,16
Contratti a termine in valuta estera — 0,02% (28 febbraio 2023: 0,02%)		
Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	280	0,02
Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	1.512.374	98,18
Contratti a termine in valuta estera — (0,15%) (28 febbraio 2023: (0,12%))		
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	(2.302)	(0,15)
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(2.302)	(0,15)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	1.510.072	98,03
Altre attività eccedenti le passività	30.309	1,97
Patrimonio in gestione	1.540.381\$	100,00

— Gli importi indicati con "—" sono pari a 0\$, inferiori a 1.000\$, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori a 0,01%.

ABBREVIAZIONI:

ADR — Ricevuta di deposito americana

	% delle attività totali
Analisi delle attività totali	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	97,05
Strumenti finanziari derivati	0,02
Altre attività	2,93
Totale Attività	100,00

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1.538	Vendita	BRL	7.653	\$ (7)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	20.328	Vendita	BRL	99.536	244
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	15	Vendita	EUR	14	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	211	Vendita	GBP	166	1
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	74	Vendita	USD	80	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	BRL	107.189	Vendita	USD	22.596	(968)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	36	Vendita	USD	47	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	2.981	Vendita	EUR	2.716	35
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	45	Vendita	EUR	42	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	71.651	Vendita	USD	78.825	(1.074)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	96	Vendita	USD	102	–
03-ott-2023	BNY Mellon	Acquisto	BRL	101.184	Vendita	USD	20.578	(253)
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 286\$)								\$ 280
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1.551)\$)								(2.302)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1.265)\$)								\$ (2.022)

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$ d'inventario	% del valore netto
Azioni ordinarie — 98,84% (28 febbraio 2023: 95,22%)		
Bevande — 1,97% (28 febbraio 2023: 1,70%)		
26 Diageo Plc ADR	4.254	1,97
Biotechologie — 14,62% (28 febbraio 2023: 14,46%)		
28 Biogen Inc	7.524	3,48
103 Ionis Pharmaceuticals Inc	4.136	1,92
56 Ultragenyx Pharmaceutical Inc	2.058	0,95
51 Vertex Pharmaceuticals Inc	17.851	8,27
	31.569	14,62
Materiali da costruzione — 3,49% (28 febbraio 2023: 3,56%)		
128 Johnson Controls International plc	7.533	3,49
Computer — 7,94% (28 febbraio 2023: 6,43%)		
12 Accenture Plc 'A'	3.786	1,75
56 CrowdStrike Holdings Inc	9.107	4,22
41 Seagate Technology Holdings Plc	2.891	1,34
30 Western Digital Corp	1.368	0,63
	17.152	7,94
Servizi finanziari diversificati — 0,63% (28 febbraio 2023: 0,67%)		
21 Cohen & Steers Inc	1.356	0,63
Elettronica — 4,94% (28 febbraio 2023: 6,57%)		
81 TE Connectivity Ltd	10.676	4,94
Intrattenimento — 3,98% (28 febbraio 2023: 4,72%)		
53 Madison Square Garden Entertainment Corp 'A'	1.692	0,78
39 Madison Square Garden Sports Corp	6.909	3,20
	8.601	3,98
Prodotti sanitari — 1,52% (28 febbraio 2023: 2,10%)		
17 Insulet Corp	3.274	1,52
Servizi sanitari — 9,49% (28 febbraio 2023: 9,41%)		
21 Charles River Laboratories International Inc	4.421	2,05
34 UnitedHealth Group Inc	16.079	7,44
	20.500	9,49
Arredamento per la casa — 1,56% (28 febbraio 2023: 1,46%)		
40 Dolby Laboratories Inc 'A'	3.372	1,56
Internet — 6,38% (28 febbraio 2023: 5,83%)		
35 Airbnb Inc	4.568	2,12
47 Etsy Inc	3.475	1,61
10 Match Group Inc	472	0,22
8 Meta Platforms Inc 'A'	2.457	1,14
102 Pinterest Inc	2.796	1,29
	13.768	6,38
Media — 9,71% (28 febbraio 2023: 10,44%)		
260 Comcast Corp	12.176	5,64
16 Liberty Broadband Corp	1.476	0,68
74 Liberty Media Corp-Liberty Formula One	5.090	2,36
18 Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	451	0,21
134 Warner Bros Discovery Inc	1.767	0,82
	20.960	9,71
Estrazione — 1,97% (28 febbraio 2023: 1,49%)		
106 Freeport-McMoRan Inc	4.247	1,97
Farmaceutici — 2,17% (28 febbraio 2023: 2,14%)		
32 AbbVie Inc	4.689	2,17
Vendita al dettaglio — 2,32% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
17 Starbucks Corp	1.657	0,77
36 TJX Cos Inc/The	3.346	1,55
	5.003	2,32
Semiconduttori — 12,02% (28 febbraio 2023: 11,40%)		
23 Broadcom Inc	20.867	9,67
106 Wolfspeed Inc	5.082	2,35
	25.949	12,02
Software — 14,13% (28 febbraio 2023: 12,84%)		
56 Autodesk Inc	12.418	5,75
40 DocuSign Inc 'A'	2.027	0,94
57 Doximity Inc	1.355	0,63
19 HubSpot Inc	10.629	4,92
26 Fiocco di neve Inc	4.071	1,89
	30.500	14,13
Telecomunicazioni — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
24 GCI Liberty, Inc. Escrow ∞	–	–
Totale azioni ordinarie (costo 152.332 dollari)	213.403	98,84
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 152.332 dollari)	213.403	98,84

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$ d'inventario	% del valore netto
Contratti a termine in valuta estera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	4	–
Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	213.407	98,84
Contratti a termine in valuta estera — (0,04%) (28 febbraio 2023: (0,10%))		
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	(86)	(0,04)
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(86)	(0,04)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	213.321	98,80
Altre attività eccedenti le passività	2.595	1,20
Patrimonio in gestione	215.916\$	100,00

– Gli importi indicati con “–” sono pari a 0\$, inferiori a 1.000\$, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

∞ Il titolo è valutato in buona fede al valore equo o a discrezione del Comitato di valutazione.

ABBREVIAZIONI:

ADR – Ricevuta di deposito americana

Analisi delle attività totali	% delle attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	98,17
Strumenti finanziari derivati	–
Altre attività	1,83
Totale Attività	100,00

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)		Valuta vendita (in migliaia)		Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)			
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	–	Vendita	AUD	–	\$	–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1	Vendita	EUR	1		–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	–	Vendita	GBP	–		–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	8	Vendita	USD	10		–
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	20	Vendita	USD	22		–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	162	Vendita	AUD	253		(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	167	Vendita	AUD	256		2
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	2	Vendita	CHF	2		–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	40	Vendita	CNH	295		–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	39	Vendita	EUR	35		–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	21	Vendita	GBP	16		–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	2	Vendita	SEK	19		–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	21	Vendita	SEK	219		–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	203	Vendita	SGD	273		1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	186	Vendita	SGD	253		(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	7.394	Vendita	USD	5.502		(27)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	2	Vendita	USD	1		–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	444	Vendita	USD	42		(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	232	Vendita	USD	295		(2)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	794	Vendita	USD	874		(12)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH	5.010	Vendita	USD	695		(6)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CHF	49	Vendita	USD	56		(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	147	Vendita	USD	94		1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	6.575	Vendita	USD	4.296		(35)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	–	Vendita	USD	–		–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH	155	Vendita	USD	21		–
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 4\$)							\$	4	
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (229\$))								(86)	
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (225\$))							\$	(82)	

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario
Azioni ordinarie — 82,82% (28 febbraio 2023: 78,26%)		
Industria aerospaziale e Difesa — 1,40% (28 febbraio 2023: 2,40%)		
2 L3Harris Technologies Inc	320	0,90
2 RTX Corp	178	0,50
	498	1,40
Banche — 2,55% (28 febbraio 2023: 3,73%)		
1 Goldman Sachs Group Inc/The	177	0,50
5 JPMorgan Chase & Co	730	2,05
	907	2,55
Bevande — 1,98% (28 febbraio 2023: 1,83%)		
12 Coca-Cola Co/The	705	1,98
Biotechologie — 1,23% (28 febbraio 2023: 1,29%)		
2 Amgen Inc	437	1,23
Prodotti chimici — 2,43% (28 febbraio 2023: 2,33%)		
2 Air Products & Chemicals Inc	457	1,29
15 Huntsman Corp	406	1,14
	863	2,43
Computer — 5,99% (28 febbraio 2023: 4,70%)		
11 Apple Inc	2.127	5,99
Cosmetici e cura della persona — 2,43% (28 febbraio 2023: 1,56%)		
- Colgate-Palmolive Co	34	0,10
8 Kenvue Inc	175	0,49
4 Procter & Gamble Co/The	653	1,84
	862	2,43
Servizi finanziari diversificati — 3,69% (28 febbraio 2023: 3,69%)		
45 Blue Owl Capital Inc 'A'	533	1,50
1 CME Group Inc	292	0,82
4 Intercontinental Exchange Inc	487	1,37
	1.312	3,69
Ambito elettrico — 6,04% (28 febbraio 2023: 4,78%)		
4 Brookfield Renewable Corp	122	0,34
18 Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP #	469	1,32
5 DTE Energy Co	512	1,44
3 NextEra Energy Inc	173	0,49
17 PPL Corp	426	1,20
6 Sempra	444	1,25
	2.146	6,04
Componenti elettrici e apparecchiature — 1,17% (28 febbraio 2023: 0,94%)		
4 Emerson Electric Co	414	1,17
Elettronica — 0,80% (28 febbraio 2023: 0,50%)		
3 Amphenol Corp 'A'	284	0,80
Energia — Fonti alternative — 1,09% (28 febbraio 2023: 0,97%)		
8 NextEra Energy Partners LP	386	1,09
Assicurazioni — 1,51% (28 febbraio 2023: 0,88%)		
3 Chubb Ltd	537	1,51
Società di investimento — 1,55% (28 febbraio 2023: 1,97%)		
23 Ares Capital Corp	450	1,27
7 Trinity Capital Inc	102	0,28
	552	1,55
Macchinari — Diversificati — 1,52% (28 febbraio 2023: 1,89%)		
6 Otis Worldwide Corp	540	1,52
Petrolio e gas — 2,00% (28 febbraio 2023: 0,48%)		
3 ConocoPhillips	407	1,14
1 Pioneer Natural Resources Co	305	0,86
	712	2,00
Farmaceutici — 6,87% (28 febbraio 2023: 6,46%)		
2 AbbVie Inc	291	0,82
3 Johnson & Johnson	409	1,15
10 Merck & Co Inc	1.072	3,02
19 Pfizer Inc	668	1,88
	2.440	6,87
Gasdotti — 11,57% (28 febbraio 2023: 12,16%)		
6 DT Midstream Inc	331	0,93
18 Enbridge Inc	615	1,73
36 Kinder Morgan Inc	618	1,74
6 ONEOK Inc	362	1,02
60 Plains GP Holdings LP, MLP 'A' #	968	2,72
35 Williams Cos Inc/The	1.218	3,43
	4.112	11,57

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) \$	% del valore netto d'inventario
Private Equity — 3,34% (28 febbraio 2023: 1,83%)		
11 Blackstone Inc	1.185	3,34
Semiconduttori — 7,71% (28 febbraio 2023: 7,20%)		
- ASML Holding NV	226	0,64
2 Broadcom Inc	1.599	4,50
1 NXP Semiconductors NV	307	0,86
5 QUALCOMM Inc	608	1,71
	2.740	7,71
Software — 12,20% (28 febbraio 2023: 9,72%)		
6 Activision Blizzard Inc	571	1,61
7 Microsoft Corp	2.280	6,42
10 Oracle Corp	1.199	3,37
2 Paychex Inc	284	0,80
	4.334	12,20
Telecomunicazioni — 1,56% (28 febbraio 2023: 2,44%)		
10 Cisco Systems Inc	554	1,56
Trasporti — 2,19% (28 febbraio 2023: 1,45%)		
2 Union Pacific Corp	516	1,45
2 United Parcel Service Inc 'B'	262	0,74
	778	2,19
Totale azioni ordinarie (costo 20.178 dollari)	29.425	82,82
Azioni privilegiate — 6,54% (28 febbraio 2023: 6,35%)		
Servizi finanziari diversificati — 2,21% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
14 Apollo Global Management Inc	785	2,21
Ambito elettrico — 1,39% (28 febbraio 2023: 1,34%)		
11 NextEra Energy Inc	494	1,39
Gas — 0,36% (28 febbraio 2023: 0,38%)		
3 Spire Inc, serie A	126	0,36
Media — 0,51% (28 febbraio 2023: 0,69%)		
8 Paramount Global, serie A	181	0,51
Private Equity — 2,07% (28 febbraio 2023: 2,42%)		
10 KKR & Co Inc, serie C	735	2,07
Totale azioni privilegiate (costo 2.630 dollari)	2.321	6,54
Fondi di investimento immobiliare — 9,87% (28 febbraio 2023: 8,91%)		
REITS — 9,87% (28 febbraio 2023: 8,91%)		
3 Alexandria Real Estate Equities Inc	401	1,13
5 American Homes 4 Rent 'A'	188	0,53
1 American Tower Corp	185	0,52
6 Apartment Income REIT Corp	202	0,57
4 Digital Realty Trust Inc	501	1,41
1 Equinix Inc	487	1,37
3 Equity LifeStyle Properties Inc	179	0,50
3 Extra Space Storage Inc	324	0,91
9 Gaming and Leisure Properties Inc	410	1,15
1 Global Medical REIT Inc	86	0,24
4 Prologis Inc	545	1,54
	3.508	9,87
Totale Società d'investimento immobiliare (costo 3.270\$)	3.508	9,87
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 26.078 dollari)	35.254	99,23
Contratti a termine in valuta estera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	-	-
Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	35.254	99,23
Contratti a termine in valuta estera — (0,04%) (28 febbraio 2023: (0,14%))		
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	(16)	(0,04)
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(16)	(0,04)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	35.238	99,19
Altre attività eccedenti le passività	290	0,81
Patrimonio in gestione	35.528\$	100,00
-	Gli importi indicati con "-" sono pari a 0\$, inferiori a 1.000\$, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.	
#	Master Limited Partnership.	
		% delle attività totali
Analisi delle attività totali		
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato		98,96
Altre attività		1,04
Totale Attività		100,00

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
05-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	–	Vendita	USD	–	\$ –
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	24	Vendita	AUD	38	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1	Vendita	CNH	11	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	24	Vendita	EUR	23	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	8	Vendita	SGD	10	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	17	Vendita	SGD	23	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	504	Vendita	USD	553	(8)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH	346	Vendita	USD	48	(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	1.115	Vendita	USD	729	(6)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	352	Vendita	USD	262	(1)
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 1\$)							\$	–
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (56\$))								(16)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (55\$))							\$	(16)

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Azioni ordinarie — 94,16% (28 febbraio 2023: 96,28%)			Macchinari — Diversificati — 2,15% (28 febbraio 2023: 2,19%)		
Abbigliamento — 1,47% (28 febbraio 2023: 1,61%)			83 Deere & Co 34.275 2,15		
231 NIKE Inc	23.432	1,47	Media — 1,36% (28 febbraio 2023: 1,56%)		
Componenti per auto e apparecchiature — 0,87% (28 febbraio 2023: 1,25%)			260 Walt Disney Co/The 21.722 1,36		
138 Aptiv Plc	13.950	0,87	Produzione varia — 2,95% (28 febbraio 2023: 2,29%)		
Banche — 4,58% (28 febbraio 2023: 6,59%)			205 Eaton Corp Plc 47.106 2,95		
295 JPMorgan Chase & Co	43.160	2,70	Imballaggi e contenitori — 1,42% (28 febbraio 2023: 1,50%)		
352 Morgan Stanley	29.930	1,88	416 Ball Corp 22.625 1,42		
	73.090	4,58	Farmaceutici — 5,18% (28 febbraio 2023: 5,46%)		
Biotechologie — 3,09% (28 febbraio 2023: 3,47%)			391 CVS Health Corp 25.486 1,60		
249 BioMarin Pharmaceutical Inc	22.755	1,43	173 Johnson & Johnson 28.040 1,76		
346 Gilead Sciences Inc	26.435	1,66	156 Novo Nordisk A/S ADR 29.028 1,82		
	49.190	3,09	82.554 5,18		
Materiali da costruzione — 3,28% (28 febbraio 2023: 3,27%)			Vendita al dettaglio — 5,93% (28 febbraio 2023: 5,83%)		
135 Trane Technologies Plc	27.754	1,74	70 Costco Wholesale Corp 38.446 2,41		
343 Trex Co Inc	24.485	1,54	110 Home Depot Inc/The 36.431 2,29		
	52.239	3,28	139 Williams-Sonoma Inc 19.650 1,23		
Prodotti chimici — 1,62% (28 febbraio 2023: 1,43%)			94.527 5,93		
141 Ecolab Inc	25.837	1,62	Semiconduttori — 2,68% (28 febbraio 2023: 3,66%)		
Servizi commerciali — 0,97% (28 febbraio 2023: 1,20%)			37 ASML Holding NV 24.167 1,52		
412 Progyny Inc	15.387	0,97	26 Lam Research Corp 18.543 1,16		
Computer — 7,88% (28 febbraio 2023: 6,53%)			42.710 2,68		
83 Accenture Plc 'A'	26.817	1,68	Software — 10,91% (28 febbraio 2023: 8,95%)		
526 Apple Inc	98.825	6,20	378 Microsoft Corp 123.831 7,77		
	125.642	7,88	125 Salesforce Inc 27.633 1,73		
Cosmetici e cura della persona — 3,33% (28 febbraio 2023: 0,00%)			49 Synopsys Inc 22.532 1,41		
353 Colgate-Palmolive Co	25.919	1,63	173.996 10,91		
176 Procter & Gamble Co/The	27.182	1,70	Telecomunicazioni — 2,15% (28 febbraio 2023: 1,86%)		
	53.101	3,33	598 Cisco Systems Inc 34.310 2,15		
Servizi finanziari diversificati — 4,64% (28 febbraio 2023: 5,42%)			Totale azioni ordinarie (costo 1.473.230 dollari) 1.501.499 94,16		
33 BlackRock Inc	22.760	1,43	Fondi di investimento immobiliare — 3,26% (28 febbraio 2023: 3,05%)		
316 Charles Schwab Corp/The	18.684	1,17	REITS — 3,26% (28 febbraio 2023: 3,05%)		
133 Visa Inc 'A'	32.593	2,04	31 Equinix Inc 24.134 1,52		
	74.037	4,64	224 Prologis Inc 27.788 1,74		
Ambito elettrico — 2,06% (28 febbraio 2023: 1,29%)			51.922 3,26		
658 Brookfield Renewable Corp	18.373	1,15	Totale fondi di investimento immobiliare (costo 47.489 dollari) 51.922 3,26		
190 Ormat Technologies Inc	14.460	0,91	Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 317.014 dollari) 1.553.421 97,42		
	32.833	2,06	Contratti a termine in valuta estera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Elettronica — 1,44% (28 febbraio 2023: 3,82%)			Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto) 31 -		
173 Keysight Technologies Inc	23.031	1,44	Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico 1.553.452 97,42		
Energia — Fonti alternative — 3,20% (28 febbraio 2023: 4,53%)			Contratti a termine in valuta estera — (0,05%) (28 febbraio 2023: (0,05%))		
55 Enphase Energy Inc	6.946	0,43	Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto) (863) (0,05)		
359 NextEra Energy Partners LP	17.885	1,12	Totale Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico (863) (0,05)		
754 Shoals Technologies Group Inc 'A'	14.814	0,93	Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico 1.552.589 97,37		
70 SolarEdge Technologies Inc	11.425	0,72	Altre attività eccedenti le passività 41.962 2,63		
	51.070	3,20	Patrimonio in gestione 1.594.551\$ 100,00		
Alimentari — 1,62% (28 febbraio 2023: 1,68%)			-		
316 McCormick & Co Inc/MD	25.900	1,62	-		
Utensili manuali/meccanici — 1,92% (28 febbraio 2023: 2,35%)			-		
189 Regal Rexnord Corp	30.667	1,92	-		
Prodotti sanitari — 5,40% (28 febbraio 2023: 5,15%)			-		
70 Cooper Cos Inc/The	25.987	1,63	-		
115 Danaher Corp	30.586	1,92	-		
53 Thermo Fisher Scientific Inc	29.518	1,85	-		
	86.091	5,40	-		
Servizi sanitari — 2,76% (28 febbraio 2023: 2,71%)			-		
92 UnitedHealth Group Inc	44.001	2,76	-		
Assicurazioni — 3,23% (28 febbraio 2023: 4,57%)			-		
358 Hartford Financial Services Group Inc/The	25.731	1,61	-		
193 Progressive Corp/The	25.734	1,62	-		
	51.465	3,23	-		
Internet — 5,49% (28 febbraio 2023: 5,25%)			-		
343 Alphabet Inc 'A'	46.665	2,93	-		
10 Booking Holdings Inc	31.655	1,99	-		
124 Etsy Inc	9.150	0,57	-		
	87.470	5,49	-		
Macchinari — Edilizia ed Estrazione — 0,58% (28 febbraio 2023: 0,86%)			-		
617 Bloom Energy Corp 'A'	9.241	0,58	-		

- Gli importi indicati con "-" sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

ABBREVIAZIONI:

ADR - American Depositary Receipt.

Analisi delle attività totali	% delle attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	96,21
Strumenti finanziari derivati	-
Altre attività	3,79
Totale Attività	100,00

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (deprezzamento) non realizzato di contratti (in migliaia)
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1	Vendita	EUR	1	\$ –
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	–	Vendita	EUR	–	–
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	757	Vendita	GBP	595	3
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1	Vendita	GBP	1	–
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	34	Vendita	USD	37	–
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	911	Vendita	USD	1.159	(7)
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	88	Vendita	USD	8	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1.094	Vendita	EUR	1.005	3
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	9	Vendita	EUR	8	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	3.401	Vendita	GBP	2.665	25
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	37	Vendita	GBP	30	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	59.654	Vendita	USD	75.972	(395)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	30.579	Vendita	USD	33.642	(461)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	38	Vendita	USD	48	–
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 22\$)							\$	31
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (840)\$)								(863)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (818)\$)							\$	(832)

FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Azioni ordinarie — 99,02% (28 febbraio 2023: 97,30%)					
Australia — 2,02% (28 febbraio 2023: 1,09%)					
AUD 18	Brambles Ltd	170	1,14		
AUD 8	Computershare Ltd	130	0,88		
		300	2,02		
Brasile — 0,35% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
	– MercadoLibre Inc	52	0,35		
Canada — 2,62% (28 febbraio 2023: 3,76%)					
CAD	– Constellation Software Inc/Canada	187	1,26		
CAD 1	Loblaw Cos Ltd	121	0,81		
	1 Shopify Inc 'A'	81	0,55		
		389	2,62		
Cina — 3,06% (28 febbraio 2023: 3,72%)					
HKD 12	Alibaba Group Holding Ltd	136	0,91		
HKD 3	Tencent Holdings Ltd	138	0,93		
HKD 61	TravelSky Technology Ltd	109	0,73		
	3 Zai Lab Ltd ADR	73	0,49		
		456	3,06		
Francia — 2,75% (28 febbraio 2023: 3,20%)					
EUR 1	Edenred	35	0,24		
EUR	– Kering SA	142	0,95		
EUR	– LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	232	1,56		
		409	2,75		
Germania — 4,84% (28 febbraio 2023: 4,64%)					
EUR 1	Deutsche Boerse AG	143	0,96		
EUR 13	Deutsche Telekom AG	280	1,89		
EUR 2	SAP SE	296	1,99		
		719	4,84		
Hong Kong — 2,59% (28 febbraio 2023: 2,63%)					
HKD 19	AIA Group Ltd	170	1,14		
HKD 6	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	216	1,45		
		386	2,59		
India — 1,17% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
	3 HDFC Bank Ltd ADR	174	1,17		
Israele — 0,74% (28 febbraio 2023: 0,93%)					
	1 Nice Ltd ADR	111	0,74		
Giappone — 6,41% (28 febbraio 2023: 5,48%)					
JPY 8	Daiichi Sankyo Co Ltd	242	1,63		
JPY	– Keyence Corp	66	0,44		
JPY 11	Olympus Corp	153	1,02		
JPY	– SMC Corp	77	0,52		
JPY 2	Sony Group Corp	185	1,25		
JPY 2	Tokyo Electron Ltd	231	1,55		
		954	6,41		
Messico — 0,69% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
MXN 21	Grupo Bimbo SAB de CV	102	0,69		
Paesi Bassi — 2,11% (28 febbraio 2023: 1,61%)					
	– Argonx SE ADR	150	1,01		
EUR	– ASML Holding NV	163	1,10		
		313	2,11		
Nuova Zelanda — 0,58% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
AUD 1	Xero Ltd	86	0,58		
Portogallo — 0,91% (28 febbraio 2023: 1,63%)					
EUR 30	EDP – Energias de Portugal SA	136	0,91		
Svezia — 0,80% (28 febbraio 2023: 1,02%)					
SEK 6	Sandvik AB	119	0,80		
Svizzera — 1,12% (28 febbraio 2023: 1,84%)					
CHF 2	Alcon Inc	167	1,12		
Taiwan — 0,92% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
TWD 8	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	137	0,92		
Regno Unito — 2,54% (28 febbraio 2023: 4,29%)					
	1 Diageo Plc ADR	141	0,95		
GBP 2	London Stock Exchange Group Plc	237	1,59		
		378	2,54		
Stati Uniti — 62,80% (28 febbraio 2023: 59,75%)					
	1 AbbVie Inc	132	0,89		
	1 Accenture Plc 'A'	206	1,38		
	– Adobe Inc	241	1,62		
	3 Alphabet Inc 'A'	455	3,06		
	3 Amazon.com Inc	440	2,96		
		117	0,79		
	4 Apple Inc	736	4,95		
22	Coty Inc 'A'	250	1,68		
	– Deere & Co	189	1,27		
	1 Dexcom Inc	147	0,99		
	1 Eli Lilly & Co	559	3,76		
	1 Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	210	1,41		
55	Haleon Plc	225	1,51		
	3 Intercontinental Exchange Inc	300	2,02		
	– Intuit Inc	159	1,07		
	– Karuna Therapeutics Inc	81	0,55		
	4 Kroger Co/The	192	1,29		
	1 Marriott International Inc/MD	109	0,73		
	5 Marvell Technology Inc	280	1,88		
	2 Microsoft Corp	714	4,80		
1	Nestle SA	96	0,64		
	– Netflix Inc	183	1,23		
	3 NextEra Energy Inc	185	1,24		
	1 NVIDIA Corp	282	1,90		
	1 Procter & Gamble Co/The	189	1,27		
	1 S&P Global Inc	285	1,92		
	1 Salesforce Inc	246	1,65		
	1 Stryker Corp	162	1,09		
	2 Sysco Corp	118	0,79		
	1 Tesla Inc	271	1,82		
	– Thermo Fisher Scientific Inc	268	1,80		
	2 TJX Cos Inc/The	149	1,00		
	2 Trex Co Inc	112	0,75		
	1 Union Pacific Corp	288	1,94		
	1 UnitedHealth Group Inc	307	2,07		
	– Vertex Pharmaceuticals Inc	122	0,82		
	2 Walt Disney Co/The	133	0,89		
	1 Waste Connections Inc	110	0,74		
	– Workday Inc 'A'	94	0,63		
		9.342	62,80		
Totale azioni ordinarie (costo 13.451 dollari)				14.730	99,02
Diritti — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
Canada — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
CAD	– Constellation Software Inc/Canada				
Diritti totali (costo — dollari)					
Warrant — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
Canada — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
CAD	– Constellation Software Inc/Canada				
Totale Warrant (costo — dollari)					
Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico				14.730	99,02
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico				14.730	99,02
Altre attività eccedenti le passività				147	0,98
Patrimonio in gestione				14.877\$	100,00
– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.					
ABBREVIAZIONI:					
ADR	– American Depositary Receipt.				
AUD	– Dollaro australiano				
CAD	– Dollaro canadese				
CHF	– Franco svizzero				
EUR	– Euro				
GBP	– Sterlina britannica				
HKD	– Dollaro di Hong Kong				
JPY	– Yen giapponese				
MXN	– Peso messicano				
SEK	– Corona svedese				
TWD	– Dollaro di Taiwan				
Analisi delle attività totali					
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato				98,72	
Altre attività				1,28	
Totale Attività				100,00	

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) €	% del Valore patrimoniale netto
Azioni ordinarie — 93,06% (28 febbraio 2023: 93,42%)		
Australia — 4,46% (28 febbraio 2023: 5,07%)		
AUD 3.386 Atlas Arteria Ltd	12.317	1,41
AUD 3.379 Transurban Group	26.692	3,05
	39.009	4,46
Brasile — 2,96% (28 febbraio 2023: 1,70%)		
BRL 2.031 Centrais Eletricas Brasileiras SA	13.339	1,53
BRL 3.012 Rumo SA	12.527	1,43
	25.866	2,96
Canada — 5,00% (28 febbraio 2023: 8,77%)		
CAD 1.561 Gibson Energy Inc	21.623	2,47
CAD 771 Pembina Pipeline Corp	22.116	2,53
	43.739	5,00
Francia — 6,24% (28 febbraio 2023: 6,89%)		
133 Aeroports de Paris	16.160	1,85
2491 Getlink SE	38.409	4,39
	54.569	6,24
Germania — 2,09% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
365 Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	18.250	2,09
Italia — 7,82% (28 febbraio 2023: 3,23%)		
5.868 Enel SpA	36.320	4,16
4208 Terna – Rete Elettrica Nazionale	31.995	3,66
	68.315	7,82
Giappone — 5,64% (28 febbraio 2023: 6,02%)		
JPY 200 Central Japan Railway Co	23.642	2,71
JPY 492 East Japan Railway Co	25.622	2,93
	49.264	5,64
Portogallo — 3,00% (28 febbraio 2023: 3,39%)		
6.238 EDP – Energias de Portugal SA	26.207	3,00
Spagna — 3,18% (28 febbraio 2023: 11,53%)		
790 Cellnex Telecom SA, 144A	27.839	3,18
Regno Unito — 7,36% (28 febbraio 2023: 10,87%)		
GBP 946 Severn Trent Plc	26.480	3,03
GBP 950 SSE Plc	18.003	2,06
GBP 1.800 United Utilities Group Plc	19.878	2,27
	64.361	7,36
Stati Uniti — 45,31% (28 febbraio 2023: 35,95%)		
USD 130 American Water Works Co Inc	16.573	1,90
USD 1.301 CenterPoint Energy Inc	33.459	3,83
USD 146 Cheniere Energy Inc	21.953	2,51
USD 281 Constellation Energy Corp	27.030	3,09
USD 1.235 CSX Corp	34.380	3,93
USD 276 Entergy Corp	24.225	2,77
1277 Ferrovial SE	37.349	4,27
USD 654 NextEra Energy Inc	40.254	4,61
USD 64 Norfolk Southern Corp	12.026	1,38

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) €	% del Valore patrimoniale netto
USD 613 OGE Energy Corp	19.242	2,20
USD 3.170 PG&E Corp	47.632	5,45
USD 1.476 PPL Corp	33.925	3,88
USD 472 Public Service Enterprise Group Inc	26.610	3,04
USD 105 Union Pacific Corp	21.446	2,45
	396.104	45,31
Totale azioni ordinarie (costo 849.269 euro)		
	813.523	93,06
Fondi di investimento immobiliare — 3,90% (28 febbraio 2023: 3,73%)		
Stati Uniti — 3,90% (28 febbraio 2023: 3,73%)		
USD 204 American Tower Corp	34.117	3,90
Totale fondi di investimento immobiliare (costo 47.412 euro)		
	34.117	3,90
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 896.681 euro)		
	847.640	96,96
Contratti a termine in valuta estera — 0,20% (28 febbraio 2023: 0,18%)		
Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)		
	1.728	0,20
Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	849.368	97,16
Contratti a termine in valuta estera — (0,03%) (28 febbraio 2023: (0,10%))		
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)		
	(210)	(0,03)
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	(210)	(0,03)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	849.158	97,13
Altre attività eccedenti le passività		
	25.052	2,87
Patrimonio in gestione		
	874.210€	100,00

– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 27.839.000 euro ovvero al 3,18% dell'attivo netto.

ABBREVIAZIONI:

AUD	– Dollaro australiano
BRL	– Real brasiliano
CAD	– Dollaro canadese
GBP	– Sterlina britannica
JPY	– Yen giapponese
USD	– Dollaro statunitense

Analisi delle attività totali	% delle attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	96,24
Strumenti finanziari derivati	0,20
Altre attività	3,56
Totale Attività	100,00

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)	Valuta vendita (in migliaia)	Apprezzamento/(deprezzamento) non realizzato di contratti (in migliaia)
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD 1	€ –
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 1.949	31
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 189	(1)
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP 133	–
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	BRL 11.343	(51)
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 30	–
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 88	1
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 32	–
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR –	–
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 18	–
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 125	–
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 1	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 79	(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 40	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 1.235	(8)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD 7	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD 6.963	41
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD 4.362	14
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH 245.347	156

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)	
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	450	Vendita	EUR	416	€	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	101.952	Vendita	EUR	92.682		1269
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH	243	Vendita	EUR	30		–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	451	Vendita	SGD	666		(4)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	4.903	Vendita	USD	5.351		(28)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	156	Vendita	USD	169		–
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	185	Vendita	AUD	365		(3)
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	2.968	Vendita	AUD	3.410		(13)
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	982	Vendita	AUD	1.666		(14)
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	96	Vendita	AUD	110		–
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	1.965	Vendita	BRL	7.235		(1)
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	153	Vendita	BRL	555		2
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	118	Vendita	BRL	752		(1)
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	9	Vendita	BRL	57		–
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	50	Vendita	BRL	264		1
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	639	Vendita	BRL	3.477		(5)
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	200	Vendita	CAD	345		(2)
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	1.079	Vendita	CAD	1.594		(8)
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	BRL	37	Vendita	EUR	7		–
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	1.182	Vendita	EUR	1.382		(3)
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	19.624	Vendita	EUR	13.296		86
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	74	Vendita	GBP	64		–
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	4.897	Vendita	GBP	2.838		28
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	1.517	Vendita	GBP	1.298		4
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	223	Vendita	JPY	41.076		–
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	1.206	Vendita	JPY	189.878		–
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	3.709	Vendita	JPY	395.164		18
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	1.842	Vendita	USD	2.345		(10)
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	9.953	Vendita	USD	10.840		(31)
26-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CAD	30.583	Vendita	USD	22.559		77
03-ott-2023	BNY Mellon	Acquisto	BRL	8.852	Vendita	EUR	1.663		(26)
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 1.921€)								€	1.728
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 1,058€)									(210)
Apprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 863€)								€	1.518

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Azioni ordinarie — 90,11% (28 febbraio 2023: 90,92%)					
Australia — 8,73% (28 febbraio 2023: 9,91%)					
AUD 2.358	APA Group	13.690	3,75		
AUD 2.455	Atlas Arteria Ltd	9.685	2,65		
AUD 992	Transurban Group	8.499	2,33		
		31.874	8,73		
Brasile — 3,25% (28 febbraio 2023: 3,91%)					
BRL 2.075	CCR SA	5.221	1,43		
BRL 966	CPFL Energia SA	6.662	1,82		
		11.883	3,25		
Canada — 8,05% (28 febbraio 2023: 10,67%)					
CAD 103	Enbridge Inc	3.620	0,99		
CAD 495	Gibson Energy Inc	7.435	2,04		
CAD 350	Pembina Pipeline Corp	10.897	2,98		
CAD 207	TC Energy Corp	7.464	2,04		
		29.416	8,05		
Cina — 1,66% (28 febbraio 2023: 1,17%)					
HKD 2.163	China Resources Gas Group Ltd	6.079	1,66		
Italia — 9,48% (28 febbraio 2023: 4,87%)					
EUR 2.419	Enel SpA	16.236	4,45		
EUR 765	Italgas SpA	4.353	1,19		
EUR 2.720	Snam SpA	14.043	3,84		
		34.632	9,48		
Giappone — 3,70% (28 febbraio 2023: 3,51%)					
JPY 312	West Japan Railway Co	13.516	3,70		
Portogallo — 4,77% (28 febbraio 2023: 5,27%)					
EUR 3.820	EDP – Energias de Portugal SA	17.402	4,77		
Spagna — 5,94% (28 febbraio 2023: 11,64%)					
EUR 401	Enagas SA	6.850	1,88		
EUR 636	Iberdrola SA	7.541	2,06		
EUR 450	Redeia Corp SA	7.299	2,00		
		21.690	5,94		
Regno Unito — 10,52% (28 febbraio 2023: 14,11%)					
GBP 1.267	National Grid Plc	15.810	4,33		
GBP 838	Pennon Group Plc	6.838	1,87		
GBP 83	Severn Trent Plc	2.511	0,69		
GBP 461	SSE Plc	9.483	2,60		
GBP 315	United Utilities Group Plc	3.770	1,03		
		38.412	10,52		
Stati Uniti — 34,01% (28 febbraio 2023: 25,86%)					
	254 Brookfield Renewable Corp	7.100	1,94		
	59 Constellation Energy Corp	6.108	1,67		
	222 Edison International	15.290	4,19		
	129 Entergy Corp	12.297	3,37		
EUR 304	Ferrovial SE	9.645	2,64		
	186 NextEra Energy Inc	12.437	3,41		
	163 NextEra Energy Partners LP	8.121	2,22		
	386 OGE Energy Corp	13.152	3,60		
	248 Public Service Enterprise Group Inc	15.174	4,16		
Azioni privilegiate — 1,56% (28 febbraio 2023: 1,42%)					
Brasile — 1,56% (28 febbraio 2023: 1,42%)					
BRL 724	Centrais Eletricas Brasileiras SA	5.684	1,56		
		5.684	1,56		
Fondi di investimento immobiliare — 5,61% (28 febbraio 2023: 6,00%)					
Stati Uniti — 5,61% (28 febbraio 2023: 6,00%)					
	63 American Tower Corp	11.442	3,13		
	90 Crown Castle Inc	9.046	2,48		
		20.488	5,61		
		20.488	5,61		
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 392.328 dollari)					
				355.274	97,28
Contratti a termine in valuta estera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,01%)					
Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)				6	–
Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico				355.280	97,28
Contratti a termine in valuta estera — (0,28%) (28 febbraio 2023: (0,55%))					
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)				(1.018)	(0,28)
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico				(1.018)	(0,28)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico				354.262	97,00
Altre attività eccedenti le passività				10.963	3,00
Patrimonio in gestione				365.225\$	100,00
– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.					
ABBREVIAZIONI:					
AUD	–	Dollaro australiano			
BRL	–	Real brasiliano			
CAD	–	Dollaro canadese			
EUR	–	Euro			
GBP	–	Sterlina britannica			
HKD	–	Dollaro di Hong Kong			
JPY	–	Yen giapponese			
Analisi delle attività totali					
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato					96,10
Strumenti finanziari derivati					–
Altre attività					3,90
Totale Attività					100,00

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)	Valuta vendita (in migliaia)	Apprezzamento/ (deprezzamento) non realizzato di contratti (in migliaia)		
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 6	Vendita	SGD 8	\$ –
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD 16	Vendita	USD 12	–
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD 126	Vendita	USD 93	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 210	Vendita	AUD 325	(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 1	Vendita	AUD 1	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 50	Vendita	CNH 364	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 218	Vendita	EUR 202	(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 1.372	Vendita	EUR 1.260	5
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 218	Vendita	GBP 172	(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 243	Vendita	GBP 192	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 108	Vendita	SGD 145	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 2.864	Vendita	SGD 3.885	(13)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD 10.890	Vendita	USD 7.120	(60)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 40.097	Vendita	USD 44.116	(604)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP 4.437	Vendita	USD 5.651	(29)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 54	Vendita	USD 58	–

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	175	Vendita	USD	222	\$ 1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	579	Vendita	USD	428	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	79.778	Vendita	USD	59.365	(295)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH	11.685	Vendita	USD	1.621	(14)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	2	Vendita	USD	2	–
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 24\$)								\$ 6
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (2.229)\$)								(1.018)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (2.205)\$)								\$ (1.012)

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Azioni ordinarie — (segue)			118 Power Solutions International Inc		
Utensili manuali/meccanici — 0,53% (28 febbraio 2023: 0,80%)			142 Twin Disc Inc		
36 Hurco Cos Inc	779	0,11	9.493		
234 Luxfer Holdings Plc	2.808	0,42	Media — 0,42% (28 febbraio 2023: 0,48%)		
	3.587	0,53	138 Thryv Holdings Inc		
Prodotti sanitari — 2,99% (28 febbraio 2023: 2,02%)			Fabbricati metallici ed hardware — 2,15% (28 febbraio 2023: 2,27%)		
1.004 Accuray Inc	2.868	0,43	47 Helios Technologies Inc		
413 Apyx Medical Corp	1.933	0,29	151 Mayville Engineering Co Inc		
209 Artivion Inc	3.540	0,52	106 Northwest Pipe Co		
39 Azena Inc	2.207	0,33	32 Olympic Steel Inc		
148 CareDx Inc	1.380	0,20	219 TimkenSteel Corp		
286 MiMedx Group Inc	2.119	0,31	14.504		
125 Tactile Systems Technology Inc	2.374	0,35	Estrazione — 1,31% (28 febbraio 2023: 1,17%)		
194 Varex Imaging Corp	3.809	0,56	CAD 424 Capstone Copper Corp		
	20.230	2,99	34 Century Aluminum Co		
Servizi sanitari — 1,34% (28 febbraio 2023: 1,33%)			690 Ferroglobe Plc		
376 Community Health Systems Inc	1.270	0,19	CAD 457 Major Drilling Group International Inc		
304 Quidt Home Medical Corp	1.797	0,27	8.841		
111 RadNet Inc	3.717	0,55	Produzione varia — 1,26% (28 febbraio 2023: 1,63%)		
77 Select Medical Holdings Corp	2.249	0,33	17 EnPro Industries Inc		
	9.033	1,34	17 Fabrinet		
Costruttori di case — 2,75% (28 febbraio 2023: 2,86%)			136 Trinity Industries Inc		
62 Beazer Homes USA Inc	1.813	0,27	8.516		
11 Cavco Industries Inc	2.954	0,44	Attrezzatura per ufficio e aziende — 0,36% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
23 Century Communities Inc	1.694	0,25	152 Xerox Holdings Corp		
15 M/I Homes Inc	1.458	0,21	Petrolio e gas — 2,74% (28 febbraio 2023: 2,57%)		
59 Skyline Champion Corp	4.233	0,63	630 Baytex Energy Corp		
60 Taylor Morrison Home Corp 'A'	2.839	0,42	28 Chesapeake Energy Corp		
21 Toll Brothers Inc	1.691	0,25	78 Matador Resources Co		
60 Tri Pointe Homes Inc	1.878	0,28	100 Northern Oil and Gas Inc		
	18.560	2,75	145 Patterson-UTI Energy Inc		
Arredamento per la casa — 0,26% (28 febbraio 2023: 0,18%)			338 Southwestern Energy Co		
406 VIA Optronics AG ADR	512	0,08	18.505		
215 Vizio Holding Corp	1.235	0,18	Servizi petroliferi e del gas — 3,65% (28 febbraio 2023: 2,41%)		
	1.747	0,26	301 Archrock Inc		
Prodotti e articoli per la casa — 0,46% (28 febbraio 2023: 0,40%)			110 DMC Global Inc		
37 Spectrum Brands Holdings Inc	3.085	0,46	427 Mammoth Energy Services Inc		
Assicurazioni — 0,68% (28 febbraio 2023: 0,33%)			420 Matrix Service Co		
92 Brighthouse Financial Inc	4.593	0,68	294 Newpark Resources Inc		
Internet — 4,17% (28 febbraio 2023: 3,78%)			210 NOW Inc		
150 Cars.com Inc	2.809	0,42	137 ProPetro Holding Corp		
661 comScore Inc	463	0,07	178 Ranger Energy Services Inc		
89 Criteo SA ADR	2.616	0,39	254 Select Water Solutions Inc		
672 DHI Group Inc	2.525	0,37	298 Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A'		
585 Entravision Communications Corp	2.236	0,33	24.663		
282 EverQuote Inc	1.744	0,26	Imballaggi e contenitori — 0,39% (28 febbraio 2023: 0,47%)		
71 IAC Inc	3.911	0,58	100 TriMas Corp		
703 Innovid Corp	819	0,12	2.632		
361 LifeMD Inc	1.391	0,21	Farmaceutici — 0,61% (28 febbraio 2023: 0,93%)		
355 Magnite Inc	2.929	0,43	160 Organon & Co		
119 Overstock.com Inc	3.093	0,46	999 Societal CDMO Inc		
365 QuinStreet Inc	3.617	0,53	4.110		
	28.153	4,17	Private Equity — 0,37% (28 febbraio 2023: 0,17%)		
Ferro/Acciaio — 2,63% (28 febbraio 2023: 3,20%)			211 P10 Inc		
101 ATI Inc	4.557	0,68	2.534		
86 Carpenter Technology Corp	5.366	0,80	Immobili — 0,15% (28 febbraio 2023: 0,17%)		
63 Commercial Metals Co	3.540	0,52	157 Fathom Holdings Inc		
88 Haynes International Inc	4.272	0,63	985		
	17.735	2,63	Vendita al dettaglio — 6,19% (28 febbraio 2023: 7,40%)		
Ricettività — 0,58% (28 febbraio 2023: 0,61%)			17 Asbury Automotive Group Inc		
136 Century Casinos Inc	885	0,13	586 Barnes & Noble Education Inc		
200 Marcus Corp/The	3.035	0,45	20 BlueLinx Holdings Inc		
	3.920	0,58	178 Caleres Inc		
Macchinari — Edilizia ed Estrazione — 1,86% (28 febbraio 2023: 1,43%)			344 Carrols Restaurant Group Inc		
65 Argan Inc	2.741	0,40	404 Chico's FAS Inc		
691 Babcock & Wilcox Enterprises Inc	3.623	0,54	327 Designer Brands Inc		
58 BWX Technologies Inc	4.303	0,64	12 Dillard's Inc		
31 Terex Corp	1.897	0,28	31 Express Inc		
	12.564	1,86	144 J Jill Inc		
Macchinari — Diversificati — 1,40% (28 febbraio 2023: 2,02%)			46 MarineMax Inc		
130 Ichor Holdings Ltd	4.762	0,71	677 Noodles & Co 'A'		
669 Intevac Inc	2.324	0,34	164 Nordstrom Inc		
			60 OneWater Marine Inc 'A'		
			34 Patrick Industries Inc		
			238 Sportsman's Warehouse Holdings Inc		
			1.145		

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Azioni ordinarie — (segue)			372 Terran Orbital Corp		
Vendita al dettaglio — (segue)			452 0,07		
164 Vera Bradley Inc	1.174	0,17	23.800 3,52		
76 Victoria's Secret & Co	1.451	0,21	Trasporti — 2,81% (28 febbraio 2023: 3,64%)		
	41.833	6,19	247 Ardmore Shipping Corp	3.068	0,45
Risparmi e prestiti — 0,49% (28 febbraio 2023: 0,52%)			442 Daseke Inc	2.346	0,35
48 Axos Financial Inc	2.085	0,31	60 Hub Group Inc 'A'	4.669	0,69
102 New York Community Bancorp Inc	1.257	0,18	241 Navigator Holdings Ltd	3.322	0,49
	3.342	0,49	357 Radiant Logistics Inc	2.406	0,36
Semiconduttori — 5,87% (28 febbraio 2023: 5,09%)			62 Scorpio Tankers Inc	3.142	0,47
125 Alpha & Omega Semiconductor Ltd	3.926	0,58		18.953	2,81
109 Amkor Technology Inc	3.048	0,45	Totale azioni ordinarie (costo 623.415 dollari)	640.372	94,79
359 Amtech Systems Inc	3.091	0,46	Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 662.736 dollari)	679.693	100,61
114 Cohu Inc	4.279	0,63	Contratti a termine in valuta estera — 0,01% (28 febbraio 2023: 0,02%)		
114 FormFactor Inc	4.040	0,60	Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto) 94 0,01		
107 inTEST Corp	1.869	0,28	Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico 679.787 100,62		
67 Kulicke & Soffa Industries Inc	3.488	0,52	Contratti a termine in valuta estera — (0,14%) (28 febbraio 2023: (0,22%))		
30 Onto Innovation Inc	4.237	0,63	Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto) (945) (0,14)		
126 Ultra Clean Holdings Inc	4.426	0,65	Totale Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico (945) (0,14)		
182 Veeco Instruments Inc	5.305	0,78	Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico 678.842 100,48		
54 Vishay Precision Group Inc	1.953	0,29	Passività in eccesso rispetto ad altre attività (3.303) (0,48)		
	39.662	5,87	Patrimonio in gestione 675.539\$ 100,00		
Software — 1,87% (28 febbraio 2023: 1,81%)			— Gli importi indicati con “-” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.		
148 ACV Auctions Inc	2.482	0,37	ABBREVIAZIONI:		
108 Digi International Inc	3.594	0,53	ADR — American Depositary Receipt.		
13 Everbridge Inc	332	0,05	CAD — Dollaro canadese		
151 HireRight Holdings Corp	1.578	0,23	Analisi delle attività totali		
366 Immersion Corp	2.571	0,38	Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato 93,96		
332 Viant Technology Inc	2.081	0,31	Organismi di investimento collettivo 5,77		
	12.638	1,87	Strumenti finanziari derivati 0,01		
Telecomunicazioni — 3,52% (28 febbraio 2023: 4,15%)			Altre attività 0,26		
179 A10 Networks Inc	2.662	0,39	Totale Attività 100,00		
272 ADTRAN Holdings Inc	2.325	0,34			
117 Aviat Networks Inc	4.115	0,61			
110 Cambium Networks Corp	1.010	0,15			
67 Clearfield Inc	2.350	0,35			
461 DZS Inc	1.069	0,16			
131 Frequency Electronics Inc	870	0,13			
305 Infinera Corp	1.425	0,21			
269 Ooma Inc	3.786	0,56			
534 PCTEL Inc	2.214	0,33			
513 Ribbon Communications Inc	1.522	0,22			

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)	Valuta vendita (in migliaia)	Apprezzamento/ (deprezzamento) non realizzato di contratti (in migliaia)
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD - Vendita	\$ -
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 249 Vendita	(2)
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 5.631 Vendita	71
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 18 Vendita	-
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 7 Vendita	-
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 145 Vendita	-
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 16 Vendita	-
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR - Vendita	-
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP 65 Vendita	-
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP - Vendita	-
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD 7 Vendita	-
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	BRL 28.801 Vendita	(260)
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 4 Vendita	-
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD 3 Vendita	-
06-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH 138 Vendita	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 242 Vendita	2
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 279 Vendita	(3)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 13 Vendita	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 194 Vendita	(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 21 Vendita	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 1.218 Vendita	11
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 8 Vendita	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 376 Vendita	3
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD - Vendita	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 9 Vendita	-
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 966 Vendita	4

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei Contratti di cambio a termine – (segue)

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (Deprezzamento) non realizzato su contratti (in migliaia)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1.218	Vendita	USD	1.649	\$ (3)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	38.953	Vendita	USD	28.986	(144)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	PLN	23.852	Vendita	USD	5.851	(75)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	855	Vendita	USD	80	(2)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	8.268	Vendita	USD	5.405	(45)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD	99	Vendita	USD	65	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH	388	Vendita	USD	53	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	64	Vendita	USD	69	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH	22.169	Vendita	USD	3.075	(27)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	20.821	Vendita	USD	22.907	(313)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD	1.134	Vendita	USD	836	3
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP	93	Vendita	USD	119	(1)
03-ott-2023	BNY Mellon	Acquisto	BRL	27.569	Vendita	USD	5.607	(69)
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 150\$)								\$ 94
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1.623)\$)								(945)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1.473)\$)								\$ (851)

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Organismi di investimento collettivo — 2,91% (28 febbraio 2023: 3,48%)		
11 iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	1.641	1,78
1044 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	1.044	1,13
Totale Organismi di investimento collettivo (Costo 2.6925)	2.685	2,91
Azioni ordinarie — 97,35% (28 febbraio 2023: 97,23%)		
Industria aerospaziale e Difesa — 1,68% (28 febbraio 2023: 1,09%)		
91 Leonardo DRS Inc	1.550	1,68
Abbigliamento — 2,92% (28 febbraio 2023: 2,41%)		
13 Carter's Inc	927	1,00
38 Steven Madden Ltd	1.318	1,43
57 Wolverine World Wide Inc	458	0,49
	2.703	2,92
Componenti per auto e apparecchiature — 3,94% (28 febbraio 2023: 3,47%)		
62 Gentex Corp	2.020	2,18
41 Miller Industries Inc/TN	1.626	1,76
	3.646	3,94
Materiali da costruzione — 1,86% (28 febbraio 2023: 2,02%)		
28 Louisiana-Pacific Corp	1.719	1,86
Prodotti chimici — 3,31% (28 febbraio 2023: 3,48%)		
21 Innospec Inc	2.296	2,49
4 Quaker Chemical Corp	760	0,82
	3.056	3,31
Servizi commerciali — 8,63% (28 febbraio 2023: 7,42%)		
12 AMN Healthcare Services Inc	1.029	1,11
14 Cass Information Systems Inc	546	0,59
22 Computer Task Group Inc	227	0,25
139 Dun & Bradstreet Holdings Inc	1.510	1,63
58 Forrester Research Inc	1.760	1,90
47 Korn Ferry	2.411	2,61
8 RB Global Inc	495	0,54
	7.978	8,63
Computer — 0,52% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
8 Crane NXT Co	484	0,52
Cosmetici e cura della persona — 2,26% (28 febbraio 2023: 2,16%)		
15 Inter Parfums Inc	2.087	2,26
Distribuzione e commercio all'ingrosso — 0,88% (28 febbraio 2023: 2,20%)		
67 Hudson Technologies Inc	811	0,88
Servizi finanziari diversificati — 8,63% (28 febbraio 2023: 7,55%)		
54 Air Lease Corp 'A'	2.213	2,39
52 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	2.010	2,18
25 Houlihan Lokey Inc 'A'	2.606	2,82
33 Lazard Ltd 'A'	1.148	1,24
	7.977	8,63
Elettronica — 6,79% (28 febbraio 2023: 5,96%)		
33 Brady Corp 'A'	1.662	1,80
26 ESCO Technologies Inc	2.748	2,97
62 Kimball Electronics Inc	1.864	2,02
	6.274	6,79
Ingegneria ed edilizia — 2,25% (28 febbraio 2023: 2,22%)		
27 Arcosa Inc	2.083	2,25
Controllo ambientale — 0,39% (28 febbraio 2023: 0,88%)		
8 Heritage-Crystal Clean Inc	358	0,39
Prodotti sanitari — 5,25% (28 febbraio 2023: 5,87%)		
31 Bio-Techne Corp	2.424	2,62
31 Enovis Corp	1.756	1,90
4 UFP Technologies Inc	669	0,73
	4.849	5,25
Costruttori di case — 4,13% (28 febbraio 2023: 3,71%)		
13 LCI Industries	1.598	1,73
31 Skyline Champion Corp	2.221	2,40
	3.819	4,13
Assicurazioni — 4,64% (28 febbraio 2023: 4,88%)		
12 RLI Corp	1.574	1,71
2 White Mountains Insurance Group Ltd	2.711	2,93
	4.285	4,64
Internet — 2,93% (28 febbraio 2023: 2,92%)		
41 Ziff Davis Inc	2.705	2,93
Tempo libero — 1,67% (28 febbraio 2023: 1,59%)		
20 Brunswick Corp/DE	1.544	1,67

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Ricettività — 1,17% (28 febbraio 2023: 1,99%)		
166 Century Casinos Inc	1.084	1,17
Macchinari — Diversificati — 3,80% (28 febbraio 2023: 3,50%)		
22 Esab Corp	1.622	1,75
9 Kadant Inc	1.895	2,05
	3.517	3,80
Fabbricati metallici ed hardware — 1,49% (28 febbraio 2023: 0,65%)		
20 Northwest Pipe Co	677	0,73
23 Ryerson Holding Corp	702	0,76
	1.379	1,49
Produzione varia — 5,41% (28 febbraio 2023: 5,33%)		
11 EnPro Industries Inc	1.465	1,58
5 Fabrinet	855	0,93
24 John Bean Technologies Corp	2.680	2,90
	5.000	5,41
Servizi petroliferi e del gas — 1,74% (28 febbraio 2023: 1,54%)		
CAD 156 Pason Systems Inc	1.612	1,74
Farmaceutici — 2,23% (28 febbraio 2023: 3,27%)		
96 Catalyst Pharmaceuticals Inc	1.345	1,46
20 Harmony Biosciences Holdings Inc	715	0,77
	2.060	2,23
Immobili — 4,39% (28 febbraio 2023: 3,88%)		
168 Kennedy-Wilson Holdings Inc	2.680	2,90
41 Marcus & Millichap Inc	1.378	1,49
	4.058	4,39
Vendita al dettaglio — 1,35% (28 febbraio 2023: 1,49%)		
46 Movado Group Inc	1.247	1,35
Semiconduttori — 10,25% (28 febbraio 2023: 9,18%)		
8 Cirrus Logic Inc	668	0,72
16 Cohu Inc	583	0,63
70 FormFactor Inc	2.460	2,66
26 MKS Instruments Inc	2.556	2,77
13 Onto Innovation Inc	1.750	1,89
41 Vishay Precision Group Inc	1.461	1,58
	9.478	10,25
Software — 0,91% (28 febbraio 2023: 2,94%)		
8 Avid Technology Inc	225	0,24
14 Simulations Plus Inc	620	0,67
	845	0,91
Trasporti — 1,93% (28 febbraio 2023: 3,63%)		
9 Landstar System Inc	1.782	1,93
Totale azioni ordinarie (costo 83.219 dollari)	89.990	97,35
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 85.911 dollari)	92.675	100,26
Contratti a termine in valuta estera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	–	–
Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	92.675	100,26
Contratti a termine in valuta estera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	(2)	–
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(2)	–
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	92.673	100,26
Passività in eccesso rispetto ad altre attività	(238)	(0,26)
Patrimonio in gestione	92.435\$	100,00

– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

ABBREVIAZIONI:

ETF	– Fondo negoziato in borsa
CAD	– Dollaro canadese

Analisi delle attività totali	% delle attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	96,72
Organismi di investimento collettivo	2,89
Altre attività	0,39
Totale Attività	100,00

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023 – (segue)

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)			Valuta vendita (in migliaia)			Apprezzamento/ (deprezzamento) non realizzato di contratti (in migliaia)
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	20	Vendita	USD	22	\$ –
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	6	Vendita	EUR	6	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	12	Vendita	SEK	129	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD	1	Vendita	SEK	14	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	161	Vendita	USD	15	(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR	92	Vendita	USD	101	(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SEK	1	Vendita	USD	–	–
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): -\$)								–
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (2)\$)								(2)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (2)\$)								\$ (2)

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Organismi di investimento collettivo — 4,05% (28 febbraio 2023: 4,24%)		
171 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	171	4,05
Totale Organismi di investimento collettivo (Costo 171\$)		
Azioni ordinarie — 95,97% (28 febbraio 2023: 96,21%)		
Australia — 3,88% (28 febbraio 2023: 3,53%)		
AUD 25 Hansen Technologies Ltd	89	2,12
AUD 15 IPH Ltd	75	1,76
	164	3,88
Belgio — 1,01% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
EUR 2 Azelis Group NV	43	1,01
Brasile — 1,49% (28 febbraio 2023: 1,03%)		
BRL 16 Odontoprev SA	33	0,79
BRL 5 TOTVS SA	30	0,70
	63	1,49
Canada — 6,11% (28 febbraio 2023: 1,16%)		
1 Colliers International Group Inc	91	2,15
1 FirstService Corp	102	2,42
1 RB Global Inc	65	1,54
	258	6,11
Francia — 0,80% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
EUR 1 Lectra	34	0,80
Germania — 1,24% (28 febbraio 2023: 1,79%)		
EUR – New Work SE	53	1,24
Italia — 2,97% (28 febbraio 2023: 3,01%)		
EUR 1 Carel Industries SpA, 144A	31	0,74
EUR – DiaSorin SpA	36	0,85
EUR 9 GVS SpA, 144A	58	1,38
	125	2,97
Giappone — 10,30% (28 febbraio 2023: 11,67%)		
JPY 1 As One Corp	39	0,93
JPY 4 BML Inc	82	1,93
JPY 3 JCU Corp	65	1,53
JPY 2 Miura Co Ltd	39	0,93
JPY 1 OBIC Business Consultants Co Ltd	47	1,12
JPY 3 TKC Corp	81	1,91
JPY 2 USS Co Ltd	33	0,78
JPY 2 Zuken Inc	50	1,17
	436	10,30
Paesi Bassi — 2,19% (28 febbraio 2023: 2,14%)		
EUR – IMCD NV	43	1,01
EUR 14 Marel hf, 144A	50	1,18
	93	2,19
Polonia — 1,14% (28 febbraio 2023: 1,33%)		
PLN 3 Asseco Poland SA	48	1,14
Corea del Sud — 1,46% (28 febbraio 2023: 1,99%)		
KRW 8 NICE Information Service Co Ltd	62	1,46
Svezia — 1,09% (28 febbraio 2023: 1,07%)		
SEK 11 Karnov Group AB	46	1,09
Svizzera — 1,83% (28 febbraio 2023: 1,79%)		
CHF – Kardex Holding AG	32	0,76
CHF – VZ Holding AG	45	1,07
	77	1,83
Regno Unito — 13,21% (28 febbraio 2023: 12,45%)		
GBP 7 Auction Technology Group Plc	63	1,49
GBP 1 Croda International Plc	41	0,96
GBP 1 Diploma Plc	57	1,34
GBP 6 DiscoverIE Group Plc	60	1,42
GBP 1 Intertek Group Plc	43	1,01
GBP 71 Learning Technologies Group Plc	69	1,62
GBP 10 Marlowe Plc	78	1,85
GBP 26 Restore Plc	58	1,38
GBP – Spirax-Sarco Engineering Plc	49	1,17
GBP 2 Victrex Plc	41	0,97
	559	13,21
Stati Uniti — 46,24% (28 febbraio 2023: 52,24%)		
1 Arcosa Inc	75	1,78
1 Avid Technology Inc	17	0,40
1 Brunswick Corp/DE	69	1,64
1 Cognex Corp	39	0,92
1 Dorman Products Inc	70	1,66

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
1 Enovis Corp	46	1,09
– EnPro Industries Inc	22	0,52
1 Esab Corp	43	1,02
1 ESCO Technologies Inc	62	1,48
2 FormFactor Inc	75	1,79
2 Forrester Research Inc	53	1,24
– Fox Factory Holding Corp	34	0,80
1 Gentex Corp	49	1,15
1 Haemonetics Corp	77	1,83
– Houlihan Lokey Inc 'A'	39	0,92
1 Innospec Inc	72	1,70
– Inter Parfums Inc	63	1,49
1 John Bean Technologies Corp	65	1,53
– Kadant Inc	76	1,79
5 Kennedy-Wilson Holdings Inc	79	1,86
– Landstar System Inc	56	1,31
– LCI Industries	62	1,47
– Lincoln Electric Holdings Inc	70	1,65
– Littelfuse Inc	42	0,98
1 LKQ Corp	28	0,67
1 Marcus & Millichap Inc	23	0,54
1 MKS Instruments Inc	90	2,14
– Quaker Chemical Corp	77	1,83
– Ralph Lauren Corp 'A'	54	1,27
– Rogers Corp	43	1,03
1 SEI Investments Co	72	1,70
1 UFP Industries Inc	86	2,03
– Valmont Industries Inc	55	1,31
1 Ziff Davis Inc	72	1,70
	1.955	46,24
Vietnam — 1,01% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
GBP 2 XP Power Ltd	43	1,01
Totale azioni ordinarie (costo 4.450 dollari)		
	4.059	95,97
Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	4.230	100,02
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	4.230	100,02
Passività in eccesso rispetto ad altre attività		
	(1)	(0,02)
Patrimonio in gestione		
	4.229\$	100,00

– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 139.000 dollari ovvero al 3,30% dell'attivo netto.

ABBREVIAZIONI:

AUD	– Dollaro australiano
BRL	– Real brasiliano
CHF	– Franco svizzero
EUR	– Euro
GBP	– Sterlina britannica
JPY	– Yen giapponese
KRW	– Won sudcoreano
PLN	– Zloty polacco
SEK	– Corona svedese

	% delle attività totali
Analisi delle attività totali	
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	95,46
Organismi di investimento collettivo	4,02
Altre attività	0,52
Totale Attività	100,00

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^μ

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) €
Azioni ordinarie — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)	
Russia — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)	
GBP 54 Evraz Plc †	—
Totale azioni ordinarie (costo 313 euro)	—
Passività in eccesso rispetto ad altre attività	—
Patrimonio in gestione	—€

— Gli importi indicati con “—” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

† Illiquido.

μ A far data dall'11 luglio 2022, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^μ ha cessato le negoziazioni.

ABBREVIAZIONI:

GBP — Sterlina britannica

Analisi delle attività totali	% delle attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	—
Altre attività	100,00
Totale Attività	100,00

^μ Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^]F

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD
Azioni ordinarie — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)	
Grecia — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)	
EUR	1 FF Group †
Hong Kong — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)	
HKD	38 Hanergy Mobile Energy Holding Group Co Ltd †
Totale azioni ordinarie (costo 44 dollari)	
Passività in eccesso rispetto ad altre attività	
Patrimonio in gestione	

– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

† Illiquido.

F A far data dal 14 aprile 2021, Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^] ha cessato le negoziazioni.

ABBREVIAZIONI:

EUR – Euro
HKD – Dollaro di Hong Kong

Analisi delle attività totali	% delle attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	–
Altre attività	100,00
Totale Attività	100,00

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^Ω

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD
Azioni ordinarie — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)	
Russia — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)	
8 Gazprom PJSC ADR †	—
Totale azioni ordinarie (costo 54 dollari)	—
Passività in eccesso rispetto ad altre attività	—
Patrimonio in gestione	—\$

— Gli importi indicati con “—” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

† Illiquido.

Ω A far data dal 27 aprile 2022, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^Ω ha cessato le negoziazioni.

ABBREVIAZIONI:

ADR — American Depositary Receipt.

Analisi delle attività totali	% delle attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	—
Altre attività	100,00
Totale Attività	100,00

^Ω Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Organismi di investimento collettivo — 0,38% (28 febbraio 2023: 0,00%)					
573 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	573	0,38	30 NVIDIA Corp	14.746	9,79
Totale Organismi di investimento collettivo (Costo 573\$)					
	573	0,38	25 ResMed Inc	4.023	2,67
Azioni ordinarie — 100,75% (28 febbraio 2023: 101,05%)					
Cina — 2,11% (28 febbraio 2023: 3,03%)					
HKD 564 Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	3.181	2,11	19 Veeva Systems Inc 'A'	3.986	2,65
Danimarca — 2,98% (28 febbraio 2023: 3,50%)					
DKK 39 Coloplast A/S	4.489	2,98	24 Zoetis Inc	4.494	2,98
Francia — 8,82% (28 febbraio 2023: 10,14%)					
EUR 6 Kering SA	3.264	2,17		83.517	55,47
EUR 14 L'Oreal SA	6.236	4,14	Totale azioni ordinarie (costo 155.254 dollari)		
EUR 19 Pernod Ricard SA	3.778	2,51		151.696	100,75
	13.278	8,82	Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 155.827 dollari)		
Irlanda — 4,16% (28 febbraio 2023: 5,88%)					
EUR 74 Kingspan Group Plc	6.271	4,16	Contratti a termine in valuta estera — 0,02% (28 febbraio 2023: 0,03%)		
Italia — 8,95% (28 febbraio 2023: 8,65%)					
EUR 21 Ferrari NV	6.669	4,43	Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)		
EUR 100 Moncler SpA	6.803	4,52		33	0,02
	13.472	8,95	Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
Paesi Bassi — 6,99% (28 febbraio 2023: 5,90%)					
EUR 3 Adyen NV, 144A	2.322	1,54	Contratti a termine in valuta estera — (0,98%) (28 febbraio 2023: (1,01%))		
EUR 12 ASML Holding NV	8.205	5,45	Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)		
	10.527	6,99		(1.479)	(0,98)
Svezia — 8,27% (28 febbraio 2023: 9,97%)					
SEK 159 Assa Abloy AB	3.583	2,38	Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
SEK 421 Atlas Copco AB	5.567	3,70		(1.479)	(0,98)
SEK 369 Hexagon AB	3.296	2,19	Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	12.446	8,27		150.823	100,17
Regno Unito — 3,00% (28 febbraio 2023: 7,55%)					
GBP 65 Croda International Plc	4.515	3,00	Passività in eccesso rispetto ad altre attività		
Stati Uniti — 55,47% (28 febbraio 2023: 43,39%)					
AUD 9 Adobe Inc	5.126	3,40		(250)	(0,17)
AUD 13 ANSYS Inc	4.282	2,84	Patrimonio in gestione		
AUD 16 Autodesk Inc	3.577	2,38		150.573\$	100,00
AUD 27 CSL Ltd	4.845	3,22	– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.		
AUD 24 Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	3.780	2,51	144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 5.503.000 dollari ovvero al 3,65% dell'attivo netto.		
AUD 13 Illumina Inc	2.107	1,40	ABBREVIAZIONI:		
AUD 20 Linde Plc	7.553	5,02	AUD – Dollaro australiano		
AUD 24 Masimo Corp	2.736	1,82	DKK – Corona danese		
AUD 14 Mastercard Inc	5.917	3,93	EUR – Euro		
AUD 4 Mettler-Toledo International Inc	4.449	2,96	GBP – Sterlina britannica		
AUD 26 Microsoft Corp	8.379	5,56	HKD – Dollaro di Hong Kong		
AUD 35 NIKE Inc	3.517	2,34	SEK – Corona svedese		
Analisi delle attività totali					
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato					
Organismi di investimento collettivo					
Strumenti finanziari derivati					
Altre attività					
Totale Attività					

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)	Valuta vendita (in migliaia)	Apprezzamento/ (deprezzamento) non realizzato di contratti (in migliaia)
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 27	\$ –
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 27	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 1.227	(6)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 5.576	30
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 238	2
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 25	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 99.726	(1.461)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 1.706	1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP 1.892	(12)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP 63	–
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 41\$)				\$ 33
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1.422)\$)				(1.479)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (1.381)\$)				\$ (1.446)

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Azioni ordinarie — 57,23% (28 febbraio 2023: 56,65%)		
Australia — 14,62% (28 febbraio 2023: 13,13%)		
AUD 107 AGL Energy Ltd	765	3,73
AUD 73 APA Group	423	2,07
AUD 583 Aurizon Holdings Ltd	1.371	6,69
AUD 51 Transurban Group	437	2,13
	2.996	14,62
Cina — 12,04% (28 febbraio 2023: 13,32%)		
HKD 386 China Merchants Port Holdings Co Ltd	463	2,26
HKD 1.996 China Tower Corp Ltd, 144A	194	0,95
HKD 1.588 Guangdong Investment Ltd	1.239	6,04
HKD 1.106 Yueshi Transport Infrastructure Ltd	571	2,79
	2.467	12,04
Hong Kong — 4,28% (28 febbraio 2023: 5,49%)		
HKD 90 CLP Holdings Ltd	701	3,42
HKD 42 Wharf Real Estate Investment Co Ltd	175	0,86
	876	4,28
India — 7,89% (28 febbraio 2023: 7,70%)		
INR 242 Indus Towers Ltd	512	2,49
INR 242 NHPC Ltd	147	0,72
INR 324 Power Grid Corp of India Ltd	959	4,68
	1.618	7,89
Malesia — 2,52% (28 febbraio 2023: 2,57%)		
MYR 50 Petronas Gas Bhd	183	0,89
MYR 442 Westports Holdings Bhd	334	1,63
	517	2,52
Nuova Zelanda — 5,32% (28 febbraio 2023: 5,98%)		
NZD 186 Chorus Ltd	896	4,37
NZD 39 Contact Energy Ltd	195	0,95
	1.091	5,32
Filippine — 1,84% (28 febbraio 2023: 1,10%)		
PHP 62 Manila Electric Co	378	1,84
Singapore — 5,51% (28 febbraio 2023: 4,14%)		
SGD 772 Capitaland India Trust	659	3,22
SGD 736 NETLINK NBN TRUST	470	2,29
	1.129	5,51
Thailandia — 3,21% (28 febbraio 2023: 3,22%)		
THB 2.427 Digital Telecommunications Infrastructure Fund	658	3,21
	11.730	57,23
Fondi di investimento immobiliare — 41,37% (28 febbraio 2023: 42,58%)		
Australia — 19,28% (28 febbraio 2023: 20,53%)		
AUD 63 Charter Hall Long Wale REIT	144	0,70
AUD 420 Charter Hall Retail REIT	943	4,60
AUD 138 GPT Group/The	373	1,82
AUD 97 Region RE Ltd	135	0,66
AUD 680 Scentre Group	1.203	5,87
AUD 155 Stockland	425	2,08
AUD 604 Vicinity Ltd	728	3,55
	3.951	19,28

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Hong Kong — 9,87% (28 febbraio 2023: 8,91%)		
HKD 1.097 Fortune Real Estate Investment Trust	681	3,32
HKD 271 Link REIT	1.342	6,55
	2.023	9,87
India — 5,23% (28 febbraio 2023: 4,22%)		
INR 292 Embassy Office Parks REIT	1.073	5,23
Nuova Zelanda — 1,94% (28 febbraio 2023: 2,04%)		
NZD 750 Kiwi Property Group Ltd	398	1,94
Singapore — 5,05% (28 febbraio 2023: 6,88%)		
SGD 249 Capitaland Integrated Commercial Trust	351	1,71
SGD 106 Frasers Centrepoint Trust	176	0,86
SGD 298 Mapletree Industrial Trust	508	2,48
	1.035	5,05
Totale fondi di investimento immobiliare (costo 10.338 dollari)		
	8.480	41,37
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 23.141 dollari)		
	20.210	98,60
Contratti a termine in valuta estera — 0,00% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)		
	–	–
Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	20.210	98,60
Contratti a termine in valuta estera — (0,01%) (28 febbraio 2023: (0,07%))		
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)		
	(1)	(0,01)
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	(1)	(0,01)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	20.209	98,59
Altre attività eccedenti le passività		
	288	1,41
Patrimonio in gestione		
	20.497\$	100,00

– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 194.000 dollari ovvero allo 0,95% dell'attivo netto.

ABBREVIAZIONI:

AUD	– Dollaro australiano
HKD	– Dollaro di Hong Kong
INR	– Rupia indiana
MYR	– Ringgit malese
NZD	– Nuovo dollaro neozelandese
PHP	– Peso filippino
SGD	– Dollaro di Singapore
THB	– Baht thailandese

Analisi delle attività totali

Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	94,78
Altre attività	5,22
Totale Attività	100,00

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)	Valuta vendita (in migliaia)	Apprezzamento/ non realizzato di contratti (in migliaia)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD – Vendita	AUD 1 \$ –
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD – Vendita	AUD 2 –
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD – Vendita	CNH – –
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD – Vendita	CNH – –
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 10 Vendita	SGD 13 –
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 3 Vendita	SGD 4 –
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD 8 Vendita	USD 5 –
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	SGD 312 Vendita	USD 233 (1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH – Vendita	USD – –
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	CNH 7 Vendita	USD 1 –
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD 1 Vendita	USD – –
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	AUD 34 Vendita	USD 22 –
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 1\$)				\$ –
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (19)\$)				(1)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (18)\$)				\$ (1)

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
Organismi di investimento collettivo — 0,73% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
241 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	241	0,73
Totale Organismi di investimento collettivo (Costo 241\$)		
	241	0,73
Azioni ordinarie — 99,62% (28 febbraio 2023: 99,55%)		
Brasile — 6,45% (28 febbraio 2023: 6,02%)		
BRL 206 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	539	1,63
BRL 176 Cosan SA	624	1,89
BRL 124 Odontoprev SA	258	0,78
BRL 98 WEG SA	707	2,15
	2.128	6,45
Cile — 2,05% (28 febbraio 2023: 2,16%)		
GBP 37 Antofagasta Plc	674	2,05
Cina — 25,56% (28 febbraio 2023: 28,67%)		
HKD 55 Alibaba Group Holding Ltd	644	1,95
7 Alibaba Group Holding Ltd ADR	609	1,85
HKD 123 China Merchants Bank Co Ltd	487	1,48
CNH 18 Contemporary Ampere Technology Co Ltd	575	1,74
HKD 28 ENN Energy Holdings Ltd	221	0,67
HKD 4 JD.com Inc	61	0,19
11 JD.com Inc ADR	356	1,08
HKD 44 Meituan 'B', 144A	735	2,23
HKD 112 Minth Group Ltd	332	1,01
CNH 189 Ping An Bank Co Ltd	289	0,88
HKD 115 Ping An Insurance Group Co of China Ltd	688	2,09
HKD 116 Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	273	0,83
CNH 34 Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	319	0,97
HKD 50 Tencent Holdings Ltd	2.055	6,23
HKD 83 Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	465	1,41
CNH 26 Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	106	0,32
HKD 250 Xinyi Solar Holdings Ltd	209	0,63
	8.424	25,56
Hong Kong — 2,44% (28 febbraio 2023: 2,94%)		
HKD 89 AIA Group Ltd	805	2,44
India — 18,75% (28 febbraio 2023: 17,02%)		
INR 12 Asian Paints Ltd	457	1,38
INR 69 HDFC Bank Ltd	1.319	4,00
INR 86 ICICI Bank Ltd	997	3,02
INR 25 Kotak Mahindra Bank Ltd	539	1,64
INR 4 Maruti Suzuki India Ltd	534	1,62
INR 32 Reliance Industries Ltd	928	2,82
INR 26 Titan Co Ltd	995	3,02
INR 4 UltraTech Cement Ltd	412	1,25
	6.181	18,75
Indonesia — 4,18% (28 febbraio 2023: 3,54%)		
IDR 476 Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	287	0,87
IDR 2.039 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	741	2,25
IDR 1.436 Telkom Indonesia Persero Tbk PT	350	1,06
	1.378	4,18
Messico — 4,55% (28 febbraio 2023: 4,57%)		
MXN 75 Grupo Financiero Banorte SAB de CV	637	1,93
MXN 122 Orbia Advance Corp SAB de CV	272	0,83
MXN 150 Wal-Mart de Mexico SAB de CV	590	1,79
	1.499	4,55
Perù — 1,24% (28 febbraio 2023: 1,15%)		
3 Credicorp Ltd	408	1,24
Filippine — 0,39% (28 febbraio 2023: 0,43%)		
PHP 148 Robinsons Retail Holdings Inc	129	0,39
Arabia Saudita — 2,32% (28 febbraio 2023: 1,78%)		
SAR 31 Al Rajhi Bank	589	1,79
SAR 3 Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	175	0,53
	764	2,32
Singapore — 0,29% (28 febbraio 2023: 0,47%)		
3 Sea Ltd ADR	97	0,29
Africa del Sud — 0,70% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
ZAR 3 Capitec Bank Holdings Ltd	232	0,70
Corea del Sud — 16,30% (28 febbraio 2023: 15,91%)		
KRW 1 LG Chem Ltd	586	1,78
KRW – LG Energy Solution Ltd	116	0,35
KRW – LG H&H Co Ltd	100	0,30
KRW 2 NAVER Corp	303	0,92
KRW 53 Samsung Electronics Co Ltd	2.690	8,16

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto
KRW 1 Samsung SDI Co Ltd	424	1,29
KRW 13 SK Hynix Inc	1.154	3,50
	5.373	16,30
Taiwan — 12,54% (28 febbraio 2023: 12,47%)		
TWD 54 Delta Electronics Inc	584	1,77
TWD 34 Globalwafers Co Ltd	489	1,48
TWD 178 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	3.062	9,29
	4.135	12,54
Stati Uniti — 1,86% (28 febbraio 2023: 2,42%)		
1 EPAM Systems Inc	243	0,73
2 Globant SA	371	1,13
	614	1,86
Totale azioni ordinarie (costo 40.294 dollari)		
	32.841	99,62
Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	33.082	100,35
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	33.082	100,35
Passività in eccesso rispetto ad altre attività		
	(117)	(0,35)
Patrimonio in gestione		
	32.965\$	100,00

– Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 1.200.000 dollari ovvero al 3,64% dell'attivo netto.

ABBREVIAZIONI:

ADR	– American Depositary Receipt.
BRL	– Real brasiliano
CNH	– Renminbi cinese
GBP	– Sterlina britannica
HKD	– Dollaro di Hong Kong
IDR	– Rupia indonesiana
INR	– Rupia indiana
KRW	– Won sudcoreano
MXN	– Peso messicano
PHP	– Peso filippino
SAR	– Riyal dell'Arabia Saudita
TWD	– Dollaro di Taiwan
ZAR	– Rand sudafricano

Analisi delle attività totali

	% delle attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	99,06
Organismi di investimento collettivo	0,73
Altre attività	0,21
Totale Attività	100,00

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) €	% del Valore patrimoniale netto
Azioni ordinarie — 99,55% (28 febbraio 2023: 99,83%)		
Danimarca — 3,65% (28 febbraio 2023: 3,76%)		
DKK 66 Coloplast A/S	6.870	3,65
Francia — 21,32% (28 febbraio 2023: 21,05%)		
211 Dassault Systemes SE	7.728	4,10
16 Kering SA	7.822	4,15
25 L'Oreal SA	10.129	5,38
30 Pernod Ricard SA	5.434	2,89
35 Sartorius Stedim Biotech	9.035	4,80
	40.148	21,32
Germania — 6,10% (28 febbraio 2023: 7,65%)		
138 Infineon Technologies AG	4.566	2,42
109 Nemetschek SE	6.920	3,68
	11.486	6,10
Irlanda — 5,05% (28 febbraio 2023: 6,83%)		
122 Kingspan Group Plc	9.514	5,05
Italia — 17,15% (28 febbraio 2023: 15,71%)		
64 Ferrari NV	18.807	9,99
216 Moncler SpA	13.494	7,16
	32.301	17,15
Paesi Bassi — 13,76% (28 febbraio 2023: 8,94%)		
4 Adyen NV, 144A	3.197	1,70
29 ASML Holding NV	17.719	9,41
47 BE Semiconductor Industries NV	5.001	2,65
	25.917	13,76
Svezia — 12,57% (28 febbraio 2023: 13,48%)		
SEK 397 Assa Abloy AB	8.243	4,38
SEK 733 Atlas Copco AB	8.930	4,74
SEK 789 Hexagon AB	6.499	3,45
	23.672	12,57
Svizzera — 3,77% (28 febbraio 2023: 3,36%)		
CHF 7 Partners Group Holding AG	7.101	3,77
Regno Unito — 6,28% (28 febbraio 2023: 12,44%)		
GBP 111 Croda International Plc	7.132	3,79
GBP 1.684 Oxford Nanopore Technologies Plc	4.680	2,49
	11.812	6,28
Stati Uniti — 9,90% (28 febbraio 2023: 6,61%)		
USD 28 Linde Plc	9.938	5,28

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) €	% del Valore patrimoniale netto
USD 8 Mettler-Toledo International Inc	8.705	4,62
	18.643	9,90
Totale azioni ordinarie (costo 207.873 euro)		
	187.464	99,55
Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 207.873 euro)		
	187.464	99,55
Contratti a termine in valuta estera — 0,01% (28 febbraio 2023: 0,01%)		
Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	11	0,01
Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	187.475	99,56
Contratti a termine in valuta estera — (0,02%) (28 febbraio 2023: (0,01%))		
Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	(28)	(0,02)
Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	(28)	(0,02)
Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
	187.447	99,54
Altre attività eccedenti le passività		
	872	0,46
Patrimonio in gestione		
	188.319€	100,00

— Gli importi indicati con “-” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.

144A Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 3.197.000 euro ovvero al 1,70% dell'attivo netto.

ABBREVIAZIONI:

CHF	– Franco svizzero
DKK	– Corona danese
GBP	– Sterlina britannica
SEK	– Corona svedese
USD	– Dollaro statunitense

Analisi delle attività totali

	% delle attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	99,47
Strumenti finanziari derivati	0,01
Altre attività	0,52
Totale Attività	100,00

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)	Valuta vendita (in migliaia)	Apprezzamento/ (deprezzamento) non realizzato di contratti (in migliaia)	
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 682	Vendita BRL 3.612	€ 10
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 77	Vendita BRL 414	–
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	BRL 3.903	Vendita EUR 744	(18)
5-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	BRL 122	Vendita EUR 23	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 59	Vendita EUR 52	1
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD –	Vendita EUR –	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 3	Vendita USD 3	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR –	Vendita USD 1	–
03-ott-2023	BNY Mellon	Acquisto	BRL 3.615	Vendita EUR 679	(10)
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 22€)				€	11
Deprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): (20)€)				€	(28)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine (28 febbraio 2023 (in migliaia): 2€)				€	(17)

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	Azioni (in migliaia)	Valore (in migliaia) USD	% del Valore patrimoniale netto	
Azioni ordinarie — 94,92%						
Brasile — 4,84%						
– MercadoLibre Inc	231	4,84	3 Xylem Inc/NY	278	5,84	
Danimarca — 4,60%				2.494	52,32	
DKK 5 Novozymes A/S	219	4,60	Totale azioni ordinarie (costo 4.765 dollari)	4.524	94,92	
Francia — 4,92%			Totale investimenti al valore equo rilevato a conto economico (costo 4.765 dollari)	4.524	94,92	
EUR 8 Veolia Environnement SA	234	4,92	Contratti di cambio a termine — 0,00%			
India — 5,80%			Apprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	–	–	
4 HDFC Bank Ltd ADR	276	5,80	Totale Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	4.524	94,92	
Indonesia — 3,05%			Contratti di cambio a termine — (0,04%)			
IDR 400 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	145	3,05	Deprezzamento non realizzato di contratti (vedi sotto)	(2)	(0,04)	
Italia — 4,28%			Totale passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	(2)	(0,04)	
EUR 6 Amplifon SpA	204	4,28	Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	4.522	94,88	
Nigeria — 4,31%			Altre attività eccedenti le passività	244	5,12	
GBP 142 Airtel Africa Plc, 144A	206	4,31	Patrimonio in gestione	4.766\$	100,00	
Svezia — 1,20%						
SEK 2 MIPS AB	57	1,20	–			
Regno Unito — 9,60%			Gli importi indicati con “–” sono pari a EUR 0, inferiori a EUR 1.000, inferiori a 1.000 azioni ovvero inferiori allo 0,01%.			
GBP 4 Croda International Plc	249	5,22	144A	Titoli esenti da registrazione ai sensi della Norma 144A della Legge sui valori mobiliari (Securities Act) del 1933 e successive modifiche. Questi titoli possono essere rivenduti, nell'ambito di transazioni esenti da registrazione, solo ad acquirenti istituzionali qualificati. Al 31 agosto 2023 questi titoli ammontavano a 206.000 dollari ovvero al 4,31% dell'attivo netto.		
GBP 6 FDM Group Holdings Plc	41	0,87				
GBP 13 Mears Group Plc	47	0,97				
GBP 12 Vistry Group Plc	121	2,54				
	458	9,60				
Stati Uniti — 52,32%						
5 Coursera Inc	84	1,75				
1 Deere & Co	215	4,51				
1 Ecolab Inc	236	4,95				
3 Energy Recovery Inc	88	1,84				
2 Everbridge Inc	54	1,13				
1 Illumina Inc	201	4,22				
1 Intuitive Surgical Inc	300	6,29				
1 Masimo Corp	152	3,20				
1 Planet Fitness Inc 'A'	74	1,55				
2 Revvity Inc	246	5,17				
1 Stride Inc	56	1,17				
1 Valmont Industries Inc	237	4,97				
1 Veeva Systems Inc 'A'	209	4,38				
4 Verra Mobility Corp 'A'	64	1,35				

ABBREVIAZIONI:

ADR	– American Depositary Receipt.
DKK	– Corona danese
EUR	– Euro
GBP	– Sterlina britannica
IDR	– Rupia indonesiana
SEK	– Corona svedese

Analisi delle attività totali

	% delle attività totali
Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato	94,57
Altre attività	5,43
Totale Attività	100,00

Prospetto dei contratti di cambio a termine

Data di scadenza	Controparte	Valuta acquisto (in migliaia)	Valuta vendita (in migliaia)	Apprezzamento/ (deprezzamento) non realizzato di contratti (in migliaia)	
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 5	Vendita EUR 4	\$ –
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	USD 4	Vendita GBP 4	–
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP 76	Vendita USD 97	(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	EUR 91	Vendita USD 100	(1)
15-set-2023	BNY Mellon	Acquisto	GBP 2	Vendita USD 2	–
Apprezzamento non realizzato di Forward Foreign Currency Contracts					\$ –
Deprezzamento non realizzato di Forward Foreign Currency Contracts					(2)
Deprezzamento netto di contratti di cambio a termine					\$ (2)

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]

Prospetto degli investimenti al 31 agosto 2023

Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) €	% del Valore patrimoniale netto	Valore nominale (in migliaia)	Valore (in migliaia) €	% del Valore patrimoniale netto
Obbligazioni ed effetti societari — 96,47% (28 febbraio 2023: 92,33%)			Portogallo — 1,31% (28 febbraio 2023: 2,24%)		
Australia — 1,44% (28 febbraio 2023: 1,34%)			1.100 Caixa Geral de Depositos SA, 5,750%, scadenza 31/10/2028 *		
1.500 Macquarie Group Ltd, 0,350%, scadenza 03/03/2028	1.264	1,44	Slovenia — 0,59% (28 febbraio 2023: 0,00%)		
Belgio — 2,43% (28 febbraio 2023: 2,19%)			600 United Group BV, 4,625%, scadenza 15/08/2028		
900 Azelis Finance NV, 5,750%, scadenza 15/03/2028	919	1,04	Spagna — 6,68% (28 febbraio 2023: 9,71%)		
1200 Crelan SA, 5,750%, scadenza 26/01/2028	1.218	1,39	1.300 Abertis Infraestructuras SA, 4,125%, scadenza 31/01/2028	1.296	1,48
	2.137	2,43	400 Arena Luxembourg Finance Sarl, 1,875%, scadenza 01/02/2028	335	0,38
Cina — 1,31% (28 febbraio 2023: 1,32%)			1000 Banco de Sabadell SA, 5,250%, scadenza 07/02/2029 *	994	1,13
1.400 Prosus NV, 1,539%, scadenza 03/08/2028	1.152	1,31	1400 CaixaBank SA, 0,750%, scadenza 26/05/2028 *	1.220	1,39
Repubblica Ceca — 1,41% (28 febbraio 2023: 1,77%)			700 Unicaja Banco SA, 7,250%, scadenza 15/11/2027 *	720	0,82
1.300 CEZ AS, 3,000%, scadenza 05/06/2028	1.234	1,41	1300 Werfen SA/Spagna, 4,625%, scadenza 06/06/2028	1.296	1,48
Danimarca — 2,65% (28 febbraio 2023: 1,57%)				5.861	6,68
1.400 H Lundbeck A/S, 0,875%, scadenza 14/10/2027	1.227	1,40	Svezia — 5,97% (28 febbraio 2023: 2,67%)		
1300 Nykredit Realkredit AS, 0,375%, scadenza 17/01/2028	1.100	1,25	1.600 Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,375%, scadenza 21/06/2028	1.347	1,53
	2.327	2,65	1200 Svenska Handelsbanken AB, 3,750%, scadenza 01/11/2027	1.200	1,37
Finlandia — 1,44% (28 febbraio 2023: 1,55%)			1400 Tele2 AB, 2,125%, scadenza 15/05/2028	1.298	1,48
1.500 OP Corporate Bank plc, 0,375%, scadenza 16/06/2028	1.268	1,44	500 Verisure Holding AB, 9,250%, scadenza 15/10/2027	534	0,61
Francia — 18,61% (28 febbraio 2023: 16,09%)			900 Volvo Car AB, 4,250%, scadenza 31/05/2028	863	0,98
600 Adevinta ASA, 3,000%, scadenza 15/11/2027	565	0,64		5.242	5,97
500 Altice France SA/Francia, 3,375%, scadenza 15/01/2028	354	0,40	Svizzera — 2,93% (28 febbraio 2023: 2,49%)		
1500 BNP Paribas SA, 0,500%, scadenza 19/02/2028 *	1.317	1,50	1.400 Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500%, scadenza 15/12/2028	1.269	1,45
1200 BPCE SA, 4,375%, scadenza 13/07/2028	1.202	1,37	1300 UBS Group AG, 4,625%, scadenza 17/03/2028 *	1.303	1,48
600 CAB SELAS, 3,375%, scadenza 01/02/2028	512	0,58		2.572	2,93
1400 Credit Agricole SA, 0,375%, scadenza 20/04/2028	1.190	1,36	Regno Unito — 12,62% (28 febbraio 2023: 14,60%)		
1200 Engie SA, 1,750%, scadenza 27/03/2028	1.108	1,26	1.500 Barclays Plc, 0,877%, scadenza 28/01/2028 *	1.331	1,52
1400 Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1,625%, scadenza 27/11/2027	1.267	1,44	1300 easyJet FinCo BV, 1,875%, scadenza 03/03/2028	1.155	1,32
320 Iliad Holding SASU, 5,625%, scadenza 15/10/2028	303	0,35	1200 HSBC Holdings Plc, 4,752%, scadenza 10/03/2028 *	1.210	1,38
300 Iliad SA, 1,875%, scadenza 11/02/2028	258	0,30	1500 Motability Operations Group Plc, 0,125%, scadenza 20/07/2028	1.263	1,44
1300 La Banque Postale SA, 1,000%, scadenza 09/02/2028 *	1.155	1,32	1500 National Grid Plc, 0,163%, scadenza 20/01/2028	1.276	1,45
1300 Orano SA, 2,750%, scadenza 08/03/2028	1.197	1,37	1500 Nationwide Building Society, 0,250%, scadenza 14/09/2028	1.251	1,42
1200 RCI Banque SA, 4,875%, scadenza 21/09/2028	1.214	1,38	1200 NatWest Markets Plc, 4,250%, scadenza 13/01/2028	1.202	1,37
900 Rexel SA, 2,125%, scadenza 15/12/2028	800	0,91	1300 Sage Group Plc/The, 3,820%, scadenza 15/02/2028	1.301	1,48
400 SANEF SA, 0,950%, scadenza 19/10/2028	344	0,39	800 Santander UK Group Holdings Plc, 3,530%, scadenza 25/08/2028 *	767	0,87
1300 Societe Generale SA, 0,125%, scadenza 18/02/2028	1.100	1,25	400 Victoria Plc, 3,625%, scadenza 24/08/2026	325	0,37
1200 TDF Infrastructure SASU, 5,625%, scadenza 21/07/2028	1.202	1,37		11.081	12,62
1500 Teleperformance SE, 0,250%, scadenza 26/11/2027	1.246	1,42	Stati Uniti — 15,49% (28 febbraio 2023: 14,75%)		
	16.334	18,61	600 Avantor Funding Inc, 3,875%, scadenza 15/07/2028	554	0,63
Germania — 2,42% (28 febbraio 2023: 3,54%)			640 Berry Global Inc, 1,500%, scadenza 15/01/2027	582	0,66
1.200 Commerzbank AG, 4,625%, scadenza 21/03/2028 *	1.190	1,35	1000 Crown European Holdings SA, 5,000%, scadenza 15/05/2028	1.007	1,15
1000 Deutsche Lufthansa AG, 3,750%, scadenza 11/02/2028	938	1,07	1400 DXC Capital Funding DAC, 0,450%, scadenza 15/09/2027	1.172	1,33
	2.128	2,42	1300 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000%, scadenza 22/03/2028	1.196	1,36
Irlanda — 2,98% (28 febbraio 2023: 3,05%)			800 IQVIA Inc, 2,250%, scadenza 15/01/2028	714	0,81
1.400 AIB Group Plc, 2,250%, scadenza 04/04/2028 *	1.292	1,47	1400 JPMorgan Chase & Co, 1,638%, scadenza 18/05/2028 *	1.286	1,46
1300 Bank of Ireland Group Plc, 4,875%, scadenza 16/07/2028 *	1.321	1,51	1200 LKQ European Holdings BV, 4,125%, scadenza 01/04/2028	1.174	1,34
	2.613	2,98	1000 Morgan Stanley, 4,813%, scadenza 25/10/2028 *	1.024	1,17
Italia — 5,42% (28 febbraio 2023: 7,49%)			1300 PVH Corp, 3,125%, scadenza 15/12/2027	1.225	1,40
900 Autostrade per l'Italia SpA, 1,625%, scadenza 25/01/2028	798	0,91	1400 Schneider Electric SE, 1,500%, scadenza 15/01/2028	1.296	1,48
600 Autostrade per l'Italia SpA, 2,000%, scadenza 04/12/2028	528	0,60	1500 Thermo Fisher Scientific Inc, 0,500%, scadenza 01/03/2028	1.309	1,49
350 IMA Industria Macchine Automatiche SpA, 3,750%, scadenza 15/01/2028	315	0,36	1200 Verizon Communications Inc, 1,375%, scadenza 02/11/2028	1.064	1,21
1500 Intesa Sanpaolo SpA, 1,750%, scadenza 20/03/2028	1.361	1,55		13.603	15,49
400 Italmatch Chemicals SpA, 10,000%, scadenza 06/02/2028	395	0,45	Totale Obbligazioni ed effetti societari (costo 84.963 euro)		
1000 Mundys SpA, 1,875%, scadenza 12/02/2028	864	0,98	84.692		
500 TeamSystem SpA, 7,413%, scadenza 15/02/2028 *	497	0,57	Obbligazioni ed effetti governativi — 2,00% (28 febbraio 2023: 2,07%)		
	4.758	5,42	Romania — 2,00% (28 febbraio 2023: 2,07%)		
Giappone — 1,45% (28 febbraio 2023: 0,00%)			2.000 Romanian Government International Bond, 2,125%, scadenza 07/03/2028		
1.500 NTT Finance Corp, 0,399%, scadenza 13/12/2028	1.275	1,45		1.761	2,00
Lussemburgo — 2,02% (28 febbraio 2023: 3,14%)			Totale Obbligazioni ed effetti governativi (costo 1.748 euro)		
1.000 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,000%, scadenza 04/05/2028	786	0,89	1.761		
500 Kleopatra Finco Sarl, 4,250%, scadenza 01/03/2026	419	0,48	Totale attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
600 Matterhorn Telecom SA, 4,000%, scadenza 15/11/2027	567	0,65	86.453		
	1.772	2,02	Totale Attività e passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico		
Paesi Bassi — 5,82% (28 febbraio 2023: 2,14%)			86.453		
1.300 ABN AMRO Bank NV, 4,000%, scadenza 16/01/2028	1.285	1,46	Altre attività eccedenti le passività		
1200 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625%, scadenza 27/01/2028 *	1.217	1,39	1.339		
1300 ING Groep NV, 4,875%, scadenza 14/11/2027 *	1.322	1,51	Patrimonio in gestione		
1400 TenneT Holding BV, 1,375%, scadenza 05/06/2028	1.283	1,46	87.792€		
	5.107	5,82	100,00		
Norvegia — 1,48% (28 febbraio 2023: 0,00%)			Analisi delle attività totali		
1.500 Telenor ASA, 0,250%, scadenza 14/02/2028	1.296	1,48	Valori mobiliari ammessi alla quotazione su una borsa ufficiale o negoziati su un mercato regolamentato		
			98,36		
			Altre attività		
			1,64		
			Totale Attività		
			100,00		

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

[Pagina lasciata intenzionalmente vuota]

Stato patrimoniale

(in migliaia)	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	
	AI	AI	AI	AI	AI	AI	AI	AI
	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023
ATTIVITÀ CORRENTI:								
Liquidità (Nota 7)	\$ 1	\$ 1	\$ -	\$ -	\$ 7.482	\$ 34.310	€ 1.873	€ 4.251
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	-	-	2.257	2.060	4.123	7.065	1.863	2.191
Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Investimenti	950.341	844.196	226.747	140.166	1.007.553	1.183.129	86.466	125.838
Investimenti costituiti in pegno	-	-	-	-	235	-	-	-
Opzioni (premio)	-	-	327	64	2.256	556	-	4
Contratti di swap	-	-	1.321	2.534	9.469	8.276	22	-
Swaption	-	-	-	-	-	-	-	-
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine	-	-	-	-	567	540	4	72
Apprezzamento non realizzato su contratti a termine	-	-	310	303	2.534	2.474	322	476
Crediti per cessione di investimenti	-	-	4.584	1.429	12.429	17.093	-	-
Crediti per azioni partecipative redimibili vendute	-	-	275	53	395	429	-	-
Crediti da interessi e altri proventi	2.142	2.036	1.538	1.107	8.528	8.995	742	1.280
Crediti per dividendi	-	-	69	8	10	10	9	31
Crediti da commissioni di gestione	-	-	-	-	-	-	-	-
Altre attività	1	-	-	-	8	-	2	-
Totale Attività correnti	952.485	846.233	237.428	147.724	1.055.589	1.262.877	91.303	134.143
PASSIVITÀ CORRENTI:								
Scoperto di c/c (Nota 7)	-	-	5.862	620	6.816	849	-	-
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	-	-	1.337	2.826	1.189	445	8	9
Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Opzioni (premio)	-	-	195	70	1.588	615	-	4
Contratti di swap	-	-	20	46	1.749	1.867	-	-
Swaption	-	-	-	-	-	-	-	-
Deprezzamento non realizzato su contratti di cambio a termine	-	-	-	-	2.005	2.578	179	338
Deprezzamento non realizzato su contratti a termine	-	-	152	180	1.496	3.625	91	1.065
Debiti per investimenti acquistati	19.824	9.879	25.760	11.726	37.494	101.191	647	187
Debiti da distribuzioni ai detentori di azioni rimborsabili	3.017	2.054	177	132	175	148	1	1
Commissioni di gestione dovute (Nota 3)	456	363	111	71	465	487	3	3
Debiti da commissioni di incentivo (Nota 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria dovute (Nota 3)	30	24	23	16	73	73	13	14
Debiti da commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	-	-	10	1	23	20	-	-
Debiti da azioni rimborsabili riacquistate	-	-	217	1	2.052	1.904	-	-
Ratei passivi e altre passività	239	298	88	116	435	375	38	55
Passività (escluso il Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative redimibili)	23.566	12.618	33.952	15.805	55.560	114.177	980	1676
Totale Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili	\$ 928.919	\$ 833.615	\$ 203.476	\$ 131.919	\$1.000.029	\$1.148.700	€ 90.323	€ 132.467

(in migliaia)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short- Term Government Fund ^A		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund ^A		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund ^A	
	AI	AI	AI	AI	AI	AI	AI	AI
	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023
ATTIVITÀ CORRENTI:								
Liquidità (Nota 7)	\$ 1.001	\$ 3.850	\$ 14	\$ 14	\$ 17	\$ 17	\$ 15	\$ 45
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	124	162	-	-	-	-	-	-
Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Investimenti	50.686	52.716	-	-	-	-	-	-
Investimenti costituiti in pegno	-	-	-	-	-	-	-	-
Opzioni (premio)	-	-	-	-	-	-	-	-
Contratti di swap	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaption	-	-	-	-	-	-	-	-
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine	32	60	-	-	-	-	-	-
Apprezzamento non realizzato su contratti a termine	-	38	-	-	-	-	-	-
Crediti per cessione di investimenti	355	554	-	-	-	-	-	-
Crediti per azioni partecipative redimibili vendute	8	4	-	-	-	-	-	-
Crediti da interessi e altri proventi	703	739	-	-	-	-	-	-
Crediti per dividendi	1	-	-	-	-	-	-	-
Crediti da commissioni di gestione	-	-	-	-	-	-	-	-
Altre attività	9	-	-	-	-	-	-	-
Totale Attività correnti	52.919	58.123	14	14	17	17	15	45
PASSIVITÀ CORRENTI:								
Scoperto di c/c (Nota 7)	-	140	-	-	-	-	-	-
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	-	38	-	-	-	-	-	-
Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Opzioni (premio)	-	-	-	-	-	-	-	-
Contratti di swap	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaption	-	-	-	-	-	-	-	-
Deprezzamento non realizzato su contratti di cambio a termine	105	271	-	-	-	-	-	-
Deprezzamento non realizzato su contratti a termine	10	-	-	-	-	-	-	-
Debiti per investimenti acquistati	851	4	-	-	-	-	-	-
Debiti da distribuzioni ai detentori di azioni rimborsabili	100	89	-	-	-	-	-	-
Commissioni di gestione dovute (Nota 3)	40	41	-	-	-	-	-	-
Debiti da commissioni di incentivo (Nota 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria dovute (Nota 3)	12	11	-	-	-	-	-	3
Debiti da commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	3	4	-	-	-	-	-	-
Debiti da azioni rimborsabili riacquistate	51	-	-	-	-	-	-	-
Ratei passivi e altre passività	64	94	14	14	17	17	15	42
Passività (escluso il Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative redimibili)	1.236	692	14	14	17	17	15	45
Totale Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili	\$ 51.683	\$ 57.431	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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 [^]	
AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023
\$ 681	\$ 1,425	\$ 8.313	\$ 20.391	\$ 631	\$ 63	\$ 29	\$ 60	\$ 22	\$ 35
-	-	1.907	882	1.060	1126	-	-	-	-
-	-	210.547	202.891	101.700	123.407	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	101	102	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	535	775	-	1	-	-	-	-
-	-	221	74	50	-	-	-	-	-
-	-	176	4.780	1.449	608	-	-	-	-
-	-	58	28	17	8	-	-	-	-
-	-	2.588	2.851	1.597	1.920	-	-	-	-
-	-	6	15	2	5	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	1	5	-	-	-	-	2	-	-
681	1.426	224.356	232.687	106.607	127.240	29	62	22	35
-	-	37	559	-	155	-	-	-	-
-	-	84	27	96	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	58	116	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	1.411	4.011	30	35	-	-	-	-
-	-	166	29	-	31	-	-	-	-
-	-	136	266	197	1250	-	-	-	-
-	12	100	94	177	172	-	-	-	-
-	14	96	91	63	67	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	9	23	20	16	14	-	3	-	3
-	2	6	6	7	7	-	-	-	-
662	1.366	11	45	52	74	11	11	-	-
19	23	123	184	52	79	18	48	22	32
681	1426	2.193	5.332	748	2000	29	62	22	35
\$ -	\$ -	\$ 222.163	\$ 227.355	\$ 105.859	\$ 125.240	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]		FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	
AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023
\$ 239	\$ 998	\$ 3.854	\$ 3.559	\$ 4.628	\$ 4.735	\$ 698	\$ 743	€ 15	€ 31
1.156	1.540	3.563	2.733	1.954	1.544	967	1.074	-	-
391.029	433.473	464.179	532.162	163.564	146.874	29.460	43.765	-	-
-	-	-	-	-	152	-	-	-	-
-	-	-	-	-	19	-	-	-	-
-	-	-	213	61	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	162	2.481	3.707	937	1.011	216	343	-	-
-	-	718	4.839	404	338	110	202	-	-
-	771	1.119	2.646	1.550	3.576	-	1	-	-
41	41	1.157	2.043	17	1	2	1	-	-
4.203	4.375	4.353	2.855	1.120	1.086	343	491	-	-
24	20	20	127	5	15	2	6	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	-	9	1	2	-	9	-	-	-
396.700	441.380	481.453	554.885	174.242	159.351	31.807	46.626	15	31
1.759	522	620	484	-	-	-	-	-	-
1	6	406	1	139	17	74	3	-	-
-	-	-	-	-	4	-	-	-	-
-	-	326	-	-	-	92	76	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
618	1.130	3.247	3.219	1.300	2.097	79	90	-	-
269	373	705	61	245	1.043	41	34	-	-
-	770	1.119	25.758	17.834	9.282	109	306	-	-
2	15	7	2	-	-	-	-	-	-
233	200	164	153	19	17	2	2	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
38	32	40	36	19	15	11	9	-	3
15	13	15	11	-	-	-	-	-	-
13	299	541	1.106	-	72	-	-	-	-
287	313	55	84	222	101	40	56	15	28
3.235	3.673	7.245	30.915	19.778	12.648	448	576	15	31
\$ 393.465	\$ 437.707	\$ 474.208	\$ 523.970	\$ 154.464	\$ 146.703	\$ 31.359	\$ 46.050	€ -	€ -

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Stato patrimoniale – (segue)

(in migliaia)	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 [^]	
	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023
	ATTIVITÀ CORRENTI:							
Liquidità (Nota 7)	\$ 26.891	\$ 63.691	\$ 30	\$ 30	\$ 3.764	\$ 3.203	\$ -	\$ -
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	143.867	250.586	-	-	3.779	3.915	-	-
Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Investimenti	1.432.224	1.913.653	-	-	275.837	267.865	-	-
Investimenti costituiti in pegno	57.208	1.590	-	-	-	-	-	-
Opzioni (premio)	21.526	6.090	-	-	280	566	-	-
Contratti di swap	113.490	155.867	-	-	725	1.033	-	-
Swaption	-	-	-	-	47	-	-	-
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine	13.409	21.504	-	-	536	536	-	-
Apprezzamento non realizzato su contratti a termine	54.997	20.467	-	-	1.448	53	-	-
Crediti per cessione di investimenti	384	13.260	-	-	3.571	5.180	-	-
Crediti per azioni partecipative redimibili vendute	899	1.024	-	-	8	2.133	-	-
Crediti da interessi e altri proventi	29.668	36.399	-	-	3.869	3.427	-	-
Crediti per dividendi	164	487	-	-	8	8	-	-
Crediti da commissioni di gestione	-	-	-	-	-	-	-	-
Altre attività	7	-	-	-	9	1	-	-
Totale Attività correnti	1.894.734	2.484.618	30	30	293.881	287.920	-	-
PASSIVITÀ CORRENTI:								
Scoperto di c/c (Nota 7)	76.873	83.849	-	-	189	2	-	-
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	19.369	76.579	-	-	249	119	-	-
Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Opzioni (premio)	45.858	46.352	-	-	56	36	-	-
Contratti di swap	53.289	43.002	-	-	353	761	-	-
Swaption	-	-	-	-	73	-	-	-
Deprezzamento non realizzato su contratti di cambio a termine	14.349	43.616	-	-	2.359	2.965	-	-
Deprezzamento non realizzato su contratti a termine	54.049	47.194	-	-	504	890	-	-
Debiti per investimenti acquistati	114.479	4.384	-	-	1.181	7.800	-	-
Debiti da distribuzioni ai detentori di azioni rimborsabili	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissioni di gestione dovute (Nota 3)	1.627	2.062	-	-	27	24	-	-
Debiti da commissioni di incentivo (Nota 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria dovute (Nota 3)	102	151	-	-	26	22	-	-
Debiti da commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	122	136	-	-	-	-	-	-
Debiti da azioni rimborsabili riacquistate	1.042	3.140	-	-	1.890	82	-	-
Ratei passivi e altre passività	1.415	1.652	30	30	165	207	-	-
Passività (escluso il Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative redimibili)	382.574	352.117	30	30	7.072	12.908	-	-
Totale Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili	\$ 1.512.160	\$ 2.132.501	\$ -	\$ -	\$ 286.809	\$ 275.012	\$ -	\$ -
(in migliaia)	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 [^]	
	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023	AI 31 agosto 2023	AI 28 febbraio 2023
	ATTIVITÀ CORRENTI:							
Liquidità (Nota 7)	\$ 67	\$ 136	\$ 3.196	\$ 223	\$ 1.920	\$ 1.762	\$ 35	\$ 5
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	275	194	-	-	1.118	2.709	99	8
Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Investimenti	8.902	8.571	151.997	164.330	260.160	538.707	23.928	10.360
Investimenti costituiti in pegno	-	-	-	-	-	-	-	-
Opzioni (premio)	-	-	-	-	-	-	-	-
Contratti di swap	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaption	-	-	-	-	-	-	-	-
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine	77	92	1.454	3.132	7.522	13.024	12	10
Apprezzamento non realizzato su contratti a termine	26	59	-	-	512	2.190	42	2
Crediti per cessione di investimenti	-	155	106	490	-	1.798	567	248
Crediti per azioni partecipative redimibili vendute	-	-	157	117	2	1.797	-	1
Crediti da interessi e altri proventi	95	104	1.883	1.781	2.667	5.523	386	175
Crediti per dividendi	3	1	340	345	156	233	4	2
Crediti da commissioni di gestione	2	2	-	-	-	-	-	-
Altre attività	8	8	-	-	-	-	16	-
Totale Attività correnti	9.455	9.322	159.133	170.418	274.057	567.743	25.089	10.811
PASSIVITÀ CORRENTI:								
Scoperto di c/c (Nota 7)	32	-	-	4	-	7	123	-
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	-	26	-	850	992	2.495	-	-
Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Opzioni (premio)	-	-	-	-	-	-	-	-
Contratti di swap	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaption	-	-	-	-	-	-	-	-
Deprezzamento non realizzato su contratti di cambio a termine	161	107	3.353	3.966	16.536	23.627	245	202
Deprezzamento non realizzato su contratti a termine	13	5	-	-	-	-	-	-
Debiti per investimenti acquistati	-	145	106	490	-	1.798	350	163
Debiti da distribuzioni ai detentori di azioni rimborsabili	-	-	-	-	-	-	1	1
Commissioni di gestione dovute (Nota 3)	-	-	85	83	208	260	6	-
Debiti da commissioni di incentivo (Nota 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria dovute (Nota 3)	14	13	24	24	27	38	10	7
Debiti da commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	-	-	11	11	-	-	-	-
Debiti da azioni rimborsabili riacquistate	-	-	1.074	2.595	55	-	3	-
Ratei passivi e altre passività	24	31	354	386	229	247	29	44
Passività (escluso il Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative redimibili)	244	327	5.007	8.409	18.047	28.472	767	417
Totale Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili	\$ 9.211	\$ 8.995	\$ 154.126	\$ 162.009	\$ 256.010	\$ 539.271	\$ 24.322	\$ 10.394

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Stato patrimoniale – (segue)

(in migliaia)	Legg Mason Brandywine Global - US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^] α	
	AI	AI	AI	AI	AI	AI	AI	AI
	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023
ATTIVITÀ CORRENTI:								
Liquidità (Nota 7)	\$ 15	\$ -	\$ 2.369	\$ 1.879	\$ 2	\$ 1.147	\$ 26	\$ -
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	-	-	1.715	664	418	431	-	-
Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Investimenti	-	-	67.273	69.694	14.815	13.130	-	2.583
Investimenti costituiti in pegno	-	-	-	-	-	-	-	-
Opzioni (premio)	-	-	-	-	-	-	-	-
Contratti di swap	-	-	-	-	4	33	-	-
Swaption	-	-	-	-	-	-	-	-
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine	-	-	266	249	38	86	-	-
Apprezzamento non realizzato su contratti a termine	-	-	55	-	66	-	-	-
Crediti per cessione di investimenti	-	-	312	327	-	-	-	-
Crediti per azioni partecipative redimibili vendute	-	-	-	-	-	-	-	-
Crediti da interessi e altri proventi	-	-	690	948	155	186	-	-
Crediti per dividendi	-	-	3	9	3	-	-	5
Crediti da commissioni di gestione	-	-	1	-	1	5	-	23
Altre attività	-	-	-	-	-	4	-	-
Totale Attività correnti	15	-	72.684	73.770	15.502	15.022	26	2.611
PASSIVITÀ CORRENTI:								
Scoperto di c/c (Nota 7)	-	-	188	1	-	-	-	-
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	-	-	66	122	-	-	-	-
Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Opzioni (premio)	-	-	-	-	-	-	-	-
Contratti di swap	-	-	-	-	41	-	-	-
Swaption	-	-	-	-	-	-	-	-
Deprezzamento non realizzato su contratti di cambio a termine	-	-	2.543	3.482	74	64	-	20
Deprezzamento non realizzato su contratti a termine	-	-	130	283	-	123	-	-
Debiti per investimenti acquistati	-	-	312	327	-	-	-	-
Debiti da distribuzioni ai detentori di azioni rimborsabili	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissioni di gestione dovute (Nota 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Debiti da commissioni di incentivo (Nota 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria dovute (Nota 3)	-	-	13	13	11	4	6	7
Debiti da commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Debiti da azioni rimborsabili riacquistate	15	-	-	-	-	-	-	-
Ratei passivi e altre passività	-	-	145	132	60	27	20	50
Passività (escluso il Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative redimibili)	15	-	3.397	4.360	186	218	26	77
Totale Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative redimibili	\$ -	\$ -	\$ 69.287	\$ 69.410	\$ 15.316	\$ 14.804	\$ -	\$ 2.534

(in migliaia)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	
	AI	AI	AI	AI	AI	AI	AI	AI
	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023
ATTIVITÀ CORRENTI:								
Liquidità (Nota 7)	\$ 3.747	\$ 11.596	\$ 301	\$ 2.053	\$ 27.439	\$ 11.074	\$ 164	\$ 385
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	-	-	-	-	-	-	-	-
Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Investimenti	213.403	214.039	35.254	36.590	1.553.421	1.629.033	14.730	12.823
Investimenti costituiti in pegno	-	-	-	-	-	-	-	-
Opzioni (premio)	-	-	-	-	-	-	-	-
Contratti di swap	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaption	-	-	-	-	-	-	-	-
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine	4	4	-	1	31	22	-	-
Apprezzamento non realizzato su contratti a termine	-	-	-	-	-	-	-	-
Crediti per cessione di investimenti	92	179	-	-	14.782	3.682	-	-
Crediti per azioni partecipative redimibili vendute	21	5	-	-	17.776	29.209	-	-
Crediti da interessi e altri proventi	6	14	-	7	10	20	1	-
Crediti per dividendi	97	42	60	72	1.208	740	21	13
Crediti da commissioni di gestione	-	-	-	-	-	-	-	-
Altre attività	2	-	8	-	8	4	5	-
Totale Attività correnti	217.372	225.879	35.623	38.723	1.614.675	1.673.784	14.921	13.221
PASSIVITÀ CORRENTI:								
Scoperto di c/c (Nota 7)	622	-	-	-	58	7	6	-
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	-	-	-	-	-	-	-	-
Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Opzioni (premio)	-	-	-	-	-	-	-	-
Contratti di swap	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaption	-	-	-	-	-	-	-	-
Deprezzamento non realizzato su contratti di cambio a termine	86	229	16	56	863	840	-	-
Deprezzamento non realizzato su contratti a termine	-	-	-	-	-	-	-	-
Debiti per investimenti acquistati	92	179	-	-	14.782	3.682	-	-
Debiti da distribuzioni ai detentori di azioni rimborsabili	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissioni di gestione dovute (Nota 3)	207	200	32	33	720	704	6	6
Debiti da commissioni di incentivo (Nota 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria dovute (Nota 3)	42	43	12	11	110	130	10	9
Debiti da commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	37	35	4	4	164	170	-	-
Debiti da azioni rimborsabili riacquistate	193	176	1	44	3.332	28.161	-	-
Ratei passivi e altre passività	177	224	30	47	95	111	22	27
Passività (escluso il Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative redimibili)	1.456	1.086	95	195	20.124	33.805	44	42
Totale Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative redimibili	\$ 215.916	\$ 224.793	\$ 35.528	\$ 38.528	\$1.594.551	\$1.639.979	\$ 14.877	\$ 13.179

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Stato patrimoniale – (segue)

(in migliaia)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]		Legg Mason US Equity Fund [^]		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^] ₆	
	AI	AI	AI	AI	AI	AI	AI	AI
	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023
ATTIVITÀ CORRENTI:								
Liquidità (Nota 7)	\$	\$	\$	\$	€	€	\$	\$
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	–	–	23	23	1.351	1.256	2.310	402
Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Investimenti	4.230	4.273	–	–	–	–	–	20.883
Investimenti costituiti in pegno	–	–	–	–	–	–	–	–
Opzioni (premio)	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratti di swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaption	–	–	–	–	–	–	–	–
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine	–	–	–	–	–	–	–	–
Apprezzamento non realizzato su contratti a termine	–	–	–	–	–	–	–	–
Crediti per cessione di investimenti	–	–	–	–	–	–	–	–
Crediti per azioni partecipative redimibili vendute	–	–	–	–	–	–	–	3
Crediti da interessi e altri proventi	–	–	–	–	–	–	–	1
Crediti per dividendi	5	8	–	–	11	3	–	62
Crediti da commissioni di gestione	1	–	–	–	–	–	–	–
Altre attività	16	–	–	–	–	–	3	–
Totale Attività correnti	4.252	4.281	23	23	1.362	1.259	2.313	21.351
PASSIVITÀ CORRENTI:								
Scoperto di c/c (Nota 7)	2	–	–	–	–	–	–	–
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Opzioni (premio)	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratti di swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaption	–	–	–	–	–	–	–	–
Deprezzamento non realizzato su contratti di cambio a termine	–	–	–	–	–	–	–	90
Deprezzamento non realizzato su contratti a termine	–	–	–	–	–	–	–	–
Debiti per investimenti acquistati	–	–	–	–	–	–	–	–
Debiti da distribuzioni ai detentori di azioni rimborsabili	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissioni di gestione dovute (Nota 3)	–	1	–	–	–	–	–	25
Debiti da commissioni di incentivo (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria dovute (Nota 3)	8	7	–	–	–	3	8	11
Debiti da commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	2
Debiti da azioni rimborsabili riacquistate	–	–	–	–	1.175	1.185	2.247	–
Ratei passivi e altre passività	13	19	23	23	187	71	58	133
Passività (escluso il Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative redimibili)	23	27	23	23	1.362	1.259	2.313	261
Totale Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili	\$ 4.229	\$ 4.254	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ 21.090

(in migliaia)	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]	
	AI	AI	AI	AI	AI	AI	AI	AI
	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023	31 agosto 2023	28 febbraio 2023
ATTIVITÀ CORRENTI:								
Liquidità (Nota 7)	\$	\$	€	€	\$	\$	\$	\$
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	28	28	82	65	51	51	61	61
Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Investimenti	–	–	–	–	–	–	–	–
Investimenti costituiti in pegno	–	–	–	–	–	–	–	–
Opzioni (premio)	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratti di swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaption	–	–	–	–	–	–	–	–
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine	–	–	–	–	–	–	–	–
Apprezzamento non realizzato su contratti a termine	–	–	–	–	–	–	–	–
Crediti per cessione di investimenti	–	–	–	–	–	–	–	–
Crediti per azioni partecipative redimibili vendute	–	–	–	–	–	–	–	–
Crediti da interessi e altri proventi	–	–	–	–	–	–	–	–
Crediti per dividendi	–	–	–	–	–	–	–	–
Crediti da commissioni di gestione	–	–	–	–	–	–	–	–
Altre attività	–	–	–	–	–	–	–	–
Totale Attività correnti	28	28	82	65	51	51	61	61
PASSIVITÀ CORRENTI:								
Scoperto di c/c (Nota 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:								
Opzioni (premio)	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratti di swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaption	–	–	–	–	–	–	–	–
Deprezzamento non realizzato su contratti di cambio a termine	–	–	–	–	–	–	–	–
Deprezzamento non realizzato su contratti a termine	–	–	–	–	–	–	–	–
Debiti per investimenti acquistati	–	–	–	–	–	–	–	–
Debiti da distribuzioni ai detentori di azioni rimborsabili	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissioni di gestione dovute (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Debiti da commissioni di incentivo (Nota 3)	–	–	3	–	–	–	–	–
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria dovute (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Debiti da commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Debiti da azioni rimborsabili riacquistate	–	–	–	–	51	51	38	38
Ratei passivi e altre passività	28	28	79	65	–	–	23	23
Passività (escluso il Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative redimibili)	28	28	82	65	51	51	61	61
Totale Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Stato patrimoniale – (segue)

(in migliaia)	Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	Al 31 agosto 2023	Al 28 febbraio 2023	Al 31 agosto 2023	Al 28 febbraio 2023
ATTIVITÀ CORRENTI:				
Liquidità (Nota 7)	€ 222	€ 1.848	\$ 235.072	\$ 331.948
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	–	–	203.275	312.657
Attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:				
Investimenti	86.453	34.759	16.096.309	17.052.700
Investimenti costituiti in pegno	–	–	57.443	1.742
Opzioni (premio)	–	–	24.476	7.318
Contratti di swap	–	–	125.776	170.266
Swaption	–	–	47	–
Apprezzamento non realizzato di contratti di cambio a termine	–	–	35.171	53.350
Apprezzamento non realizzato su contratti a termine	–	–	69.493	32.496
Crediti per cessione di investimenti	156	–	218.032	135.703
Crediti per azioni partecipative redimibili vendute	–	689	35.638	48.971
Crediti da interessi e altri proventi	1.020	344	91.408	103.724
Crediti per dividendi	40	11	11.968	10.290
Crediti da commissioni di gestione	–	9	17	64
Altre attività	3	2	269	59
Totale Attività correnti	87.894	37.662	17.204.394	18.261.288
PASSIVITÀ CORRENTI:				
Scoperto di c/c (Nota 7)	–	–	105.849	91.015
Conti in marginazione e liquidità vincolata (Nota 7)	–	–	25.997	84.123
Passività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico:				
Opzioni (premio)	–	–	47.795	47.119
Contratti di swap	–	–	65.757	46.859
Swaption	–	–	73	–
Deprezzamento non realizzato su contratti di cambio a termine	–	–	74.855	121.367
Deprezzamento non realizzato su contratti a termine	–	–	58.809	59.938
Debiti per investimenti acquistati	–	815	391.788	301.633
Debiti da distribuzioni ai detentori di azioni rimborsabili	–	–	4.030	2.826
Commissioni di gestione dovute (Nota 3)	35	–	9.556	9.548
Debiti da commissioni di incentivo (Nota 3)	–	–	3	–
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria dovute (Nota 3)	8	2	1.618	1.695
Debiti da commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	–	–	1.027	1.005
Debiti da azioni rimborsabili riacquistate	23	–	67.302	54.803
Ratei passivi e altre passività	36	22	11.358	11.327
Passività (escluso il Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative redimibili)	102	839	865.817	833.258
Totale Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili	€ 87.792	€ 36.823	\$ 16.338.577	\$ 17.428.030

Gli importi indicati con “–” sono pari a 0\$/0€/0¥/0£ o inferiori a 1.000\$/1.000€/1.000¥/1.000£.

I dati in euro di 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[^] e Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] sono stati convertiti in dollari statunitensi nel dato totale di Franklin Templeton Global Funds Plc al 31 agosto 2023 utilizzando il tasso di chiusura USD/EUR di 0,9222 (28 febbraio 2023: 0,9454).

I dati in yen di Legg Mason Japan Equity Fund[^] sono stati convertiti in dollari USA nel dato totale di Franklin Templeton Global Funds Plc al 31 agosto 2023 utilizzando il tasso di chiusura USD/JPY di 145,4950 (28 febbraio 2023: 136,1550).

I dati in sterline britanniche di FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] sono stati convertiti in dollari statunitensi nel dato totale di Franklin Templeton Global Funds Plc al 31 agosto 2023 utilizzando il tasso di chiusura USD/GBP di 0,7894 (28 febbraio 2023: 0,8314).

α A far data dal 24 marzo 2023, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] e FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] hanno cessato le negoziazioni.

β A far data dal 20 aprile 2023, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] ha cessato le negoziazioni.

γ A far data dal 20 giugno 2023, è stato lanciato il fondo FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^].

δ A far data dal 17 luglio 2023, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^] ha cessato le negoziazioni.

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

Stato patrimoniale – (segue)

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

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Stato patrimoniale – (segue)

	31 agosto 2023			28 febbraio 2023			28 febbraio 2022		
	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund (segue)									
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (D)	\$ 708	9	82,04	\$ 697	8	82,45	\$ 1.399	15	91,68
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	62	1	101,30	8	–	100,36	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (D) (Copertura)	63	1	77,55	60	1	78,21	76	1	87,81
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	28.225	162	178,09	34.965	201	174,28	44.980	243	185,22
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (M)	361	4	102,25	368	4	102,68	12.098	106	113,85
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier CHF (Copertura)	58.335	522	98,79	54.671	522	98,72	3.442	28	111,13
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (Copertura)	818	6	130,90	1.365	10	129,55	4.740	30	141,32
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	39	1	66,14	39	1	67,15	69	1	76,38
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura)	744	7	78,41	827	9	79,03	49.523	266	138,99
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura) Plus (e)	203	2	68,28	203	2	69,00	205	2	77,65
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier PLN (Copertura)	2.800	90	128,35	2.666	95	124,47	3.664	121	127,30
Azioni a Distribuzione di Classe LM in AUD (M) (Copertura)	59.304	1.015	90,19	59.726	973	91,26	93.108	1.251	102,46
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in GBP (Copertura)	201	1	138,43	207	1	135,69	148	1	145,04
FTGF Western Asset US High Yield Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 17.076	93	184,30	\$ 18.805	105	179,29	\$ 25.055	129	194,84
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	25.944	385	67,32	27.885	411	67,77	34.889	446	78,15
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	1.203	15	81,53	1.375	17	82,01	2.271	24	94,27
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	1.024	15	68,57	1.290	18	69,82	2.424	30	81,29
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) (Copertura)	1.401	19	66,39	1.403	20	67,53	1.414	16	79,66
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	17	1	100,59	5	–	94,71	–	–	93,84
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	394	823	0,65	383	776	0,66	520	907	0,78
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	–	–	–	–	–	–	338	2	192,79
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (D)	–	–	–	46	–	67,77	106	1	78,17
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	4.095	23	174,58	4.132	24	170,27	3.170	17	185,96
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)	1.703	25	67,32	2.074	31	67,78	2.748	35	78,16
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	2.611	16	164,69	3.404	21	160,70	3.837	22	175,71
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)	433	5	84,10	581	7	84,66	1.106	11	97,67
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)	361	3	95,28	347	3	94,00	413	3	105,40
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	4.092	24	169,77	4.327	26	164,83	7.467	42	178,39
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)	230	3	80,12	257	3	80,65	226	2	93,01
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	20.214	114	176,94	35.228	205	171,58	101.736	549	185,21
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	696	5	105,44	1	–	102,60	1	–	111,69
Azioni a Distribuzione di Classe S in USD (M)	1	–	87,88	1	–	88,37	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (M) (Copertura)	30	–	84,70	28	–	86,14	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	–	–	–	–	–	–	45.730	232	197,50
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (M)	22.136	297	74,59	21.415	285	75,02	23.015	267	86,21
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in GBP (Copertura)	32	–	107,51	40	–	104,43	51	–	113,46
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	194	1	188,59	189	1	183,52	211	1	199,51
Azioni a Distribuzione di Classe A (G) in USD (D)	1.037	16	66,79	1.072	16	67,23	1.243	16	77,53
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	147	1	173,75	170	1	169,50	185	1	185,19
Azioni a Distribuzione di Classe L (G) in USD (D)	647	10	66,78	645	10	67,22	795	10	77,52
Azioni ad Accumulazione di Classe GF in USD	141	1	168,26	137	1	163,56	149	1	177,45
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^A									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 5.371	32	170,12
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	–	–	–	–	–	–	1.415	14	99,47
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	–	–	–	–	–	–	908	10	89,94
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	–	–	–	–	–	–	10	–	67,72
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	–	–	–	–	–	–	219	2	127,14
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (D) (Copertura)	–	–	–	–	–	–	293	4	67,99
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (D) (Copertura)	–	–	–	–	–	–	44	–	84,50
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	–	–	–	–	–	–	9	17	0,70
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	–	–	–	–	–	–	243	2	154,50
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)	–	–	–	–	–	–	1.023	10	99,42
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)	–	–	–	–	–	–	413	5	84,99
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)	–	–	–	–	–	–	10	–	88,88
Azioni a Distribuzione di Classe E in EUR (M) (Copertura)	–	–	–	–	–	–	15	–	75,92
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	–	–	–	–	–	–	67	–	151,93
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (D) (Copertura)	–	–	–	–	–	–	15	–	82,01
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	–	–	–	–	–	–	93	1	93,44
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	–	–	–	–	–	–	2.097	15	123,82
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (D) (Copertura)	–	–	–	–	–	–	79	1	73,50
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (M) (Copertura)	–	–	–	–	–	–	25.470	288	88,50
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	–	–	–	–	–	–	494	3	178,03
Azioni a Distribuzione di Classe A (G) in USD (D)	–	–	–	–	–	–	814	9	89,17
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	–	–	–	–	–	–	1.125	7	165,24
Azioni a Distribuzione di Classe L (G) in USD (D)	–	–	–	–	–	–	891	10	89,14
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund^A									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 24	–	106,83
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	–	–	–	–	–	–	1	–	90,49
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	–	–	–	–	–	–	5	–	89,98
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	–	–	–	–	–	–	1.928	18	94,23
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (M)	–	–	–	–	–	–	25.890	286	90,51
FTGF Western Asset Global High Yield Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 5.261	32	166,22	\$ 5.649	34	164,18	\$ 8.812	49	178,94
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	5.910	95	62,16	6.082	96	63,39	7.374	101	72,88
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	7.340	106	69,05	8.467	120	70,35	11.065	137	80,65
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	4.397	71	61,63	5.245	83	63,52	10.681	145	73,86
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)	4.259	93	70,73	5.294	107	73,48	7.679	122	86,67
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	2.114	18	109,24	2.233	19	110,61	2.029	16	113,76
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (D) (Copertura)	119	2	61,48	120	2	63,37	65	1	74,80
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	1.668	3.836	0,59	1.724	3.810	0,61	2.177	4.140	0,71
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	–	–	–	–	–	–	72	–	175,72
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (D)	29	–	62,04	30	–	63,26	201	3	72,72
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	929	6	157,16	920	6	155,61	1.483	9	170,46
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)	2.108	34	61,89	2.429	38	63,11	2.962	41	72,56
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	861	6	143,64	1.123	8	142,35	1.249	8	156,17
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)	162	2	76,20	165	2	77,70	207	2	89,34
Azioni a Distribuzione di Classe E in EUR (M) (Copertura)	14	–	61,20	14	–	63,06	18	–	74,28
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	2.919	19	150,47	2.845	19	148,37	2.036	13	161,10
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)	456	6	72,32	543	7	73,75	965	11	84,81
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (D)	4.181	52	81,07	4.458	54	82,67	5.807	61	95,06
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (D) (Copertura)	3.820	47	64,73	3.701	46	66,23	4.406	43	77,04
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	–	–	–	–	–	–	6.086	29	212,96
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	1.691	14	114,25	2.244	19	113,78	1.770	12	126,57
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (D) (Copertura)	28	–	70,38	27	–	72,01	35	–	83,77
Azioni a Distribuzione di Classe S in USD (M)	1	–	88,52	1	–	90,17	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (M) (Copertura)	30	–	85,24	29	–	87,81	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	1.411	8	169,02	2.047	12	167,12	2.374	13	182,46
Azioni a Distribuzione di Classe A (G) in USD (D)	936	15	62,16	1.003	16	63,38	1.240	17	72,88
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	434	3	155,73	431	3	154,37	507	3	169,39
Azioni a Distribuzione di Classe L (G) in USD (D)	605	10	62,17	607	10	63,40	678	9	72,89

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Stato patrimoniale – (segue)

	31 agosto 2023			28 febbraio 2023			28 febbraio 2022		
	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^A									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ -	-	-	\$ -	-	-	\$ 3.549	23	155,66
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	-	-	-	-	-	-	4.844	36	133,96
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	-	-	-	-	-	-	28	-	108,80
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	-	-	-	-	-	-	93	1	99,75
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	-	-	-	-	-	-	843	6	130,28
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	-	-	-	-	-	-	29	-	100,15
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	-	-	-	-	-	-	7.094	63	100,66
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	-	-	-	-	-	-	42.980	369	116,57
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	-	-	-	-	-	-	5	-	163,47
Azioni a Distribuzione di Classe A (G) in USD (A)	-	-	-	-	-	-	45	-	130,79
Azioni a Distribuzione di Classe L (G) in USD (A)	-	-	-	-	-	-	15	-	120,50
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 26.990	180	150,19	\$ 29.246	196	149,02	\$ 39.106	241	162,46
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	5.387	56	95,90	5.574	58	96,54	6.592	61	108,04
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	5.038	57	88,47	9.535	107	89,01	12.847	129	99,50
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	28.058	433	64,79	29.850	452	66,00	45.247	604	74,94
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)	11.979	259	71,45	13.954	283	73,37	21.798	356	84,24
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CHF (Copertura)	301	3	85,99	286	3	87,16	330	3	98,04
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura)	6.439	675	69,42	3.528	341	71,91	5.325	405	83,16
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1.695	7	218,21	1.927	8	221,94	2.698	11	228,02
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	962	9	95,50	935	9	95,84	1.734	14	107,09
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A)	398	4	104,93	447	4	109,59	541	4	115,43
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus	5.913	592	78,31	6.684	657	79,85	10.989	951	90,29
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (Copertura)	783	766	1,38	672	656	1,38	1.296	1.162	1,51
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	1.548	3.132	0,67	1.394	2.739	0,69	2.389	4.143	0,78
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus	429	817	0,71	605	1.131	0,72	940	1.545	0,82
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	55	-	144,50	54	-	143,57	62	-	156,90
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (D)	-	-	-	-	-	-	19	-	107,96
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	1.452	10	138,79	1.433	10	138,07	1.697	11	151,27
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)	1.096	11	95,92	1.111	12	96,56	1.306	12	108,06
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	581	5	119,64	590	5	119,08	704	5	130,59
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)	182	2	88,16	181	2	88,75	199	2	99,32
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	2.324	17	137,93	2.326	17	136,58	2.699	18	148,29
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)	581	7	88,21	585	7	88,80	654	7	99,38
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	-	-	-	-	-	-	221	2	110,48
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (M)	1.159	14	85,06	1.204	14	85,58	3.705	39	95,65
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	233	2	89,30	228	2	89,39	268	2	99,36
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	59.543	360	165,39	83.254	509	163,56	72.450	409	177,15
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (M)	136	1	102,26	1.371	13	102,87	-	-	-
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	121.629	732	153,33	120.289	732	155,45	130.405	732	158,82
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	11.741	100	107,82	8.187	72	107,84	8.686	65	119,68
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (A)	65.928	657	92,51	69.572	678	96,97	77.670	678	102,12
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (M)	10.869	102	98,66	10.936	102	101,76	12.221	102	107,28
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M)	74	1	105,01	84	1	111,31	92	1	111,51
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	15.063	84	179,53	25.877	146	176,99	43.801	230	190,55
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (M)	3.249	37	88,99	4.430	49	89,52	-	-	-
Azioni a Distribuzione di Classe LM in EUR (M) (Copertura)	1.650	18	82,79	1.358	15	84,23	1.103	10	96,42
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 32.260	262	123,03	\$ 30.772	254	121,01	\$ 22.239	176	126,60
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	11.497	112	102,58	7.663	75	101,67	6.851	64	106,79
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	21.870	223	90,61	21.104	222	90,07	9.882	91	96,55
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) (Copertura)	321	3	98,62	313	3	98,80	-	-	-
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (Copertura)	11.777	1.413	91,26	12.582	1.452	90,68	22.680	2.221	96,73
Azioni a Distribuzione di Classe A in SEK (M) (Copertura)	1	-	90,08	1	-	90,27	1	-	96,70
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	-	-	-	52	1	99,51	-	-	-
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	3.523	31	114,62	3.828	34	113,01	8.415	71	118,83
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (M)	4.053	40	101,44	3.761	37	100,53	519	5	105,71
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	3.329	31	107,84	3.313	31	106,39	3.238	29	111,98
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)	4.903	50	97,33	4.856	50	96,49	4.983	49	101,56
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	3.396	27	123,95	3.410	28	121,66	7.631	60	126,78
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)	904	10	93,67	1.287	14	92,86	1.596	16	97,66
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	22.778	229	91,58	8.345	87	90,78	9.247	85	96,86
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	15.094	111	135,64	25.521	192	132,97	27.247	197	138,22
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in CHF (M) (Copertura)	4.526	40	99,95	-	-	-	-	-	-
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	11.851	113	96,35	65.972	653	95,51	31.220	274	101,73
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (M) (Copertura)	247	2	99,50	-	-	87,78	189	2	94,28
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	112	1	126,64	565	4	124,65	2	-	130,72
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura)	34	-	96,69	13	-	96,15	1.278	9	101,92
Azioni a Distribuzione di Classe S in USD (M) Plus (e)	30.863	318	97,02	29.107	302	96,32	10.106	100	101,50
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	27	-	92,56	27	-	91,66	55	1	97,58
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (M) (Copertura) Plus (e)	8.813	94	86,09	6.422	70	86,37	3.050	29	93,27
Azioni a Distribuzione di Classe S in GBP (M) (Copertura) Plus (e)	272.530	2.353	91,42	285.334	2.604	91,09	262.829	2.023	96,86
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in AUD (Copertura)	9.499	155	94,58	9.722	155	93,22	10.991	155	97,63
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^A									
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	\$ 17	-	91,00	\$ 1	-	91,31	\$ 1	-	102,91
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1.681	16	105,85	1.721	17	103,78	2.746	24	115,64
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	16.767	116	143,93	25.147	178	141,02	42.779	273	156,86
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	35.323	332	98,05	20.636	201	97,14	39.201	315	110,84
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	2	-	87,15	2	-	85,63	3	-	96,15
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier NZD (Copertura)	4.127	71	98,08	5.009	84	96,21	6.128	84	107,57
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	1	-	93,62	1	-	91,67	-	-	-
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	28	-	90,30	28	-	89,44	-	-	-
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	4.168	41	101,50	4.099	41	99,25	4.122	37	109,96
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR (Copertura)	1.603	17	84,74	1.857	21	83,81	2.442	23	95,23
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in CAD (Copertura)	90.747	1.177	104,18	88.202	1.177	102,26	105.526	1.177	113,65
FTGF Western Asset Global Credit Fund^A									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 2.178	17	126,88	\$ 2.174	17	127,27	\$ 3.171	22	142,04
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	277	2	107,38	321	3	108,91	408	3	124,74
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1	-	100,31	-	-	-	-	-	-
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	27	-	82,03	27	-	82,92	53	1	94,35
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	19	-	84,06	18	-	84,38	63	1	94,58
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	24.453	160	152,58	39.438	259	152,29	69.126	411	168,26
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR (Copertura)	4.404	50	81,89	4.072	47	82,64	4.532	43	93,68
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^A									
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (D)	€ -	-	-	€ -	-	-	€ 48	-	96,68
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (Copertura)	-	-	-	-	-	-	6	-	97,70
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	-	-	-	-	-	-	1	-	105,33
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	-	-	-	-	-	-	37.393	205	182,42
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^A									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 317.519	2.547	124,65	\$ 388.476	3.241	119,86	\$ 788.243	5.937	132,77
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	113.722	1.481	76,80	124.647	1.627	76,61	200.496	2.254	88,97
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (S)	25.352	277	91,61	28.115	311	90,26	41.551	408	101,94
Azioni ad Accumulazione di Classe A in AUD (Copertura)	1.469	25	90,25	1.089	18	87,62	1.348	19	98,55

Stato patrimoniale – (segue)

	31 agosto 2023			28 febbraio 2023			28 febbraio 2022		
	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] (segue)									
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) (Copertura) Plus (e)	\$ 12.409	261	73,51	\$ 15.473	310	74,06	\$ 25.043	395	87,37
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CHF (Copertura)	4.835	43	98,33	5.462	53	96,71	17.146	142	110,87
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CNH (Copertura)	983	55	129,60	1.006	55	126,70	1.234	55	141,25
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) (Copertura) Plus (e)	1.604	134	86,94	2.787	220	88,22	4.928	302	103,16
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	151.228	1.349	103,39	157.441	1.479	100,65	364.733	2.837	114,66
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A)	4.792	50	88,33	5.211	55	90,13	7.824	73	96,24
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) (Copertura) Plus (e)	4.553	59	70,75	5.789	77	71,44	8.555	89	85,34
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (S) (Copertura)	5.821	67	80,41	6.023	71	80,16	7.304	70	93,13
Azioni ad Accumulazione di Classe A	232	1	141,65	385	2	143,47	508	3	142,50
Azioni ad Accumulazione di Classe A in GBP (Copertura)	5.172	37	110,93	5.757	45	107,22	22.692	141	120,28
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) (Copertura) Plus (e)	7.415	84	69,97	10.137	120	70,14	14.437	130	82,55
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus	–	–	–	69	7	75,21	80	7	86,91
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus (e)	–	–	–	2	–	74,98	4	–	86,74
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (Copertura)	1.301	150	94,64	1.390	158	92,28	3.282	297	104,81
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (Copertura)	9.030	10.435	1,17	9.979	11.868	1,13	23.139	24.857	1,26
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) (Copertura) Plus (e)	21.590	39.437	0,74	25.125	45.526	0,74	39.579	61.771	0,87
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (e)	29	50	0,79	29	50	0,79	34	50	0,92
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	–	–	–	91	1	107,65	126	1	119,54
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	32.259	290	111,20	34.826	325	107,20	49.624	416	119,34
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (S)	3.975	44	90,69	4.194	47	89,36	5.973	59	100,90
Azioni a Distribuzione di Classe A in JPY (M) Plus (e)	154	2	9.773,49	154	2	9.123,43	179	2	8.945,99
Azioni ad Accumulazione di Classe A in NOK (Copertura)	3.371	412	86,90	6.043	740	84,75	7.423	687	95,32
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	13.175	120	109,53	15.021	142	105,64	20.437	174	117,72
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (S)	1.291	14	90,46	1.410	16	89,13	2.115	21	100,63
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)	2.757	28	91,94	2.721	29	89,78	4.390	38	102,88
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	44.660	374	119,42	51.472	449	114,61	126.827	1.003	126,44
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (S)	6.318	68	92,80	6.629	73	91,43	11.450	111	103,26
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	74.920	591	126,79	87.446	719	121,62	189.669	1.415	134,04
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (M) Plus (e)	6.259	76	81,82	16.104	198	81,40	37.367	397	94,07
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (S)	10.067	110	91,31	11.462	127	89,96	20.429	201	101,60
Azioni ad Accumulazione di Classe X in CHF (Copertura)	9.628	83	102,23	9.965	94	100,30	28.117	225	114,39
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	1.983	12	148,48	2.037	13	146,02	5.023	30	151,60
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	56.593	481	108,50	48.362	434	105,36	155.230	1.158	119,51
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (A) (Copertura)	3.188	39	75,20	9.389	117	75,95	11.901	120	88,55
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (M) (Copertura)	603	7	76,80	2.413	30	76,88	6.919	68	90,25
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	917	5	148,14	964	5	149,67	1.576	8	147,89
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (Copertura)	34.208	230	117,32	38.851	286	113,11	78.246	462	126,27
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) (Copertura) Plus (e)	1.461	15	75,19	1.878	21	75,17	6.852	58	88,04
Azioni ad Accumulazione di Classe X in SGD (Copertura)	3.133	3.456	1,23	4.358	4.958	1,19	5.057	5.222	1,31
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	190.102	1.431	132,80	242.867	1.908	127,29	318.448	2.274	140,05
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (S)	22.727	249	91,10	23.154	258	89,75	25.952	552	101,36
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier AUD (Copertura)	845	14	95,90	850	14	92,81	2.277	30	103,71
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in AUD (S) (Copertura)	1.755	31	87,84	2.742	47	87,39	44.269	608	100,20
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (Copertura)	35.630	1.054	167,47	38.397	1.288	156,04	132.553	4.300	158,82
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier CHF (Copertura)	4.226	38	97,93	4.384	43	96,00	17.535	147	109,37
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in CHF (S) (Copertura)	1.217	14	76,11	1.151	14	76,70	2.440	25	89,64
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	1.038	6	154,76	22.074	137	151,92	32.676	185	157,68
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	127.680	1.100	107,00	361.662	3.293	103,82	627.086	4.760	117,49
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (S) (Copertura)	33.802	394	79,18	37.969	455	78,94	24.197	235	91,74
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	5.994	43	110,64	6.545	51	106,58	86.494	543	118,83
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura) Plus (e)	18.873	202	73,73	19.336	218	73,65	145.729	1.261	86,13
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier JPY (Copertura)	48.785	718	9.883,86	52.479	733	9.751,61	76.911	797	11.091,23
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in JPY (S) (Copertura)	–	–	–	–	–	–	7.912	100	9.096,56
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier PLN (Copertura)	1.190	49	101,13	1.116	52	96,27	1.546	63	102,28
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier SEK (Copertura)	25	3	96,63	25	3	96,83	50	4	109,26
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	1.164	8	138,06	11	–	132,05	12.078	83	144,73
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	2.998	24	116,95	147.182	1.229	113,27	177.135	1.238	127,65
Azioni a Distribuzione di Classe LM in AUD (S) (Copertura)	13.435	247	83,87	19.202	342	83,45	70.133	1.008	95,77
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	698	5	134,52	1.173	8	131,56	1.323	9	135,18
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 23	–	108,22	\$ 45	–	105,94	\$ 125	1	115,42
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	41	1	76,75	42	1	78,10	48	1	90,27
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	25	–	93,40	24	–	92,46	28	–	103,30
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	1	–	107,34	1	–	105,15	1	–	114,76
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	–	–	–	–	–	–	56	–	119,42
Azioni a Distribuzione di Classe X in CHF (M) (Copertura)	41	1	68,27	40	1	70,41	48	1	82,74
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	–	–	–	–	–	–	3.644	31	105,47
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura) Plus (e)	14	–	78,01	193	2	79,35	597	5	91,91
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	1.442	15	94,14	1.443	16	91,70	1.777	18	98,92
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	20.333	200	93,75	19.433	199	92,33	21.698	190	102,11
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP (Copertura)	35.101	285	97,17	31.373	274	95,04	35.151	253	103,53
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in AUD (Copertura)	–	–	–	–	–	–	101.230	1.230	113,36
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR (Copertura)	40.381	392	94,96	30.300	307	93,33	40.071	347	102,86
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in GBP (Copertura)	150.234	989	119,88	150.891	1.072	117,01	146.379	860	126,95
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in CAD (Copertura)	16.320	232	95,08	17.807	262	92,76	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe S in CHF (A)	18.542	200	81,90	19.240	200	90,61	21.046	200	96,50
Azioni a Distribuzione di Classe S in CHF (A) (Copertura)	4.311	40	95,21	4.180	40	98,43	–	–	–
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]									
Azioni ad Accumulazione di Classe D in EUR (Copertura)	\$ 966	10	91,64	\$ 958	10	91,07	\$ 645	6	98,36
Azioni a Distribuzione di Classe D in EUR (M) (Copertura)	344	5	70,42	348	5	73,01	423	5	83,76
Azioni ad Accumulazione di Classe D in USD	2.207	21	103,66	12.154	119	101,95	14.316	133	107,68
Azioni a Distribuzione di Classe D in USD (M)	997	13	78,34	1.461	18	80,39	1.638	18	90,09
Azioni a Distribuzione di Classe D in USD (M) Plus	213	3	72,66	219	3	74,86	247	3	84,29
Azioni ad Accumulazione di Classe M in CHF (Copertura)	319	3	91,87	299	3	91,94	1.415	13	99,34
Azioni a Distribuzione di Classe M in GBP (M) (Copertura)	–	–	–	–	–	–	697	6	86,63
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	–	–	–	–	–	–	419	4	110,41
Azioni ad Accumulazione di Classe M in USD	–	–	–	–	–	–	643	7	98,42
Azioni a Distribuzione di Classe M in USD (M)	766	10	78,03	747	9	80,06	787	9	89,71
Azioni ad Accumulazione di Classe M in EUR (Copertura)	52	1	95,89	50	1	95,01	1.052	9	102,04
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	78.717	596	132,14	78.484	606	129,48	263.425	1.941	135,74
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (Q)	7.581	95	80,21	8.643	105	82,24	10.212	112	91,28
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	4.152	33	114,69	4.182	35	113,55	153.236	1.121	121,86
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (Q) (Copertura)	184	2	71,67	523	7	74,31	16.884	179	84,35
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura) Plus (e)	11	–	72,20	85	–	74,62	12.070	106	84,77
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier JPY (Copertura)	–	–	–	41.500	500	11.303,04	53.024	500	12.194,36
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	419.557	3.023	138,80	409.895	3.023	135,60	526.808	3.728	141,30
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]									
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	\$ 9	–	73,46	\$ 9	–	74,87	\$ 10	–	86,27
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	60.438	615	98,27	57.381	585	98,09	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	–	–	–	–	–	–	717	6	100,06
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	1.065.732	10.625	100,30	1.062.117	10.625	99,96	1.146.553	10.359	110,68
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]									
Azioni ad Accumulazione di Classe A	£ 1	–	96,30	£ 1	–	97,14	£ 1	–	111,82
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP	1	–	82,52	1	–	83,09	1	–	95,37
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in GBP	–	–	–						

Stato patrimoniale – (segue)

	31 agosto 2023			28 febbraio 2023			28 febbraio 2022		
	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 101	1	107,81	\$ 102	1	108,03	\$ 644	5	122,84
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	15.518	158	98,63	16.144	164	98,52	19.025	171	111,27
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	–	–	–	–	–	–	870	7	111,34
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	1	–	90,80	1	–	90,61	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in GBP (Copertura)	–	–	–	–	–	–	154.630	951	121,21
Azioni a Distribuzione di Classe LM in GBP (M) (Copertura)	39.670	352	90,32	78.528	704	92,75	–	–	–
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^									
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (Q)	\$ 18.637	257	72,58	\$ 18.441	250	73,76	\$ 21.958	244	90,04
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 8	–	85,83	\$ 9	–	85,86	\$ 10	–	95,97
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	9	–	86,43	9	–	86,26	10	–	96,01
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	2.120	24	86,78	2.138	25	86,50	2.401	25	96,05
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (Copertura)	2.756	139	98,23	2.540	140	94,89	2.664	142	96,96
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	40	–	83,58	39	–	84,26	47	–	95,97
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	40	–	85,55	38	–	85,61	47	–	96,05
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	4.198	48	86,92	4.183	48	86,60	4.640	48	96,06
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	40	–	83,72	39	–	84,36	47	–	95,98
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 8.456	69	122,18	\$ 9.739	79	122,52	\$ 12.568	87	144,07
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	620	8	73,62	521	7	75,50	1.099	12	91,71
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (S)	17.885	196	91,41	17.976	192	93,73	22.007	196	112,29
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)	180	5	54,03	381	10	56,40	526	10	69,92
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	620	8	67,76	717	10	68,79	1.075	11	83,44
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura) (IH)	14.405	103	129,37	14.676	107	130,10	25.053	152	146,74
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (A) (Copertura)	189	3	56,00	305	5	58,95	583	7	72,27
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (S)	39	–	74,96	41	–	78,82	49	–	89,08
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (S) (Copertura) (IH)	5.161	57	84,08	5.444	60	86,44	7.052	63	99,31
Azioni ad Accumulazione di Classe A	87	1	87,01	87	1	91,89	102	1	96,89
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) (Copertura)	160	2	60,69	204	3	62,54	254	2	77,41
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (S) (Copertura)(IH)	2.952	25	93,79	3.053	27	95,78	4.647	32	108,33
Azioni ad Accumulazione di Classe A SGD	62	101	0,84	60	97	0,84	68	93	0,99
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	6	–	110,57	7	–	111,01	23	–	130,86
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (S)	61	1	91,36	63	1	93,69	107	1	112,23
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	253	2	106,35	285	3	106,92	450	4	126,35
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (S)	801	9	90,99	833	9	93,31	1.099	10	111,77
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	749	9	81,08	666	8	81,55	625	6	96,47
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura) (IH)	476	5	91,40	492	5	92,19	737	6	104,63
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	157	2	87,32	182	2	87,39	1.023	10	102,33
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (S)	77	1	67,44	79	1	69,16	202	2	82,84
Azioni a Distribuzione di Classe R in GBP (S) (Copertura) (IH)	24	–	77,47	24	–	79,11	38	–	89,48
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	2.541	29	87,68	2.545	29	87,70	3.321	32	102,61
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (S)	35	1	67,76	35	1	69,49	234	3	83,25
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	63	1	74,32	97	1	75,27	104	1	90,83
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura) (IH)	312	3	88,49	315	3	88,76	1.203	11	99,63
Azioni a distribuzione di Classe X in EUR (S) (Copertura) (IH)	–	–	–	8	–	75,89	528	5	87,56
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	14.747	110	105,88	17.560	131	111,55	26.213	167	117,12
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (Copertura)	4.427	46	76,43	5.057	55	76,86	18.737	152	91,79
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (Copertura) (IH)	154	1	94,44	162	1	94,07	250	2	104,00
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (S) (Copertura)	6.267	82	60,35	6.551	88	62,22	11.372	111	76,08
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (S) (Copertura) (IH)	4.018	40	79,10	4.031	41	80,78	6.464	53	91,37
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	21.505	211	102,08	21.695	213	102,03	26.070	219	119,20
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (S)	89	1	69,93	110	2	71,71	922	11	85,89
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	2.503	18	128,89	2.927	21	132,08	4.125	25	145,57
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	1.860	24	72,39	1.864	24	73,25	81	1	88,25
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura) (IH)	3.936	33	111,32	4.278	36	111,56	11.130	79	125,02
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	3	–	78,09	3	–	78,48	4	–	93,51
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura)	87	1	60,16	99	1	62,01	270	3	76,76
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (S) (Copertura) (IH)	642	6	85,23	672	6	87,04	1.663	13	98,46
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	3.083	35	87,95	3.149	36	87,64	3.162	31	101,78
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD (Copertura) (IH)	34.434	313	110,14	35.016	322	108,78	20.395	173	118,09
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 710	6	115,31	\$ 847	7	114,61	\$ 938	8	119,84
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	143	2	89,32	142	2	91,28	149	2	96,69
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	188	2	90,22	230	2	90,77	386	4	97,53
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (Copertura)	–	–	–	–	–	–	–	–	94,46
Azioni ad Accumulazione di Classe A SGD	43	60	0,98	1	1	0,97	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	557	6	99,64	69	1	99,28	124	1	104,34
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	–	–	–	71	1	98,39	172	2	103,51
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (A)	22	–	90,65	23	–	92,36	24	–	97,84
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	27	–	106,82	519	5	105,96	807	7	110,36
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	170	2	98,59	168	2	97,77	189	2	101,78
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (Copertura)	2.610	21	99,23	2.468	21	98,87	3.499	25	104,13
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) (Copertura)	86	1	80,55	403	4	82,44	154	1	89,35
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	132.800	1.194	111,22	226.102	2.052	110,21	85.918	750	114,56
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)	–	–	–	160	2	90,05	169	2	95,36
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	74.454	663	103,51	103.945	947	103,83	77.402	623	110,83
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (A) (Copertura)	26.877	348	71,22	26.284	337	73,84	29.738	330	80,37
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura)	12.142	122	78,26	9.234	96	80,03	11.162	96	86,74
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	5.181	44	118,70	5.111	44	117,09	5.265	44	120,62
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in AUD (Copertura)	–	–	–	163.494	1.698	143,13	536.622	4.944	149,45
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 557	5	119,94	\$ 260	2	114,70	\$ 207	2	121,94
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	105	1	82,51	91	1	81,94	103	1	92,91
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	4.726	32	149,10	1	–	142,10	1	–	150,00
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier GBP (Copertura) (IH)	74	–	145,97	67	–	140,14	102	1	146,92
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (A) (Copertura) (IH)	8.353	73	106,03	–	–	–	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe S in CAD (Copertura) (IH)	10.507	100	142,26	9.975	100	136,39	11.177	100	141,96
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 4.814	46	104,11	\$ 3.169	31	102,90	\$ 3.382	28	122,37
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	575	7	86,77	583	7	87,66	702	7	106,98
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1	–	73,43	1	–	73,48	1	–	90,11
Azioni ad Accumulazione di Classe A SGD	48	74	0,88	23	36	0,87	51	67	1,04
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	130	1	94,62	129	1	93,75	1.096	10	112,05
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	283	3	92,53	281	3	91,73	347	3	109,74
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	2.155	24	91,35	2.342	26	90,10	3.090	29	106,72
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (M)	221	3	74,39	231	3	75,15	280	3	91,69
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	264	3	95,52	261	3	94,17	308	3	111,42
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) (Copertura)	41	–	65,30	135	2	66,38	382	3	82,76
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) (Copertura) (IH)	796	7	87,77	970	9	88,36	1.209	9	101,85
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	181.879	1.641	110,82	175.727	1.610	109,17	207.613	1.610	128,99
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura) (IH)	1.970	19	83,85	1.835	18	84,39	2.282	17	97,27

Stato patrimoniale – (segue)

	31 agosto 2023			28 febbraio 2023			28 febbraio 2022		
	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund (segue)									
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier NZD (Copertura) (IH)	\$ 5.493	62	148,58	\$ 5.577	62	145,48	\$ 6.513	59	161,81
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	1.823	16	107,44	3.990	35	108,20	5.010	37	119,82
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in NZD (Copertura) (IH)	7.281	70	175,49	9.892	93	171,35	12.130	95	189,36
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 191.927	1.467	130,83	\$ 184.162	1.434	128,45	\$ 227.926	1.582	144,04
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	1.560	18	84,56	1.913	22	86,14	2.423	24	99,14
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	15.839	191	82,72	15.995	192	83,26	28.700	297	96,74
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	32.340	417	77,58	36.853	469	78,56	67.038	726	92,32
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	91.888	1.131	81,27	103.737	1.260	82,33	163.878	1.695	96,70
Azioni ad Accumulazione di Classe A in AUD (Copertura)	2.665	48	85,02	2.736	48	84,05	3.500	50	95,72
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)	2.928	59	76,66	2.007	38	78,18	4.268	63	93,28
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura)	1.384	134	75,08	871	78	77,28	1.169	80	92,59
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	2	–	98,50	2	–	99,13	1	–	104,69
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	43.584	414	97,00	32.034	315	96,30	49.951	401	111,20
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A) (Copertura)	27.207	313	80,26	27.469	314	82,68	33.645	306	98,11
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) (Copertura) Plus	2.307	28	75,07	2.230	27	76,87	3.108	30	93,01
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) (Copertura) Plus (e)	31.505	422	68,79	33.044	443	70,47	38.905	407	85,23
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) Plus (Copertura)	2.291	24	76,93	2.189	23	78,20	3.289	26	93,28
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) (Copertura) Plus (e)	6.233	66	74,72	6.204	68	75,97	8.329	69	90,60
Azioni ad Accumulazione di Classe A HKD	627	56	87,20	577	53	85,70	766	63	95,68
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus	9.822	982	78,46	9.913	978	79,53	17.554	1.474	93,06
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	36.156	58.508	0,84	37.208	58.904	0,85	49.398	66.538	1,01
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) (Copertura) Plus (e)	23.544	41.366	0,77	24.225	41.619	0,78	3.914	5.723	0,93
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus	4.196	7.178	0,79	5.130	8.666	0,80	8.763	12.594	0,94
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	22.751	251	90,77	22.302	250	89,35	39.688	394	100,69
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)	9.641	119	81,24	9.667	118	81,77	1.454	15	95,00
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CZK (Copertura)	32	1	1.004,96	28	1	979,39	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	34.706	353	98,25	30.266	314	96,75	35.222	323	109,15
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)	651	8	81,02	611	7	81,55	567	6	94,73
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)	5.097	50	93,41	4.425	45	93,02	5.373	44	108,08
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	25.305	272	92,88	25.037	275	90,98	40.863	402	101,56
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)	4.925	55	90,33	5.074	56	90,91	6.875	65	105,62
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	5.465	58	94,13	5.584	104	92,12	14.895	145	102,71
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (D)	158	2	90,32	387	4	90,97	147	1	106,01
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (M) Plus (e)	16.086	188	85,44	17.624	204	86,27	25.931	257	100,74
Azioni ad Accumulazione di Classe X in CHF (Copertura)	–	–	–	88	1	82,57	1.173	11	95,30
Azioni a Distribuzione di Classe X in CHF (A) (Copertura)	–	–	–	396	5	80,59	3.019	29	95,94
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	1.045	10	99,04	972	9	99,36	1.281	11	104,50
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	9.257	101	84,61	15.314	173	83,73	36.681	340	96,16
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (M) (Copertura) Plus (e)	12.777	162	72,63	16.053	205	74,16	22.675	227	89,18
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) (Copertura) Plus (e)	4.270	43	79,03	5.206	54	80,09	9.746	76	94,97
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	70.358	754	93,28	51.346	563	91,22	82.954	817	101,55
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (M) Plus (e)	19.539	223	87,52	19.197	217	88,30	21.157	205	102,96
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (Copertura)	2.379	116	101,15	2.211	121	96,03	2.265	118	98,52
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	90.517	766	108,93	91.195	801	107,70	141.515	1.022	123,47
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (M) (Copertura) Plus (e)	36.021	450	73,83	41.888	526	73,35	42.876	423	90,45
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura) Plus (e)	1.742	17	79,79	6.824	70	80,81	2.311	18	95,62
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier SEK (Copertura)	2.334	234	109,26	2.027	196	107,98	3.339	256	123,61
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	82.078	848	96,74	90.056	952	94,56	188.113	1.790	105,08
Azioni a Distribuzione di Classe S in USD (Q) Plus (e)	194	2	80,93	208	3	81,54	262	3	94,61
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	47.513	435	100,81	49.405	469	99,63	70.922	555	114,04
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (M) (Copertura) Plus (e)	4.468	49	83,45	5.144	57	85,09	6.325	55	101,98
Azioni a Distribuzione di Classe S in GBP (M) (Copertura) Plus (e)	194	2	82,61	284	3	83,61	1.909	14	98,90
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	15.213	149	101,81	11.406	115	99,33	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (M)	5.283	65	81,73	6.126	75	82,22	7.573	79	95,27
Azioni a Distribuzione di Classe LM in EUR (Q) (Copertura) Plus (e)	101.200	1.195	78,13	115.356	1.372	79,49	44.361	418	94,65
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in GBP (Copertura)	25.749	219	92,60	25.939	238	90,69	30.076	220	101,96
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 440	4	107,91	\$ 12.219	109	111,73	\$ 12.217	108	113,34
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (M)	1	–	89,02	1	–	94,36	1	–	98,28
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	29.038	254	114,54	30.650	259	118,21	36.297	305	119,13
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	3.787	30	127,00	3.886	30	130,32	3.871	30	129,83
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^α									
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	\$ –	–	–	\$ 75	1	75,72	\$ 86	1	87,94
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (A) (Copertura) (IH)	–	–	–	8.314	100	78,60	10.077	100	89,87
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 28	–	85,04	\$ 27	–	82,04	\$ 10	–	92,02
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (Copertura)	74	120	0,83	72	120	0,81	3.880	5.726	0,92
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) (Copertura) Plus (e)	4	–	61,36	4	–	61,32	6	–	73,57
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in AUD (Copertura)	69.181	1.223	87,31	69.307	1.223	84,23	100.335	1.460	94,63
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^									
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	\$ 101	1	96,80	\$ 98	1	97,52	\$ –	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	15.083	148	102,08	14.581	148	98,69	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (M) (Copertura) Plus (e)	106	1	95,69	101	1	96,98	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP (Copertura)	26	–	99,94	24	–	97,01	–	–	–
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^α									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ –	–	–	\$ 650	3	191,94	\$ 141	1	196,64
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	–	–	–	581	3	205,43	589	3	208,48
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP	–	–	–	3	–	108,28	3	–	98,53
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	–	–	–	1.300	7	180,30	1.444	7	188,84
FTGF ClearBridge Value Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 116.841	688	169,75	\$ 123.192	764	161,25	\$ 121.303	732	165,63
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	31.565	98	322,50	32.769	107	306,36	34.995	111	314,69
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	13.575	63	198,03	10.721	53	192,77	8.899	43	186,70
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	546	5	109,57	2.900	26	105,31	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A) (Copertura)	44	–	154,22	163	1	148,17	82	–	158,13
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (A)	23	–	239,70	22	–	239,81	23	–	220,87
Azioni ad Accumulazione di Classe A SGD	5.047	5.047	1,42	4.485	4.483	1,35	4.372	4.254	1,39
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (Copertura)	1.436	728	2,67	1.709	903	2,55	2.375	1.214	2,65
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	9.606	56	170,58	11.911	73	162,44	9.512	57	167,70
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	2.778	10	290,33	2.870	10	276,49	2.695	9	285,43
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	3.286	31	107,58	4.195	41	102,58	2.907	27	106,16
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	21.389	63	339,60	25.113	78	321,62	24.053	73	328,39
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)	347	2	187,10	385	2	177,83	2.818	16	181,76
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	143	1	110,61	110	1	104,72	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)	6.313	27	234,05	1.839	8	222,54	15.344	67	227,42
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	1.891	13	130,23	4.337	32	126,47	5.094	37	121,64
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	580.623	1.878	309,18	546.618	1.871	292,19	506.317	1.704	297,07
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)	462	2	208,91	2.347	12	198,95	482	2	203,29
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	48.152	170	261,89	87.612	327	253,64	105.810	388	243,25
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	106.655	948	103,70	57.089	544	99,13	31.343	267	104,79
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (A)	8.084	75	107,96	9.339	91	103,12	13.814	132	104,99

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Stato patrimoniale – (segue)

	31 agosto 2023			28 febbraio 2023			28 febbraio 2022		
	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 34.371	108	317,31	\$ 33.113	119	278,54	\$ 38.354	126	303,63
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	9.174	29	317,08	9.060	33	278,34	12.540	41	303,41
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	2.138	5	428,63	1.469	4	385,75	862	2	396,80
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	23	–	285,56	20	–	251,30	55	–	275,31
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (A)	15.435	54	107,38	–	–	–	–	–	281,93
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	19.516	67	285,52	17.444	68	251,27	16.457	60	275,27
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	17.967	54	292,34	17.444	68	251,27	20.120	71	281,84
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)	1.142	3	330,82	18.769	64	291,41	22.561	70	320,04
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	17.958	60	299,29	1.067	4	291,51	1.171	4	320,22
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)	4.375	11	397,15	20.872	80	261,94	26.406	93	283,88
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)	1.382	5	256,81	4.100	12	347,83	4.282	11	376,97
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	14	–	330,05	1.480	7	224,94	1.684	7	243,72
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	7.658	19	413,52	12	–	296,11	286	1	302,61
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)	1.987	4	480,02	2.219	5	421,23	3.421	8	455,60
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	26.644	51	478,33	20.884	46	428,10	12.422	25	435,74
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	24.902	109	228,39	24.655	124	198,89	25.866	121	213,40
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1.284	5	239,41	2.115	9	213,81	2.519	10	216,39
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	4.094	12	334,04	3.734	13	292,72	4.429	14	318,04
Azioni ad Accumulazione di Classe B (G) in USD	5	–	307,12	4	–	269,86	5	–	294,80
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	2.925	10	307,85	2.579	10	270,45	2.964	10	295,32
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in USD	4.546	14	334,67	4.167	14	293,53	4.570	14	319,45
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in EUR	378	1	443,81	368	1	398,98	401	1	409,60
Azioni a Distribuzione di Classe GA in EUR (A)	517	1	442,49	453	1	397,87	530	1	408,46
Azioni ad Accumulazione di Classe GE in USD	123	–	305,38	108	–	268,85	119	–	294,80
Azioni ad Accumulazione di Classe GE in EUR	8	–	404,68	9	–	365,13	10	–	377,75
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 241.846	543	445,40	\$ 208.487	571	364,91	\$ 275.982	640	431,31
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	37.488	84	445,61	30.903	85	365,08	40.436	94	431,51
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	70.570	99	659,91	59.073	101	554,31	91.461	132	618,12
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	9.384	39	221,22	6.519	34	183,21	7.277	29	225,03
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	62	–	404,34	66	–	332,11	182	–	394,51
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (A)	38	–	410,53	39	–	337,19	158	–	400,54
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	23.939	59	404,48	21.984	66	332,22	27.505	70	394,65
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	10.572	26	410,60	9.309	28	337,25	14.390	36	400,61
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	10.437	44	239,18	9.229	47	196,70	13.185	56	234,24
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (A)	41	–	231,97	51	–	190,76	195	1	227,17
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	136.141	557	244,33	129.606	649	199,57	152.031	648	234,47
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)	18.432	76	243,81	14.933	75	199,15	25.793	110	233,98
Azioni ad Accumulazione di Classe U in USD	211.331	1.140	185,34	197.273	1.306	151,03	283.702	1.606	176,60
Azioni ad Accumulazione di Classe U in EUR	82.854	363	210,29	15.490	83	175,64	89.392	411	193,77
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	41.311	151	273,57	36.363	163	223,43	39.088	149	262,44
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	2.662	12	197,19	1.169	7	165,08	1.009	5	182,92
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	2.603	12	201,30	1.803	10	166,19	6.550	29	203,10
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	11.782	32	289,97	7.294	24	249,48	8.173	23	262,72
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	286.410	989	289,72	191.353	810	236,21	269.653	975	276,47
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)	6.453	47	136,72	6.124	55	111,46	7.854	60	130,46
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (Copertura)	20.421	476	212,25	22.607	704	168,22	52.354	1.465	184,08
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	82.227	301	251,74	71.935	323	210,40	122.774	471	232,38
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	64.611	265	225,23	21.337	109	185,58	24.290	96	225,88
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (A)	4.444	30	136,24	3.771	31	113,87	3.905	28	125,70
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP	86.443	231	295,02	59.348	195	253,36	87.385	245	265,81
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	54.926	203	270,36	80.119	365	219,73	103.953	407	255,58
Azioni ad Accumulazione di Classe C in EUR	285	1	283,44	514	2	236,22	581	2	259,13
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	9.139	20	467,90	7.893	21	382,97	9.838	22	450,72
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	11.800	27	431,15	9.700	27	353,51	11.883	28	418,46
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in USD	1.708	3	553,14	1.426	3	452,77	1.696	3	534,19
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in EUR	21	–	650,85	17	–	546,16	20	–	607,83
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 56.180	258	217,79	\$ 59.419	295	201,50	\$ 82.146	347	236,91
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	15.972	73	217,93	16.442	82	201,63	20.870	88	237,06
Azioni ad Accumulazione di Classe A in AUD (Copertura)	4.045	39	158,63	4.700	47	148,15	5.832	45	179,96
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CHF (Copertura)	54	–	107,39	48	–	101,44	60	–	124,19
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CNH (Copertura)	672	34	143,75	984	51	135,16	1.338	52	161,19
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	7.206	20	324,26	6.874	21	307,57	9.335	24	341,16
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	608	4	146,26	581	4	136,82	671	4	167,18
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A) (Copertura)	13	–	105,81	11	–	98,97	15	–	120,90
Azioni ad Accumulazione di Classe A	138	1	162,61	138	1	158,44	476	2	167,01
Azioni ad Accumulazione di Classe A HKD	156	9	131,42	201	13	121,73	276	15	142,49
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (Copertura)	19	1	151,33	18	1	141,68	22	1	173,54
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (Copertura)	5.106	3.928	1,76	1.373	1.130	1,64	2.297	1.598	1,95
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	–	–	–	–	–	–	267	1	229,61
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (A)	4	–	200,77	82	–	186,21	58	–	220,02
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	6.447	31	209,43	6.110	31	194,26	9.131	40	229,54
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	8.449	42	200,75	8.523	46	186,21	12.112	55	220,03
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	4.653	22	207,04	5.324	28	192,28	11.574	51	227,78
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (A)	631	3	207,07	1.046	5	192,32	1.239	5	227,82
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR	9	–	81,17	0	–	77,29	10	–	86,39
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)	83	1	122,10	95	1	114,66	157	1	141,17
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	8.438	34	245,87	8.708	38	226,80	11.191	42	265,05
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)	626	3	246,04	1.498	7	226,96	2.748	10	265,24
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	3.096	18	176,55	3.219	20	162,82	5.160	27	190,19
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)	593	3	196,24	544	3	180,97	877	4	211,39
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	345	2	186,77	855	5	176,54	1.090	5	194,53
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	53	–	123,29	55	–	114,99	78	–	139,60
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	10.115	36	222,72	10.255	39	216,32	18.219	60	226,58
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	21.210	72	295,51	20.680	76	272,04	238.793	754	316,67
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	2.606	8	318,92	2.505	8	301,00	3.121	8	330,46
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	79	1	105,82	–	–	–	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (A)	–	–	–	–	–	–	12	–	311,48
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP	233	1	122,88	215	1	119,13	303	2	124,41
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	275	2	133,42	350	2	123,31	672	3	147,39
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (A)	35.920	102	277,28	42.019	130	269,21	68.221	181	281,04
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier PLN (Copertura)	–	–	–	–	–	–	1.142	33	146,83
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	314	2	167,96	602	4	158,07	727	4	172,45
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	14.942	65	229,88	14.718	69	212,32	18.973	76	248,75
Azioni ad Accumulazione di Classe B (G) in USD	6	–	211,91	6	–	196,19	7	–	231,00
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	6.321	30	211,82	6.310	32	196,13	8.113	35	230,95
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in EUR	136	–	342,65	125	–	324,64	147	–	359,23
Azioni a Distribuzione di Classe GA in EUR (A)	64	–	341,36	59	–	323,42	70	–	357,88
Azioni ad Accumulazione di Classe GE in USD	63	–	264,54	59	–	245,41	69	–	290,04
Azioni ad Accumulazione di Classe GE in EUR	36	–	312,13	34	–	296,85	40	–	330,96
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 12.070	82	147,87	\$ 13.397	97	138,55	\$ 13.299	87	152,81
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	91	1	113,38	86	1	107,55	95	1	119,93
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	2.098	25	83,86	2.262	28	80,14	2.042	22	92,06
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	10	–	102,17	113	1	97,14	128	1	110,21

Stato patrimoniale – (segue)

	31 agosto 2023			28 febbraio 2023			28 febbraio 2022		
	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund (segue)									
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (Q)	\$ 1.158	10	112,77	\$ 1.092	10	106,31	\$ 1.216	10	118,47
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)	714	15	75,19	859	18	72,55	1.166	19	85,71
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura)	47	4	81,73	60	5	79,42	124	8	93,35
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	148	1	134,77	141	1	129,46	150	1	134,68
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	461	4	110,15	502	5	104,45	1.262	9	119,24
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) Plus (e)	17	–	79,96	294	4	76,94	366	4	90,31
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus	125	12	84,59	151	15	80,92	790	67	92,60
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	238	403	0,80	599	1.052	0,77	483	735	0,89
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	771	6	139,78	896	7	131,30	972	7	145,53
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	112	1	113,21	106	1	107,11	246	2	119,46
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (Q)	78	1	104,62	73	1	98,62	81	1	109,98
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	17.194	122	141,18	17.713	134	131,88	20.648	143	144,58
Azioni ad Accumulazione di Classe F in EUR	59	–	142,04	55	–	136,03	61	–	140,68
Azioni a Distribuzione di Classe F in EUR (A)	83	1	114,03	79	1	111,26	88	1	116,98
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (M) (Copertura) Plus (e)	54	1	97,54	50	1	93,55	62	1	109,21
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 49.497	327	151,51	\$ 47.722	328	145,55	\$ 48.817	304	160,43
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	11.631	49	237,53	10.477	46	228,19	10.463	42	251,52
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	5.422	51	97,74	4.993	49	96,27	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	19.896	92	200,52	21.414	104	194,79	49.413	198	223,06
Azioni ad Accumulazione di Classe A SEK	56.684	4.179	148,50	56.766	4.360	136,29	66.724	4.656	135,75
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	6.101	39	154,55	5.947	40	148,03	6.403	39	162,19
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	12.873	100	129,28	12.869	104	123,82	20.266	149	135,66
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)	795	3	248,86	857	4	238,35	1.622	6	261,15
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	6.727	55	112,46	708	6	110,40	927	7	114,04
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	5.792	25	210,51	2.811	13	203,85	1.823	7	231,69
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	419.260	1.179	280,80	478.725	1.405	283,28	237.295	635	278,51
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (Copertura)	1.052	6	131,21	2.318	15	126,11	2.436	13	141,45
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	95.629	683	139,95	94.620	707	133,80	167.377	1.146	146,09
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)	33.952	135	250,98	33.164	138	240,49	35.826	136	262,86
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	–	–	103,17	–	–	101,11	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	4.728	20	216,61	5.531	25	209,43	5.203	8	237,15
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP	26.175	68	304,79	11.173	30	306,82	4.987	12	300,59
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	548.776	3.043	180,34	532.065	3.089	172,25	601.256	3.203	187,69
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR	67.520	437	142,38	52.170	354	139,45	56.873	354	143,34
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	1.906	14	128,01	1.699	13	123,63	7.774	50	139,69
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP	97.500	517	148,97	145.409	807	149,85	161.607	823	146,43
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP (Copertura)	72.604	416	137,67	72.678	458	132,01	78.117	395	147,25
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (Q)	11.797	64	146,07	10.539	59	147,32	15.238	79	144,37
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	38.233	313	112,53	35.323	304	109,96	21.868	173	112,61
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 757	5	151,35	\$ 686	5	137,15	\$ 754	5	150,84
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	14.120	89	159,38	12.493	87	143,70	15.264	98	156,48
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	€ 11.191	997	12,18	€ 22.713	1.980	12,13	€ 30.452	2.723	12,54
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD (Copertura)	42.544	3.096	14,90	54.425	3.812	15,10	49.791	3.885	14,37
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (Copertura)	39.436	4.156	10,29	44.093	4.340	10,75	47.028	4.911	10,74
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (Q)	2.826	225	13,63	2.915	226	13,62	3.039	242	14,09
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)	2.561	439	9,76	2.473	382	10,18	5.707	853	10,33
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura)	30.223	23.828	10,01	23.313	16.311	10,51	7.660	5.083	10,67
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	129.526	9.261	13,99	145.537	10.186	14,29	73.628	5.290	13,92
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura) (PH)	4.482	396	11,31	6.339	554	11,43	5.029	436	11,54
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A)	451	49	9,16	418	45	9,36	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) Plus	4.000	337	11,86	3.899	315	12,36	2.624	210	12,47
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	4.359	6.394	1,00	4.235	5.789	1,04	4.158	6.018	1,05
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	2.811	262	11,65	3.347	304	11,64	3.683	342	12,08
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD (Copertura)	1.304	101	14,04	1.366	101	14,27	646	53	13,66
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	5.027	402	13,55	6.399	499	13,56	8.126	646	14,10
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD (Copertura)	1.279	120	11,54	2.326	210	11,74	904	90	11,26
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR	1	–	9,56	–	–	–	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe E in EUR (A)	1	–	9,56	–	–	–	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	4.899	425	12,51	4.659	397	12,43	1.537	135	12,77
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD (Copertura)	6.202	449	14,99	9.258	646	15,15	1.840	144	14,34
Azioni ad Accumulazione di Classe U in EUR	38.218	3.951	9,67	–	–	–	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1.150	102	12,27	1.495	130	12,17	67	6	12,46
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)	488	43	12,19	501	43	12,22	447	40	12,62
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	40.052	2.789	14,36	57.566	3.942	14,60	26.937	1.910	14,10
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura) (PH)	5.652	489	11,57	10.121	869	11,65	2.536	218	11,65
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (Q)	2.023	146	11,83	2.493	176	12,45	1.489	108	11,53
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (Q) (Copertura)	–	–	–	410	34	10,52	810	67	10,15
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	55.978	3.787	16,03	74.451	4.958	15,88	11.876	820	16,23
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (Copertura)	1.651	434	20,43	2.798	775	20,00	5.511	1.828	17,42
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in CAD (Q) (Copertura) (PH) Plus (e)	46.138	5.941	11,38	46.777	5.861	11,52	51.721	6.384	11,51
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in CAD (Q) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	6.322	811	11,08
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	301.473	12.986	23,21	432.296	18.330	23,58	207.952	9.151	22,73
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura) (PH)	11.730	952	12,32	4.026	325	12,40	7.393	596	12,40
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP	353	19	15,95	405	21	16,65	6.622	363	15,25
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (A) (Copertura) (PH) Plus (e)	4.753	196	20,76	14.897	618	21,18	21.555	844	21,34
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (Q)	71.428	4.518	13,53	76.882	4.746	14,25	74.334	4.710	13,19
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 224	3	87,06
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (Q)	–	–	–	–	–	–	174	2	83,85
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	–	–	–	–	–	–	679	7	81,36
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (Q)	–	–	–	–	–	–	730	7	79,04
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	–	–	–	–	–	–	858	9	82,16
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 21.947	231	95,21	\$ 27.166	280	96,98	\$ 17.858	169	105,90
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	54.222	621	87,31	61.518	674	91,28	28.785	274	104,96
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	53.530	609	89,00	61.812	670	92,22	70.314	707	105,12
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)	6.862	129	82,12	8.133	139	86,78	5.538	75	102,34
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura)	1.559	137	82,95	1.325	104	88,26	315	19	103,79
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A) Plus (e)	90	1	79,87	67	1	85,09	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) Plus (Copertura) Plus	6.973	80	80,86	8.022	89	85,54	3.929	34	101,92
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) Plus (Copertura)	5.030	48	81,99	5.016	48	86,10	136	1	101,30
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus	1.325	117	88,68	1.385	117	92,80	1.827	135	106,10
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	56.598	91.187	0,84	63.459	96.802	0,88	27.834	36.826	1,02
Azioni ad Accumulazione di Classe U in USD	11.194	120	93,11	4.556	48	94,25	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe U in EUR	2.677	26	93,25	8.777	86	96,85	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe U in EUR (Q) Plus (e)	65	1	92,54	67	1	97,29	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe U in GBP	3.258	28	90,45	3.127	27	96,41	–	–	–
Azioni ad Accumulazione di Classe U in GBP (Copertura)	29	–	98,63	–	–	–	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe U in GBP (Q) (Copertura) Plus (e)	219	2	100,37	–	–	–	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe U in GBP (Q) Plus (e)	586	5	91,95	–	–	–	–	–	–
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (M) Plus (e)	6.436	72	89,44	17.277	185	93,47	322	3	105,76

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Stato patrimoniale – (segue)

	31 agosto 2023			28 febbraio 2023			28 febbraio 2022		
	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund (segue)									
Azioni a distribuzione di Classe X in EUR (M) (Copertura)	\$ 373	4	79,99	\$ 376	4	84,08	\$ -	-	-
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (Q) (Copertura) Plus (e)	1.270	14	85,72	2.323	24	90,22	645	5	105,94
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (Q) (Copertura) Plus (e)	120	1	83,56	651	6	87,29	160	1	100,27
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	2.334	27	84,93	2.352	27	86,03	4.720	46	102,52
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (M) Plus	58.473	669	87,46	59.725	657	90,93	4.994	48	103,28
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (M) (Copertura)	33.585	358	86,44	32.976	343	90,86	155	1	105,08
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	29.676	301	98,72	28.020	281	99,82	263	2	107,42
Azioni a Distribuzione di Classe S in USD (M) Plus	6.794	76	88,94	7.918	86	92,31	1.599	15	104,48
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 132.626	464	285,90	\$ 136.340	481	283,21	\$ 179.306	607	295,45
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	28.058	32	868,27	30.404	35	860,08	35.534	40	897,28
Azioni ad Accumulazione di Classe A in AUD (Copertura)	5.013	36	213,69	5.856	41	213,77	7.110	43	230,14
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CNH (Copertura)	2.929	112	189,70	2.411	88	190,89	2.416	76	201,78
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	31.266	84	344,81	32.297	87	350,21	46.391	120	344,60
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	8.133	36	208,07	14.136	64	208,42	14.213	56	225,70
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (A) (Copertura)	216	1	158,23	172	1	158,47	385	2	171,75
Azioni ad Accumulazione di Classe A in GBP (Copertura)	114	1	173,52	460	2	172,42	1.070	4	184,68
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (A)	678	2	356,38	727	2	371,81	778	2	347,78
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (Copertura)	71	4	204,00	80	4	204,46	88	4	222,22
Azioni ad Accumulazione di Classe A SGD	3.941	1.890	2,82	10.567	5.109	2,79	11.147	5.166	2,93
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (Copertura)	28.349	14.270	2,68	26.220	13.193	2,68	26.201	12.563	2,83
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	16	-	294,55	119	-	292,49	127	-	306,67
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (A)	21	-	787,73	21	-	782,27	22	-	820,22
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	9.753	33	295,05	11.432	39	293,00	13.207	43	307,21
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	5.205	7	782,60	5.195	7	777,17	5.656	7	814,85
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	8.155	31	263,27	9.939	38	261,78	11.386	41	275,11
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (A)	505	2	263,23	502	2	261,74	528	2	275,11
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR	2.507	7	348,28	1.582	4	355,11	1.274	3	351,98
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)	2.169	12	165,57	1.111	6	166,43	1.109	5	181,52
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	12.593	40	311,86	15.873	52	307,98	26.949	84	319,38
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)	272	1	312,19	267	1	308,31	244	1	319,72
Azioni ad Accumulazione di Classe R in USD	-	-	111,83	1	-	110,12	-	-	113,60
Azioni ad Accumulazione di Classe R in EUR	309	1	271,14	302	1	274,66	307	1	268,95
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	40.094	145	276,75	47.508	174	273,10	33.276	118	282,78
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)	1.162	6	191,88	1.177	6	189,35	1.492	8	196,06
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	5.542	29	174,23	5.887	32	176,23	13.906	72	172,19
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	8.287	41	185,85	11.488	59	185,38	22.708	102	199,32
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	38.332	85	354,69	39.715	90	368,64	42.807	93	342,20
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (A)	2.744	7	324,69	3.082	8	337,47	4.309	10	313,21
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	205.641	562	365,64	220.211	611	360,19	257.090	692	371,66
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (Copertura)	5.577	155	178,16	6.630	203	170,82	17.351	541	165,25
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	44.552	84	487,57	46.669	90	492,39	63.706	119	479,41
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	3.097	14	201,81	5.193	24	200,98	960	4	215,21
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP	32.194	75	337,99	44.274	105	350,66	67.856	156	324,40
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier PLN (Copertura)	5.418	152	147,50	3.681	114	144,10	5.300	152	146,12
FTGF Royce US Smaller Companies Fund									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 34.969	145	241,87	\$ 31.063	134	231,96	\$ 35.531	154	231,37
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	9.078	22	409,45	9.540	24	392,74	11.155	28	391,87
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1.447	3	389,12	2.035	5	382,78	1.975	5	360,17
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	94	1	164,80	98	1	159,80	174	1	165,50
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A)	118	-	275,78	124	-	271,21	111	-	255,46
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (A)	56	-	381,80	54	-	385,69	123	-	345,13
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (Copertura)	2	-	166,15	2	-	161,28	1	-	167,25
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	3.053	13	234,06	2.964	13	225,03	3.094	14	225,58
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	2.714	7	369,82	2.765	8	355,62	2.999	8	356,61
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	749	3	250,38	721	3	241,07	750	3	242,35
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (A)	7	-	147,32	7	-	141,84	8	-	142,67
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR	9	-	161,02	9	-	158,95	8	-	150,73
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	13.614	45	300,70	11.194	39	287,56	10.813	38	285,20
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)	669	2	321,67	532	2	307,61	543	2	305,10
Azioni ad Accumulazione di Classe R in USD	86	-	176,29	109	1	168,67	212	1	167,46
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	18	-	217,76	53	-	208,08	333	2	206,08
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)	1	-	99,92	1	-	95,46	-	-	94,37
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	9.818	30	330,91	600	2	315,65	966	3	311,50
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)	12.473	54	230,17	12.361	56	219,68	14.320	66	216,79
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (A)	1.472	4	291,45	1.473	4	292,99	1.769	5	259,24
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	320	1	231,20	702	3	225,37	854	4	208,25
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	886	3	272,14	941	4	260,24	1.022	4	258,11
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	782	3	250,62	750	3	240,27	1.174	5	239,50
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	\$ 8	-	82,86	\$ 8	-	83,66	\$ 9	-	90,44
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	8	-	83,95	9	-	84,44	9	-	90,61
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	6	-	92,94	14	-	98,60	-	-	-
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	4.207	50	84,47	4.223	50	84,81	4.516	50	90,69
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^									
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	€ -	-	-	€ -	-	-	€ 608	7	100,59
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD (Copertura)	-	-	-	-	-	-	1.157	9	144,30
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	-	-	-	-	-	-	762	5	183,06
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (Copertura)	-	-	-	-	-	-	4.140	48	97,65
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)	-	-	-	-	-	-	1.402	23	92,61
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura)	-	-	-	-	-	-	158	11	102,33
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	-	-	-	-	-	-	333	2	195,74
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A)	-	-	-	-	-	-	84	1	166,20
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) Plus	-	-	-	-	-	-	430	4	97,95
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	-	-	-	-	-	-	224	390	0,87
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	-	-	-	-	-	-	14	-	93,06
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (A)	-	-	-	-	-	-	56	-	180,51
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	-	-	-	-	-	-	144	2	94,91
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	-	-	-	-	-	-	1.236	8	180,39
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD (Copertura)	-	-	-	-	-	-	123	1	102,25
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	-	-	-	-	-	-	290	3	124,53
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	-	-	-	-	-	-	1	-	104,43
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	-	-	-	-	-	-	53	-	144,35
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier PLN (Copertura)	-	-	-	-	-	-	480	18	127,46
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	-	-	-	-	-	-	2.034	15	137,11
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	-	-	-	-	-	-	958	10	104,34
Azioni ad Accumulazione di Classe B (G) in USD	-	-	-	-	-	-	1	-	96,33
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	-	-	-	-	-	-	95	1	96,85
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in USD	-	-	-	-	-	-	870	5	178,58
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in EUR	-	-	-	-	-	-	12.539	62	201,63
Azioni a Distribuzione di Classe GA in EUR (A)	-	-	-	-	-	-	101	1	158,26
Azioni ad Accumulazione di Classe GE in USD	-	-	-	-	-	-	44	-	163,28

Stato patrimoniale – (segue)

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

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Stato patrimoniale – (segue)

	31 agosto 2023			28 febbraio 2023			28 febbraio 2022		
	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:	Totale NAV (in migliaia)	N° di azioni (in migliaia)	NAV/ azione:
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] (segue)									
Azioni ad Accumulazione di Classe K in EUR	€ -	-	-	€ 98	1	98,11	€ -	-	-
Azioni a Distribuzione di Classe K in EUR (A)	-	-	-	98	1	98,11	-	-	-
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	474	5	100,31	9.474	97	98,17	-	-	-
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (A)	30.001	299	100,39	21.739	221	98,22	-	-	-

Gli importi indicati con “-” sono pari a 0\$/0€/0€ o inferiori a 1.000\$/1.000€/1.000€.

I dati sul NAV per azione si riferiscono alle Azioni partecipative redimibili denominate nella rispettiva valuta di ciascuna Classe azionaria pertinente.

α A far data dal 24 marzo 2023, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] e FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] hanno cessato le negoziazioni.

β A far data dal 20 aprile 2023, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] ha cessato le negoziazioni.

γ A far data dal 20 giugno 2023, è stato lanciato il fondo FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^].

δ A far data dal 17 luglio 2023, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^] ha cessato le negoziazioni.

^ Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

Conto economico

	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	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
(in migliaia)								
REDDITO DA INVESTIMENTI:								
Redditi lordi da dividendi e interessi obbligazionari	\$ 23.172	\$ 4.265	\$ 3.280	\$ 3.207	\$ 25.271	\$ 24.148	€ 1.391	€ 1.063
Interessi	–	–	–	–	26	–	9	–
Perequazione	–	–	–	–	(17)	2	–	–
Altri proventi	–	–	–	–	–	–	–	–
Profitti/(Perdite) netti su attività e passività finanziarie al valore equo rilevati a conto economico:								
Profitti/(Perdite) netti realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	–	–	(963)	(14.071)	(40.143)	(80.758)	(7.880)	(1.805)
Profitti/(Perdite) netti non realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	–	–	(579)	(10.394)	31.447	(100.138)	9.820	(15.176)
Totale profitti/(perdite) da investimento	23.172	4.265	1.738	(21.258)	16.584	(156.746)	3.340	(15.918)
SPESE:								
Commissioni di gestione (Nota 3)	2.612	2.535	535	725	2.985	3.948	18	16
Commissioni di incentivo (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria (Nota 3)	119	115	62	74	411	504	47	52
Commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	–	–	58	90	140	169	1	1
Oneri legali	15	–	2	3	15	16	1	1
Oneri di revisione	10	9	20	19	20	19	12	12
Spese di stampa	2	33	–	9	–	49	2	5
Spese per dividendi	–	–	–	–	–	–	–	–
Interessi passivi	–	–	–	–	25	10	–	6
Compensi e spese degli Amministratori (Nota 3)	5	3	1	1	6	5	1	–
Adeguamento a ratei passivi e altre passività	–	–	–	–	–	–	–	–
Altre spese	58	37	27	40	134	173	18	16
Totale Spese	2.821	2.732	705	961	3.736	4.893	100	109
Deroghe a spese e rimborsi/risarcimenti (Nota 3)	–	(645)	(8)	(2)	(3)	–	–	–
Totale spese nette	2.821	2.087	697	959	3.733	4.893	100	109
Profitti/(perdite) netti al lordo degli oneri finanziari	20.351	2.178	1.041	(22.217)	12.851	(161.639)	3.240	(16.027)
ONERI FINANZIARI:								
Distribuzioni ai detentori di azioni partecipative redimibili (Nota 4)	(16.470)	(1.825)	(937)	(993)	(1.502)	(1.354)	(8)	(3)
Profitti/(perdite) d'esercizio	3.881	353	104	(23.210)	11.349	(162.993)	3.232	(16.030)
Crediti per ritenute d'acconto/(imposte) su dividendi e altre imposte	–	–	(4)	2	(92)	(106)	3	1
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni rimborsabili	\$ 3.881	\$ 353	\$ 100	\$ (23.208)	\$ 11.257	\$ (163.099)	€ 3.235	€ (16.029)

	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 [^]	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
(in migliaia)								
REDDITO DA INVESTIMENTI:								
Redditi lordi da dividendi e interessi obbligazionari	\$ 2.026	\$ 2.104	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.650
Interessi	1	–	–	–	–	–	–	–
Perequazione	(7)	(1)	–	–	–	–	–	–
Altri proventi	–	–	–	–	–	–	–	–
Profitti/(Perdite) netti su attività e passività finanziarie al valore equo rilevati a conto economico:								
Profitti/(Perdite) netti realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	(4.456)	(2.124)	–	–	–	–	–	(2.945)
Profitti/(Perdite) netti non realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	3.286	(8.536)	–	–	–	–	–	(1.696)
Totale profitti/(perdite) da investimento	850	(8.557)	–	–	–	–	–	(2.991)
SPESE:								
Commissioni di gestione (Nota 3)	245	339	–	–	–	–	–	56
Commissioni di incentivo (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria (Nota 3)	23	27	–	–	–	–	–	17
Commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	34	44	–	–	–	–	–	7
Oneri legali	1	1	–	–	–	–	–	1
Oneri di revisione	13	13	–	–	–	–	–	14
Spese di stampa	1	4	–	–	–	–	–	2
Spese per dividendi	–	–	–	–	–	–	–	–
Interessi passivi	–	1	–	–	–	–	–	–
Compensi e spese degli Amministratori (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Adeguamento a ratei passivi e altre passività	–	–	–	–	–	–	–	–
Altre spese	20	16	–	–	–	–	–	15
Totale Spese	337	445	–	–	–	–	–	112
Deroghe a spese e rimborsi/risarcimenti (Nota 3)	(13)	(6)	–	–	–	–	–	(13)
Totale spese nette	324	439	–	–	–	–	–	99
Profitti/(perdite) netti al lordo degli oneri finanziari	526	(8.996)	–	–	–	–	–	(3.090)
ONERI FINANZIARI:								
Distribuzioni ai detentori di azioni partecipative redimibili (Nota 4)	(1.317)	(1.145)	–	–	–	–	–	(153)
Profitti/(perdite) d'esercizio	(791)	(10.141)	–	–	–	–	–	(3.243)
Crediti per ritenute d'acconto/(imposte) su dividendi e altre imposte	11	(31)	–	–	–	–	–	1
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni rimborsabili	\$ (780)	\$ (10.172)	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (3.242)

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

Conto economico – (segue)

	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 [^]	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
(in migliaia)								
REDDITO DA INVESTIMENTI:								
Redditi lordi da dividendi e interessi obbligazionari	\$ 55.517	\$ 58.441	\$ –	\$ –	\$ 11.110	\$ 8.907	\$ –	\$ –
Interessi	30	98	–	–	3	–	–	–
Perequazione	(481)	(327)	–	–	(1)	–	–	–
Altri proventi	–	–	–	–	–	–	–	–
Profitti/(Perdite) netti su attività e passività finanziarie al valore equo rilevati a conto economico:								
Profitti/(Perdite) netti realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	(19.221)	(477.283)	–	–	(1.601)	(46.892)	–	–
Profitti/(Perdite) netti non realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	70.165	(48.388)	–	–	7.693	(24.721)	–	–
Totale profitti/(perdite) da investimento	106.010	(467.459)	–	–	17.204	(62.706)	–	–
SPESE:								
Commissioni di gestione (Nota 3)	10.631	17.305	–	–	158	161	–	–
Commissioni di incentivo (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria (Nota 3)	644	993	–	–	109	113	–	–
Commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	767	1.201	–	–	–	–	–	–
Oneri legali	14	62	–	–	3	10	–	–
Oneri di revisione	20	19	–	–	13	13	–	–
Spese di stampa	–	143	–	–	7	27	–	–
Spese per dividendi	–	–	–	–	–	–	–	–
Interessi passivi	17	89	–	–	–	3	–	–
Compensi e spese degli Amministratori (Nota 3)	11	14	–	–	1	1	–	–
Adeguamento a ratei passivi e altre passività	–	–	–	–	–	–	–	–
Altre spese	12	493	–	–	28	63	–	–
Totale Spese	12.116	20.319	–	–	319	391	–	–
Deroghe a spese e rimborsi/risarcimenti (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Totale spese nette	12.116	20.319	–	–	319	391	–	–
Profitti/(perdite) netti al lordo degli oneri finanziari	93.894	(487.778)	–	–	16.885	(63.097)	–	–
ONERI FINANZIARI:								
Distribuzioni ai detentori di azioni partecipative redimibili (Nota 4)	(11.992)	(9.115)	–	–	(1.340)	(299)	–	–
Profitti/(perdite) d'esercizio	81.902	(496.893)	–	–	15.545	(63.396)	–	–
Crediti per ritenute d'acconto/(imposte) su dividendi e altre imposte	(2.088)	(4.053)	–	–	(38)	(83)	–	–
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni rimborsabili	\$ 79.814	\$ (500.946)	\$ –	\$ –	\$ 15.507	\$ (63.479)	\$ –	\$ –

	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 [^]	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
(in migliaia)								
REDDITO DA INVESTIMENTI:								
Redditi lordi da dividendi e interessi obbligazionari	\$ 140	\$ 118	\$ 4.922	\$ 3.864	\$ 15.092	\$ 10.072	\$ 932	\$ 356
Interessi	–	–	1	1	–	2	–	–
Perequazione	–	–	(12)	(21)	(12)	–	–	–
Altri proventi	–	–	–	–	–	–	–	–
Profitti/(Perdite) netti su attività e passività finanziarie al valore equo rilevati a conto economico:								
Profitti/(Perdite) netti realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	(298)	524	(14.204)	(17.945)	(15.960)	(64.076)	265	(1.289)
Profitti/(Perdite) netti non realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	445	(1.495)	12.052	(16.282)	14.594	(20.744)	110	(284)
Totale profitti/(perdite) da investimento	287	(853)	2.759	(30.383)	13.714	(74.746)	1.307	(1.217)
SPESE:								
Commissioni di gestione (Nota 3)	14	14	530	689	1.472	904	40	26
Commissioni di incentivo (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria (Nota 3)	10	10	66	72	177	226	11	7
Commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	–	–	70	101	4	4	–	–
Oneri legali	5	–	2	2	6	7	–	–
Oneri di revisione	9	9	20	19	13	13	13	13
Spese di stampa	–	–	–	1	–	24	–	1
Spese per dividendi	–	–	–	–	–	–	–	–
Interessi passivi	–	–	1	2	1	21	1	–
Compensi e spese degli Amministratori (Nota 3)	–	–	1	–	3	2	–	–
Adeguamento a ratei passivi e altre passività	–	–	–	–	–	–	–	–
Altre spese	12	9	28	21	44	82	7	7
Totale Spese	50	42	718	907	1.720	1.283	72	54
Deroghe a spese e rimborsi/risarcimenti (Nota 3)	(29)	(21)	–	–	–	–	(15)	(20)
Totale spese nette	21	21	718	907	1.720	1.283	57	34
Profitti/(perdite) netti al lordo degli oneri finanziari	266	(874)	2.041	(31.290)	11.994	(76.029)	1.250	(1.251)
ONERI FINANZIARI:								
Distribuzioni ai detentori di azioni partecipative redimibili (Nota 4)	–	–	(925)	(349)	(1.217)	(668)	(4)	(3)
Profitti/(perdite) d'esercizio	266	(874)	1.116	(31.639)	10.777	(76.697)	1.246	(1.254)
Crediti per ritenute d'acconto/(imposte) su dividendi e altre imposte	–	(1)	5	(88)	125	(469)	–	(2)
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni rimborsabili	\$ 266	\$ (875)	\$ 1.121	\$ (31.727)	\$ 10.902	\$ (77.166)	\$ 1.246	\$ (1.256)

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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 [^]	
per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
\$ 12.674	\$ 13.236	\$ 19.185	\$ 15.600	£ 805	£ 947	\$ 2.335	\$ 2.896	\$ 384	\$ 295
-	-	8	-	4	-	3	-	-	-
(14)	-	-	-	-	-	-	-	1	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(11.422)	(24.228)	(15.221)	(25.430)	(443)	(813)	(3.266)	(22.966)	(99)	(2.306)
8.293	(26.455)	445	(67.968)	(581)	(8.519)	4.586	(17.109)	(123)	(923)
9.531	(37.447)	4.417	(77.798)	(215)	(8.385)	3.658	(37.179)	163	(2.934)
427	841	89	28	-	-	26	34	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
206	265	425	384	19	26	40	56	10	9
6	15	-	-	-	-	-	-	-	-
24	19	15	11	1	1	1	2	-	-
20	20	13	13	8	8	13	13	23	18
-	35	19	33	1	2	2	6	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	1	8	-	-	-	-	1	-	-
3	3	6	3	-	-	1	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
27	101	98	94	2	9	17	21	(4)	17
713	1.300	673	566	31	46	100	134	29	45
-	-	-	-	-	-	-	-	(29)	(45)
713	1.300	673	566	31	46	100	134	-	-
8.818	(38.747)	3.744	(78.364)	(246)	(8.431)	3.558	(37.313)	163	(2.934)
(513)	(477)	-	-	(762)	-	(2.182)	-	(459)	(290)
8.305	(39.224)	3.744	(78.364)	(1.008)	(8.431)	1.376	(37.313)	(296)	(3.224)
-	-	-	-	(3)	(4)	(7)	(36)	(2)	-
\$ 8.305	\$ (39.224)	\$ 3.744	\$ (78.364)	£ (1.011)	£ (8.435)	\$ 1.369	\$ (37.349)	\$ (298)	\$ (3.224)
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	
per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
\$ 6.299	\$ 3.833	\$ -	\$ -	\$ 37.070	\$ 25.456	\$ 1.385	\$ 1.061	\$ 50	\$ 280
-	-	-	-	1	7	-	-	-	-
(1)	-	-	-	(93)	113	-	-	-	-
-	-	-	761	-	-	-	-	-	-
(18.913)	(21.087)	-	-	(65.770)	(138.672)	(3.204)	(443)	(420)	(2.067)
16.074	(16.191)	-	-	66.953	(77.529)	853	(1.354)	452	98
3.459	(33.445)	-	761	38.161	(190.625)	(966)	(736)	82	(1.689)
673	678	-	-	4.519	5.514	222	306	2	17
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
84	80	-	-	455	479	20	24	1	6
6	5	-	-	499	597	5	9	-	-
3	3	-	-	17	14	1	1	-	-
13	13	-	-	20	16	13	13	-	13
4	9	-	-	20	42	1	2	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	2	-	-	4	9	-	-	-	-
-	1	-	-	6	7	-	-	-	-
-	-	-	761	-	-	-	-	-	-
30	22	-	-	167	153	15	7	-	10
814	813	-	761	5.707	6.831	277	362	3	47
-	-	-	-	-	-	(21)	(8)	-	(23)
814	813	-	761	5.707	6.831	256	354	3	24
2.645	(34.258)	-	-	32.454	(197.456)	(1.222)	(1.090)	79	(1.713)
(95)	(46)	-	-	(16.814)	(11.121)	-	-	(576)	(585)
2.550	(34.304)	-	-	15.640	(208.577)	(1.222)	(1.090)	(497)	(2.298)
(5)	(150)	-	-	(478)	(185)	(6)	25	-	(2)
\$ 2.545	\$ (34.454)	\$ -	\$ -	\$ 15.162	\$ (208.762)	\$ (1.228)	\$ (1.065)	\$ (497)	\$ (2.300)

Conto economico – (segue)

	Legg Mason Brandywine Global - US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^] _α	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
(in migliaia)								
REDDITO DA INVESTIMENTI:								
Redditi lordi da dividendi e interessi obbligazionari	\$ -	\$ -	\$ 2.580	\$ 2.250	\$ 539	\$ -	\$ 7	\$ 23
Interessi	-	-	-	-	-	-	-	-
Perequazione	-	-	-	-	-	-	-	-
Altri proventi	-	-	-	-	-	-	-	-
Profitti/(Perdite) netti su attività e passività finanziarie al valore equo rilevati a conto economico:								
Profitti/(Perdite) netti realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	-	-	(8.838)	(13.714)	(390)	-	(109)	(66)
Profitti/(Perdite) netti non realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	-	-	6.230	(4.266)	404	-	(63)	(298)
Totale profitti/(perdite) da investimento	-	-	(28)	(15.730)	553	-	(165)	(341)
SPESE:								
Commissioni di gestione (Nota 3)	-	-	1	1	27	-	1	5
Commissioni di incentivo (Nota 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria (Nota 3)	-	-	30	32	9	-	-	4
Commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Oneri legali	-	-	1	2	-	-	-	-
Oneri di revisione	-	-	13	13	10	-	-	13
Spese di stampa	-	-	2	6	1	-	-	-
Spese per dividendi	-	-	-	-	-	-	-	-
Interessi passivi	-	-	-	-	-	-	-	-
Compensi e spese degli Amministratori (Nota 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Adeguamento a ratei passivi e altre passività	-	-	-	-	-	-	-	-
Altre spese	-	-	13	28	22	-	-	5
Totale Spese	-	-	60	82	69	-	1	27
Deroghe a spese e rimborsi/risarcimenti (Nota 3)	-	-	(6)	(17)	(34)	-	-	(20)
Totale spese nette	-	-	54	65	35	-	1	7
Profitti/(perdite) netti al lordo degli oneri finanziari	-	-	(82)	(15.795)	518	-	(166)	(348)
ONERI FINANZIARI:								
Distribuzioni ai detentori di azioni partecipative redimibili (Nota 4)	-	-	-	-	(7)	-	-	-
Profitti/(perdite) d'esercizio	-	-	(82)	(15.795)	511	-	(166)	(348)
Crediti per ritenute d'acconto/(imposte) su dividendi e altre imposte	-	-	(41)	(79)	(7)	-	(2)	(6)
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni rimborsabili	\$ -	\$ -	\$ (123)	\$ (15.874)	\$ 504	\$ -	\$ (168)	\$ (354)

	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
(in migliaia)								
REDDITO DA INVESTIMENTI:								
Redditi lordi da dividendi e interessi obbligazionari	\$ 1.191	\$ 2.171	\$ 637	\$ 853	\$ 12.276	\$ 9.634	\$ 123	\$ 123
Interessi	-	-	-	-	-	-	-	-
Perequazione	(5)	-	(1)	-	-	-	-	-
Altri proventi	-	-	-	-	-	-	-	-
Profitti/(Perdite) netti su attività e passività finanziarie al valore equo rilevati a conto economico:								
Profitti/(Perdite) netti realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	1.512	11.278	1.252	392	(8.928)	(14.603)	292	148
Profitti/(Perdite) netti non realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	16.274	(85.884)	899	(4.703)	83.654	(164.705)	1.098	(1.866)
Totale profitti/(perdite) da investimento	18.972	(72.435)	2.787	(3.458)	87.002	(169.674)	1.513	(1.595)
SPESE:								
Commissioni di gestione (Nota 3)	1.239	2.192	210	239	4.402	4.017	49	46
Commissioni di incentivo (Nota 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria (Nota 3)	91	165	18	18	620	526	8	8
Commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	221	276	33	38	1.076	744	2	1
Oneri legali	2	6	1	1	23	15	-	-
Oneri di revisione	20	20	13	13	15	11	7	6
Spese di stampa	6	-	1	2	29	43	-	-
Spese per dividendi	-	-	-	-	-	-	-	-
Interessi passivi	-	-	-	-	27	9	-	-
Compensi e spese degli Amministratori (Nota 3)	1	2	-	-	9	6	-	-
Adeguamento a ratei passivi e altre passività	-	-	-	-	-	-	-	-
Altre spese	31	36	17	16	189	122	10	9
Totale Spese	1.611	2.697	293	327	6.390	5.493	76	70
Deroghe a spese e rimborsi/risarcimenti (Nota 3)	-	-	(22)	(18)	(46)	(45)	(15)	(13)
Totale spese nette	1.611	2.697	271	309	6.344	5.448	61	57
Profitti/(perdite) netti al lordo degli oneri finanziari	17.361	(75.132)	2.516	(3.767)	80.658	(175.122)	1.452	(1.652)
ONERI FINANZIARI:								
Distribuzioni ai detentori di azioni partecipative redimibili (Nota 4)	(57)	-	(80)	(117)	(100)	(58)	-	-
Profitti/(perdite) d'esercizio	17.304	(75.132)	2.436	(3.884)	80.558	(175.180)	1.452	(1.652)
Crediti per ritenute d'acconto/(imposte) su dividendi e altre imposte	(232)	(422)	(113)	(175)	(3.082)	(2.586)	(16)	(17)
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni rimborsabili	\$ 17.072	\$ (75.554)	\$ 2.323	\$ (4.059)	\$ 77.476	\$ (177.766)	\$ 1.436	\$ (1.669)

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

Conto economico – (segue)

	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]		Legg Mason US Equity Fund [^]		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^] §	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
(in migliaia)								
REDDITO DA INVESTIMENTI:								
Redditi lordi da dividendi e interessi obbligazionari	\$ 44	\$ 40	\$ –	\$ –	€ –	€ 793	\$ 749	\$ 987
Interessi	–	–	–	–	–	–	–	–
Perequazione	–	–	–	–	–	–	–	–
Altri proventi	–	–	–	–	135	–	–	–
Profitti/(Perdite) netti su attività e passività finanziarie al valore equo rilevati a conto economico:								
Profitti/(Perdite) netti realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	(113)	(131)	–	–	–	(706)	(2.379)	(507)
Profitti/(Perdite) netti non realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	78	(434)	–	–	–	(522)	2.918	(3.080)
Totale profitti/(perdite) da investimento	9	(525)	–	–	135	(435)	1.288	(2.600)
SPESE:								
Commissioni di gestione (Nota 3)	16	16	–	–	–	125	115	172
Commissioni di incentivo (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria (Nota 3)	4	4	–	–	–	8	6	11
Commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	–	–	–	–	–	12	17	27
Oneri legali	–	–	–	–	–	–	–	–
Oneri di revisione	6	5	–	–	–	12	10	9
Spese di stampa	–	–	–	–	–	–	–	2
Spese per dividendi	–	–	–	–	–	–	–	–
Interessi passivi	–	–	–	–	–	2	–	–
Compensi e spese degli Amministratori (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Adeguamento a ratei passivi e altre passività	–	–	–	–	135	–	–	–
Altre spese	11	8	–	–	–	1	34	15
Totale Spese	37	33	–	–	135	160	182	236
Deroghe a spese e rimborsi/risarcimenti (Nota 3)	(18)	(14)	–	–	–	(9)	(41)	(14)
Totale spese nette	19	19	–	–	135	151	141	222
Profitti/(perdite) netti al lordo degli oneri finanziari	(10)	(544)	–	–	–	(586)	1.147	(2.822)
ONERI FINANZIARI:								
Distribuzioni ai detentori di azioni partecipative redimibili (Nota 4)	–	–	–	–	–	(119)	(324)	(325)
Profitti/(perdite) d'esercizio	(10)	(544)	–	–	–	(705)	823	(3.147)
Crediti per ritenute d'acconto/(imposte) su dividendi e altre imposte	(7)	(7)	–	–	–	(226)	(11)	(100)
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni rimborsabili	\$ (17)	\$ (551)	\$ –	\$ –	€ –	€ (931)	\$ 812	\$ (3.247)

	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
(in migliaia)								
REDDITO DA INVESTIMENTI:								
Redditi lordi da dividendi e interessi obbligazionari	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Interessi	–	–	–	–	–	–	–	–
Perequazione	–	–	–	–	–	–	–	–
Altri proventi	–	–	22	–	–	–	–	–
Profitti/(Perdite) netti su attività e passività finanziarie al valore equo rilevati a conto economico:								
Profitti/(Perdite) netti realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	–	–	–	–	–	–	–	–
Profitti/(Perdite) netti non realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	–	–	–	–	–	–	–	–
Totale profitti/(perdite) da investimento	–	–	22	–	–	–	–	–
SPESE:								
Commissioni di gestione (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissioni di incentivo (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Oneri legali	–	–	–	–	–	–	–	–
Oneri di revisione	–	–	–	–	–	–	–	–
Spese di stampa	–	–	–	–	–	–	–	–
Spese per dividendi	–	–	–	–	–	–	–	–
Interessi passivi	–	–	–	–	–	–	–	–
Compensi e spese degli Amministratori (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Adeguamento a ratei passivi e altre passività	–	–	22	–	–	–	–	–
Altre spese	–	–	–	–	–	–	–	–
Totale Spese	–	–	22	–	–	–	–	–
Deroghe a spese e rimborsi/risarcimenti (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Totale spese nette	–	–	22	–	–	–	–	–
Profitti/(perdite) netti al lordo degli oneri finanziari	–	–	–	–	–	–	–	–
ONERI FINANZIARI:								
Distribuzioni ai detentori di azioni partecipative redimibili (Nota 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Profitti/(perdite) d'esercizio	–	–	–	–	–	–	–	–
Crediti per ritenute d'acconto/(imposte) su dividendi e altre imposte	–	–	–	–	–	–	–	–
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni rimborsabili	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

Conto economico – (segue)

(in migliaia)	Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
REDDITO DA INVESTIMENTI:				
Redditi lordi da dividendi e interessi obbligazionari	€ 1.623	€ –	\$ 332.686	\$ 278.665
Interessi	5	–	205	110
Perequazione	528	–	(269)	(106)
Altri proventi	–	–	182	762
Profitti/(Perdite) netti su attività e passività finanziarie al valore equo rilevati a conto economico:				
Profitti/(Perdite) netti realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	(389)	–	(241.931)	(834.932)
Profitti/(Perdite) netti non realizzati su strumenti finanziari detenuti a scopo di negoziazione	480	–	708.669	(1.602.174)
Totale profitti/(perdite) da investimento	2.247	–	799.542	(2.157.675)
SPESE:				
Commissioni di gestione (Nota 3)	152	–	58.828	68.952
Commissioni di incentivo (Nota 3)	–	–	–	–
Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca depositaria (Nota 3)	29	–	6.381	6.826
Commissioni per i servizi agli Azionisti (Nota 3)	–	–	6.379	6.914
Oneri legali	1	–	244	259
Oneri di revisione	9	–	629	696
Spese di stampa	1	–	169	731
Spese per dividendi	–	–	–	–
Interessi passivi	–	–	94	345
Compensi e spese degli Amministratori (Nota 3)	–	–	90	71
Adeguamento a ratei passivi e altre passività	–	–	200	762
Altre spese	11	–	1.901	2.649
Totale Spese	203	–	74.915	88.205
Deroghe a spese e rimborsi/risarcimenti (Nota 3)	(1)	–	(392)	(1.112)
Totale spese nette	202	–	74.523	87.093
Profitti/(perdite) netti al lordo degli oneri finanziari	2.045	–	725.019	(2.244.768)
ONERI FINANZIARI:				
Distribuzioni ai detentori di azioni partecipative redimibili (Nota 4)	–	–	(84.425)	(49.425)
Profitti/(perdite) d'esercizio	2.045	–	640.594	(2.294.193)
Crediti per ritenute d'acconto/(imposte) su dividendi e altre imposte	(10)	–	(15.212)	(17.967)
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni rimborsabili	€ 2.035	€ –	\$ 625.382	\$(2.312.160)

Gli importi indicati con “–” sono pari a 0\$/0€/0¥/0£ o inferiori a 1.000\$/1.000€/1.000¥/1.000£.

I profitti e le perdite derivano esclusivamente da attività continuative, ad eccezione di FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] e FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^] che hanno cessato l'attività. Non vi sono stati altri profitti o perdite all'infuori di quelli riportati nel Conto economico.

I dati in euro di FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] e Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] sono stati convertiti in dollari statunitensi nel dato totale di Franklin Templeton Global Funds Plc al 31 agosto 2023 utilizzando il tasso medio USD/EUR di 0,9186 (28 febbraio 2023: 0,9590).

I dati in sterline britanniche di FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] sono stati convertiti in dollari statunitensi nel dato totale di Franklin Templeton Global Funds Plc al 31 agosto 2023 utilizzando il tasso di chiusura USD/GBP di 0,7973 (28 febbraio 2023: 0,8252).

α A far data dal 24 marzo 2023, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] e FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] hanno cessato le negoziazioni.

β A far data dal 20 aprile 2023, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] ha cessato le negoziazioni.

γ A far data dal 20 giugno 2023, è stato lanciato il fondo FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^].

δ A far data dal 17 luglio 2023, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^] ha cessato le negoziazioni.

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

[Pagina lasciata intenzionalmente vuota]

Prospetto delle variazioni del Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative rimborsabili

(in migliaia)	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	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative rimborsabili	\$ 3.881	\$ 353	\$ 100	\$ (23.208)	\$ 11.257	\$ (163.099)	€ 3.235	€ (16.029)
OPERAZIONI IN AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Proventi netti da vendite di azioni	892.129	785.309	93.855	16.134	154.975	406.503	804	7.423
Proventi netti da distribuzioni reinvestite	15.427	851	603	374	509	428	4	1
Costo delle azioni riacquistate	(816.133)	(841.015)	(23.001)	(42.699)	(315.412)	(462.033)	(46.187)	(696)
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto derivante da operazioni in azioni partecipative rimborsabili	91.423	(54.855)	71.457	(26.191)	(159.928)	(55.102)	(45.379)	6.728
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative rimborsabili	95.304	(54.502)	71.557	(49.399)	(148.671)	(218.201)	(42.144)	(9.301)
PATRIMONIO NETTO ATTRIBUIBILE A DETENTORI DI AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Inizio del periodo	833.615	919.324	131.919	232.906	1.148.700	1.488.090	132.467	149.386
Conversione valutaria	-	-	-	-	-	-	-	-
Fine del periodo	\$ 928.919	\$ 864.822	\$ 203.476	\$ 183.507	\$1.000.029	\$1.269.889	€ 90.323	€ 140.085
(in migliaia)	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 [^]	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative rimborsabili	\$ (780)	\$ (10.172)	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ (3.242)
OPERAZIONI IN AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Proventi netti da vendite di azioni	2.186	4.323	-	-	-	-	-	5.977
Proventi netti da distribuzioni reinvestite	133	104	-	-	-	-	-	46
Costo delle azioni riacquistate	(7.287)	(14.246)	-	-	-	-	-	(52.270)
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto derivante da operazioni in azioni partecipative rimborsabili	(4.968)	(9.819)	-	-	-	-	-	(46.247)
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative rimborsabili	(5.748)	(19.991)	-	-	-	-	-	(49.489)
PATRIMONIO NETTO ATTRIBUIBILE A DETENTORI DI AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Inizio del periodo	57.431	81.978	-	-	-	-	-	59.525
Conversione valutaria	-	-	-	-	-	-	-	-
Fine del periodo	\$ 51.683	\$ 61.987	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 10.036
(in migliaia)	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 [^]	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative rimborsabili	\$ 79.814	\$ (500.946)	\$ -	\$ -	\$ 15.507	\$ (63.479)	\$ -	\$ -
OPERAZIONI IN AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Proventi netti da vendite di azioni	94.495	260.281	-	-	24.364	39.773	-	-
Proventi netti da distribuzioni reinvestite	374	349	-	-	-	-	-	-
Costo delle azioni riacquistate	(795.024)	(1.317.097)	-	-	(28.074)	(100.127)	-	-
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto derivante da operazioni in azioni partecipative rimborsabili	(700.155)	(1.056.467)	-	-	(3.710)	(60.354)	-	-
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative rimborsabili	(620.341)	(1.557.413)	-	-	11.797	(123.833)	-	-
PATRIMONIO NETTO ATTRIBUIBILE A DETENTORI DI AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Inizio del periodo	2.132.501	4.183.834	-	-	275.012	371.899	-	-
Conversione valutaria	-	-	-	-	-	-	-	-
Fine del periodo	\$ 1.512.160	\$ 2.626.421	\$ -	\$ -	\$ 286.809	\$ 248.066	\$ -	\$ -

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]		FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	
per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
\$ (783)	\$ (48.966)	\$ 20.634	\$ (61.118)	\$ 3.735	\$ (22.268)	\$ 37	\$ (7.988)	€ -	€ (2.426)
39.903	17.457	137.909	65.411	19.589	16.477	374	434	-	4
58	47	21	4	-	-	-	-	-	-
(83.420)	(35.776)	(208.326)	(80.735)	(15.563)	(38.046)	(15.102)	(3.164)	-	(35.026)
(43.459)	(18.272)	(70.396)	(15.320)	4.026	(21.569)	(14.728)	(2.730)	-	(35.022)
(44.242)	(67.238)	(49.762)	(76.438)	7.761	(43.837)	(14.691)	(10.718)	-	(37.448)
437.707	509.794	523.970	444.249	146.703	202.948	46.050	77.353	-	37.448
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 393.465	\$ 442.556	\$ 474.208	\$ 367.811	\$ 154.464	\$ 159.111	\$ 31.359	\$ 66.635	€ -	€ -

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]		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 [^]	
per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
\$ 8.305	\$ (39.224)	\$ 3.744	\$ (78.364)	£ (1.011)	£ (8.435)	\$ 1.369	\$ (37.349)	\$ (298)	\$ (3.224)
253	9.235	2.928	44.563	-	69.541	41	133.770	172	328
-	-	-	-	-	-	-	-	442	275
(52.040)	(366.026)	-	(345)	-	(69.541)	(40.895)	(130.219)	(120)	(342)
(51.787)	(356.791)	2.928	44.218	-	-	(40.854)	3.551	494	261
(43.482)	(396.015)	6.672	(34.146)	(1.011)	(8.435)	(39.485)	(33.798)	196	(2.963)
559.548	1.057.941	1.119.507	1.147.280	45.912	73.633	94.775	175.169	18.441	21.958
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 516.066	\$ 661.926	\$ 1.126.179	\$ 1.113.134	£ 44.901	£ 65.198	\$ 55.290	\$ 141.371	\$ 18.637	\$ 18.995

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative rimborsabili – (segue)

(in migliaia)	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 [^]	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative rimborsabili	\$ 266	\$ (875)	\$ 1.121	\$ (31.727)	\$ 10.902	\$ (77.166)	\$ 1.246	\$ (1.256)
OPERAZIONI IN AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Proventi netti da vendite di azioni	–	–	11.355	37.486	18.678	10.821	12.804	19
Proventi netti da distribuzioni reinvestite	–	–	297	79	9	5	1	1
Costo delle azioni riacquistate	(50)	(6)	(20.656)	(35.094)	(312.850)	(148.873)	(123)	–
Incremento/(Decremento) del Patrimonio netto derivante da operazioni in azioni partecipative riscattabili	(50)	(6)	(9.004)	2.471	(294.163)	(138.047)	12.682	20
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative rimborsabili	216	(881)	(7.883)	(29.256)	(283.261)	(215.213)	13.928	(1.236)
PATRIMONIO NETTO ATTRIBUIBILE A DETENTORI DI AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Inizio del periodo	8.995	9.866	162.009	215.635	539.271	752.718	10.394	11.590
Conversione valutaria	–	–	–	–	–	–	–	–
Fine del periodo	\$ 9.211	\$ 8.985	\$ 154.126	\$ 186.379	\$ 256.010	\$ 537.505	\$ 24.322	\$ 10.354

(in migliaia)	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund ^{^α}	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative rimborsabili	\$ –	\$ –	\$ (123)	\$ (15.874)	\$ 504	\$ –	\$ (168)	\$ (354)
OPERAZIONI IN AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Proventi netti da vendite di azioni	–	–	–	112	4	–	–	69
Proventi netti da distribuzioni reinvestite	–	–	–	–	4	–	–	–
Costo delle azioni riacquistate	–	–	–	(17.709)	–	–	(2.366)	(7)
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto derivante da operazioni in azioni partecipative rimborsabili	–	–	–	(17.597)	8	–	(2.366)	62
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative rimborsabili	–	–	(123)	(33.471)	512	–	(2.534)	(292)
PATRIMONIO NETTO ATTRIBUIBILE A DETENTORI DI AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Inizio del periodo	–	–	69.410	104.231	14.804	–	2.534	2.177
Conversione valutaria	–	–	–	–	–	–	–	–
Fine del periodo	\$ –	\$ –	\$ 69.287	\$ 70.760	\$ 15.316	\$ –	\$ –	\$ 1.885

(in migliaia)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative rimborsabili	\$ 17.072	\$ (75.554)	\$ 2.323	\$ (4.059)	\$ 77.476	\$ (177.766)	\$ 1.436	\$ (1.669)
OPERAZIONI IN AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Proventi netti da vendite di azioni	8.484	4.589	811	3.404	319.430	614.239	1.002	211
Proventi netti da distribuzioni reinvestite	–	–	4	3	–	–	–	–
Costo delle azioni riacquistate	(34.433)	(54.880)	(6.138)	(2.023)	(442.334)	(402.757)	(740)	(1.888)
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto derivante da operazioni in azioni partecipative rimborsabili	(25.949)	(50.291)	(5.323)	1.384	(122.904)	211.482	262	(1.677)
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative rimborsabili	(8.877)	(125.845)	(3.000)	(2.675)	(45.428)	33.716	1.698	(3.346)
PATRIMONIO NETTO ATTRIBUIBILE A DETENTORI DI AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Inizio del periodo	224.793	538.159	38.528	43.279	1.639.979	1.599.315	13.179	16.018
Conversione valutaria	–	–	–	–	–	–	–	–
Fine del periodo	\$ 215.916	\$ 412.314	\$ 35.528	\$ 40.604	\$1.594.551	\$1.633.031	\$ 14.877	\$ 12.672

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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}	
per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
\$ 2.545	\$ (34.454)	\$ -	\$ -	\$ 15.162	\$ (208.762)	\$ (1.228)	\$ (1.065)	\$ (497)	\$ (2.300)
27.081	1.598	-	-	134.138	246.355	2.279	1.476	-	-
7	3	-	-	237	155	-	-	-	1
(27.005)	(9.529)	-	-	(174.889)	(434.813)	(14.541)	(1.565)	(7.892)	-
83	(7.928)	-	-	(40.514)	(188.303)	(12.262)	(89)	(7.892)	1
2.628	(42.382)	-	-	(25.352)	(397.065)	(13.490)	(1.154)	(8.389)	(2.299)
205.146	244.396	-	-	1.210.305	1.608.073	46.756	52.386	8.389	10.163
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 207.774	\$ 202.014	\$ -	\$ -	\$1.184.953	\$1.211.008	\$ 33.266	\$ 51.232	\$ -	\$ 7.864

FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund [^]		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
\$ 47.156	\$ (88.725)	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 26.329	\$ (15.091)	\$ 287.882	\$ (280.810)
185.570	183.445	-	-	-	-	14.365	14.256	363.086	213.856
1	4	-	-	-	-	2	-	-	-
(203.380)	(105.991)	-	-	-	-	(31.702)	(22.771)	(336.322)	(419.098)
(17.809)	77.458	-	-	-	-	(17.335)	(8.515)	26.764	(205.242)
29.347	(11.267)	-	-	-	-	8.994	(23.606)	314.646	(486.052)
929.726	892.238	-	-	-	-	189.610	213.480	1.225.735	1.772.695
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 959.073	\$ 880.971	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 198.604	\$ 189.874	\$1.540.381	\$1.286.643

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
€ (20.220)	€ 107.781	\$ -	\$ (299)	\$ (14.318)	\$ (21.099)	\$ (313)	\$ (114.946)	\$ 3.186	\$ (7.109)
190.309	561.163	-	15	31.752	305.392	131.912	101.415	19.906	4.716
13	11	-	1	1.181	496	-	-	-	-
(358.725)	(255.798)	-	(2)	(59.438)	(44.110)	(197.589)	(244.838)	(8.755)	(10.172)
(168.403)	305.376	-	14	(26.505)	261.778	(65.677)	(143.423)	11.151	(5.456)
(188.623)	413.157	-	(285)	(40.823)	240.679	(65.990)	(258.369)	14.337	(12.565)
1.062.833	671.424	-	2.665	406.048	173.394	741.529	916.209	78.098	87.935
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
€ 874.210	€1.084.581	\$ -	\$ 2.380	\$ 365.225	\$ 414.073	\$ 675.539	\$ 657.840	\$ 92.435	\$ 75.370

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative rimborsabili – (segue)

(in migliaia)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]		Legg Mason US Equity Fund [^]		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^] §	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
	\$	\$	\$	\$	€	€	\$	\$
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative rimborsabili	\$ (17)	\$ (551)	\$ -	\$ -	€ -	€ (931)	\$ 812	\$ (3.247)
OPERAZIONI IN AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Proventi netti da vendite di azioni	9	1	-	-	-	305	53	1.589
Proventi netti da distribuzioni reinvestite	-	-	-	-	-	-	98	88
Costo delle azioni riacquistate	(17)	-	-	-	-	(27.711)	(22.053)	(3.353)
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto derivante da operazioni in azioni partecipative rimborsabili	(8)	1	-	-	-	(27.406)	(21.902)	(1.676)
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative rimborsabili	(25)	(550)	-	-	-	(28.337)	(21.090)	(4.923)
PATRIMONIO NETTO ATTRIBUIBILE A DETENTORI DI AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Inizio del periodo	4.254	4.534	-	-	-	28.337	21.090	25.883
Conversione valutaria	-	-	-	-	-	-	-	-
Fine del periodo	\$ 4.229	\$ 3.984	\$ -	\$ -	€ -	€ -	\$ -	\$ 20.960

(in migliaia)	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
	\$	\$	€	€	\$	\$	\$	\$
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative rimborsabili	\$ -	\$ -	€ -	€ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
OPERAZIONI IN AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Proventi netti da vendite di azioni	-	-	-	-	-	-	-	-
Proventi netti da distribuzioni reinvestite	-	-	-	-	-	-	-	-
Costo delle azioni riacquistate	-	-	-	-	-	-	-	-
Incremento/(Decremento) del Patrimonio netto derivante da operazioni in azioni partecipative rimborsabili	-	-	-	-	-	-	-	-
Incremento/(Decremento) del Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative rimborsabili	-	-	-	-	-	-	-	-
PATRIMONIO NETTO ATTRIBUIBILE A DETENTORI DI AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI								
Inizio del periodo	-	-	-	-	-	-	-	-
Conversione valutaria	-	-	-	-	-	-	-	-
Fine del periodo	\$ -	\$ -	€ -	€ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -

(in migliaia)	Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]		Franklin Templeton Global Funds plc	
	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
	€	€	\$	\$
Incremento netto/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative rimborsabili	€ 2.035	€ -	\$ 625.382	\$ (2.312.160)
OPERAZIONI IN AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI				
Proventi netti da vendite di azioni	70.915	-	3.075.829	4.431.367
Proventi netti da distribuzioni reinvestite	-	-	21.345	5.801
Costo delle azioni riacquistate	(21.981)	-	(4.853.609)	(6.180.820)
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto derivante da operazioni in azioni partecipative rimborsabili	48.934	-	(1.756.435)	(1.743.652)
Incremento/(decremento) del Patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative rimborsabili	50.969	-	(1.131.053)	(4.055.812)
PATRIMONIO NETTO ATTRIBUIBILE A DETENTORI DI AZIONI PARTECIPATIVE RISCATTABILI				
Inizio del periodo	36.823	-	17.428.030	22.628.678
Conversione valutaria	-	-	41.600	(162.565)
Fine del periodo	€ 87.792	€ -	\$ 16.338.577	\$ 18.410.301

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

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 ^{^β}	
per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 166	¥ -	¥ -	\$ 127	\$ (2.008)
-	-	-	-	-	-	-	-	12	27
-	-	-	-	-	-	-	-	3	2
-	-	-	-	-	(12.709)	-	-	(3.680)	(265)
-	-	-	-	-	(12.709)	-	-	(3.665)	(236)
-	-	-	-	-	(12.543)	-	-	(3.538)	(2.244)
-	-	-	-	-	12.543	-	-	3.538	16.118
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	¥ -	¥ -	\$ -	\$ 13.874
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]		FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]		FTGF Martin Currie Improving Society Fund ^{^γ}	
per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2023	per il periodo di sei mesi chiuso al 31 agosto 2022
\$ 13.117	\$ (46.302)	\$ (974)	\$ (1.790)	\$ 561	\$ (8.123)	€ 1.468	€ (40.375)	\$ (233)	\$ -
14.413	56.471	51	657	1.447	11.301	9.972	23.179	4.999	-
-	-	161	146	-	-	-	-	-	-
(18.006)	(28.057)	(3.862)	(1.412)	(3.745)	(17.015)	(12.218)	(86.025)	-	-
(3.593)	28.414	(3.650)	(609)	(2.298)	(5.714)	(2.246)	(62.846)	4.999	-
9.524	(17.888)	(4.624)	(2.399)	(1.737)	(13.837)	(778)	(103.221)	4.766	-
141.049	169.381	25.121	27.934	34.702	47.838	189.097	303.590	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 150.573	\$ 151.493	\$ 20.497	\$ 25.535	\$ 32.965	\$ 34.001	€ 188.319	€ 200.369	\$ 4.766	\$ -

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative rimborsabili – (segue)

Gli importi designati come “-” sono USD 0/EUR 0/GBP 0/JPY 0 o meno di USD 1.000/EUR 1.000/GBP 1.000/JPY 1.000.

Tutti i dati in euro, ad eccezione del patrimonio netto di inizio periodo attribuibile ai detentori di azioni rimborsabili, per FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] e Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] sono stati convertiti in dollari statunitensi nel dato totale di Franklin Templeton Global Funds Plc per il periodo finanziario conclusosi il 31 agosto 2023, utilizzando il tasso medio USD/EUR di 0,9186 (28 febbraio 2023: 0,9590).

Il patrimonio netto di inizio periodo attribuibile ai detentori di azioni rimborsabili di FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] e Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] è stato convertito in dollari statunitensi nel dato totale utilizzando il tasso di chiusura USD/EUR al 28 febbraio 2023 di 0,9454 (28 febbraio 2022: 0,8919).

Tutti i dati in sterline britanniche, ad eccezione del patrimonio netto di inizio periodo attribuibile ai detentori di azioni rimborsabili, per FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] sono stati convertiti in dollari statunitensi nel dato totale di Franklin Templeton Global Funds Plc per il periodo finanziario conclusosi il 31 agosto 2023, utilizzando il tasso medio USD/GBP di 0,7973 (28 febbraio 2023: 0,8252).

Il patrimonio netto di inizio periodo attribuibile ai detentori di azioni rimborsabili di FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] è stato convertito in dollari statunitensi nel dato totale utilizzando il tasso di chiusura USD/GBP al 28 febbraio 2023 di 0,8314 (28 febbraio 2022: 0,7454).

α A far data dal 24 marzo 2023, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] e FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] hanno cessato le negoziazioni.

β A far data dal 20 aprile 2023, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] ha cessato le negoziazioni.

γ A far data dal 20 giugno 2023, è stato lanciato il fondo FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^].

δ A far data dal 17 luglio 2023, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^] ha cessato le negoziazioni.

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD		
Vendute	878	1.094
Rimborsate	(672)	(904)
Incremento netto	206	190
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)		
Vendute	604.431	320.506
Rimborsate	(516.730)	(414.297)
Incremento netto/(decremento)	87.701	(93.791)
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD		
Rimborsate	(1)	–
Decremento netto	(1)	–
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (D)		
Vendute	–	218
Rimborsate	(44)	–
(Decremento)/incremento netto	(44)	218
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD		
Rimborsate	–	(2)
Decremento netto	–	(2)
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)		
Rimborsate	(134)	–
Decremento netto	(134)	–
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (D)		
Vendute	212.512	351.147
Rimborsate	(231.821)	(332.929)
(Decremento) netto/incremento	(19.309)	18.218
Azioni a Distribuzione di Classe A (G) in USD (D)		
Vendute	4	35
Rimborsate	–	(72)
Incremento/(decremento) netto	4	(37)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD		
Vendute	40	35
Rimborsate	(36)	(43)
Incremento netto/(decremento)	4	(8)
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)		
Vendute	46	48
Rimborsate	(27)	(59)
Incremento netto/(decremento)	19	(11)
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD		
Vendute	2	–
Rimborsate	(12)	(15)
Decremento netto	(10)	(15)
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)		
Vendute	1	1
Rimborsate	(2)	(6)
Decremento netto	(1)	(5)
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD		
Vendute	3	–
Rimborsate	(1)	(11)
Incremento netto/(decremento)	2	(11)
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD		
Vendute	668	53
Rimborsate	(30)	(211)
Incremento netto/(decremento)	638	(158)
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)		
Vendute	74	3
Rimborsate	(15)	(21)
Incremento/(decremento) netto	59	(18)
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD		
Vendute	–	1
Rimborsate	(1)	(1)
Decremento netto	(1)	–
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD		
Rimborsate	(85)	–
Decremento netto	(85)	–
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)		
Vendute	–	1
Rimborsate	–	(2)
Decremento netto	–	(1)

	Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD		
Vendute	1	2
Rimborsate	(4)	(1)
(Decremento)/incremento netto	(3)	1
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in USD		
Rimborsate	–	(1)
Decremento netto	–	(1)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD		
Vendute	57	80
Rimborsate	(93)	(134)
Decremento netto	(36)	(54)
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)		
Vendute	56	106
Rimborsate	(26)	(160)
Incremento netto/(decremento)	30	(54)
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus		
Vendute	1	4
Rimborsate	(7)	(21)
Decremento netto	(6)	(17)
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)		
Vendute	8	59
Rimborsate	(105)	(4)
(Decremento)/incremento netto	(97)	55
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)		
Vendute	–	1
Rimborsate	–	(5)
Decremento netto	–	(4)
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD		
Vendute	15	2
Rimborsate	(7)	(33)
Incremento netto/(decremento)	8	(31)
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)		
Vendute	5	1
Rimborsate	(3)	(10)
Incremento/(decremento) netto	2	(9)
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD		
Vendute	5	7
Rimborsate	(13)	(60)
Decremento netto	(8)	(53)
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD		
Vendute	598	1.705
Rimborsate	(1.628)	(2.608)
Decremento netto	(1.030)	(903)
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)		
Vendute	55	11
Rimborsate	(54)	(28)
Incremento netto/(decremento)	1	(17)
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD		
Vendute	13	2
Rimborsate	(4)	(9)
Incremento netto/(decremento)	9	(7)
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (D)		
Vendute	1	8
Rimborsate	(1)	(2)
Incremento netto	–	6
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)		
Rimborsate	(1)	(3)
Decremento netto	(1)	(3)
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD		
Vendute	407	1.030
Rimborsate	(688)	(629)
(Decremento) netto/incremento	(281)	401
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (M)		
Vendute	6	4
Rimborsate	–	(1)
Incremento netto	6	3
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)		
Vendute	60	146
Rimborsate	–	(18)
Incremento netto	60	128

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al		Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – (segue)				
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (M)				
Vendute	7	28		
Rimborsate	(35)	(33)		
Decremento netto	(28)	(5)		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR				
Rimborsate	(8)	(1)		
Decremento netto	(8)	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe A (G) in USD (D)				
Rimborsate	(1)	(2)		
Decremento netto	(1)	(2)		
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund				
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)				
Vendute	4	–		
Incremento netto	4	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (D)				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR				
Vendute	5	76		
Rimborsate	(33)	(4)		
(Decremento)/incremento netto	(28)	72		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR				
Rimborsate	(450)	(1)		
Decremento netto	(450)	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in EUR				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^Δ				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	–	4		
Rimborsate	–	(57)		
Decremento netto	–	(53)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)				
Vendute	–	5		
Rimborsate	–	(25)		
Decremento netto	–	(20)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus				
Vendute	–	2		
Rimborsate	–	(12)		
Decremento netto	–	(10)		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Vendute	–	9		
Rimborsate	–	(10)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)				
Rimborsate	–	(22)		
Decremento netto	–	(22)		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Rimborsate	–	(2)		
Decremento netto	–	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Vendute	–	23		
Rimborsate	–	(1)		
Incremento netto	–	22		
Azioni a Distribuzione di Classe A (G) in USD (D)				
Rimborsate	–	(2)		
Decremento netto	–	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe L (G) in USD (D)				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute			15	4
Rimborsate			(6)	(13)
Incremento netto/(decremento)			9	(9)
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)				
Vendute			2	4
Rimborsate			(19)	(5)
Decremento netto			(17)	(1)
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus				
Vendute			9	–
Rimborsate			(7)	(1)
Incremento netto/(decremento)			2	(1)
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)				
Rimborsate			(1)	(2)
Decremento netto			(1)	(2)
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)				
Vendute			–	2
Incremento netto			–	2
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)				
Vendute			1	1
Rimborsate			(5)	(4)
Decremento netto			(4)	(3)
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (M) (Copertura)				
Rimborsate			(3)	(1)
Decremento netto			(3)	(1)
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus				
Rimborsate			–	(5)
Decremento netto			–	(5)
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)				
Vendute			67	60
Rimborsate			(54)	(16)
Incremento netto			13	44
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (D)				
Rimborsate			–	(2)
Decremento netto			–	(2)
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Vendute			–	1
Rimborsate			(6)	(3)
Decremento netto			(6)	(2)
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)				
Vendute			1	1
Rimborsate			(5)	(10)
Decremento netto			(4)	(9)
Azioni a Distribuzione di Classe A in ZAR (M) Plus (Copertura)				
Vendute			3	6
Rimborsate			(3)	(5)
Incremento netto			–	1
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)				
Rimborsate			(2)	–
Decremento netto			(2)	–
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute			12	12
Rimborsate			(10)	(19)
Incremento/(decremento) netto			2	(7)
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)				
Rimborsate			(4)	–
Decremento netto			(4)	–
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (D)				
Vendute			1	–
Rimborsate			–	(4)
Incremento netto/(decremento)			1	(4)
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)				
Vendute			1	–
Incremento netto			1	–
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute			3	86
Rimborsate			(42)	(21)
(Decremento)/incremento netto			(39)	65
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (M)				
Vendute			–	13
Rimborsate			–	(102)
Decremento netto			–	(89)

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al		Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (segue)				
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Rimborsate	(4)	(4)		
Decremento netto	(4)	(4)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)				
Rimborsate	–	(71)		
Decremento netto	–	(71)		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura)				
Rimborsate	(2)	(13)		
Decremento netto	(2)	(13)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier PLN (coperte)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(5)	(17)		
Decremento netto	(5)	(16)		
Azioni a Distribuzione di Classe LM in AUD (M) (Copertura)				
Vendute	42	28		
Incremento netto	42	28		
FTGF Western Asset US High Yield Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	4	15		
Rimborsate	(16)	(16)		
Decremento netto	(12)	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)				
Vendute	12	7		
Rimborsate	(38)	(19)		
Decremento netto	(26)	(12)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus				
Vendute	4	1		
Rimborsate	(7)	(12)		
Decremento netto	(3)	(11)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)				
Vendute	1	4		
Rimborsate	(3)	(9)		
Decremento netto	(2)	(5)		
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (M) (Copertura)				
Vendute	–	4		
Rimborsate	(1)	–		
(Decremento)/incremento netto	(1)	4		
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus				
Vendute	2	–		
Rimborsate	(1)	–		
Incremento netto	1	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)				
Vendute	66	6		
Rimborsate	(19)	(145)		
Incremento/(decremento) netto	47	(139)		
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD				
Rimborsate	–	(2)		
Decremento netto	–	(2)		
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (D)				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Vendute	–	8		
Rimborsate	(1)	–		
(Decremento)/incremento netto	(1)	8		
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(6)	(4)		
Decremento netto	(6)	(3)		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD				
Vendute	–	5		
Rimborsate	(5)	(4)		
(Decremento)/incremento netto	(5)	1		
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(2)	–		
(Decremento)/incremento netto	(2)	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	–	12		
Rimborsate	(2)	(19)		
Decremento netto	(2)	(7)		
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)				
Vendute	–	2		
Incremento netto	–	2		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	13	327		
Rimborsate	(104)	(560)		
Decremento netto	(91)	(233)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)				
Vendute	5	–		
Incremento netto	5	–		
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (Coperte)				
Vendute	–	1		
Incremento netto	–	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD				
Rimborsate	–	(17)		
Decremento netto	–	(17)		
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (M)				
Vendute	12	8		
Incremento netto	12	8		
Azioni a Distribuzione di Classe A (G) in USD (D)				
Vendute	1	–		
Rimborsate	(1)	–		
Incremento netto	–	–		
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^A				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Rimborsate	–	(8)		
Decremento netto	–	(8)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)				
Rimborsate	–	(6)		
Decremento netto	–	(6)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus				
Vendute	–	19		
Incremento netto	–	19		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)				
Vendute	–	5		
Rimborsate	–	(3)		
Incremento netto	–	2		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Rimborsate	–	(2)		
Decremento netto	–	(2)		
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Rimborsate	–	(6)		
Decremento netto	–	(6)		
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (M) (Copertura)				
Vendute	–	102		
Incremento netto	–	102		
FTGF Western Asset Global High Yield Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	3	3		
Rimborsate	(5)	(6)		
Decremento netto	(2)	(3)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)				
Vendute	1	4		
Rimborsate	(2)	(7)		
Decremento netto	(1)	(3)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus				
Vendute	–	8		
Rimborsate	(12)	(51)		
Decremento netto	(12)	(43)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)				
Vendute	1	2		
Rimborsate	(15)	(18)		
Decremento netto	(14)	(16)		

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al		Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (segue)				
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)				
Vendute	3	7		
Rimborsate	(17)	(17)		
Decremento netto	(14)	(10)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (D) (Copertura)				
Vendute	–	1		
Incremento netto	–	1		
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)				
Vendute	508	333		
Rimborsate	(482)	(297)		
Incremento netto	26	36		
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (D)				
Rimborsate	–	(3)		
Decremento netto	–	(3)		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Rimborsate	–	(2)		
Decremento netto	–	(2)		
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)				
Vendute	1	–		
Rimborsate	(5)	(2)		
Decremento netto	(4)	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD				
Rimborsate	(2)	–		
Decremento netto	(2)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	5	9		
Rimborsate	(5)	(6)		
Incremento netto	–	3		
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)				
Rimborsate	(1)	(4)		
Decremento netto	(1)	(4)		
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (D)				
Vendute	2	2		
Rimborsate	(4)	(4)		
Decremento netto	(2)	(2)		
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (D) (Copertura)				
Vendute	5	4		
Rimborsate	(4)	(2)		
Incremento netto	1	2		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Rimborsate	–	(23)		
Decremento netto	–	(23)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(5)	–		
(Decremento)/incremento netto	(5)	1		
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (M) (Copertura)				
Vendute	–	1		
Incremento netto	–	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD				
Rimborsate	(4)	–		
Decremento netto	(4)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A (G) in USD (D)				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	–	17		
Rimborsate	–	(4)		
Incremento netto	–	13		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)				
Vendute	–	7		
Rimborsate	–	(22)		
Decremento netto	–	(15)		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Vendute	–	1		
Incremento netto	–	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	–	11		
Incremento netto	–	11		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Vendute	–	12		
Rimborsate	–	(75)		
Decremento netto	–	(63)		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD				
Rimborsate	–	(369)		
Decremento netto	–	(369)		
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	14	29		
Rimborsate	(30)	(62)		
Decremento netto	(16)	(33)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(2)	(3)		
Decremento netto	(2)	(2)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus				
Vendute	44	32		
Rimborsate	(63)	(129)		
Decremento netto	(19)	(97)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)				
Vendute	7	9		
Rimborsate	(57)	(7)		
(Decremento)/incremento netto	(50)	2		
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)				
Vendute	23	24		
Rimborsate	(47)	(81)		
Decremento netto	(24)	(57)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura)				
Vendute	429	2		
Rimborsate	(95)	(50)		
Incremento netto/(decremento)	334	(48)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)				
Rimborsate	–	(2)		
Decremento netto	–	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR				
Vendute	–	2		
Rimborsate	(1)	(2)		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus				
Vendute	6	16		
Rimborsate	(71)	(163)		
Decremento netto	(65)	(147)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (coperte)				
Vendute	123	16		
Rimborsate	(13)	(52)		
Incremento netto/(decremento)	110	(36)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)				
Vendute	9492	79		
Rimborsate	(9.099)	(87)		
Incremento netto/(decremento)	393	(8)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus				
Vendute	43	300		
Rimborsate	(357)	(312)		
Decremento netto	(314)	(12)		
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD				
Vendute	–	1		
Incremento netto	–	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	–	1		
Rimborsate	–	(1)		
Incremento netto	–	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD				
Rimborsate	–	(2)		
Decremento netto	–	(2)		

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al		Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF Western Asset Global Credit Fund^ – (segue)				
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD				
Rimborsate	(99)	(15)		
Decremento netto	(99)	(15)		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR (Copertura)				
Vendute	3	4		
Rimborsate	–	(1)		
Incremento netto	3	3		
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	32	60		
Rimborsate	(726)	(1.371)		
Decremento netto	(694)	(1.311)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)				
Vendute	6	63		
Rimborsate	(152)	(364)		
Decremento netto	(146)	(301)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (S)				
Vendute	5	20		
Rimborsate	(39)	(106)		
Decremento netto	(34)	(86)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in AUD (coperte)				
Vendute	9	1		
Rimborsate	(2)	–		
Incremento netto	7	1		
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) (Copertura) Plus (e)				
Vendute	2	–		
Rimborsate	(51)	(67)		
Decremento netto	(49)	(67)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CHF (coperte)				
Rimborsate	(10)	(54)		
Decremento netto	(10)	(54)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) (Copertura) Plus (e)				
Rimborsate	(86)	(61)		
Decremento netto	(86)	(61)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)				
Vendute	186	351		
Rimborsate	(316)	(1.721)		
Decremento netto	(130)	(1.370)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A)				
Vendute	3	–		
Rimborsate	(8)	(11)		
Decremento netto	(5)	(11)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) (Copertura) Plus (e)				
Rimborsate	(18)	(9)		
Decremento netto	(18)	(9)		
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (S) (Copertura)				
Vendute	1	8		
Rimborsate	(5)	(3)		
(Decremento)/incremento netto	(4)	5		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in GBP (coperte)				
Vendute	1	–		
Rimborsate	(9)	(90)		
Decremento netto	(8)	(90)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A				
Rimborsate	(1)	(1)		
Decremento netto	(1)	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) (Copertura) Plus (e)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(36)	(7)		
Decremento netto	(36)	(6)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus				
Rimborsate	(7)	–		
Decremento netto	(7)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (coperte)				
Vendute	4	11		
Rimborsate	(12)	(57)		
Decremento netto	(8)	(46)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (coperte)				
Vendute	3.504	–		
Rimborsate	(4.937)	(12.305)		
Decremento netto	(1.433)	(12.305)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) (Copertura) Plus (e)				
Vendute	225	893		
Rimborsate	(6.314)	(11.870)		
Decremento netto	(6.089)	(10.977)		
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Rimborsate	(35)	(61)		
Decremento netto	(35)	(61)		
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (S)				
Vendute	1	–		
Rimborsate	(4)	(10)		
Decremento netto	(3)	(10)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in NOK (coperte)				
Vendute	111	254		
Rimborsate	(439)	(121)		
(Decremento)/incremento netto	(328)	133		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD				
Rimborsate	(22)	(20)		
Decremento netto	(22)	(20)		
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (S)				
Rimborsate	(2)	(5)		
Decremento netto	(2)	(5)		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)				
Vendute	2	–		
Rimborsate	(3)	(8)		
Decremento netto	(1)	(8)		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	9	61		
Rimborsate	(84)	(204)		
Decremento netto	(75)	(143)		
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (S)				
Vendute	7	3		
Rimborsate	(12)	(30)		
Decremento netto	(5)	(27)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD				
Vendute	22	3		
Rimborsate	(150)	(551)		
Decremento netto	(128)	(548)		
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (M) Plus (e)				
Vendute	–	2		
Rimborsate	(122)	(125)		
Decremento netto	(122)	(123)		
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (S)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(17)	(60)		
Decremento netto	(17)	(59)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in CHF (coperte)				
Vendute	2	7		
Rimborsate	(13)	(71)		
Decremento netto	(11)	(64)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)				
Vendute	142	1.408		
Rimborsate	(95)	(622)		
Incremento netto	47	786		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR				
Rimborsate	(1)	(14)		
Decremento netto	(1)	(14)		
Azioni a distribuzione di Classe X in EUR (A) (Copertura)				
Vendute	1	7		
Rimborsate	(79)	(18)		
Decremento netto	(78)	(11)		
Azioni a distribuzione di Classe X in EUR (M) (Copertura)				
Rimborsate	(23)	(31)		
Decremento netto	(23)	(31)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (coperte)				
Vendute	2	25		
Rimborsate	(58)	(138)		
Decremento netto	(56)	(113)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X				
Rimborsate	–	(3)		
Decremento netto	–	(3)		

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] – (segue)		
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) (Copertura) Plus (e)		
Vendute	–	1
Rimborsate	(6)	(21)
Decremento netto	(6)	(20)
Azioni ad Accumulazione di Classe X in SGD (coperte)		
Vendute	266	930
Rimborsate	(1.768)	(1.063)
Decremento netto	(1.502)	(133)
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD		
Vendute	30	52
Rimborsate	(507)	(934)
Decremento netto	(477)	(882)
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (S)		
Vendute	6	1
Rimborsate	(15)	(218)
Decremento netto	(9)	(217)
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier AUD (Copertura)		
Vendute	–	1
Rimborsate	–	(16)
Decremento netto	–	(15)
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in AUD (S) (Copertura)		
Vendute	–	10
Rimborsate	(16)	(548)
Decremento netto	(16)	(538)
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (Copertura)		
Vendute	19	92
Rimborsate	(253)	(1.998)
Decremento netto	(234)	(1.906)
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier CHF (Copertura)		
Rimborsate	(5)	(81)
Decremento netto	(5)	(81)
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in CHF (S) (Copertura)		
Rimborsate	–	(11)
Decremento netto	–	(11)
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)		
Vendute	134	1.114
Rimborsate	(2.327)	(2.581)
Decremento netto	(2.193)	(1.467)
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR		
Vendute	–	11
Rimborsate	(131)	(34)
Decremento netto	(131)	(23)
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (S) (Copertura)		
Vendute	197	1
Rimborsate	(258)	(97)
Decremento netto	(61)	(96)
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)		
Vendute	5	12
Rimborsate	(13)	(482)
Decremento netto	(8)	(470)
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura) Plus (e)		
Vendute	4	7
Rimborsate	(20)	(1.018)
Decremento netto	(16)	(1.011)
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier JPY (Copertura)		
Vendute	–	99
Rimborsate	(15)	(156)
Decremento netto	(15)	(57)
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in JPY (S) (Copertura)		
Rimborsate	–	(100)
Decremento netto	–	(100)
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier PLN (coperte)		
Vendute	–	16
Rimborsate	(3)	(31)
Decremento netto	(3)	(15)
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier SEK (Copertura)		
Rimborsate	–	(1)
Decremento netto	–	(1)
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD		
Vendute	8	–
Rimborsate	–	(26)
Incremento netto(decremento)	8	(26)

	Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)		
Vendute	4	–
Rimborsate	(1.209)	(9)
Decremento netto	(1.205)	(9)
Azioni a Distribuzione di Classe LM in AUD (S) (Copertura)		
Vendute	13	31
Rimborsate	(108)	(565)
Decremento netto	(95)	(534)
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR		
Vendute	–	1
Rimborsate	(3)	(1)
Decremento netto	(3)	–
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)		
Vendute	–	19
Rimborsate	–	(15)
Incremento netto	–	4
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura) Plus (e)		
Rimborsate	(2)	(3)
Decremento netto	(2)	(3)
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD		
Vendute	–	1
Rimborsate	(1)	(1)
Decremento netto	(1)	–
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)		
Vendute	9	35
Rimborsate	(8)	(28)
Incremento netto	1	7
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP (Copertura)		
Vendute	27	21
Rimborsate	(16)	(10)
Incremento netto	11	11
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in AUD (Copertura)		
Rimborsate	–	(1.230)
Decremento netto	–	(1.230)
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR (Copertura)		
Vendute	164	21
Rimborsate	(79)	(14)
Incremento netto	85	7
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in GBP (Copertura)		
Vendute	20	43
Rimborsate	(103)	(22)
(Decremento) netto/incremento	(83)	21
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in CAD (Copertura)		
Vendute	–	264
Rimborsate	(30)	(4)
(Decremento)/incremento netto	(30)	260
Azioni a Distribuzione di Classe S in CHF (A) (Copertura)		
Vendute	–	20
Incremento netto	–	20
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe D in USD		
Rimborsate	(98)	(7)
Decremento netto	(98)	(7)
Azioni a Distribuzione di Classe D in USD (M)		
Rimborsate	(5)	–
Decremento netto	(5)	–
Azioni ad Accumulazione di Classe M in CHF (Copertura)		
Rimborsate	–	(10)
Decremento netto	–	(10)
Azioni a Distribuzione di Classe M in USD (M)		
Vendute	1	–
Incremento netto	1	–
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD		
Vendute	1	62
Rimborsate	(11)	(1.316)
Decremento netto	(10)	(1.254)
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (Q)		
Rimborsate	(10)	–
Decremento netto	(10)	–

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al		Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^] – (segue)				
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Vendute	1	5		
Rimborsate	(3)	(1.030)		
Decremento netto	(2)	(1.025)		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (Q) (Copertura)				
Vendute	–	3		
Rimborsate	(5)	(175)		
Decremento netto	(5)	(172)		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura) Plus (e)				
Rimborsate	(1)	(105)		
Decremento netto	(1)	(105)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier JPY (Copertura)				
Rimborsate	(500)	–		
Decremento netto	(500)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD				
Rimborsate	–	(209)		
Decremento netto	–	(209)		
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]				
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	30	420		
Incremento netto	30	420		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Vendute	–	19		
Rimborsate	–	(3)		
Incremento netto	–	16		
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]				
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in GBP				
Rimborsate	–	(637)		
Decremento netto	–	(637)		
Azioni a Distribuzione di Classe LM in GBP (M)				
Vendute	–	695		
Incremento netto	–	695		
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	–	5		
Rimborsate	(6)	(2)		
(Decremento)/incremento netto	(6)	3		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Vendute	–	31		
Rimborsate	–	(3)		
Incremento netto	–	28		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in GBP (Copertura)				
Rimborsate	–	(951)		
Decremento netto	–	(951)		
Azioni a Distribuzione di Classe LM in GBP (M) (Copertura)				
Vendute	–	1.065		
Rimborsate	(352)	–		
(Decremento)/incremento netto	(352)	1.065		
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^]				
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (Q)				
Vendute	9	7		
Rimborsate	(2)	(4)		
Incremento netto	7	3		
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]				
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in BRL (Copertura)				
Rimborsate	(1)	(1)		
Decremento netto	(1)	(1)		
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	8	2		
Rimborsate	(18)	(5)		
Decremento netto	(10)	(3)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)				
Vendute	8	1		
Rimborsate	(7)	(6)		
Incremento netto/(decremento)	1	(5)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (S)				
Vendute	8	12		
Rimborsate	(4)	(11)		
Incremento netto	4	1		
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)				
Rimborsate	(5)	–		
Decremento netto	(5)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura) (IH)				
Vendute	4	1		
Rimborsate	(8)	(24)		
Decremento netto	(4)	(23)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)				
Vendute	–	2		
Rimborsate	(2)	(3)		
Decremento netto	(2)	(1)		
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (A) (Copertura)				
Rimborsate	(2)	(2)		
Decremento netto	(2)	(2)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (S) (Copertura) (IH)				
Vendute	1	1		
Rimborsate	(4)	(3)		
Decremento netto	(3)	(2)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) (Copertura)				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (S) (Copertura)(IH)				
Rimborsate	(2)	(2)		
Decremento netto	(2)	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A SGD				
Vendute	1.831	2		
Rimborsate	(1.827)	–		
Incremento netto	4	2		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Rimborsate	(1)	(1)		
Decremento netto	(1)	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (S)				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD				
Vendute	2	–		
Rimborsate	(1)	–		
Incremento netto	1	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura) (IH)				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	–	1		
Rimborsate	–	(2)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD				
Vendute	–	59		
Rimborsate	–	(4)		
Incremento netto	–	55		
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (S)				
Rimborsate	–	(2)		
Decremento netto	–	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura) (IH)				
Rimborsate	–	(8)		
Decremento netto	–	(8)		
Azioni a distribuzione di Classe X in EUR (S) (Copertura) (IH)				
Rimborsate	–	(4)		
Decremento netto	–	(4)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (coperte) (IH)				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (coperte)				
Vendute	9	12		
Rimborsate	(18)	(34)		
Decremento netto	(9)	(22)		

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al		Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – (segue)				
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP				
Vendute	15	105		
Rimborsate	(36)	(61)		
(Decremento) netto/incremento	(21)	44		
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (S) (Copertura) (IH)				
Vendute	4	3		
Rimborsate	(5)	(8)		
Decremento netto	(1)	(5)		
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (S) (Copertura)				
Vendute	5	9		
Rimborsate	(11)	(22)		
Decremento netto	(6)	(13)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	6	–		
Rimborsate	(8)	(2)		
Decremento netto	(2)	(2)		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (S)				
Rimborsate	(1)	(9)		
Decremento netto	(1)	(9)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura) (IH)				
Vendute	2	1		
Rimborsate	(5)	(51)		
Decremento netto	(3)	(50)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(3)	(4)		
Decremento netto	(3)	(3)		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura)				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (S) (Copertura) (IH)				
Rimborsate	–	(4)		
Decremento netto	–	(4)		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD (Copertura) (IH)				
Vendute	22	103		
Rimborsate	(31)	(18)		
(Decremento)/incremento netto	(9)	85		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD				
Vendute	1	2		
Rimborsate	(2)	(1)		
(Decremento)/incremento netto	(1)	1		
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)				
Rimborsate	–	(2)		
Decremento netto	–	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A SGD				
Vendute	3.319	3.936		
Rimborsate	(3.260)	(3.936)		
Incremento netto	59	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Vendute	5	–		
Incremento netto	5	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Rimborsate	(5)	–		
Decremento netto	(5)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (coperte)				
Rimborsate	–	(4)		
Decremento netto	–	(4)		
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) (Copertura)				
Vendute	–	3		
Rimborsate	(3)	–		
(Decremento)/incremento netto	(3)	3		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	34	63		
Rimborsate	(892)	(38)		
(Decremento)/incremento netto	(858)	25		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)				
Rimborsate		(2)		–
Decremento netto		(2)		–
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Vendute		2		–
Rimborsate		(286)		–
Decremento netto		(284)		–
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (A) (Copertura)				
Vendute		11		7
Incremento netto		11		7
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura)				
Vendute		109		–
Rimborsate		(83)		–
Incremento netto		26		–
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in AUD (Copertura)				
Rimborsate		(1.698)		(1.443)
Decremento netto		(1.698)		(1.443)
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute		4		–
Rimborsate		(1)		–
Incremento netto		3		–
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute		32		–
Incremento netto		32		–
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (A) (Copertura) (IH)				
Vendute		73		–
Incremento netto		73		–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute		24		3
Rimborsate		(9)		(5)
Incremento/(decremento) netto		15		(2)
Azioni ad Accumulazione di Classe A SGD				
Vendute		6.710		3
Rimborsate		(6.672)		(34)
Incremento netto/(decremento)		38		(31)
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Rimborsate		–		(9)
Decremento netto		–		(9)
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Rimborsate		(2)		(2)
Decremento netto		(2)		(2)
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) (Copertura) (IH)				
Rimborsate		(2)		–
Decremento netto		(2)		–
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) (Copertura)				
Rimborsate		(2)		–
Decremento netto		(2)		–
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute		171		5
Rimborsate		(140)		(54)
Incremento netto/(decremento)		31		(49)
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura) (IH)				
Vendute		1		1
Incremento netto		1		1
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier NZD (Copertura) (IH)				
Vendute		–		3
Incremento netto		–		3
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR				
Rimborsate		(19)		(2)
Decremento netto		(19)		(2)
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in NZD (Copertura) (IH)				
Vendute		5		2
Rimborsate		(28)		(6)
Decremento netto		(23)		(4)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute		187		74
Rimborsate		(154)		(274)
Incremento netto/(decremento)		33		(200)

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al		Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (segue)				
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)				
Vendute	1	5		
Rimborsate	(5)	(7)		
Decremento netto	(4)	(2)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)				
Vendute	19	7		
Rimborsate	(20)	(112)		
Decremento netto	(1)	(105)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)				
Vendute	57	54		
Rimborsate	(186)	(354)		
Decremento netto	(129)	(300)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus				
Vendute	7	11		
Rimborsate	(59)	(211)		
Decremento netto	(52)	(200)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in AUD (coperte)				
Rimborsate	–	(2)		
Decremento netto	–	(2)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)				
Vendute	27	–		
Rimborsate	(6)	(14)		
Incremento/(decremento) netto	21	(14)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura)				
Vendute	56	3		
Rimborsate	–	(11)		
Incremento netto/(decremento)	56	(8)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)				
Vendute	139	75		
Rimborsate	(40)	(157)		
Incremento netto/(decremento)	99	(82)		
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (A) (Copertura)				
Vendute	23	32		
Rimborsate	(24)	(15)		
(Decremento)/incremento netto	(1)	17		
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) (Copertura) Plus (e)				
Vendute	28	44		
Rimborsate	(49)	(31)		
(Decremento) netto/incremento	(21)	13		
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) (Copertura) Plus				
Vendute	1	1		
Rimborsate	–	(4)		
Incremento netto/(decremento)	1	(3)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) (Copertura) Plus (e)				
Vendute	7	1		
Rimborsate	(9)	(8)		
Decremento netto	(2)	(7)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) Plus (Copertura)				
Vendute	2	5		
Rimborsate	(1)	(6)		
Incremento netto/(decremento)	1	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in HKD				
Vendute	9	1		
Rimborsate	(6)	(14)		
Incremento/(decremento) netto	3	(13)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus				
Vendute	48	15		
Rimborsate	(44)	(478)		
Incremento netto/(decremento)	4	(463)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) (Copertura) Plus (e)				
Vendute	5.024	45.934		
Rimborsate	(5.277)	(7.819)		
(Decremento) netto/incremento	(253)	38.115		
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)				
Vendute	1.350	2.040		
Rimborsate	(1.746)	(5.580)		
Decremento netto	(396)	(3.540)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus				
Vendute	32	140		
Rimborsate	(1.520)	(1.092)		
Decremento netto	(1.488)	(952)		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Vendute	48	3		
Rimborsate	(47)	(130)		
Incremento netto/(decremento)	1	(127)		
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)				
Vendute		101		
Rimborsate	(2)	(2)		
Incremento netto	1	99		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CZK (coperte)				
Vendute	–	1		
Incremento netto	–	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD				
Vendute	54	10		
Rimborsate	(15)	(21)		
Incremento/(decremento) netto	39	(11)		
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)				
Vendute	2	–		
Rimborsate	(1)	(2)		
Incremento/(decremento) netto	1	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)				
Vendute	7	4		
Rimborsate	(2)	(7)		
Incremento/(decremento) netto	5	(3)		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	18	30		
Rimborsate	(21)	(168)		
Decremento netto	(3)	(138)		
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)				
Vendute	4	4		
Rimborsate	(5)	(14)		
Decremento netto	(1)	(10)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD				
Vendute	12	3		
Rimborsate	(58)	(12)		
Decremento netto	(46)	(9)		
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (D)				
Rimborsate	(2)	(1)		
Decremento netto	(2)	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (M) Plus (e)				
Vendute	–	10		
Rimborsate	(16)	(52)		
Decremento netto	(16)	(42)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in CHF (coperte)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(1)	(6)		
Decremento netto	(1)	(5)		
Azioni a distribuzione di Classe X in CHF (A) (Copertura)				
Rimborsate	(5)	(20)		
Decremento netto	(5)	(20)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)				
Vendute	5	29		
Rimborsate	(77)	(199)		
Decremento netto	(72)	(170)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR				
Vendute	1	–		
Incremento netto	1	–		
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (M) (Copertura) Plus (e)				
Vendute	4	4		
Rimborsate	(47)	(19)		
Decremento netto	(43)	(15)		
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) (Copertura) Plus (e)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(11)	(11)		
Decremento netto	(11)	(10)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	295	70		
Rimborsate	(104)	(336)		
Incremento netto/(decremento)	191	(266)		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (M) Plus (e)				
Vendute	6	4		
Rimborsate	–	(57)		
Incremento/(decremento) netto	6	(53)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (Copertura)				
Vendute	–	4		
Rimborsate	(5)	–		
(Decremento)/incremento netto	(5)	4		

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al		Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (segue)				
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Vendute	108	142		
Rimborsate	(143)	(341)		
Decremento netto	(35)	(199)		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (M) (Copertura) Plus (e)				
Vendute	31	76		
Rimborsate	(107)	(132)		
Decremento netto	(76)	(56)		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura) Plus (e)				
Vendute	5	–		
Rimborsate	(58)	(14)		
Decremento netto	(53)	(14)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier SEK (Copertura)				
Vendute	53	1		
Rimborsate	(15)	(38)		
Incremento netto/(decremento)	38	(37)		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD				
Vendute	–	193		
Rimborsate	(104)	(1.031)		
Decremento netto	(104)	(838)		
Azioni a Distribuzione di Classe S in USD (Q) Plus (e)				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)				
Vendute	30	158		
Rimborsate	(64)	(235)		
Decremento netto	(34)	(77)		
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (M) (Copertura) Plus (e)				
Vendute	–	5		
Rimborsate	(8)	(2)		
(Decremento)/incremento netto	(8)	3		
Azioni a Distribuzione di Classe S in GBP (M) (Copertura) Plus (e)				
Vendute	–	2		
Rimborsate	(1)	(12)		
Decremento netto	(1)	(10)		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD				
Vendute	34	100		
Incremento netto	34	100		
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (M)				
Vendute	2	8		
Rimborsate	(12)	(8)		
Decremento netto	(10)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe LM in EUR (Q) (Copertura) Plus (e)				
Vendute	104	910		
Rimborsate	(281)	(6)		
(Decremento)/incremento netto	(177)	904		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in GBP (Copertura)				
Vendute	10	25		
Rimborsate	(29)	(106)		
Decremento netto	(19)	(81)		
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Rimborsate	(105)	–		
Decremento netto	(105)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	20	12		
Rimborsate	(25)	(13)		
Decremento netto	(5)	(1)		
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^				
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (A) (Copertura) (IH)				
Rimborsate	(100)	–		
Decremento netto	(100)	–		
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	–	1		
Incremento netto	–	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (coperte)				
Vendute	–	104		
Rimborsate	–	(5.710)		
Decremento netto	–	(5.606)		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in AUD (Copertura)				
Rimborsate	–	(237)		
Decremento netto	–	(237)		
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Rimborsate	(3)	–		
Decremento netto	(3)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Rimborsate	(3)	–		
Decremento netto	(3)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)				
Rimborsate	(7)	–		
Decremento netto	(7)	–		
FTGF ClearBridge Value Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	49	141		
Rimborsate	(125)	(102)		
(Decremento) netto/incremento	(76)	39		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)				
Vendute	9	9		
Rimborsate	(18)	(8)		
(Decremento)/incremento netto	(9)	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)				
Vendute	2	29		
Rimborsate	(23)	(29)		
Decremento netto	(21)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR				
Vendute	36	28		
Rimborsate	(26)	(23)		
Incremento netto	10	5		
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A) (Copertura)				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (coperte)				
Vendute	169	124		
Rimborsate	(344)	(525)		
Decremento netto	(175)	(401)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A SGD				
Vendute	845	581		
Rimborsate	(281)	(488)		
Incremento netto	564	93		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Vendute	2	22		
Rimborsate	(19)	(3)		
(Decremento)/incremento netto	(17)	19		
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)				
Vendute	–	2		
Incremento netto	–	2		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD				
Vendute	1	14		
Rimborsate	(11)	–		
(Decremento)/incremento netto	(10)	14		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	7	26		
Rimborsate	(22)	(25)		
(Decremento)/incremento netto	(15)	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD				
Vendute	–	4		
Rimborsate	–	(3)		
Incremento netto	–	1		
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)				
Vendute	19	19		
Rimborsate	–	(75)		
Incremento netto/(decremento)	19	(56)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR				
Vendute	7	72		
Rimborsate	(26)	(46)		
(Decremento) netto/incremento	(19)	26		

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al		Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF ClearBridge Value Fund – (segue)				
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	184	281		
Rimborsate	(177)	(70)		
Incremento netto	7	211		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)				
Vendute	–	10		
Rimborsate	(10)	–		
(Decremento)/incremento netto	(10)	10		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Vendute	651	159		
Rimborsate	(247)	(45)		
Incremento netto	404	114		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR				
Vendute	119	83		
Rimborsate	(276)	(82)		
(Decremento) netto/incremento	(157)	1		
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (A)				
Vendute	2	5		
Rimborsate	(18)	(31)		
Decremento netto	(16)	(26)		
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	7	7		
Rimborsate	(18)	(12)		
Decremento netto	(11)	(5)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(4)	(7)		
Decremento netto	(4)	(6)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR				
Vendute	2	–		
Rimborsate	(1)	–		
Incremento netto	1	–		
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (A)				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(1)	(2)		
Decremento netto	(1)	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)				
Rimborsate	(1)	(2)		
Decremento netto	(1)	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD				
Vendute	1	1		
Rimborsate	(11)	(5)		
Decremento netto	(10)	(4)		
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (A)				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	4	7		
Rimborsate	(24)	(14)		
Decremento netto	(20)	(7)		
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)				
Vendute	1	1		
Rimborsate	(2)	–		
(Decremento)/incremento netto	(1)	1		
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)				
Rimborsate	(2)	–		
Decremento netto	(2)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	5	–		
Rimborsate	(6)	(21)		
Decremento netto	(1)	(21)		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)				
Rimborsate	(1)	(3)		
Decremento netto	(1)	(3)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR				
Vendute	18	18		
Rimborsate	(13)	(2)		
Incremento netto	5	16		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD				
Vendute	–	6		
Rimborsate	(15)	–		
(Decremento)/incremento netto	(15)	6		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR				
Rimborsate	(4)	–		
Decremento netto	(4)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	55	54		
Rimborsate	(83)	(75)		
Decremento netto	(28)	(21)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)				
Vendute	4	7		
Rimborsate	(5)	(7)		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)				
Vendute	14	17		
Rimborsate	(9)	(18)		
Incremento/(decremento) netto	5	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR				
Vendute	9	11		
Rimborsate	(11)	(36)		
Decremento netto	(2)	(25)		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Vendute	–	2		
Rimborsate	(7)	(4)		
Decremento netto	(7)	(2)		
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)				
Rimborsate	(2)	(1)		
Decremento netto	(2)	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD				
Vendute	3	4		
Rimborsate	(6)	(7)		
Decremento netto	(3)	(3)		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	48	101		
Rimborsate	(140)	(121)		
Decremento netto	(92)	(20)		
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)				
Vendute	15	2		
Rimborsate	(14)	(32)		
Incremento netto/(decremento)	1	(30)		
Azioni ad Accumulazione di Classe U in USD				
Vendute	174	291		
Rimborsate	(340)	(413)		
Decremento netto	(166)	(122)		
Azioni ad Accumulazione di Classe U in EUR				
Vendute	289	19		
Rimborsate	(9)	(137)		
Incremento netto/(decremento)	280	(118)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD				
Vendute	18	19		
Rimborsate	(30)	(32)		
Decremento netto	(12)	(13)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)				
Vendute	6	1		
Rimborsate	(4)	(12)		
Incremento/(decremento) netto	2	(11)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR				
Vendute	7	1		
Rimborsate	(2)	(1)		
Incremento netto	5	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP				
Vendute	18	8		
Rimborsate	(10)	(7)		
Incremento netto	8	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	416	250		
Rimborsate	(237)	(607)		
Incremento netto/(decremento)	179	(357)		

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al		Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund – (segue)				
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)				
Vendute	1	11		
Rimborsate	(9)	(5)		
(Decremento)/incremento netto	(8)	6		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (coperte)				
Rimborsate	(228)	(492)		
Decremento netto	(228)	(492)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Vendute	263	14		
Rimborsate	(107)	(34)		
Incremento netto/(decremento)	156	(20)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR				
Vendute	14	11		
Rimborsate	(36)	(99)		
Decremento netto	(22)	(88)		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (A)				
Vendute	1	4		
Rimborsate	(2)	–		
(Decremento)/incremento netto	(1)	4		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP				
Vendute	88	27		
Rimborsate	(52)	(68)		
Incremento netto/(decremento)	36	(41)		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD				
Vendute	31	89		
Rimborsate	(193)	(38)		
(Decremento)/incremento netto	(162)	51		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD				
Rimborsate	(1)	(1)		
Decremento netto	(1)	(1)		
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	7	7		
Rimborsate	(44)	(32)		
Decremento netto	(37)	(25)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(9)	(4)		
Decremento netto	(9)	(3)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in AUD (coperte)				
Vendute	3	2		
Rimborsate	(11)	(3)		
Decremento netto	(8)	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CNH (coperte)				
Vendute	54	2		
Rimborsate	(71)	–		
(Decremento)/incremento netto	(17)	2		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR				
Vendute	1	1		
Rimborsate	(2)	(1)		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe A HKD				
Rimborsate	(4)	(2)		
Decremento netto	(4)	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (coperte)				
Vendute	3	1		
Rimborsate	(3)	(1)		
Incremento netto	–	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (coperte)				
Vendute	2.871	54		
Rimborsate	(73)	(352)		
Incremento netto/(decremento)	2.798	(298)		
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (A)				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Rimborsate	–	(3)		
Decremento netto	–	(3)		
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)				
Rimborsate	(4)	(8)		
Decremento netto	(4)	(8)		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD				
Rimborsate	(6)	(20)		
Decremento netto	(6)	(20)		
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (A)				
Rimborsate	(2)	–		
Decremento netto	(2)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	1	2		
Rimborsate	(5)	(3)		
Decremento netto	(4)	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)				
Rimborsate	(4)	(1)		
Decremento netto	(4)	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD				
Rimborsate	(2)	(2)		
Decremento netto	(2)	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR				
Rimborsate	(3)	(2)		
Decremento netto	(3)	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP				
Vendute	1	1		
Rimborsate	(4)	(12)		
Decremento netto	(3)	(11)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	2	1		
Rimborsate	(6)	(79)		
Decremento netto	(4)	(78)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Vendute	1	–		
Incremento netto	1	–		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (A)				
Vendute	1	2		
Rimborsate	(29)	(27)		
Decremento netto	(28)	(25)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier PLN (coperte)				
Rimborsate	–	(33)		
Decremento netto	–	(33)		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR				
Rimborsate	(2)	–		
Decremento netto	(2)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD				
Rimborsate	(4)	(3)		
Decremento netto	(4)	(3)		
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD				
Rimborsate	(2)	(1)		
Decremento netto	(2)	(1)		
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	3	10		
Rimborsate	(18)	(2)		
(Decremento)/incremento netto	(15)	8		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus				
Vendute	2	8		
Rimborsate	(5)	(2)		
(Decremento)/incremento netto	(3)	6		
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)				
Vendute	–	2		
Rimborsate	(3)	(1)		
(Decremento)/incremento netto	(3)	1		
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura)				
Rimborsate	(1)	(3)		
Decremento netto	(1)	(3)		

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al		Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – (segue)				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) (Plus) (Copertura) (e)				
Rimborsate	(4)	–		
Decremento netto	(4)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus				
Vendute	–	3		
Rimborsate	(3)	(24)		
Decremento netto	(3)	(21)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)				
Vendute	306	1.297		
Rimborsate	(955)	(17)		
(Decremento)/incremento netto	(649)	1.280		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Rimborsate	(1)	(1)		
Decremento netto	(1)	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(12)	(6)		
Decremento netto	(12)	(5)		
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	28	58		
Rimborsate	(29)	(28)		
(Decremento)/incremento netto	(1)	30		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)				
Vendute	14	13		
Rimborsate	(11)	(15)		
Incremento netto/(decremento)	3	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)				
Vendute	11	43		
Rimborsate	(23)	(136)		
Decremento netto	(12)	(93)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR				
Vendute	7	–		
Rimborsate	(5)	–		
Incremento netto	2	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK				
Vendute	41	58		
Rimborsate	(222)	(188)		
Decremento netto	(181)	(130)		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(1)	–		
(Decremento)/incremento netto	(1)	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD				
Vendute	3	9		
Rimborsate	(7)	(94)		
Decremento netto	(4)	(85)		
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)				
Vendute	–	2		
Rimborsate	(1)	(3)		
Decremento netto	(1)	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)				
Vendute	15	1		
Rimborsate	(3)	(2)		
Incremento/(decremento) netto	12	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR				
Vendute	52	–		
Rimborsate	(3)	–		
Incremento netto	49	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (coperte)				
Vendute	1	4		
Rimborsate	(10)	(4)		
Decremento netto	(9)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP				
Vendute	415	829		
Rimborsate	(641)	(226)		
(Decremento) netto/incremento	(226)	603		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	69	226		
Rimborsate	(93)	(432)		
Decremento netto	(24)	(206)		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)				
Vendute	–	8		
Rimborsate	(3)	–		
(Decremento)/incremento netto	(3)	8		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Vendute	1	7		
Rimborsate	(6)	(2)		
(Decremento)/incremento netto	(5)	5		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP				
Vendute	55	63		
Rimborsate	(17)	(47)		
Incremento netto	38	16		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD				
Vendute	504	1.096		
Rimborsate	(550)	(876)		
(Decremento) netto/incremento	(46)	220		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)				
Vendute	3	2		
Rimborsate	(2)	(42)		
Incremento/(decremento) netto	1	(40)		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR				
Vendute	86	–		
Rimborsate	(3)	–		
Incremento netto	83	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP (Copertura)				
Vendute	21	33		
Rimborsate	(63)	(16)		
(Decremento)/incremento netto	(42)	17		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP				
Vendute	86	172		
Rimborsate	(376)	(185)		
Decremento netto	(290)	(13)		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (Q)				
Vendute	13	14		
Rimborsate	(8)	(10)		
Incremento netto	5	4		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR				
Vendute	24	84		
Rimborsate	(15)	(2)		
Incremento netto	9	82		
FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]				
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	7	1		
Rimborsate	(5)	(12)		
Incremento/(decremento) netto	2	(11)		
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD (Copertura)				
Vendute	700	6.788		
Rimborsate	(1.416)	(4.737)		
(Decremento) netto/incremento	(716)	2.051		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	120	1.108		
Rimborsate	(1.103)	(1.859)		
Decremento netto	(983)	(751)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (Copertura)				
Vendute	697	2.195		
Rimborsate	(881)	(2.706)		
Decremento netto	(184)	(511)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (Q)				
Vendute	19	61		
Rimborsate	(20)	(73)		
Decremento netto	(1)	(12)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)				
Vendute	117	314		
Rimborsate	(60)	(751)		
Incremento netto/(decremento)	57	(437)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura)				
Vendute	9.697	5.708		
Rimborsate	(2.180)	(4.011)		
Incremento netto	7.517	1.697		

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – (segue)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura) (PH)		
Vendute	14	317
Rimborsate	(172)	(63)
(Decremento) netto/incremento	(158)	254
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR		
Vendute	1.997	4.336
Rimborsate	(2.922)	(1.104)
(Decremento) netto/incremento	(925)	3.232
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A)		
Vendute	13	10
Rimborsate	(9)	–
Incremento netto	4	10
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) Plus		
Vendute	84	163
Rimborsate	(62)	(99)
Incremento netto	22	64
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)		
Vendute	2.180	5.156
Rimborsate	(1.575)	(3.078)
Incremento netto	605	2.078
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD (Copertura)		
Vendute	13	40
Rimborsate	(13)	–
Incremento netto	–	40
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD		
Vendute	100	34
Rimborsate	(142)	(31)
(Decremento) netto/incremento	(42)	3
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD (Copertura)		
Vendute	6	143
Rimborsate	(96)	(44)
(Decremento) netto/incremento	(90)	99
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD		
Vendute	7	95
Rimborsate	(104)	(61)
(Decremento) netto/incremento	(97)	34
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD (Copertura)		
Vendute	19	252
Rimborsate	(216)	(27)
(Decremento) netto/incremento	(197)	225
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD		
Vendute	135	393
Rimborsate	(107)	(125)
Incremento netto	28	268
Azioni ad Accumulazione di Classe U in EUR		
Vendute	4.208	–
Rimborsate	(257)	–
Incremento netto	3.951	–
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD		
Vendute	9	93
Rimborsate	(37)	–
(Decremento) netto/incremento	(28)	93
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)		
Vendute	–	5
Incremento netto	–	5
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura) (PH)		
Vendute	215	554
Rimborsate	(595)	(131)
(Decremento) netto/incremento	(380)	423
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR		
Vendute	446	1.347
Rimborsate	(1.599)	(682)
(Decremento) netto/incremento	(1.153)	665
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (Q) (coperte)		
Vendute	–	32
Rimborsate	(34)	(32)
Decremento netto	(34)	–
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (Q)		
Vendute	33	36
Rimborsate	(63)	(15)
(Decremento) netto/incremento	(30)	21
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD		
Vendute	584	4.001
Rimborsate	(1.755)	(1.401)
(Decremento) netto/incremento	(1.171)	2.600

	Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (coperte)		
Vendute	–	320
Rimborsate	(341)	(114)
(Decremento) netto/incremento	(341)	206
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in CAD (Q) (Copertura) (PH) Plus (e)		
Vendute	80	68
Incremento netto	80	68
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in CAD (Q) Plus (e)		
Vendute	–	7
Rimborsate	–	(108)
Decremento netto	–	(101)
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura) (PH)		
Vendute	638	16
Rimborsate	(11)	(2)
Incremento netto	627	14
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR		
Vendute	1.833	7.891
Rimborsate	(7.177)	(1.262)
(Decremento) netto/incremento	(5.344)	6.629
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP		
Vendute	1	10
Rimborsate	(3)	(77)
Decremento netto	(2)	(67)
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (A) (Copertura) (PH) Plus (e)		
Vendute	1	351
Rimborsate	(423)	(8)
(Decremento) netto/incremento	(422)	343
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (Q)		
Vendute	687	1.204
Rimborsate	(915)	(1.373)
Decremento netto	(228)	(169)
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD		
Vendute	5	124
Rimborsate	(54)	(33)
(Decremento) netto/incremento	(49)	91
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)		
Vendute	4	172
Rimborsate	(65)	(152)
(Decremento) netto/incremento	(61)	20
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus		
Vendute	27	407
Rimborsate	(80)	(53)
(Decremento) netto/incremento	(53)	354
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)		
Vendute	4	58
Rimborsate	(14)	–
(Decremento) netto/incremento	(10)	58
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura)		
Vendute	42	46
Rimborsate	(9)	(8)
Incremento netto	33	38
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) (Copertura) Plus		
Vendute	6	42
Rimborsate	(15)	(4)
(Decremento) netto/incremento	(9)	38
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) Plus (Copertura)		
Vendute	3	29
Rimborsate	(3)	–
Incremento netto	–	29
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus		
Vendute	–	62
Incremento netto	–	62
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)		
Vendute	4.630	60.001
Rimborsate	(10.245)	(6.637)
(Decremento) netto/incremento	(5.615)	53.364
Azioni ad Accumulazione di Classe U in USD		
Vendute	95	–
Rimborsate	(23)	–
Incremento netto	72	–
Azioni ad Accumulazione di Classe U in EUR		
Vendute	4	–
Rimborsate	(64)	–
Decremento netto	(60)	–

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al		Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (segue)				
Azioni ad Accumulazione di Classe U in GBP				
Vendute	3	–		
Rimborsate	(2)	–		
Incremento netto	1	–		
Azioni a Distribuzione di Classe U in GBP (Q) (Copertura Plus (e))				
Vendute	2	–		
Incremento netto	2	–		
Azioni a Distribuzione di Classe U in GBP (Q) Plus (e)				
Vendute	5	–		
Incremento netto	5	–		
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (M) Plus (e)				
Vendute	2	402		
Rimborsate	(115)	(5)		
(Decremento)/incremento netto	(113)	397		
Azioni a distribuzione di Classe X in EUR (M) (Copertura)				
Vendute	–	2		
Incremento netto	–	2		
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (Q) (Copertura Plus (e))				
Vendute	1	7		
Rimborsate	(11)	(2)		
(Decremento)/incremento netto	(10)	5		
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (Q) (Coperte) Plus (e)				
Vendute	–	4		
Rimborsate	(5)	(1)		
(Decremento)/incremento netto	(5)	3		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	2	97		
Rimborsate	(2)	(56)		
Incremento netto	–	41		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (M) Plus				
Vendute	70	773		
Rimborsate	(58)	(39)		
Incremento netto	12	734		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (M) (Copertura)				
Vendute	28	11		
Rimborsate	(13)	–		
Incremento netto	15	11		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD				
Vendute	39	210		
Rimborsate	(19)	(19)		
Incremento netto	20	191		
Azioni a Distribuzione di Classe S in USD (M) Plus				
Vendute	3	89		
Rimborsate	(13)	(3)		
(Decremento)/incremento netto	(10)	86		
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	62	46		
Rimborsate	(79)	(132)		
Decremento netto	(17)	(86)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)				
Vendute	1	2		
Rimborsate	(4)	(6)		
Decremento netto	(3)	(4)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in AUD (coperte)				
Vendute	9	8		
Rimborsate	(14)	(13)		
Decremento netto	(5)	(5)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CNH (coperte)				
Vendute	93	9		
Rimborsate	(69)	(4)		
Incremento netto	24	5		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)				
Vendute	13	5		
Rimborsate	(41)	(30)		
Decremento netto	(28)	(25)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR				
Vendute	23	24		
Rimborsate	(26)	(38)		
Decremento netto	(3)	(14)		
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (A) (Copertura)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	–	(1)		
Incremento netto	–	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in GBP (coperte)				
Rimborsate	(1)	(2)		
Decremento netto	(1)	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (coperte)				
Vendute	2	11		
Rimborsate	(2)	(8)		
Incremento netto	–	3		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (coperte)				
Vendute	3.299	2.460		
Rimborsate	(2.222)	(1.907)		
Incremento netto	1.077	553		
Azioni ad Accumulazione di Classe A SGD				
Vendute	561	388		
Rimborsate	(3.780)	(423)		
Decremento netto	(3.219)	(35)		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Vendute	5	2		
Rimborsate	(11)	(3)		
Decremento netto	(6)	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD				
Vendute	3	5		
Rimborsate	(10)	(5)		
Decremento netto	(7)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)				
Vendute	7	1		
Rimborsate	(1)	(1)		
Incremento netto	6	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR				
Vendute	3	1		
Rimborsate	–	(1)		
Incremento netto	3	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(12)	(18)		
Decremento netto	(12)	(17)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD				
Vendute	31	40		
Rimborsate	(60)	(78)		
Decremento netto	(29)	(38)		
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)				
Vendute	5	28		
Rimborsate	(23)	(95)		
Decremento netto	(18)	(67)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR				
Vendute	6	7		
Rimborsate	(9)	(28)		
Decremento netto	(3)	(21)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP				
Vendute	9	12		
Rimborsate	(14)	(21)		
Decremento netto	(5)	(9)		
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (A)				
Vendute	–	2		
Rimborsate	(1)	(2)		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	169	41		
Rimborsate	(218)	(168)		
Decremento netto	(49)	(127)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (Copertura)				
Rimborsate	(48)	(201)		
Decremento netto	(48)	(201)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)				
Vendute	7	13		
Rimborsate	(17)	(1)		
(Decremento)/incremento netto	(10)	12		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR				
Vendute	15	50		
Rimborsate	(21)	(82)		
Decremento netto	(6)	(32)		

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al		Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund – (segue)				
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP				
Vendute	4	9		
Rimborsate	(34)	(35)		
Decremento netto	(30)	(26)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier PLN (coperte)				
Vendute	42	–		
Rimborsate	(4)	(48)		
Incremento/(decremento) netto	38	(48)		
FTGF Royce US Smaller Companies Fund				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	26	8		
Rimborsate	(15)	(18)		
Incremento/(decremento) netto	11	(10)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)				
Vendute	1	1		
Rimborsate	(3)	(4)		
Decremento netto	(2)	(3)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR				
Vendute	1	–		
Rimborsate	(3)	(1)		
Decremento netto	(2)	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (coperte)				
Vendute	1	5		
Rimborsate	(1)	(5)		
Incremento netto	–	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	10	5		
Rimborsate	(4)	(4)		
Incremento netto	6	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe R in USD				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	28	–		
Rimborsate	–	(1)		
Incremento netto/(decremento)	28	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)				
Vendute	2	3		
Rimborsate	(4)	(8)		
Decremento netto	(2)	(5)		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR				
Rimborsate	(2)	(1)		
Decremento netto	(2)	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD				
Rimborsate	–	(1)		
Decremento netto	–	(1)		
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^Δ				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Rimborsate	(12)	(1)		
Decremento netto	(12)	(1)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(13)	(1)		
Decremento netto	(13)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus				
Vendute	–	3		
Rimborsate	(38)	(5)		
Decremento netto	(38)	(2)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)				
Vendute	–	14		
Rimborsate	(45)	(2)		
(Decremento)/incremento netto	(45)	12		
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura)				
Rimborsate	(16)	–		
Decremento netto	(16)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(1)	(1)		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus				
Rimborsate	(139)	(10)		
Decremento netto	(139)	(10)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)				
Vendute	–	11		
Rimborsate	(48)	–		
(Decremento)/incremento netto	(48)	11		
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)				
Rimborsate	(6)	–		
Decremento netto	(6)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Rimborsate	(2)	–		
Decremento netto	(2)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier PLN (coperte)				
Rimborsate	(1)	(66)		
Decremento netto	(1)	(66)		
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in USD				
Rimborsate	(45)	(1)		
Decremento netto	(45)	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in EUR				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe GE in USD				
Rimborsate	(4)	–		
Decremento netto	(4)	–		
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^{Δβ}				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe M in GBP (A)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(85)	(12)		
Decremento netto	(85)	(11)		
Azioni a Distribuzione di Classe M in USD (A)				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(26)	–		
(Decremento)/incremento netto	(26)	1		
Azioni a Distribuzione di Classe M in EUR (A)				
Rimborsate	(4)	–		
Decremento netto	(4)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Rimborsate	(15)	–		
Decremento netto	(15)	–		
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^Δ				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	1	1		
Rimborsate	(1)	(4)		
Decremento netto	–	(3)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)				
Vendute	1	–		
Rimborsate	–	(48)		
Incremento/(decremento) netto	1	(48)		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR				
Vendute	1	24		
Rimborsate	(10)	(5)		
(Decremento)/incremento netto	(9)	19		

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al		Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^] – (segue)				
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD				
Rimborsate	(4)	(8)		
Decremento netto	(4)	(8)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR				
Vendute	–	1		
Incremento netto	–	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (coperte)				
Rimborsate	(2)	(2)		
Decremento netto	(2)	(2)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	3	27		
Rimborsate	(12)	(62)		
Decremento netto	(9)	(35)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)				
Rimborsate	(2)	–		
Decremento netto	(2)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD				
Rimborsate	(63)	(8)		
Decremento netto	(63)	(8)		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)				
Vendute	136	520		
Rimborsate	(58)	(107)		
Incremento netto	78	413		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP				
Vendute	3	3		
Rimborsate	(1)	–		
Incremento netto	2	3		
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund				
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)				
Vendute	2	1		
Rimborsate	(15)	–		
(Decremento)/incremento netto	(13)	1		
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus				
Vendute	14	44		
Rimborsate	(7)	(49)		
Incremento netto/(decremento)	7	(5)		
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) (Copertura) Plus				
Rimborsate	(6)	–		
Decremento netto	(6)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) (Copertura) Plus				
Rimborsate	(89)	(807)		
Decremento netto	(89)	(807)		
Azioni a Distribuzione di Classe D in USD (M) Plus				
Vendute	–	2		
Rimborsate	(9)	–		
(Decremento)/incremento netto	(9)	2		
Azioni ad Accumulazione di Classe D in USD				
Rimborsate	(11)	–		
Decremento netto	(11)	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in AUD				
Rimborsate	(1)	(1)		
Decremento netto	(1)	(1)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD				
Vendute	–	2		
Rimborsate	–	(1)		
Incremento netto	–	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in AUD				
Rimborsate	–	(4)		
Decremento netto	–	(4)		
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(8)	(26)		
Decremento netto	(8)	(25)		
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD				
Vendute	–	1		
Incremento netto	–	1		
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD				
Vendute	12	67		
Rimborsate	(23)	(32)		
(Decremento) netto/incremento	(11)	35		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD				
Rimborsate	–	(6)		
Decremento netto	–	(6)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD				
Vendute	–	25		
Rimborsate	(3)	(38)		
Decremento netto	(3)	(13)		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD				
Vendute	1	1		
Rimborsate	(1)	(10)		
Decremento netto	–	(9)		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR				
Vendute	–	1		
Rimborsate	–	(45)		
Decremento netto	–	(44)		
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR				
Vendute	1	4		
Rimborsate	(2)	(26)		
Decremento netto	(1)	(22)		
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR				
Vendute	–	1		
Rimborsate	(1)	(6)		
Decremento netto	(1)	(5)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (Copertura)				
Vendute	12	–		
Rimborsate	(53)	(54)		
Decremento netto	(41)	(54)		
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR				
Vendute	1	7		
Rimborsate	(1)	(168)		
Decremento netto	–	(161)		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD				
Vendute	–	5		
Incremento netto	–	5		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR				
Vendute	31	95		
Rimborsate	(40)	(445)		
Decremento netto	(9)	(350)		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP				
Vendute	61	91		
Rimborsate	(63)	(13)		
(Decremento)/incremento netto	(2)	78		
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^{^y}				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD				
Vendute	1	–		
Incremento netto	1	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD				
Vendute	47	–		
Incremento netto	47	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)				
Vendute	1	–		
Incremento netto	1	–		
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP (Copertura)				
Vendute	1	–		
Incremento netto	1	–		
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]				
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR				
Vendute	113	–		
Rimborsate	(3)	–		
Incremento netto	110	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A) Plus				
Rimborsate	(1)	–		
Decremento netto	(1)	–		
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A)				
Vendute	399	–		
Rimborsate	(4)	–		
Incremento netto	395	–		

La nota integrativa costituisce parte integrante del Bilancio

Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili – (segue)

	Per il periodo chiuso al	
	31 agosto 2023 Azioni (in migliaia)	31 agosto 2022 Azioni (in migliaia)
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] – (segue)		
Azioni ad Accumulazione di Classe D in EUR		
Vendute	13	–
Rimborsate	(1)	–
Incremento netto	12	–
Azioni a Distribuzione di Classe D in EUR		
Vendute	2	–
Rimborsate	(1)	–
Incremento netto	1	–
Azioni ad Accumulazione di Classe K in EUR		
Rimborsate	(1)	–
Decremento netto	(1)	–
Azioni a Distribuzione di Classe K in EUR (A)		
Rimborsate	(1)	–
Decremento netto	(1)	–
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR		
Vendute	5	–
Rimborsate	(97)	–
Decremento netto	(92)	–
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (A)		
Vendute	192	–
Rimborsate	(114)	–
Incremento netto	78	–

– Gli importi indicati con “–” sono pari a 0 o inferiori a 1.000. Sono mostrate soltanto le classi che hanno perfezionato operazioni nel corso dell’esercizio.

^α A far data dal 24 marzo 2023, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] e FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] hanno cessato le negoziazioni.

^β A far data dal 20 aprile 2023, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] ha cessato le negoziazioni.

^γ A far data dal 20 giugno 2023, è stato lanciato il fondo FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^].

^δ A far data dal 17 luglio 2023, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^] ha cessato le negoziazioni.

[^] Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio

1. Politiche contabili principali

I principali criteri contabili e le tecniche di valutazione applicati nella preparazione del presente bilancio sono coerenti con quelli adottati dalla Società nel bilancio annuale chiuso al 28 febbraio 2023.

Dichiarazione di conformità

Il bilancio per il periodo finanziario chiuso il 31 agosto 2023 è stato redatto in conformità al Financial Reporting Standard ("FRS") 104: "Bilanci intermedi", i Regolamenti delle Comunità Europea (Organismi di Investimento Collettivo in Valori Mobiliari) del 2011 (e successive modifiche) (i "Regolamenti OICVM") e i Regolamenti della Banca Centrale (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Sezione 48(1)) (Organismi di Investimento Collettivo in Valori Mobiliari) del 2019 (i "Regolamenti OICVM della Banca Centrale"). Il bilancio sintetico deve essere letto congiuntamente al bilancio sottoposto a revisione per l'esercizio chiuso al 28 febbraio 2023, che è stato redatto in conformità con l'FRS 102: "Il Financial Reporting Standard applicabile nel Regno Unito e nella Repubblica d'Irlanda".

Base di redazione

Il bilancio è stato redatto secondo il principio della continuità aziendale ai sensi del criterio del costo storico modificato con la rivalutazione delle attività e passività finanziarie detenute a valore equo rilevato a conto economico. I bilanci di Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund[^], Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^], Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund[^], Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund[^], FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^], Legg Mason Brandywine Global - US High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Growth Fund[^], Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^], Legg Mason US Equity Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason BatteryMarch International Large Cap Fund[^], Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^], Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Japan Equity Fund[^], Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund[^], Legg Mason Martin Currie Greater China Fund[^] and FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] sono stati redatti sulla base del principio di continuità aziendale in quanto tali Comparti sono stati chiusi durante l'attuale e i precedenti periodi finanziari.

Il formato e determinate locuzioni del bilancio sono stati adattati da quelli riportati nel Companies Act del 2014 in modo da riflettere in maniera più appropriata, a giudizio degli Amministratori, la natura dell'attività della Società quale fondo d'investimento.

La Società si è avvalsa dell'esenzione - consentita ai fondi d'investimento di tipo aperto ai sensi della Sezione 7 "Statement of Cash Flows" (Rendiconti finanziari) del principio FRS 102 - dalla stesura di un rendiconto finanziario, in virtù del fatto che sostanzialmente tutti i propri investimenti sono altamente liquidi e rilevati a valore equo e che fornisce un Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile ai detentori di azioni partecipative redimibili.

2. Gestione efficiente del portafoglio

Nel rispetto delle condizioni e dei limiti disposti di volta in volta dalla Banca Centrale d'Irlanda (la "Banca Centrale"), e salvo quanto diversamente stabilito nell'obiettivo e nelle politiche d'investimento di un Comparto, i Gestori degli investimenti delegati possono ricorrere a tecniche e strumenti di investimento come futures, opzioni, contratti di cambio a termine e altri derivati ai fini di una gestione efficiente del portafoglio. Inoltre, tecniche e strumenti nuovi potrebbero essere sviluppati e risultare idonei per l'uso da parte di un Comparto in futuro, e un Comparto potrà impiegare tali tecniche e strumenti con la preventiva approvazione e nel rispetto delle eventuali restrizioni imposte dalla Banca centrale.

Per quanto riguarda gli OICVM che hanno adottato tecniche e strumenti di gestione efficiente del portafoglio, i Regolamenti OICVM della Banca Centrale prevedono alcune informative. Un OICVM è tenuto a rilevare i proventi derivanti da tecniche e strumenti di gestione efficiente del portafoglio per l'intero periodo di riferimento unitamente ai costi operativi diretti e indiretti e agli oneri sostenuti. Si rimanda alla tabella sottostante.

I dettagli degli strumenti finanziari derivati aperti alla fine dell'esercizio sono riportati nel Prospetto degli Investimenti dei Fondi. Tutti i guadagni e le perdite realizzati derivanti dall'uso dei contratti derivati utilizzati per una gestione efficiente del portafoglio sono inclusi nei guadagni/(perdite) netti sulle attività e passività finanziarie al valore equo rilevati in conto economico.

Nel periodo finanziario sono stati perfezionati accordi di riacquisto inverso ai fini di una gestione efficiente del portafoglio. I dettagli di tutti gli accordi di riacquisto inverso alla fine del periodo sono riportati nel Prospetto degli investimenti.

Accordi di riacquisto inverso

Una parte delle attività di ciascun Comparto può essere detenuta in attività liquide accessorie. Ai fini dell'efficiente gestione del portafoglio, ciascun Comparto può concludere accordi di riacquisto e di riacquisto inverso.

La tabella sottostante mostra il reddito conseguito dai contratti di riacquisto inverso durante il periodo finanziario chiuso il 31 agosto 2023:

	31 agosto 2023 (in migliaia)
Nome del Fondo	
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	6.581\$

Non vi sono stati costi di operazione per gli acquisti e le vendite di accordi di riacquisto inverso.

Operazioni di prestito titoli

Alcuni Comparti possono inoltre utilizzare contratti di prestito titoli ai fini dell'efficiente gestione del portafoglio, come sopra descritto. Nell'ambito di tali operazioni il Comparto può temporaneamente trasferire i suoi titoli a un mutuatario, il quale accetta di restituire al Comparto titoli equivalenti in un momento prestabilito. Nel perfezionare tali operazioni, il Comparto cercherà di incrementare i rendimenti sul suo portafoglio titoli ricevendo un compenso per aver messo i suoi titoli a disposizione del mutuatario. Per il periodo finanziario chiuso il 31 agosto 2023 i Comparti non hanno eseguito alcuna operazione di prestito titoli.

3. Spese di gestione e altre Operazioni con parti correlate

Ai sensi del contratto di gestione tra Franklin Templeton International Services S.à r.l (il "Gestore" o "FTIS") e la Società (il "Contratto di Gestione"), il gestore avrà diritto a ricevere una commissione di gestione degli investimenti - a valere sulle attività del Comparto interessato - per i servizi di gestione degli investimenti e di distribuzione, la quale maturerà ogni giorno di negoziazione e sarà pagabile ogni mese in via posticipata (le "Commissioni di gestione degli investimenti"). La Società sarà anche responsabile del tempestivo pagamento o rimborso al Gestore di qualsiasi provvigione, commissione di trasferimento, commissione di registrazione, imposta e simili passività, costi e spese vive adeguatamente pagabili al o sostenute da FTIS.

Di seguito è riportata la Commissione di gestione massima per ciascuna classe di azioni (espressa in percentuale del NAV del Comparto pertinente attribuibile a detta classe) alla fine del periodo finanziario

Nome del Fondo	Commissione di gestione massima	Nome del Fondo	Commissione di gestione massima
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund	
Classe A	0,800%	Classe A	0,800%
Classe B	1,050%	Classe B	1,050%
Classe C	1,300%	Classe C	1,300%
Classe E	1,400%	Classe E	1,400%
Classe X	0,600%	Classe F	0,400%
Classe Premier	0,300%	Classe R	0,550%
Classe LM	Nessuno	Classe T	0,800%
Classe A (G)	0,800%	Classe X	0,300%
Classe L (G)	0,800%	Classe Premier	0,300%
		Classe S	0,200%
		Classe LM	Nessuno
		Classe GA	0,820%
		Classe GE	1,420%

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

3. Spese di gestione e altre Operazioni con parti correlate – (segue)

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

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

3. Spese di gestione e altre Operazioni con parti correlate – (segue)

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

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

3. Spese di gestione e altre Operazioni con parti correlate – (segue)

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

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

3. Spese di gestione e altre Operazioni con parti correlate – (segue)

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

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

3. Spese di gestione e altre Operazioni con parti correlate – (segue)

Nelle tabelle sopra riportate, le Commissioni di gestione indicate per ogni Comparto si applicano a tutte le classi azionarie da esso offerte, le quali sono elencate nella colonna pertinente. Non tutte le classi di azioni vengono offerte da ogni Comparto e non tutte erano in circolazione alla fine del periodo finanziario in corso e precedente. Il Prospetto, di volta in volta modificato o integrato, indica quali classi azionarie vengono offerte da ogni Comparto.

Ai sensi del contratto di gestione degli investimenti, il Gestore sarà responsabile del pagamento delle commissioni e delle spese vive del Gestore degli investimenti pertinente.

Il Gestore ha volontariamente accettato di rinunciare a una parte delle proprie commissioni e/o di rimborsare determinate spese al fine di garantire che le spese totali non superino specifiche limitazioni volontarie di spesa stabilite per i Comparti. Il Gestore può, a sua esclusiva discrezione, rivedere o cessare le rinunce volontarie e/o i rimborsi spese in qualsiasi momento.

Per il periodo finanziario chiuso il 31 agosto 2023, le Commissioni di gestione non applicate, rimborsate e altre spese recuperate sono riportate qui di seguito:

Nome del Fondo	Per il periodo chiuso il 31 agosto 2023 (in migliaia)	
	Commissione di gestione non applicata	Commissione di gestione rimborsata e altre spese recuperate
FTGF Western Asset US High Yield Fund	-\$	1\$
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	-\$	29\$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	14\$	15\$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	15\$	-\$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	16\$	2\$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	-\$	6\$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	27\$	7\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	11\$	-\$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	14\$	-\$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	16\$	2\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	1\$	38\$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	1\$	16\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	1\$	4\$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	16\$	-\$
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	-\$	19\$
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	1€	-€

Gli importi indicati con “-” sono pari a 0\$/0€ o inferiori a 1.000\$/1.000€.

Ai sensi dei singoli Contratti di gestione degli investimenti, ciascun Gestore degli investimenti ha diritto a ricevere una commissione di gestione degli investimenti e sarà responsabile del pagamento di commissioni e spese vive dei Gestori degli investimenti delegati a valere sulla propria Commissione di gestione degli investimenti (che può comprendere le “Commissioni di performance”).

Ai sensi dei termini del Contratto Quadro di Distribuzione tra il Gestore, la Società e Franklin Distributors, LLC (il “Master distributor”), il Master distributor è autorizzato a commercializzare, promuovere, offrire e predisporre la vendita e il rimborso di Azioni della Società (collettivamente “servizi di distribuzione”). Inoltre, il Master distributor è autorizzato a sue spese a incaricare uno o più distributori per assisterla nell’espletamento delle funzioni e responsabilità, a condizione che le nomine di tali altre società siano realizzate in conformità con i requisiti delle regole della Banca Centrale. Ai sensi del Contratto Quadro di Distribuzione tra il Gestore, la Società e il Master distributor, il Master distributor in tali ipotesi rimarrà responsabile nei confronti del Gestore per l’adempimento delle proprie obbligazioni ai sensi di tale contratto. Il Master distributor, in conformità con i requisiti della Banca Centrale, ha nominato Franklin Templeton Investments (Asia) Limited (“FTIA”) e Templeton Asset Management Ltd. come ulteriori Distributori dei Fondi. Il Gestore ha inoltre incaricato se stesso e Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc. di fornire determinati servizi di distribuzione.

La Società sarà anche responsabile del tempestivo pagamento o rimborso al Gestore di qualsiasi provvigione, commissione di trasferimento, commissione di registrazione, imposta e simili passività, costi e spese vive adeguatamente pagabili al o sostenute dal Gestore.

Commissione per i servizi agli azionisti

Ai sensi del Contratto di Gestione tra la Società e il Gestore, quest’ultimo avrà diritto a ricevere una commissione per servizi agli azionisti - a valere sulle attività dei Comparti interessati - per i suoi servizi, la quale maturerà ogni giorno di negoziazione e sarà pagabile ogni mese in via posticipata (le “Commissioni per i servizi agli azionisti”). Le Commissioni per i Servizi agli Azionisti saranno esigibili mensilmente in via posticipata e matureranno ogni giorno di negoziazione. Ai sensi del Contratto Quadro di Prestazione di Servizi agli Azionisti tra il Gestore, la Società e Franklin Distributors, LLC (l’“Agente Master Incaricato dei Servizi agli Azionisti”), l’Agente Master Incaricato dei Servizi agli Azionisti avrà diritto a ricevere dal Gestore una commissione per servizi agli azionisti da determinate classi azionarie per i loro servizi come Agente Master Incaricato dei Servizi agli Azionisti.

Ai sensi del Contratto Quadro di Prestazione di Servizi agli Azionisti, l’Agente Master Incaricato dei Servizi agli Azionisti è autorizzato a incaricare a sue spese una o più parti di assisterlo nello svolgimento delle sue mansioni previste dal contratto, fermo restando che l’Agente Master Incaricato dei Servizi agli Azionisti resterà tuttavia responsabile nei confronti del Gestore per l’adempimento delle sue obbligazioni ai sensi di tale contratto. In virtù di ciò, l’Agente di servizio agli azionisti di riferimento ha nominato FTIA e Templeton Asset Management Ltd. come Agenti di servizio agli azionisti aggiuntivi della Società. Il Gestore ha autorizzato Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc. a fornire servizi agli azionisti in relazione a Taiwan.

L’importo complessivo delle Commissioni per i servizi agli Azionisti pagato da ciascuna classe di azioni sarà o è stato pari al seguente:

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

Le Commissioni per i servizi agli azionisti sono dovute su tutte le classi ad eccezione delle Classi azionarie di Classe F, Classe J, Classe U, Classe Y, Premier, Classe S, LM, Grandfathered e Galleon (ciascuna come definita nel Prospetto informativo) né sono dovute su tutte le classi azionarie offerte da FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^] e Franklin Responsible Income 2028 Fund[^].

Durante il periodo finanziario chiuso il 31 agosto 2023, non sono state applicate le seguenti commissioni per i Servizi agli Azionisti:

Nome del Fondo	Commissioni per i Servizi agli Azionisti applicate per il periodo chiuso il 31 agosto 2023 (in migliaia)
	FTGF Western Asset US Core Bond Fund
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	3\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	1\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	13\$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	3\$

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

3. Spese di gestione e altre Operazioni con parti correlate – (segue)

Nome del Fondo	Commissioni per i Servizi agli Azionisti applicate per il periodo chiuso il 31 agosto 2023 (in migliaia)
	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	11\$
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	46\$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	1\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	2\$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	7\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	2\$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	1\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	16\$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	2\$

Gli importi indicati con “-” sono pari a 0\$/0€ o inferiori a 1.000\$/1.000€.

Inoltre, alcune spese di gestione, tra cui, a titolo esemplificativo ma non esaustivo, le commissioni pagabili alle controllate di Franklin Templeton per la fornitura di supporto alla governance e la rendicontazione al Consiglio di Amministrazione, i servizi assicurativi al Consiglio medesimo e i servizi continuativi di registrazione per le giurisdizioni in cui i Comparti sono offerti pubblicamente. Per il periodo finanziario chiuso il 31 agosto 2023, queste spese sono risultate pari a %581.299.

Parti correlate

Jane Trust, Jaspal Sagger, William Jackson (fino alla data delle sue dimissioni) e Craig Tyle sono o sono stati Amministratori della Società e sono stati anche amministratori e/o dirigenti di talune affiliate del Gestore, dei Gestori degli Investimenti, dei Distributori e degli Agenti Incaricati dei Servizi agli Azionisti. Joseph Carrier è stato amministratore della Società e, fino alla data di cessazione del suo impiego presso Franklin Templeton Investments il 3 ottobre 2022, è stato anche amministratore e/o direttore esecutivo di determinate affiliate del Gestore, dei Gestori del portafoglio, dei Distributori e degli Agenti Incaricati dei Servizi agli Azionisti. William Jackson è stato amministratore di FTIS (fino alla data delle sue dimissioni). Anche Jane Trust è amministratore di FTIS. I rimanenti Amministratori della Società, elencati in precedenza, sono o sono stati tutti dipendenti di FTIS o di una delle sue affiliate. Salvo quanto dichiarato sopra, nessuno degli Amministratori ha o ha avuto interessi, diretti o indiretti, in qualsiasi contratto o accordo esistenti alla data del presente bilancio che sono significativi in relazione all'attività della Società.

Al 31 agosto 2023, i Comparti indicati nella tabella seguente detenevano investimenti in organismi di investimento collettivo che hanno nominato il medesimo Gestore, Gestori degli investimenti o Sub-gestori degli investimenti del Comparto o hanno nominato una parte correlata di quel Gestore, Gestori degli investimenti o Sub-gestori degli investimenti.

La tabella seguente riporta le quote percentuali di proprietà di tali organismi di investimento collettivo detenute dalla Società:

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

Gli investimenti incrociati dei Comparti all'interno della Società sono indicati nella Nota 13 al bilancio.

Operazioni con Soggetti correlati

Il Regolamento 43(1) dei Regolamenti OICVM della Banca Centrale stabilisce che un “soggetto responsabile garantirà che qualunque operazione tra un OICVM e una parte correlata sia (a) condotta in base al principio di libera concorrenza e (b) nel migliore interesse dei detentori di quote dell'OICVM”.

Come richiesto dal Regolamento 81(4) del Regolamento OICVM della Banca Centrale, il Consiglio ha accertato che (a) esistono disposizioni, comprovate da procedure scritte, per assicurare che gli obblighi prescritti dal Regolamento 43(1) siano applicati a tutte le transazioni con persone consociate; e (b) tutte le transazioni con persone consociate effettuate durante il periodo hanno rispettato gli obblighi prescritti dal Regolamento 43(1).

Commissioni dell'Agente amministrativo e della Banca Depositaria

The Bank of New York Mellon SA/NV, Filiale di Dublino, agisce come banca depositaria (la “Banca depositaria”) e BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company agisce come agente amministrativo (l'“Agente amministrativo”) della Società. Per i servizi di amministrazione, contabilità, servizi agli azionisti, fiduciari e di deposito, esse ricevono collettivamente dai Comparti una commissione non superiore allo 0,15% del valore patrimoniale netto di ciascun Comparto.

Compensi degli Amministratori

Gli onorari degli amministratori e le spese vive addebitate nel Conto economico e relative al periodo finanziario chiuso il 31 agosto 2023 sono stati pari a \$90.000.

I compensi degli Amministratori non sono o non sono stati dovuti relativamente a Jane Trust, Jaspal Sagger, William Jackson (fino alla data delle sue dimissioni) e Craig Tyle, i quali sono o sono stati dipendenti del Gestore, del Gestore degli investimenti o di loro affiliate. I compensi degli Amministratori non erano dovuti relativamente a Joseph Carrier fino al 3 ottobre 2022, data di cessazione del suo impiego a tempo pieno presso Franklin Templeton Investments. Il Sig. Carrier continuerà a fungere da amministratore non esecutivo della Società e dal 3 ottobre 2022 verrà remunerato in linea con gli altri amministratori non esecutivi della Società.

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

3. Spese di gestione e altre Operazioni con parti correlate – (segue)

Operazioni con altre parti correlate

La tabella seguente riporta le quote percentuali di proprietà degli azionisti significativi detentori di oltre il 20% del capitale azionario emessi del Comparto:

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

Linea di credito globale

La Società, insieme ad altri fondi d'investimento registrati europei e statunitensi gestiti da Franklin Templeton Investments (individualmente, "Mutuatario", collettivamente, "Mutuatari"), ha stipulato una linea di credito sindacata senior non garantita per un totale di 2.675 milioni di dollari USA (la "Global Credit Facility") per fornire una fonte di fondi ai Mutuatari per scopi temporanei e di emergenza, compresa la capacità di soddisfare future richieste di rimborso impreviste o insolitamente elevate.

Ai sensi dei termini della linea di credito globale, la Società, oltre agli interessi addebitati a qualsiasi finanziamento da essa concesso e altri costi da essa sostenuti, pagherà la propria percentuale di commissioni e spese sostenute in relazione all'attuazione e al mantenimento della linea di credito globale, in base alla propria percentuale relativa del patrimonio netto complessivo di tutti i Mutuatari, inclusa una commissione di mandato annua basata sulla componente inutilizzata della linea di credito globale.

Tutti i Comparti della Società, ad eccezione di FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, rientrano nell'ambito di applicazione della Global Credit Facility.

4. Distribuzioni ai Detentori di Azioni partecipative redimibili

Classi azionarie a distribuzione

Le lettere tra parentesi alla fine del nome di ogni Classe azionaria a distribuzione indicano una particolare frequenza delle dichiarazioni e dei pagamenti di dividendi, come illustrato nella tabella che segue.

Designazione della Classe azionaria a distribuzione	Frequenza delle dichiarazioni di dividendi	Frequenza dei pagamenti di dividendi
(D)	Giornaliera	Mensile
(M)	Mensile	Mensile
(Q)	Trimestrale	Trimestrale (marzo, giugno, settembre, dicembre)
(S)	Semestrale	Semestrale (marzo, settembre)
(A)	Annuale	Annuale (marzo)

Per ciascuna Classe Azionaria a Distribuzione di ciascun Comparto a Reddito Fisso (Comparto a Reddito Fisso come definito a pagina 15), al momento di ogni dichiarazione di dividendo: (1) all, or some portion of, net investment income, if any, will be declared as a dividend; and (2) all, or some portion, of realised and unrealised capital gains net of realised and unrealised capital losses may be, but is not required to be, declared as a dividend.

Per ciascuna Classe azionaria a Distribuzione di ciascun Comparto Azionario (secondo la definizione di cui a pagina 15), al momento di ogni dichiarazione di dividendi, la totalità o parte dell'eventuale reddito netto da investimenti sarà dichiarata dividendo. Per ciascun Azionista di ciascuna Classe azionaria a Distribuzione, le distribuzioni vengono effettuate nella valuta scelta dall'Azionista all'atto della sottoscrizione azionaria, salvo diversamente richiesto dall'Azionista stesso.

Per ciascuna Classe azionaria a Distribuzione di ciascun Comparto Multi-Asset (secondo la definizione di cui a pagina 15), al momento di ogni dichiarazione di dividendi, la totalità o parte dell'eventuale reddito netto da investimenti sarà dichiarata dividendo. Per ciascun Azionista di ciascuna Classe azionaria a Distribuzione, le distribuzioni vengono effettuate nella valuta scelta dall'Azionista all'atto della sottoscrizione azionaria, salvo diversamente richiesto dall'Azionista stesso.

Le classi azionarie a distribuzione Plus possono dichiarare e pagare distribuzioni a valere sul capitale. Gli investitori in queste classi azionarie devono essere consapevoli del fatto che il pagamento di dividendi a valere sul capitale equivale a un rimborso o a un ritiro di parte dell'investimento originario di un investitore o delle plusvalenze attribuibili a tale investimento originario e tali distribuzioni comporteranno una corrispondente riduzione immediata del valore patrimoniale netto per azione della classe di azioni. Il pagamento delle distribuzioni a valere sul capitale porterà di conseguenza all'erosione del capitale e potrà essere realizzato rinunciando al potenziale di futura crescita del capitale.

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

4. Distribuzioni ai detentori di azioni partecipative riscattabili – (segue)

Nel corso del periodo finanziario, i seguenti Comparti hanno pagato distribuzioni a valore sul capitale sulle Classi azionarie a Distribuzione Plus:

	Distribuzioni a valore sul capitale per il periodo chiuso il 31 agosto 2023 (in migliaia)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Classe A US\$ Distributing (M) Plus	24\$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Classe A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	7\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Classe A US\$ Distributing (M) Plus	5\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Classe A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	1\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Classe A HKD Distributing (M) Plus	-\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Classe A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	7\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Classe A ZAR Distributing (M) (Hedged) Plus	14\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Classe A US\$ Distributing (M) Plus	15\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Classe A HKD Distributing (M) Plus	-\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Classe A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	3\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Classe A US\$ Distributing (M) Plus	53\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Classe A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	54\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Classe A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	20\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Classe A US\$ Distributing (M) Plus	408\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Classe A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	177\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Classe A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	98\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Classe A HKD Distributing (M) Plus	88\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Classe A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	41\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Classe A SGD Distributing (M) Plus	6\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A HKD Distributing (M) Plus	-\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – Classe D US\$ Distributing (M) Plus	1\$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – Classe A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	1\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A US\$ Distributing (M) Plus	242\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	9\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	261\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A SGD Distributing (M) Plus	31\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A CNH Distributing (Monthly) Hedged Plus	8\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A HKD Distributing (M) Plus	70\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A GBP Distributing (M) (Hedged) Plus	16\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus	7\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A US\$ Distributing (M) Plus	29\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	11\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	1\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A HKD Distributing (M) Plus	2\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	5\$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Classe A US\$ Distributing (M) (Hedged) Plus	954€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Classe A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	42€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Classe A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	355€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Classe A Euro Distributing (M) Plus	52€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Classe A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	74€
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	8\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A US\$ Distributing (M) Plus	412\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	42\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus	40\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A GBP Distributing (M) (Hedged) Plus	29\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A HKD Distributing (M) Plus	8\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	336\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - S Classe US\$ Distributing (M) Plus	23\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Premier Classe US\$ Distributing (M) Plus	237\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^] - Classe A US\$ Distributing (M) Plus	7\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^] - Classe A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	5\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^] - Classe A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	-\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^] - Classe A HKD Distributing (M) Plus	4\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^] - Classe A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	-\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe A AUD Distributing (M) Plus	4\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe A SGD Distributing (M) Plus	-\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe D US\$ Distributing (M) Plus	5\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe D HKD Distributing (M) Plus	-\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe D CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	-\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe D AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	1\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe D SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	2\$

Gli importi indicati con “-” sono pari a 0\$/0€ o inferiori a 1.000\$/1.000€.

Le classi azionarie a Distribuzione Plus (e) e a Distribuzione Plus (u) offerte da alcuni Comparti possono addebitare determinate commissioni e spese a valore sul capitale anziché sul reddito. L'addebito totale o parziale delle commissioni e delle spese sul capitale comporterà un aumento del reddito per la distribuzione; tuttavia, il capitale che queste classi azionarie a Distribuzione Plus (e) e a Distribuzione Plus (u) hanno a disposizione per l'investimento in futuro e la crescita del capitale potrebbero essere ridotti. Gli azionisti devono tenere presente che esiste un rischio maggiore che, in caso di rimborso di azioni delle classi azionarie a Distribuzione Plus (e) e a Distribuzione Plus (u), gli azionisti possano non ricevere l'intero importo investito. Per gli investitori nelle classi azionarie a Distribuzione Plus (e) e a Distribuzione Plus (u), ciò può comportare l'erosione dell'investimento di capitale degli investitori nonostante la performance del Comparto pertinente, o le plusvalenze attribuibili a tale investimento originale, il che probabilmente diminuirà il valore dei rendimenti futuri. L'aumento del pagamento dei dividendi a seguito dell'addebito di commissioni e spese sul capitale equivale in effetti a un rimborso o ritiro dell'investimento di capitale originale di un investitore o delle plusvalenze attribuibili a tale investimento originale. Il livello più elevato di pagamento dei dividendi nell'ambito di questo meccanismo di addebito comporterà una corrispondente riduzione immediata del valore patrimoniale netto delle classi azionarie alla data ex dividendo. Gli Azionisti devono tenere presente che nella misura in cui le spese sono addebitate al capitale, alcune o tutte le distribuzioni effettuate dalle classi azionarie a Distribuzione Plus (e) e a Distribuzione Plus (u) devono essere considerate come una forma di rimborso del capitale. Tutte le spese delle Classi azionarie a Distribuzione Plus (e) sono state imputate al capitale.

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

4. Distribuzioni ai detentori di azioni partecipative riscattabili – (segue)

Nel corso del periodo finanziario, i seguenti Comparti hanno imputato oneri e spese al capitale su Classi azionarie a Distribuzione Plus (e):

	Commissioni e spese imputate al capitale per il periodo chiuso il 31 agosto 2023 (in migliaia)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Classe A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	1\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Premier Classe GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	1\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Classe US\$ Distributing (M) Plus (e)	55\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Classe Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	3\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Classe GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	2\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A US\$ Distributing (M) Plus (e)	1,043\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	117\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	17\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	44\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	75\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A HKD Distributing (M) Plus (e)	-\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A JPY Distributing (M) Plus (e)	1\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	205\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A SGD Distributing (M) Plus (e)	-\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe X US\$ Distributing (M) Plus (e)	60\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe X GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	10\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Premier Classe GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	107\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Classe A US\$ Distributing (M) Plus (e)	-\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Premier Classe GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	-\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – Premier Classe GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	-\$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^] – Classe A US\$ Distributing (M) Plus (e)	-\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A US\$ Distributing (M) Plus (e)	663\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	229\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	41\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	73\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe X US\$ Distributing (M) Plus (e)	60\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe X Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	55\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe X GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	17\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Classe US\$ Distributing (M) Plus (e)	56\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Classe Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	118\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Classe GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	16\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Classe S US\$ Distributing (Q) Plus (e)	-\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Classe Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	12\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Classe GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	1\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – LM Classe Euro Distributing (Q) (Hedged) Plus (e)	58\$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^] – Classe X GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	-\$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^] – Classe A US\$ Distributing (M) Plus (e)	1\$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^] – Classe S Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	-\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A US\$ Distributing (M) Plus (e)	-\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	-\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe X Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	-\$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Premier Classe CAD Distributing (Q) (Hedged) (PH) Plus (e)	204€
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A US\$ Distributing (M) Plus (e)	596\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A Euro Distributing (A) Plus (e)	-\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (Q) Plus (e)	-\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Classe U GBP Distributing (Q) Plus (e)	1\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Classe U GBP Distributing (Q) (Hedged) Plus (e)	-\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe X US\$ Distributing (M) Plus (e)	62\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe X Euro Distributing (Q) (Hedged) Plus (e)	8\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe X GBP Distributing (Q) (Hedged) Plus (e)	2\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe A US\$ Distributing (M) Plus (e)	54\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe A Euro Distributing (M) Plus (e)	5\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – S Classe GBP Distributing (M) Plus (e)	1\$

Gli importi indicati con “-” sono pari a 0\$/0€ o inferiori a 1.000\$/1.000€.

Classi di Azioni ad accumulazione

Relativamente alle Classi Azionarie ad Accumulazione, è previsto che, nel corso del normale andamento dell'attività, le distribuzioni non siano dichiarate e che qualsiasi reddito netto da investimento attribuibile a ciascuna Classe Azionaria ad Accumulazione sia accantonato giornalmente nel rispettivo valore patrimoniale netto per azione di ogni rispettiva classe azionaria.

5. Capitale sociale e azioni partecipative redimibili

Capitale sociale

La Società è stata costituita con un capitale sociale iniziale di EUR 39.000 suddiviso in 39.000 azioni di sottoscrizione senza valore nominale. Tutte le azioni di sottoscrizione, tranne tre, sono state riacquistate dalla Società. I titolari di queste tre azioni di sottoscrizione hanno il diritto di partecipare e votare in tutte le assemblee della Società, ma non di partecipare ai dividendi o al patrimonio netto di qualsiasi Comparto o della Società.

Azioni partecipative redimibili

Il capitale sociale della Società sarà sempre pari al valore patrimoniale netto. Gli Amministratori sono autorizzati a emettere fino a cinquecento miliardi di azioni senza valore nominale nella Società al valore patrimoniale netto per azione e ai termini da essi ritenuti opportuni. Non esistono diritti di prelazione sull'emissione di azioni della Società.

Ciascuna delle azioni conferisce pari diritti all'azionista di partecipare, in misura proporzionale e ove applicabile, ai dividendi e al patrimonio netto del Comparto in ordine al quale è stata emessa, salvo nel caso di dividendi dichiarati prima che l'azionista divenisse tale.

I proventi dell'emissione di azioni saranno attribuiti nei registri della Società al relativo Comparto e saranno utilizzati per l'acquisizione per conto del relativo Comparto di valori mobiliari in cui esso è autorizzato a investire. Le scritture contabili di ciascun Comparto saranno tenute separatamente.

Per ogni Comparto sono offerte diverse classi azionarie, come indicato nel Prospetto informativo della Società. Tali diverse classi azionarie differiscono principalmente in termini di commissioni di vendita, oneri, percentuali previste di spesa, politica di distribuzione e denominazione valutaria. L'investitore può pertanto scegliere la Classe azionaria più idonea alle proprie esigenze di investimento, in considerazione dell'importo di investimento e del periodo di detenzione atteso.

Ciascuna Classe azionaria è designata come Classe azionaria a Distribuzione o Classe azionaria ad Accumulazione. Le Classi azionarie ad Accumulazione non distribuiscono reddito netto né plusvalenze nette realizzate o non realizzate, mentre le Classi azionarie a Distribuzione effettuano la distribuzione a intervalli specifici, che variano a seconda della lettera tra parentesi riportata alla fine del nome della Classe azionaria a Distribuzione, come spiegato nella precedente Nota 5 Distribuzioni ai detentori di azioni partecipative redimibili. Inoltre la Società dispone di azioni di sottoscrizione in circolazione. Le azioni di sottoscrizione non danno diritto ai detentori di partecipare alle attività dei Comparti.

Ogni Comparto può offrire classi azionarie designate in valute diverse dalla valuta base del Comparto. Per ogni classe azionaria di questo tipo, salvo in presenza dell'indicazione “(Copertura)” nel proprio nome, il pertinente Gestore degli investimenti o il Gestore degli investimenti delegato non applicherà alcuna tecnica di copertura dell'esposizione della classe azionaria alle variazioni dei tassi di cambio tra la valuta base del Comparto e la valuta della classe azionaria.

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

5. Capitale sociale e azioni partecipative redimibili – (segue)

Le Azioni di Classe A sono disponibili per tutti gli investitori. I pagamenti di commissioni/sconti possono essere effettuati dai distributori a operatori o ad altri investitori che hanno un accordo con un distributore per quanto riguarda tali azioni. Le Azioni di Classe B, C, D, E e K sono disponibili per tutti gli investitori che sono clienti degli operatori nominati da un distributore in relazione a tali azioni. I pagamenti delle commissioni possono essere effettuati dai distributori a operatori o altri investitori che hanno un accordo con un distributore relativamente a tali azioni. Le Azioni di Classe F sono disponibili per investitori professionali e investitori con un accordo di investimento discrezionale con un operatore nominato dal distributore in relazione a tali azioni. I pagamenti di commissioni/sconti possono essere effettuati dai distributori a operatori o altri investitori che hanno un accordo con il distributore in merito a tali azioni. Le Azioni di Classe J sono destinate alla distribuzione giapponese, a discrezione degli Amministratori o dei distributori. Le Azioni di Classe M sono disponibili per investitori professionali e investitori con un accordo di investimento discrezionale con un operatore o altra entità nominati dal distributore in relazione a tali azioni. Le Azioni di Classe R sono disponibili a tutti gli investitori che hanno un accordo basato su commissioni con un intermediario dal quale hanno ricevuto una raccomandazione personale in relazione al loro investimento nei Comparti. Le Azioni di Classe T sono destinate alla distribuzione a Taiwan, a discrezione degli Amministratori o dei distributori. Le Azioni di Classe X sono disponibili per gli operatori, i gestori di portafoglio o le piattaforme che, in base a requisiti regolamentari o basati su accordi di commissione con i propri clienti, non sono autorizzati ad accettare e trattare commissioni di distribuzione; e investitori istituzionali (per gli investitori nell'Unione europea, ciò significa "Controparti qualificate" come definite ai sensi del MIFID II) che investono per proprio conto. Le Azioni di Classe U, Y e S sono disponibili per gli investitori istituzionali a discrezione degli Amministratori o dei distributori. Le classi azionarie BW LM sono disponibili a discrezione degli Amministratori o dei distributori per gli investitori qualificati che sono membri del gruppo Franklin Templeton o clienti di tali membri. Le classi azionarie LM sono disponibili a discrezione degli Amministratori o dei distributori per gli investitori qualificati che sono membri del gruppo Franklin Templeton, piani pensionistici e schemi di natura simile sponsorizzati dai membri del gruppo Franklin Templeton o clienti di tali membri. Per gli investitori con sede nell'Unione Europea, le classi azionarie Premier BW sono disponibili a discrezione degli Amministratori o dei distributori presso le "Controparti qualificate" come definito in MIFID II; per gli investitori con sede al di fuori dell'Unione Europea, le classi azionarie Premier BW sono disponibili per gli investitori istituzionali a discrezione degli Amministratori o dei distributori o per gli investitori qualificati che sono membri del gruppo Franklin Templeton o clienti di tali membri. Per gli investitori con sede nell'Unione europea, le classi azionarie Premier sono disponibili per le "Controparti qualificate" come definito in MIFID II; per gli investitori con sede al di fuori dell'Unione Europea, le classi azionarie Premier sono disponibili per gli investitori istituzionali.

Per le classi azionarie che includono "(Copertura)" nel loro nome dopo la denominazione della valuta, si intende che tali classi azionarie saranno coperte contro le oscillazioni dei tassi di cambio tra la valuta della classe di azioni e la valuta di base del relativo Comparto. Alcune classi azionarie in Comparti gestiti da Brandywine Global Investment Management, LLC sono coperte rispetto a un indice, come indicato dall'inclusione del simbolo "(IH)" nel nome della Classe di azioni. I Fondi gestiti da Brandywine Global Investment Management, LLC e il FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund gestito da ClearBridge Investments (North America) Pty Limited offrono classi azionarie coperte a livello di portafoglio, come indicato dall'inclusione del simbolo "(PH)" nel nome della classe di azioni. Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] (ha cessato la negoziazione l'1 giugno 2021) offriva classi di azioni che potevano pagare una commissione di performance, come indicato da "(PF)" nel nome della classe di azioni.

Alcuni Comparti hanno inoltre emesso Classi azionarie Grandfathered, come indicato dall'inclusione dai simboli "GA", "GE", "GP" o "(G)" nel nome della classe di azioni. Le Classi Azionarie Grandfathered sono disponibili solo per i detentori di quote dei Comparti affiliati. Le Classi Azionarie Grandfathered sono chiuse a qualsiasi sottoscrizione successiva, sia da parte di Azionisti esistenti nella classe azionaria sia da parte di nuovi investitori; tuttavia le azioni possono continuare ad essere acquistate tramite (1) il reinvestimento di dividendi; (2) le conversioni automatiche da una Classe Azionaria B (G) di un Comparto in una Classe Azionaria A (G) dello stesso Comparto; e (3) lo scambio di azioni di una Classe Azionaria Grandfathered con la stessa designazione di lettera. Fermo restando quanto precede, come indicato nei Supplementi del Comparto, alcune Classi Azionarie Grandfathered per determinati Comparti possono essere rese disponibili per le successive sottoscrizioni da parte degli azionisti esistenti nella classe azionaria a sola discrezione degli Amministratori.

6. Regime fiscale

Ai sensi delle leggi e delle prassi irlandesi in vigore, la Società si qualifica come organismo di investimento ai sensi della Sezione 739B del Taxes Consolidation Act del 1997 (e successive modifiche). La Società non sarà pertanto generalmente tenuta al versamento di imposte irlandesi relativamente al proprio reddito e ai propri utili, salvo in seguito al verificarsi di un evento imponibile. Un evento imponibile si verifica in linea generale in occasione di qualsiasi distribuzione, rimborso, riacquisto, annullamento, trasferimento di azioni o alla fine di un "Periodo pertinente"; per "Periodo pertinente" si intende un periodo di otto anni avente inizio all'acquisizione delle azioni da parte degli Azionisti e tutti i successivi periodi di otto anni aventi inizio subito dopo il Periodo pertinente precedente.

La Società non sarà soggetta ad alcuna imposta irlandese relativamente a eventi imponibili nei seguenti casi:

- (i) un azionista non sia residente irlandese né abitualmente residente in Irlanda ai fini fiscali, al momento del fatto generatore dell'imposta, purché sia stata rilasciata una necessaria valida dichiarazione, oppure, in assenza di quest'ultima, la Società sia stata autorizzata dalle Autorità tributarie irlandesi (Irish Revenue) a effettuare pagamenti lordi; e
- (ii) certain exempted Irish tax resident shareholders who have provided the Company with the necessary signed statutory declarations.

Inoltre, qualsiasi operazione (che potrebbe altrimenti essere un evento imponibile) relativa ad azioni detenute nell'ambito di un sistema di compensazione riconosciuto designato su ordinanza dell'Autorità fiscale e tributaria irlandese non costituirà un evento imponibile.

In assenza di una dichiarazione appropriata, la Società sarà tenuta a versare l'imposta irlandese al verificarsi di un evento imponibile.

Eventuali plusvalenze, dividendi e interessi ricevuti potrebbero essere soggetti a imposte, comprese ritenute d'imposta prescritte dal Paese di origine, e tali imposte potrebbero non essere recuperabili da parte del Fondo o dei suoi azionisti.

7. Liquidità e mezzi equivalenti e conti in marginazione

Le disponibilità liquide e i mezzi equivalenti sono valutati al loro valore nominale con gli interessi maturati, ove applicabile. I saldi di liquidità e mezzi equivalenti e scoperti di cassa di qualsiasi Comparto sono detenuti presso la Banca Depositaria. I "Conti in marginazione e liquidità vincolata" nello Stato patrimoniale rappresentano depositi a margine, garanzie liquide e utili e perdite realizzati su contratti futures non ancora consegnati. I depositi a margine e le garanzie reali liquide, detenute in relazione a operazioni OTC e su derivati negoziati in borsa al 31 agosto 2023, sono detenuti presso i seguenti broker: Bank of America Merrill Lynch, Barclays, BNP Paribas, BNY Mellon, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley e UBS.

8. Impegni e sopravvenienze passive

Al 31 agosto 2023 non risultavano impegni o sopravvenienze passive significativi.

9. Accordi di soft commission

La Società ha delle politiche volte a garantire che i suoi fornitori di servizi agiscano nel migliore interesse dei Comparti nell'esecuzione delle decisioni di negoziazione per conto di tali Comparti nel contesto della gestione dei portafogli dei Comparti. A tal fine, devono essere prese tutte le misure ragionevoli per ottenere il miglior risultato possibile per i Comparti, tenendo conto del prezzo, dei costi, della velocità, della probabilità di esecuzione e regolamento, delle dimensioni e della natura dell'ordine, o di qualsiasi altra considerazione relativa all'esecuzione dell'ordine. Eventuali rimborsi in contanti ricevuti da un broker o dealer in contropartita delle operazioni di intermediazione del Comparto destinate a tale broker o dealer non saranno tratti dal Gestore degli Investimenti, dal Gestore degli Investimenti delegato o da persone ad essi collegate. La Società non si farà carico dei costi di ricerca esterna svolta dai Gestori degli Investimenti e dai Sub-gestori degli investimenti. Tali costi saranno a carico del Gestore degli Investimenti o Gestore degli Investimenti delegato pertinente. Le informazioni sulle politiche di esecuzione dei Comparti sono disponibili gratuitamente per gli Azionisti su richiesta.

Nel corso del periodo finanziario chiuso al 31 agosto 2023, Royce & Associates, LP ("Royce") ha stipulato accordi di soft commission con i broker, ma ha rimborsato i relativi Comparti per eventuali spese di ricerca sostenute nell'ambito di tali accordi.

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

10. Tassi di cambio

Nel presente bilancio sono stati applicati i tassi di cambio di seguito riportati per ottenere il controvalore in dollari USA, euro e sterline britanniche per i Comparti interessati rispettivamente denominati in dollari USA, euro e sterline britanniche:

	Valuta	Tassi di cambio al 31 agosto 2023
Comparti in USD	Peso argentino	729,8774*
	Dollaro australiano	1,5433
	Real brasiliano	4,9521
	Sterlina britannica	0,7894
	Dollaro canadese	1,3512
	Renminbi cinese (CNH)	7,2777
	Renminbi cinese (CNY)	7,2902
	Peso colombiano	4.090,5000
	Corona Ceca	22,1958
	Corona danese	6,8731
	Sterlina egiziana	30,9000
	Euro	0,9222
	Dollaro di Hong Kong	7,8424
	Fiorino ungherese	351,6393
	Rupia indiana	82,7863
	Rupia indonesiana	15.230,0000
	Yen giapponese	145,4950
	Ringgit malese	4,6400
	Peso messicano	17,0505
	Dollaro neozelandese	1,6770
	Corona norvegese	10,6317
	Nuevo sol peruviano	3,6955
	Peso filippino	56,6200
	Zloty polacco	4,1257
	Rublo russo	95,8750
	Riyal saudita	3,7507
	Dollaro di Singapore	1,3515
	Rand sudafricano	18,8850
	Won sudcoreano	1.321,7500
	Corona svedese	10,9485
	Franco svizzero	0,8834
	Dollaro di Taiwan	31,8465
	Baht thailandese	35,0175
Lira turca	26,7203	
Comparti in EUR	Valuta	Tassi di cambio al 31 agosto 2023
	Dollaro australiano	1,6735
	Real brasiliano	5,3698
	Sterlina britannica	0,8560
	Dollaro canadese	1,4652
	Corona danese	7,4528
	Yen giapponese	157,7676
	Zloty polacco	4,4737
	Rand sudafricano	20,4780
	Corona svedese	11,8720
	Franco svizzero	0,9579
Dollaro statunitense	1,0844	
Comparti in GBP	Valuta	Tassi di cambio al 31 agosto 2023
	Euro	1,1683
	Yen giapponese	184,3132
Dollaro statunitense	1,2668	

* TG scontato basato sull'Indice ARS Eqy EqWgt Impli (NON UFFICIALE) secondo le istruzioni di FTIS.

11. Stima del valore equo

La Società ha classificato le valutazioni a valore equo usando una gerarchia del valore equo che riflette il significato dei dati di partenza utilizzati per effettuare le valutazioni stesse. La gerarchia del valore equo si articola nei livelli seguenti:

Livello 1 – I dati di partenza sono prezzi quotati non rettificati in mercati attivi per attività o passività identiche a cui l'entità può accedere alla data di valutazione.

Livello 2 – I dati di partenza sono diversi dai prezzi quotati compresi nel Livello 1 e sono osservabili (ad esempio, sviluppati utilizzando i dati di mercato) per l'attività o la passività, direttamente o indirettamente.

Livello 3 – I dati di partenza non sono osservabili (ad esempio, quelli per cui non sono disponibili dati di mercato) per l'attività o la passività.

Un investimento viene sempre complessivamente classificato come livello 1, 2 o 3. In alcuni casi la misurazione al valore equo per un investimento potrebbe prevedere l'uso di alcuni dati di partenza differenti che ricadono in diversi livelli della gerarchia del valore equo. In tali casi il livello di un investimento nell'ambito della gerarchia del valore equo è basato sul livello più basso del dato di partenza che sia significativo ai fini della misurazione del valore equo. La stima dell'importanza di un particolare dato di partenza relativamente alla misurazione del valore equo richiede un giudizio ed è specifica rispetto all'investimento.

I dati di partenza o la metodologia utilizzati per la valutazione dei titoli non sono necessariamente indicativi del rischio associato all'investimento in tali titoli.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

11. Stima del valore equo – (segue)

Le tabelle che seguono riportano analisi, basate sulla gerarchia del valore equo, delle attività e passività dei Comparti misurate al valore equo al 31 agosto 2023:

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Western Asset US Core Bond Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)
Level 1					
Obbligazioni ed effetti	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Strumenti del mercato monetario	–	–	–	–	–
Strumenti azionari	–	–	–	–	376
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	–	637	4.720	322	221
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	–	(347)	(2.905)	(91)	(166)
	–	290	1.815	231	431
Level 2					
Obbligazioni ed effetti	\$ 702.821	\$ 215.372	\$ 1.006.983	€ 85.946	\$ 207.139
Strumenti del mercato monetario	247.520	–	–	–	–
Strumenti azionari	–	10.768	–	520	3.032
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	–	1.321	10.106	26	535
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	–	(20)	(3.933)	(179)	(1.411)
	950.341	227.441	1.013.156	86.313	209.295
Level 3					
Obbligazioni ed effetti	\$ –	\$ 607	\$ 805	€ –	\$ –
Strumenti del mercato monetario	–	–	–	–	–
Strumenti azionari	–	–	–	–	–
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	–	–	–	–	–
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	–	–	–	–	–
	–	607	805	–	–
Totale investimenti	\$ 950.341	\$ 228.338	\$ 1.015.776	€ 86.544	\$ 209.726

	FTGF Western Asset US High Yield Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)
Level 1					
Obbligazioni ed effetti	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Strumenti del mercato monetario	–	–	–	–	–
Strumenti azionari	–	1	–	–	–
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	50	–	–	718	404
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	–	(10)	(269)	(705)	(245)
	50	(9)	(269)	13	159
Level 2					
Obbligazioni ed effetti	\$ 100.606	\$ 50.685	\$ 388.384	\$ 460.222	\$ 151.281
Strumenti del mercato monetario	–	–	–	–	–
Strumenti azionari	143	–	2.645	3.957	12.283
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	101	32	6	2.481	998
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	(88)	(105)	(618)	(3.573)	(1.300)
	100.762	50.612	390.417	463.087	163.262
Level 3					
Obbligazioni ed effetti	\$ 659	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Strumenti del mercato monetario	–	–	–	–	–
Strumenti azionari	292	–	–	–	–
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	–	–	–	–	–
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	–	–	–	–	–
	951	–	–	–	–
Totale investimenti	\$ 101.763	\$ 50.603	\$ 390.148	\$ 463.100	\$ 163.421

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

11. Stima del valore equo – (segue)

	FTGF Western Asset Global Credit Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)
Level 1					
Obbligazioni ed effetti	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	-	-	-	-	-
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	110	76.459	1.665	-	1.098
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	(41)	(99.527)	(560)	(538)	(94)
	69	(23.068)	1.105	(538)	1.004
Level 2					
Obbligazioni ed effetti	\$ 29.238	\$ 1.480.486	\$ 273.990	\$ 479.117	\$ 1.130.718
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	222	1.606	-	15.887	3.712
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	216	126.963	1.371	577	-
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	(171)	(68.018)	(2.785)	(664)	-
	29.505	1.541.037	272.576	494.917	1.134.430
Level 3					
Obbligazioni ed effetti	\$ -	\$ 7.340	\$ 731	\$ 17.995	\$ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	-	-	1.116	-	-
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
	-	7.340	1.847	17.995	-
Totale investimenti	\$ 29.574	\$ 1.525.309	\$ 275.528	\$ 512.374	\$ 1.135.434
	FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)
Level 1					
Obbligazioni ed effetti	£ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	-	192	-	-	-
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	90	50	301	26	-
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	(24)	(17)	(172)	(13)	-
	66	225	129	13	-
Level 2					
Obbligazioni ed effetti	£ 43.046	\$ 59.077	\$ 18.207	\$ 8.537	\$ 147.642
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	-	750	130	365	4.355
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	8	147	532	77	1.454
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	(11)	(878)	(73)	(161)	(3.353)
	43.043	59.096	18.796	8.818	150.098
Level 3					
Obbligazioni ed effetti	£ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	-	-	-	-	-
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-
Totale investimenti	£ 43.109	\$ 59.321	\$ 18.925	\$ 8.831	\$ 150.098

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

11. Stima del valore equo – (segue)

	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)
Level 1					
Obbligazioni ed effetti	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	-	-	-	-	16
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	512	42	-	6.156	18
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	(177)
	512	42	-	6.156	(143)
Level 2					
Obbligazioni ed effetti	\$ 252.450	\$ 23.082	\$ 199.024	\$ 1.094.717	\$ 32.048
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	7.710	846	8.871	61.400	630
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	7.522	12	1.150	2.658	225
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	(16.536)	(245)	(4.628)	(21.063)	(236)
	251.146	23.695	204.417	1.137.712	32.667
Level 3					
Obbligazioni ed effetti	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	-	-	-	-	-
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-
Totale investimenti	\$ 251.658	\$ 23.737	\$ 204.417	\$ 1.143.868	\$ 32.524
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)					
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)					
FTGF ClearBridge Value Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)					
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)					
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)					
Level 1					
Obbligazioni ed effetti	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	-	-	914.073	197.279	1.512.094
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	55	66	-	-	-
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	(130)	-	-	-	-
	(75)	66	914.073	197.279	1.512.094
Level 2					
Obbligazioni ed effetti	\$ 63.486	\$ 13.884	\$ -	\$ -	\$ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	3.787	931	-	-	-
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	266	42	28	-	280
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	(2.543)	(115)	(1.547)	-	(2.302)
	64.996	14.742	(1.519)	-	(2.022)
Level 3					
Obbligazioni ed effetti	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	-	-	-	-	-
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-
Totale investimenti	\$ 64.921	\$ 14.808	\$ 912.554	\$ 197.279	\$ 1.510.072

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

11. Stima del valore equo – (segue)

	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)
Level 1					
Obbligazioni ed effetti	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	€ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	213.403	35.254	1.553.421	14.730	847.640
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
	213.403	35.254	1.553.421	14.730	847.640
Level 2					
Obbligazioni ed effetti	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	€ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	-	-	-	-	-
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	4	-	31	-	1.728
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	(86)	(16)	(863)	-	(210)
	(82)	(16)	(832)	-	1.518
Level 3					
Obbligazioni ed effetti	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	€ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	-	-	-	-	-
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-
Totale investimenti	\$ 213.321	\$ 35.238	\$ 1.552.589	\$ 14.730	€ 849.158
	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Royce US Smaller Companies Fund al 31 agosto 2023 (in migliaia)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] al 31 agosto 2023 (in migliaia)
Level 1					
Obbligazioni ed effetti	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	€ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	355.274	640.372	91.631	4.059	-
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
	355.274	640.372	91.631	4.059	-
Level 2					
Obbligazioni ed effetti	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	€ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	-	39.321	1.044	171	-
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	6	94	-	-	-
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	(1.018)	(945)	(2)	-	-
	(1.012)	38.470	1.042	171	-
Level 3					
Obbligazioni ed effetti	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	€ -
Strumenti del mercato monetario	-	-	-	-	-
Strumenti azionari	-	-	-	-	-
Attività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
Passività derivate detenute a scopo di negoziazione	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-
Totale investimenti	\$ 354.262	\$ 678.842	\$ 92.673	\$ 4.230	€ -

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

12. Garanzia in titoli – (segue)

Fondo	Broker	Al 31 agosto 2023 Valore di mercato della garanzia in migliaia
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Morgan Stanley	134\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Citi	322\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	JP Morgan	78\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Bank of America Merrill Lynch	3.275\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	BNP Paribas	7.900\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Goldman Sachs	1.219\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	JP Morgan	2.380\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	BNP Paribas	61\$

Viene mantenuto un elenco di controparti approvate. Eventuali aggiunte a tale elenco sono verificate con cadenza trimestrale, mentre annualmente viene condotto un minuzioso riesame di tutte le controparti. La verifica comprende l'analisi dell'adeguatezza patrimoniale, della redditività e della liquidità della controparte e altri fattori eventualmente appropriati.

Ai fini di una gestione efficiente del portafoglio, ciascun Comparto può perfezionare accordi di riacquisto, accordi di riacquisto inverso e operazioni di prestito titoli nel rispetto delle condizioni e dei limiti indicati dai Regolamenti OICVM della Banca centrale.

Fino alla scadenza dei contratti di riacquisto, degli accordi di riacquisto inverso e delle operazioni di prestito titoli, la garanzia ottenuta in virtù di tali contratti od operazioni:

- (i) must be marked to market daily;
- (ii) must equal or exceed, in value, at all times the value of the amount invested or securities loaned;
- (iii) must be transferred to the trustee, or its agent; and
- (iv) must be immediately available to the scheme, without recourse to the counterparty, in the event of a default by that entity.

La garanzia accessoria non liquida ricevuta dalla Società non può essere venduta né ricostituita in pegno, ma deve essere detenuta al rischio di credito della controparte e deve essere rilasciata da un'entità indipendente della stessa.

Il Comitato di valutazione si riunisce almeno una volta al mese e ogniqualvolta le circostanze lo richiedano, per esaminare e deliberare i problemi di valutazione, rischio di credito compreso. Il Gestore degli Investimenti e i rispettivi Gestori degli investimenti delegati presentano l'analisi del rischio al Consiglio e al Comitato ogni sei mesi.

Sostanzialmente, tutte le disponibilità liquide e i titoli detenuti dai Comparti sono detenuti tramite la Banca Depositaria, che ha un rating creditizio di AA-. La bancarotta o l'insolvenza della Banca depositaria può causare un ritardo o una limitazione dei diritti dei Comparti relativamente alla liquidità da essa detenuta. Al credito della Banca depositaria le principali agenzie di rating hanno attribuito un rating elevato. Se la qualità del credito o la situazione finanziaria della Banca Depositaria dovesse peggiorare in modo significativo, il Gestore degli Investimenti e i rispettivi Gestori degli investimenti delegati possono trasferire la liquidità in un'altra banca.

Eventuali titoli collocati come garanzia sono divulgati nel Prospetto degli investimenti. Le disponibilità liquide ed i mezzi equivalenti detenuti presso la Banca Depositaria, i conti in marginazione e la liquidità vincolata sono indicati nello Stato patrimoniale.

Se un Comparto rilascia una garanzia a una controparte, in caso di insolvenza della stessa tale Comparto può avere il diritto, in base a contratti di negoziazione perfezionati con la controparte, di richiamare tale garanzia. In pratica, tuttavia, il Comparto può cercare di ridurre qualsiasi importo dovuto alla controparte per regolare eventuali operazioni aperte portando a compensazione gli importi dovuti a fronte della garanzia emessa. Se ad avvenuta compensazione con gli importi dovuti, al Comparto dovesse essere restituita una garanzia (ad esempio nel caso in cui la posizione del Comparto fosse eccessivamente garantita), è probabile che il Comparto vanterà un credito non garantito verso la controparte nella procedura fallimentare per l'importo in eccesso ad esso dovuto.

Al fine di attenuare il rischio di credito della controparte, alcuni derivati over-the-counter vengono compensati mediante organismi centrali di compensazione. Ai sensi di tale accordo, le operazioni perfezionate con controparti sono affidate a organismi di compensazione, che dopo l'accettazione sostituiscono a tutti gli effetti la controparte per quel che riguarda gli aspetti di rischio dell'operazione in questione.

La tabella che segue mostra il valore di mercato dei titoli collocati in garanzia presso i broker in relazione a negoziazioni in strumenti derivati:

Fondo	Broker	Al 31 agosto 2023 Valore di mercato della garanzia in migliaia
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Bank of America Merrill Lynch	235\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Bank of America Merrill Lynch	57.208\$

13. Informativa per gli Investimenti incrociati effettuati dai Comparti all'interno della Società

Alcuni Comparti investono in altri Comparti della Società. Questi investimenti incrociati sono stati eliminati nel bilancio della Società, come di seguito illustrato:

- i valori di mercato degli OIC sottostanti sono stati eliminati negli importi totali della Società nello Stato patrimoniale;
- i profitti e le perdite realizzati, inclusi i movimenti in plusvalenze e minusvalenze latenti, e il relativo reddito da dividendi e le distribuzioni sugli investimenti incrociati sono stati eliminati negli importi totali della Società rilevati nel Conto economico; e
- gli importi monetari degli acquisti e delle vendite di unità di detti OIC sono stati eliminati dai proventi netti delle vendite di azioni e dal costo delle azioni riacquistate, rispettivamente, negli importi totali della Società rilevati nel Prospetto delle variazioni del patrimonio netto attribuibile a detentori di azioni partecipative redimibili.

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] deteneva 29.816 azioni in FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] alla fine del periodo. Le operazioni che hanno implicato queste azioni e i relativi utili, perdite e distribuzioni durante il periodo sono state:

	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^] Per il periodo chiuso il 31 agosto 2023 (in migliaia)
Emissione di azioni	-\$
Rimborso di azioni	-
Profitti/(Perdite) netti realizzati su attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	-
Distribuzioni ricevute	-
Costo	3.500
Valore equo	3.787
Profitto netto non realizzato su attività finanziarie al valore equo rilevato a conto economico	287\$

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Nota integrativa al bilancio – (segue)

14. Eventi significativi

A partire dal 24 marzo 2023, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] e FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] hanno cessato la negoziazione.

A decorrere dal 20 aprile 2023, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] ha cessato la negoziazione.

Il 12 giugno 2023, la Società ha emesso un Supplemento di FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^], un Prospetto informativo supplementare e un Prospetto informativo specialistico per Franklin Templeton Global Funds Plc che sono stati annotati dalla Banca Centrale.

A decorrere dal 20 giugno 2023, FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] ha avviato la negoziazione.

A decorrere dal 17 luglio 2023, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^] ha cessato la negoziazione.

A decorrere dal 17 luglio 2023, William Jackson ha rassegnato le dimissioni da amministratore della Società.

A decorrere dal 27 luglio 2023, Craig Tyle è stato nominato amministratore del consiglio di amministrazione della Società.

15. Separazione patrimoniale

Il 24 febbraio 2022, la Russia ha avviato operazioni militari nel territorio sovrano dell'Ucraina. Il perdurare dell'incertezza politica e finanziaria che circonda la Russia e l'Ucraina può aumentare la volatilità del mercato e il rischio economico dell'investimento in titoli di questi Paesi e di altri Paesi colpiti all'interno della regione. A causa delle sanzioni, delle azioni delle autorità, degli sviluppi nella stessa Ucraina e di altre circostanze, il Gestore continua a monitorare l'impatto sulle valutazioni e sulla liquidità e adotterà tutte le potenziali azioni del caso, in linea con le politiche e le procedure del Fondo.

Nel periodo chiuso il 31 agosto 2023 non si sono verificati altri eventi significativi.

La Società è un fondo multicomparto con separazione patrimoniale tra i suoi Comparti. In quanto tale, ai sensi della legge irlandese, le attività di ciascun Comparto non saranno esposte alle passività di altri Comparti della Società. Ciò nonostante non può essere in alcun modo garantito che, se venisse promossa un'azione contro la Società nei fori di un'altra giurisdizione, sarebbe necessariamente mantenuta la natura separata dei Comparti.

16. Eventi successivi

Il 18 settembre 2023, la Società ha emesso un Supplemento di FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^], un Prospetto informativo supplementare e un Prospetto informativo aggiornato per Franklin Templeton Global Funds Plc che sono stati annotati dalla Banca Centrale.

A decorrere dal 22 settembre 2023, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^] ha avviato la negoziazione.

Non si sono verificati altri eventi importanti successivi alla data di chiusura dello Stato patrimoniale che richiedano la divulgazione nei prospetti finanziari.

17. Approvazione della relazione semestrale e del bilancio non certificato

Il 17 ottobre 2023, la Relazione semestrale e il bilancio provvisorio non sottoposto a revisione sono stati presentati al consiglio di amministrazione, che li ha annotati, e sono stati approvati per la consegna presso la Banca centrale e per la diffusione agli azionisti.

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Informazioni supplementari - Total Expense Ratio (TER)

	Rapporto tra il totale delle operazioni Spese in CU(1) e media Patrimonio netto giornaliero del fondo in CU(1)(%) Per il periodo chiuso il 31 agosto 2023**	Rapporto tra il totale delle operazioni Spese in CU(1) e media Patrimonio netto giornaliero del fondo in CU(1)(%) Per il periodo chiuso il 31 agosto 2023**
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	0,65	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	0,65	
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	1,10	
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (D)	1,10	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	1,35	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)	0,45	
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	0,65	
Azioni a Distribuzione di Classe A (G) in USD (D)	0,65	
Azioni a Distribuzione di Classe L (G) in USD (D)	0,69	
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,08	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	1,09	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	1,59	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)	1,58	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	1,76	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	0,73	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)	0,75	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	0,58	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (D)	0,59	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,56	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	0,21	
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in USD	1,03	
Azioni ad Accumulazione di Classe GE in USD	1,63	
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,27	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	1,27	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	1,27	
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)	1,28	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,27	
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (D)	1,52	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	1,77	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)	1,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	1,88	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	0,68	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)	0,67	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	0,58	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (D)	0,58	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	0,57	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,43	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (M)	0,42	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,42	
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (M)	0,13	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	0,14	
Azioni ad accumulazione di Classe LM in GBP (Copertura)	0,12	
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	1,28	
Azioni a Distribuzione di Classe A (G) in USD (D)	1,28	
Azioni a Distribuzione di Classe B (G) in USD (D)	1,78	
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	1,78	
Azioni a Distribuzione di Classe L (G) in USD (D)	1,78	
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	1,10	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (D)	1,08	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)	1,58	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	0,43	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	0,13	
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in EUR	0,95	
Azioni a Distribuzione di Classe GA in EUR (A)	0,95	
Azioni ad Accumulazione di Classe GE in EUR	1,55	
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A (M) in AUD (Copertura) Plus	1,37	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) (Copertura)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) Plus (Copertura) (e)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) (Copertura)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (D)	1,62	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	1,87	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)	1,87	
Azioni a Distribuzione di Classe A in ZAR (M) Plus (Copertura)	1,37	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	1,97	
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)	1,97	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)	1,97	
Azioni a Distribuzione di Classe E in EUR (M) (Copertura)	1,97	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	0,77	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)	0,77	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (D)	0,82	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	0,82	
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (D) (Copertura)	0,82	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,52	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (M)	0,52	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier CHF (Copertura)	0,52	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,52	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (M) (Copertura)	0,52	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura)	0,52	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura) Plus (e)	0,52	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in PLN (Copertura)	0,52	
Azioni a Distribuzione di Classe LM in AUD (M) (Copertura)	0,12	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in GBP (Copertura)	0,12	
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) (Copertura)	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	1,24	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	1,85	
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)	1,85	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)	1,85	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	0,85	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)	0,85	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,60	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	0,59	
Azioni a Distribuzione di Classe S in USD (M)	0,45	
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (Coperte)	0,44	
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (M)	0,14	
Azioni ad accumulazione di Classe LM in GBP (Copertura)	0,14	
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	1,30	
Azioni a Distribuzione di Classe A (G) in USD (D)	1,30	
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	1,80	
Azioni a Distribuzione di Classe L (G) in USD (D)	1,80	
Azioni ad Accumulazione di Classe GF in USD	1,09	

Informazioni supplementari - Total Expense Ratio (TER) - (continua)

	Rapporto tra il totale delle operazioni Spese in CU(1) e media Patrimonio netto giornaliero del fondo in CU(1)(%) Per il periodo chiuso il 31 agosto 2023**	Rapporto tra il totale delle operazioni Spese in CU(1) e media Patrimonio netto giornaliero del fondo in CU(1)(%) Per il periodo chiuso il 31 agosto 2023**
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)	1,24	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (D) (Copertura)	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (D)	1,49	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	1,92	
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)	1,92	
Azioni a Distribuzione di Classe E in EUR (M) (Copertura)	1,92	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	0,92	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)	0,92	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (D)	0,82	
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (D) (Copertura)	0,82	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,67	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (D) (Copertura)	0,67	
Azioni a Distribuzione di Classe S in USD (M)	0,45	
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (Coperte)	0,44	
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	1,47	
Azioni a Distribuzione di Classe A (G) in USD (D)	1,47	
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	1,97	
Azioni a Distribuzione di Classe L (G) in USD (D)	1,97	
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,36	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	1,36	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	1,36	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	1,36	
Azioni a Distribuzione di Classe A (M) in AUD (Copertura) Plus	1,36	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CHF (Copertura)	1,36	
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) (Coperte) Plus	1,36	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1,36	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,36	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A)	1,36	
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus	1,36	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (Copertura)	1,36	
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	1,36	
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus	1,36	
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	1,61	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	1,86	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)	1,86	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	1,96	
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)	1,96	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	0,96	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)	0,96	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (M)	0,86	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	0,86	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,71	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (M)	0,71	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	0,71	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,71	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (M)	0,71	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (M)	0,71	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M)	0,71	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	0,11	
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (M)	0,11	
Azioni a Distribuzione di Classe LM in EUR (M) (Copertura)	0,11	
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,10	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	1,10	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,10	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) (Copertura)	1,11	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (coperte)	1,10	
Azioni a Distribuzione di Classe A in SEK (M) (Copertura)	0,99	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	1,60	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (M)	1,60	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	1,70	
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)	1,70	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	0,71	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)	0,70	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	0,61	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,45	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in CHF (M) (Copertura)	0,46	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,45	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (M) (Copertura)	0,46	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	0,45	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura)	0,45	
Azioni a Distribuzione di Classe S in USD (M) Plus (3)	0,35	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	0,35	
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (M) Plus (Copertura) (e)	0,35	
Azioni a Distribuzione di Classe S in GBP (M) Plus (Copertura) (e)	0,35	
Azioni ad accumulazione di Classe LM in AUD (con copertura)	0,10	
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	1,16	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	0,69	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,54	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,54	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	0,55	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in NZD (Copertura)	0,53	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	0,45	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	0,44	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	0,14	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR (Copertura)	0,14	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in CAD (Copertura)	0,14	
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,19	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,19	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	0,58	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,54	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	0,54	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	0,18	
Azioni ad accumulazione di Classe LM in EUR (Copertura)	0,19	

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Informazioni supplementari - Total Expense Ratio (TER) - (continua)

	Rapporto tra il totale delle operazioni Spese in CU(1) e media Patrimonio netto giornaliero del fondo in CU(1)(%) Per il periodo chiuso il 31 agosto 2023**	Rapporto tra il totale delle operazioni Spese in CU(1) e media Patrimonio netto giornaliero del fondo in CU(1)(%) Per il periodo chiuso il 31 agosto 2023**
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (S)	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in AUD (coperte)	1,73	
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura) (e)	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CHF (Copertura)	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CNH (coperte)	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura) (e)	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,73	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A)	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) Plus (Copertura) (e)	1,74	
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (S) (Copertura)	1,73	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in GBP	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in GBP (coperte)	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) Plus (Copertura) (e)	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (coperte)	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (Copertura)	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura) (e)	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (e)	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	2,24	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD	2,24	
Azioni a Distribuzione di Classe A in JPY (M) Plus (e)	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in NOK (coperte)	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	2,34	
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (S)	2,34	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)	2,34	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	1,34	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (S)	1,34	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (M) Plus (e)	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (S)	1,24	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in CHF (coperte)	1,24	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	1,24	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	1,24	
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (A) (Copertura)	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (M) (Copertura)	1,24	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	1,23	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (coperte)	1,24	
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) Plus (Copertura) (e)	1,24	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in SGD (coperte)	1,23	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	1,08	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (S)	1,09	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier AUD (coperte)	1,08	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in AUD (S) (Copertura)	1,09	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (coperte)	1,09	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier CHF (Copertura)	1,09	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in CHF (S) (Copertura)	1,08	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	1,09	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	1,09	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (S) (Copertura)	1,08	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	1,09	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura)		
Plus (e)	1,08	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier JPY (coperte)	1,08	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in PLN (Copertura)	1,08	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier SEK (coperte)	1,08	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	0,71	
Azioni ad accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	0,69	
Azioni a Distribuzione di Classe LM in AUD (S) (Copertura)	0,09	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	0,09	
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,51	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	1,51	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,51	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	2,05	
Azioni a Distribuzione di Classe X in CHF (M) (Copertura)	0,89	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura)		
Plus (e)	0,72	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	0,52	
Azioni ad accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	0,51	
Azioni ad accumulazione di Classe S in GBP (Copertura)	0,51	
Azioni ad accumulazione di Classe LM in EUR (Copertura)	0,12	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in GBP (Copertura)	0,11	
Azioni ad accumulazione di Classe LM in CAD (Copertura)	0,12	
Azioni a Distribuzione di Classe S in CHF (A)	0,52	
Azioni a Distribuzione di Classe S in CHF (Coperte)	0,51	
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe D in EUR (Copertura)	1,45	
Azioni a Distribuzione di Classe D in EUR (M) (Copertura)	1,45	
Azioni ad Accumulazione di Classe D in USD	1,45	
Azioni a Distribuzione di Classe D in USD (M)	1,45	
Azioni a Distribuzione di Classe D in USD (M) Plus	1,45	
Azioni ad Accumulazione di Classe M in CHF (Copertura)	0,85	
Azioni a Distribuzione di Classe M in USD (M)	0,85	
Azioni ad Accumulazione di Classe M in EUR (Copertura)	0,85	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,70	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (Q)	0,70	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,70	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (Q) (Copertura)	0,70	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura)		
Plus (e)	0,70	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier JPY (coperte)	0,70	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	0,10	
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	1,26	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,40	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	0,10	
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in GBP	1,10	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP	0,59	
Azioni a Distribuzione di Classe LM in GBP (M)	0,14	
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,08	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,44	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	0,35	
Azioni a Distribuzione di Classe LM in GBP (M) (Copertura)	0,14	
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]		
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (Q)	n/a	
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,15	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	0,75	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,50	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in BRL (Copertura)	0,50	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,50	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	0,50	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	0,40	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	0,40	
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	1,38	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (S)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A (M) in AUD (Copertura) Plus	1,37	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,37	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura) (IH)	1,37	
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (Q) (Copertura)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (S)	1,37	
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (S) (Copertura) (IH)	1,37	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in GBP	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) (Copertura)	1,37	
Azioni a distribuzione di Classe A in GBP (S) (Copertura) (IH)	1,37	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD	1,39	
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	1,64	
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (S)	1,62	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	1,87	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (S)	1,87	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	1,98	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura) (IH)	1,97	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	0,96	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (S)	0,97	
Azioni a Distribuzione di Classe R in GBP (S) (Copertura) (IH)	0,97	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	0,87	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (S)	0,87	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	0,87	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura) (IH)	0,87	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	0,87	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (Copertura)	0,87	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (Copertura) (IH)	0,87	
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (S) (Copertura)	0,87	
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (S) (Copertura) (IH)	0,87	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,72	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (S)	0,72	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	0,72	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,72	
Azioni ad accumulazione di Classe S in EUR (Copertura) (IH)	0,72	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	0,73	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura)	0,72	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (S) (Copertura) (IH)	0,72	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	0,12	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD (Copertura) (IH)	0,12	

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Informazioni supplementari - Total Expense Ratio (TER) - (continua)

	Rapporto tra il totale delle operazioni Spese in CU(1) e media Patrimonio netto giornaliero del fondo in CU(1)(%) Per il periodo chiuso il 31 agosto 2023**	Rapporto tra il totale delle operazioni Spese in CU(1) e media Patrimonio netto giornaliero del fondo in CU(1)(%) Per il periodo chiuso il 31 agosto 2023**
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,60	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	1,60	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,60	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD	1,61	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	2,11	
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (A)	2,20	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	1,20	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1,15	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (coperte)	1,15	
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) (Copertura)	1,15	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	1,00	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	1,00	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (A) (Copertura)	1,00	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura)	1,00	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	0,10	
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,39	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	1,39	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,75	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura) (IH)	0,74	
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (A) (Copertura) (IH)	0,48	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in CAD (Copertura)	0,50	
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,42	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M)	1,42	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,45	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD	1,42	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	1,92	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	2,02	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	1,02	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (M)	1,02	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	0,92	
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) (Copertura)	0,91	
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) (Copertura) (IH)	0,92	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,77	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura) (IH)	0,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in NZD (Copertura) (IH)	0,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	0,11	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in NZD (Copertura) (IH)	0,12	
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (D)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	1,37	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in AUD (coperte)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A (M) in AUD (Copertura) Plus	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura)	1,37	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1,40	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (Q) (Copertura)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) Plus (Copertura)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) Plus (Copertura) (e)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) Plus (Copertura)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) Plus (Copertura) (e)	1,37	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in HKD	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura) (e)	1,37	
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus	1,37	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	1,87	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (D)	1,87	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CZK (Coperte)	1,37	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	1,97	
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (D)	1,97	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)	1,97	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	0,92	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (D)	0,92	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	0,75	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (D)	0,72	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (M) Plus (e)	0,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	0,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	0,74	
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (M) Plus (Copertura) (e)	0,74	
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) Plus (Copertura) (e)	0,75	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,59	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (M) Plus (e)	0,59	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (coperte)	0,59	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,59	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (M) Plus (Copertura) (e)	0,59	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (M) (Copertura) Plus (e)	0,57	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier SEK (coperte)	0,59	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	0,47	
Azioni a Distribuzione di Classe S in US\$ (Q) Plus (e)	0,47	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	0,47	
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (M) Plus (Copertura) (e)	0,47	
Azioni a Distribuzione di Classe S in GBP (M) Plus (Copertura) (e)	0,47	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	0,12	
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (M)	0,12	
Azioni a Distribuzione di Classe LM in EUR (Q) Plus (Copertura) (e)	0,12	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in GBP (Copertura)	0,12	
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,94	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (M)	1,45	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	1,30	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	0,15	
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	2,28	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (Copertura)	2,28	
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (M) Plus (Copertura) (e)	1,45	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in AUD (Copertura)	0,14	
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]		
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	1,40	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	0,50	
Azioni a Distribuzione di Classe S in EUR (M) Plus (Copertura) (e)	0,51	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP (Copertura)	0,48	

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Informazioni supplementari - Total Expense Ratio (TER) - (continua)

	Rapporto tra il totale delle operazioni Spese in CU(1) e media Patrimonio netto giornaliero del fondo in CU(1)(%) Per il periodo chiuso il 31 agosto 2023**	Rapporto tra il totale delle operazioni Spese in CU(1) e media Patrimonio netto giornaliero del fondo in CU(1)(%) Per il periodo chiuso il 31 agosto 2023**
FTGF ClearBridge Value Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,81	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	1,81	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1,81	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,81	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A) (Copertura)	1,81	
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (A)	1,81	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD	1,81	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (Copertura)	1,81	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	2,31	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	2,31	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	2,56	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	1,21	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)	1,20	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1,13	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)	1,13	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	1,13	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,78	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)	0,78	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	0,78	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,78	
Azioni a Distribuzione di Classe LM in USD (A)	0,11	
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1,76	
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	2,23	
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (A)	2,23	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	2,23	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	2,23	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	2,51	
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (A)	2,51	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	1,16	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)	1,16	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)	1,13	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	1,13	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,79	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)	0,79	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	0,78	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	0,16	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	0,17	
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	1,41	
Azioni ad Accumulazione di Classe B (G) in USD	2,35	
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	1,91	
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in USD	1,58	
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in EUR	1,58	
Azioni a Distribuzione di Classe GA in EUR (A)	1,58	
Azioni ad Accumulazione di Classe GE in USD	2,33	
Azioni ad Accumulazione di Classe GE in EUR	2,33	
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,70	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	1,70	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1,70	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,70	
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	2,20	
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (A)	2,20	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	2,20	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	2,20	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	2,45	
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (A)	2,46	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	1,10	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)	1,10	
Azioni ad Accumulazione di Classe U in USD	0,63	
Azioni ad Accumulazione di Classe U in EUR	0,63	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	1,08	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	1,08	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	1,08	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	1,08	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,73	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)	0,73	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (coperte)	0,73	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	0,73	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,73	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (A)	0,73	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP	0,73	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in USD	0,11	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	0,11	
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	1,35	
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	1,85	
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in USD	1,52	
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in EUR	1,52	
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,77	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	1,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in AUD (coperte)	1,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CHF (Copertura)	1,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CNH (coperte)	1,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,77	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (Q) (Copertura)	1,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in GBP	1,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in HKD	1,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (coperte)	1,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (Copertura)	1,78	
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (A)	2,30	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	2,27	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	2,27	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	2,52	
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (A)	2,52	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR	2,52	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)	2,52	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	1,17	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)	1,17	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1,12	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)	1,12	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	1,12	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	1,12	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	1,12	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,75	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	0,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,79	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP	0,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	0,77	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (A)	0,77	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	0,12	
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	1,42	
Azioni ad Accumulazione di Classe B (G) in USD	1,92	
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	1,92	
Azioni ad Accumulazione di Classe GA in EUR	1,54	
Azioni a Distribuzione di Classe GA in EUR (A)	1,54	
Azioni ad Accumulazione di Classe GE in USD	2,29	
Azioni ad Accumulazione di Classe GE in EUR	2,29	
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (Q)	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) Plus (Copertura)	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) Plus (Copertura) (e)	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus	1,74	
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	1,74	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	2,24	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	2,24	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (Q)	2,24	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	1,14	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in EUR	1,14	
Azioni a Distribuzione di Classe F in EUR (A)	1,14	
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (M) Plus (Copertura) (e)	1,12	
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,66	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	1,66	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1,66	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,65	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK	1,50	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	1,06	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1,06	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)	1,06	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	1,06	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	1,06	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	1,06	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (Copertura)	1,05	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,70	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)	0,71	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	0,75	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,71	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP	0,71	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	0,51	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR	0,51	
Azioni ad accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	0,51	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP	0,51	
Azioni ad accumulazione di Classe S in GBP (Copertura)	0,51	
Azioni a Distribuzione di Classe S in GBP (Q)	0,51	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	0,11	

^ Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Informazioni supplementari - Total Expense Ratio (TER) - (continua)

	Rapporto tra il totale delle operazioni Spese in CU(1) e media Patrimonio netto giornaliero del fondo in CU(1)(%) Per il periodo chiuso il 31 agosto 2023**	Rapporto tra il totale delle operazioni Spese in CU(1) e media Patrimonio netto giornaliero del fondo in CU(1)(%) Per il periodo chiuso il 31 agosto 2023**
FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,79	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,80	
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,95	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD (Copertura)	1,95	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (Copertura)	1,95	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (Q)	1,95	
Azioni a Distribuzione di Classe A (M) in AUD (Copertura) Plus	1,95	
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) (Coperte) Plus	1,95	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1,95	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura) (PH)	1,95	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A)	1,95	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) Plus	1,95	
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	1,95	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	2,45	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD (Copertura)	2,45	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	2,70	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD (Copertura)	2,70	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR	2,75	
Azioni a Distribuzione di Classe E in EUR (A)	2,75	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	1,35	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD (Copertura)	1,35	
Azioni ad Accumulazione di Classe U in EUR	0,71	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1,05	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)	1,05	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	1,05	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura) (PH)	1,05	
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (Q)	1,05	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,85	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in BRL (Copertura)	0,85	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in CAD (Q) (Copertura) 0,85 (PH) Plus (e)	0,85	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	0,85	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura) 0,85 (PH)	0,85	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP	0,85	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (A) (Copertura) 0,85 (PH) Plus (e)	0,85	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (Q)	0,85	
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,96	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus	1,96	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	1,96	
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)	1,96	
Azioni a Distribuzione di Classe A in CNH (M) (Coperte) Plus	1,97	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A) Plus (e)	1,97	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) Plus (Copertura)	1,97	
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (M) Plus (Copertura)	1,97	
Azioni a Distribuzione di Classe A in HKD (M) Plus	1,96	
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus (Copertura)	1,96	
Azioni ad Accumulazione di Classe U in USD	0,72	
Azioni ad Accumulazione di Classe U in EUR	0,72	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (Q) Plus (e)	0,72	
Azioni ad Accumulazione di Classe U in GBP	0,72	
Azioni ad Accumulazione di Classe U in GBP (Copertura)	0,72	
Azioni a Distribuzione di Classe U in GBP (Q) Plus (Copertura) (e)	0,72	
Azioni a Distribuzione di Classe U in GBP (Q) Plus (e)	0,71	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (M) Plus (e)	1,21	
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (M) (Copertura)	1,22	
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (Q) Plus (Copertura) (e)	1,22	
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (Q) Plus (Copertura) (e)	1,22	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,86	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (M) Plus	0,86	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in EUR (M) (Copertura)	0,87	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	0,52	
Azioni a Distribuzione di Classe S in USD (M) Plus	0,51	
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,96	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	1,96	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in AUD (coperte)	1,96	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in CNH (coperte)	1,96	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1,96	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,96	
Azioni a distribuzione di Classe A in EUR (Q) (Copertura)	1,96	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in GBP (coperte)	1,96	
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (A)	1,96	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (coperte)	1,96	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SGD (Copertura)	1,96	
Azioni ad Accumulazione di Classe B in USD	2,46	
Azioni a Distribuzione di Classe B in USD (A)	2,46	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	2,46	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	2,46	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	2,71	
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (A)	2,71	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR	2,71	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR (Copertura)	2,71	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	1,36	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)	1,36	
Azioni ad Accumulazione di Classe R in USD	0,90	
Azioni ad Accumulazione di Classe R in EUR	1,46	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1,21	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)	1,21	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	1,21	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR (Copertura)	1,21	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	1,21	
Azioni a Distribuzione di Classe X in GBP (A)	1,21	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,86	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier BRL (coperte)	0,86	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	0,86	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR (Copertura)	0,86	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP	0,86	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in PLN (Copertura)	0,86	
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,99	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (A)	2,04	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	2,04	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	2,04	
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A)	2,04	
Azioni a Distribuzione di Classe A in GBP (A)	2,04	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in SEK (coperte)	2,00	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	2,49	
Azioni a Distribuzione di Classe C in USD (A)	2,53	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	2,79	
Azioni a Distribuzione di Classe E in USD (A)	2,79	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in EUR	2,79	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	1,43	
Azioni a Distribuzione di Classe F in USD (A)	1,43	
Azioni ad Accumulazione di Classe R in USD	1,54	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1,29	
Azioni a Distribuzione di Classe X in USD (A)	1,28	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,92	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in USD (A)	0,94	
Azioni a Distribuzione di Classe Premier in GBP (A)	0,94	
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in EUR	0,19	
Azioni ad Accumulazione di Classe A (G) in USD	1,44	
Azioni ad Accumulazione di Classe L (G) in USD	1,93	
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	2,00	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1,23	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	1,25	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,90	
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]		
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,98	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1,98	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR (Copertura)	1,98	
Azioni ad Accumulazione di Classe C in USD	2,48	
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	2,73	
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	1,38	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1,23	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	1,23	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP	1,23	
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (coperte)	1,23	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,88	
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in GBP (Copertura)	0,88	
Azioni ad accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	0,53	
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP	0,53	

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.
[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Informazioni supplementari - Total Expense Ratio (TER) - (continua)

**Rapporto tra il totale delle operazioni
Spese in CU(1) e media
Patrimonio netto giornaliero
del fondo in CU(1)(%)
Per il periodo chiuso il
31 agosto 2023****

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	
Azioni a Distribuzione di Classe A in USD (M) Plus (e)	2,00
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus	2,00
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (M) Plus (e)	2,00
Azioni a Distribuzione di Classe A in SGD (M) Plus	1,99
Azioni a Distribuzione di Classe A in AUD (M) Plus (Copertura)	1,59
Azioni a Distribuzione di Classe D in CNH (M) Plus (Copertura)	1,60
Azioni a Distribuzione di Classe D in HKD (M) Plus	1,60
Azioni a Distribuzione di Classe D in SGD (M) Plus (Copertura)	1,60
Azioni a Distribuzione di Classe D in USD (M) Plus	1,60
Azioni ad Accumulazione di Classe D in USD	1,60
Azioni ad Accumulazione di Classe X in AUD	1,25
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1,25
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP	0,59
Azioni a Distribuzione di Classe S in GBP (M) Plus (e)	0,59
Azioni ad Accumulazione di Classe LM in AUD	0,15
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	1,99
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD	2,74
Azioni ad Accumulazione di Classe F in USD	1,39
Azioni ad Accumulazione di Classe X in USD	1,25
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in USD	0,90
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	0,70
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR	0,70
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD (Copertura)	1,97
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	1,97
Azioni ad Accumulazione di Classe E in USD (Copertura)	2,72
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	1,22
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in BRL (Copertura)	0,87
Azioni ad Accumulazione di Classe Premier in EUR	0,87
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	0,50
Azioni ad Accumulazione di Classe S in EUR	0,47
Azioni ad Accumulazione di Classe S in GBP	0,47
FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in USD	2,00
Azioni ad Accumulazione di Classe X in GBP (Copertura)	1,25
Azioni ad Accumulazione di Classe S in USD	0,15
Azioni ad accumulazione di Classe S in EUR (Copertura)	0,15
Azioni ad accumulazione di Classe S in GBP (Copertura)	0,15
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]	
Azioni ad Accumulazione di Classe A in EUR	0,74
Azioni a Distribuzione di Classe A in EUR (A)	0,74
Azioni ad Accumulazione di Classe D in EUR	1,29
Azioni a Distribuzione di Classe D in EUR	1,29
Azioni ad Accumulazione di Classe X in EUR	0,34
Azioni a Distribuzione di Classe X in EUR (A)	0,34

Il metodo di calcolo del Total Expense Ratios (TER) è descritto sul sito web dell'Asset Management Association Switzerland (AMAS) (www.am-switzerland.ch).

(1) CU = Currency units in the Fund's accounting currency.

** Annualised for periods less than one year.

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio

Per l'esercizio chiuso al 31 agosto 2023

In conformità ai Regolamenti OICVM, viene riportato un prospetto delle principali variazioni intervenute nella composizione del Portafoglio degli investimenti di ciascun Fondo durante l'esercizio in esame al fine di assicurare che gli azionisti possano identificare i cambiamenti negli investimenti detenuti da ciascun Fondo. Sono definiti come gli acquisti e le vendite aggregati di un investimento (comprese le scadenze, ma escluse le operazioni di pronti contro termine, i titoli a sconto overnight e i depositi a termine, utilizzati principalmente per garantire una gestione efficiente del portafoglio) che superano l'1,00% del valore totale degli acquisti e delle vendite del periodo. Vengono elencati almeno i venti acquisti e le venti vendite di entità più significativa. Qualora un Fondo abbia perfezionato meno di venti operazioni di acquisto o di vendita nel corso dell'esercizio in esame, sono riportate tutte le operazioni.

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDETE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 26/06/2023	42.382	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 26/06/2023	42.400
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 21/06/2023	40.505	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 21/06/2023	40.600
United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 18/05/2022	37.892	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 18/05/2022	37.900
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 14/03/2023	34.996	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 14/03/2023	35.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 15/05/2023	34.986	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 15/05/2023	35.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 13/03/2023	32.288	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 13/03/2023	32.300
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 18/08/2023	29.617	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 18/08/2023	30.000
Federal Home Loan Banks, serie 0002, 5,330%, scadenza 25/09/2023	26.198	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 16/05/2023	25.300
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 15/03/2023	24.997	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 15/03/2023	25.000
United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 06/06/2023	24.838	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 16/03/2023	25.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 16/05/2023	25.264	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 06/06/2023	25.000
Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,450%, scadenza 20/03/2024	25.001	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 14/03/2023	25.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 17/09/2023	21.431	Federal Home Loan Banks, 4,600%, 01/03/2023 FRN	22.900
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 25/05/2023	21.103	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 17/09/2023	21.500
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 26/07/2023	20.512	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 25/05/2023	21.200
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 26/07/2023	20.047	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 24/05/2023	21.000
Federal Home Loan Banks, 5,420%, scadenza 14/03/2024	20.008	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 19/05/2023	20.600
Federal Home Loan Banks, 4,630%, scadenza 14/06/2023	20.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 26/07/2023	20.515
United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 07/11/2023	19.953	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 26/07/2023	20.310
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 03/05/2023	19.925	Federal Farm Credit Discount, zero coupon, scadenza 08/03/2023	20.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 27/06/2023	19.897	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 03/05/2023	20.000
		Federal Home Loan Banks, 4,850%, 03/05/2023 FRN	20.000
		Federal Home Loan Banks, 4,910%, 06/04/2023 FRN	20.000
		Federal Home Loan Banks, 5,130%, scadenza 14/06/2023 FRN	20.000
		United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 08/10/2023	20.000
		United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 07/11/2023	20.000
		United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 31/08/2022	20.000
		United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 04/04/2023	19.981
		Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 27/06/2023	19.900
		Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 17/05/2023	19.897
		Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 2,610%, scadenza 09/06/2023	19.000

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDETE PRINCIPALI	RICAVI (in 000's) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	57.041	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	48.014
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	8.458	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	8.448
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/05/2053	7.752	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	7.472
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	7.473	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	5.537
United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/07/2028	6.091	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	4.425
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	5.565	United States Treasury Note/Bond, 3,875%, scadenza 31/12/2027	4.079
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	4.434	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	4.042
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	4.004	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	3.994
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	3.903	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	3.666
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 2,500%	3.731	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	3.519
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	3.678	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	3.500
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	3.560	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	3.114
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	3.514	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	2.775
United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/08/2030	3.323	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	2.518
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	3.149	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 5,000%	2.427
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/05/2028	3.063	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	2.302
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	2.782	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	2.147
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	2.518	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	2.113
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,000%	2.493	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	2.087
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 5,500%	2.460	United States Treasury Note/Bond, 0,000%, scadenza 18/04/2053	2.050

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDETE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	27.049	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	27.473
United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 29/02/2028	24.520	United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 29/02/2028	24.827
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/05/2028	23.945	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/05/2028	23.890
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,500%	17.327	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	22.824
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 4,000%	16.648	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 3,000%	17.858
United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/08/2030	16.384	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,500%	17.546
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 4,500%	14.862	United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 31/01/2028	17.256
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	14.791	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 4,000%	16.606
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,000%	14.248	United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/08/2030	16.388
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	12.993	United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/01/2025	15.342
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 4,000%	12.086	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 4,500%	14.970
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 4,000%	12.003	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	14.797
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 4,500%	11.358	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,000%	14.316
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	11.315	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	12.927

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

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

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDETE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,000%	11.266	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,000%	12.343
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	11.204	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 4,000%	12.325
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	11.115	United States Treasury Note/Bond, 4,500%, scadenza 30/11/2024	12.322
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,000%	11.013	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 4,000%	11.891
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/05/2053	10.613	United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 28/03/2023	11.650
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,000%	10.494	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	11.508
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 4,000%	10.276	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, scadenza 08/03/2023	11.450
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 5,000%	9.497	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 4,500%	11.380
		Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	11.321
		Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,000%	11.285
		Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	11.280
		Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,000%	11.203

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) €	VENDETE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) €
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	6.852	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, scadenza 15/02/2031	9.825
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700%, scadenza 15/08/2032	1.971	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	6.965
Goldman Sachs Group Inc/The, 0,875%, scadenza 09/05/2029	1.220	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700%, scadenza 15/08/2032	2.349
Bundesrepublik Deutschland, 0,000%, scadenza 10/04/2026	900	Netherlands Government Bond, 144A, 0,000%, scadenza 15/07/2030	1.895
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	829	Spain Government Bond, Serie 30 anni, 144A, 2,700%, scadenza 31/10/2048	1.788
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	816	French Republic Government Bond OAT, 3,250%, scadenza 25/05/2045	1.745
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	786	French Republic Government Bond OAT, 0,000%, scadenza 25/11/2030	1.676
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	708	Buoni Poliennali Del Tesoro dell'Italia, serie 31 anni, 144A 3,250%, scadenza 01/09/2046	1.640
Vodafone Group Plc, 2,875%, scadenza 20/11/2037	694	Mexico Government International Bond, 4,600%, scadenza 23/01/2046	1.435
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	684	Buoni Poliennali Del Tesoro dell'Italia, serie CPI, 144A 0,400%, scadenza 15/05/2030	1.421
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	629	Meccanismo di stabilità europeo, serie EUR, 0,750%, scadenza 05/09/2028	1.247
Bundesrepublik Deutschland, 4,25%, scadenza 04/07/2039	618	HSBC Holdings Plc, 3,019%, scadenza 15/06/2027	1.245
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	593	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000%, scadenza 01/11/2028	1.196
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	522	NatWest Group Plc, 2,500%, scadenza 22/03/2023	1.190
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	447	Republic of Austria Government Bond, 144A, 0,900%, scadenza 20/02/2032	1.076
Bundesrepublik Deutschland, 0,000%, scadenza 15/08/2052	377	Wells Fargo & Co, 2,250%, scadenza 02/05/2023	1.050
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	338	Kingdom of Belgium Government Bond, Serie 71, 3,750%, scadenza 22/06/2045	953
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	328	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	827
Cellnex Finance Co SA, 2,000%, scadenza 15/09/2032	308	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	816
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	267	Republic of South Africa Government International Bond, 4,300%, scadenza 12/10/2028	811
		French Republic Government Bond OAT, 0,750%, scadenza 25/05/2028	798
		Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	793
		Svenska Handelsbanken AB, 1,250%, scadenza 02/03/2028	760
		French Republic Government Bond OAT, 1,000%, scadenza 25/05/2027	744
		Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	704

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDETE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/10/2027	11.729	Mexican Bonos, Serie M, 7,750%, scadenza 13/11/2042	4.021
Mexico Government International Bond, 8,500%, scadenza 31/05/2029	4.019	JPMorgan Chase & Co, Serie U, 6,125%, Perpetuo	1.743
United States Treasury Note/Bond, 2,000%, scadenza 15/11/2026	3.981	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250%, scadenza 15/08/2027	1.522
United States Treasury Note/Bond, 0,625%, scadenza 31/03/2027	1.964	Gabon Government International Bond, 144A, 7,000%, scadenza 24/11/2031	1.290
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250%, scadenza 15/08/2027	1.513	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250%, scadenza 27/04/2029	1.278
United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 15/11/2042	1.417	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800%, scadenza 21/07/2023	1.162
Vodafone Group Plc, 8,000%, scadenza 30/08/2086	1.252	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc - Western Asset European Loan Fund - Classe LM ad accumulazione in Euro	1.141
Banco Santander SA, 5,750%, scadenza 23/08/2033	1.083	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875%, scadenza 15/01/2028	1.085
Sedgwick Claims Management Services Inc, 8,324%, scadenza 17/02/2028	913	Vale Overseas Ltd, 6,250%, scadenza 10/08/2026	1.079
Intesa Sanpaolo SpA, 6,500%, scadenza 14/03/2029	908	Transportadora de Gas del Perú SA, 4,250%, scadenza 30/04/2028	1.066
Altice Financing SA/France, 2,250%, scadenza 15/01/2025	817	Deutsche Bank AG, 4,000%, scadenza 24/06/2026	1.031
Altice France SA, 2,125%, scadenza 15/02/2025	811	Credit Suisse Group AG, 6,373%, scadenza 15/07/2026	1.030
Via Celere Desarrollos Inmobiliari, 5,250%, scadenza 01/04/2036	761	Match Group Holdings II LLC, 144A, 5,000%, scadenza 15/12/2027	1.018
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000%, scadenza 01/01/2027	625	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000%, scadenza 01/05/2025	951
Republic of South Africa Government International Bond, 6,500%, scadenza 28/02/2041	613	Sedgwick Claims Management Services Inc, 5,622%, scadenza 31/12/2025	913
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/03/2028	501	DP World Ltd/Emirati Arabi Uniti, 5,625%, scadenza 25/09/2048	892
Connecticut Avenue Securities Trust, Serie 2041, 8,169%, scadenza 25/10/2041	452	Intesa Sanpaolo SpA, 6,375%, Perpetual	886
Indonesia Treasury Bond, Serie FR59, 7,000%, scadenza 15/05/2027	401	Renk AG/Frankfurt am Main, 5,750%, scadenza 15/07/2025	869
Connecticut Avenue Securities Trust, Serie 2043, 0,000%, scadenza 25/06/2043	390	Clarios Global LP, 5,622%, scadenza 30/04/2026	811
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/05/2053	376	IPD 3 BV, 5,500%, scadenza 01/12/2025	639
		Castor SpA, 6,000%, scadenza 15/02/2029	575
		Cidron Aida Finco Srl, 6,250%, scadenza 01/04/2028	565
		Panama Government International Bond, 4,500%, scadenza 01/04/2056	499
		CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500%, scadenza 01/06/2033	453
		Sands China Ltd, 3,100%, scadenza 03/08/2029	448
		Delta Air Lines Inc, 7,375%, scadenza 15/01/2026	445
		Icici Bank Ltd/Dubai, 4,000%, scadenza 18/03/2026	405
		Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4,375%, scadenza 15/01/2028	403
		Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750%, scadenza 20/10/2028	385
		Navient Corp, 5,875%, scadenza 25/10/2024	335
		Antofagasta Plc, 2,375%, scadenza 14/10/2030	333

^ Non autorizzato alla vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF Western Asset US High Yield Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Classe WA (Distribuzione)	17.354	18.872
Open Text Corp, 144A, 6,900%, scadenza 01/12/2027	1.543	1.499
ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125%, scadenza 14/04/2030	952	1.345
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625%, scadenza 01/06/2031	938	897
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710%, scadenza 15/01/2026	674	787
LifePoint Health Inc, 144A, 9,875%, scadenza 15/08/2030	610	715
Las Vegas Sands Corp, 3,200%, scadenza 08/08/2024	581	641
DCert Buyer, Inc., 12,331%, scadenza 16/02/2029	569	629
GFL Environmental Inc, 144A, 4,750%, scadenza 15/06/2029	553	623
Lloyds Banking Group Plc, 8,000%, Perpetuo	501	
R.R. Donnelley, 14,500%, scadenza 08/03/2028	485	
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125%, scadenza 15/09/2031	460	
Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875%, scadenza 15/08/2027	439	
Royal Caribbean Cruises Ltd, 3,700%, scadenza 15/03/2028	375	
Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,375%, scadenza 15/07/2027	364	
Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250%, scadenza 01/07/2031	345	
US Renal Care Inc, 144A, 10,625%, scadenza 28/06/2028	344	
Credit Agricole SA, 144A, 8,125%, perpetuo	322	
Toronto-Dominion Bank/The, 8,125%, scadenza 03/10/2082	320	
BNP Paribas SA, 144A, 7,750%, perpetuo	309	
VENDITE PRINCIPALI		
Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Classe WA (Distribuzione)		18.872
Open Text Corp, 144A, 6,900%, scadenza 01/12/2027		1.499
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875%, scadenza 15/10/2027		1.345
Ford Motor Co, 6,100%, scadenza 19/08/2032		897
Western Midstream Operating LP 5,450%, scadenza 01/04/2044		787
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875%, scadenza 01/11/2033		715
Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250%, scadenza 15/08/2026		641
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125%, scadenza 09/05/2029		629
Occidental Petroleum Corp, 8,875%, scadenza 15/07/2030		623
Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500%, scadenza 20/06/2027		622
Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000%, scadenza 15/05/2025		620
US Renal Care Inc, 144A, 10,625%, scadenza 15/07/2027		606
StoneMor Inc, 144A, 8,500%, scadenza 15/05/2029		600
Bombardier Inc, 144A, 7,875%, scadenza 15/04/2027		577
DCert Buyer, Inc., 9,372%, scadenza 16/02/2029		569
Diversified Healthcare Trust, 9,750%, scadenza 15/06/2025		553
Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875%, scadenza 15/08/2027		541
Transocean Inc, 144A, 8,750%, scadenza 15/02/2030		527
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500%, scadenza 01/05/2032		504
Carriage Services Inc, 144A, 4,250%, scadenza 15/05/2029		502

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	PROVENTI (in migliaia) \$
United States Treasury Note/Bond, 0,750%, scadenza 30/04/2026	905	
ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875%, scadenza 14/04/2028	578	
United Rentals North America Inc, 3,875%, scadenza 15/11/2027	512	
United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 15/02/2033	502	
Altice Financing SA, 144A, 5,750%, scadenza 15/08/2029	501	
Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375%, scadenza 01/05/2025	499	
Panama Government International Bond, 2,252%, scadenza 29/09/2032	498	
Vodafone Group Plc, 4,125%, scadenza 30/05/2025	395	
GFL Environmental Inc, 144A, 4,250%, scadenza 01/06/2025	386	
American Airlines Group Inc, 144A, 3,750%, scadenza 01/03/2025	384	
Nigeria Government International Bond, 144A, 7,143%, scadenza 23/02/2030	270	
Colombia Government International Bond, 3,125%, scadenza 15/04/2031	261	
Lloyds Banking Group Plc, 8,000%, Perpetuo	253	
Comerica Bank, 2,500%, scadenza 23/07/2024	253	
CSC Holdings LLC, 11,250%, scadenza 15/05/2028	250	
Ritchie Bros Holdings Inc, 144A, 7,750%, scadenza 15/03/2031	250	
United States Treasury Bill, zero coupon, scadenza 09/05/2023	249	
Mexico Government International Bond, 2,659%, scadenza 24/05/2031	249	
T-Mobile USA Inc, 2,625%, scadenza 15/04/2026	235	
Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750%, Perpetuo	219	
Turkey Government International Bond, 4,875%, scadenza 16/04/2043	208	
ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125%, scadenza 14/04/2030	203	
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625%, scadenza 01/06/2031	200	
Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303%, scadenza 30/05/2024	196	
Delta Air Lines Inc, 2,900%, scadenza 28/10/2024	193	
Service Corp International/US, 5,125%, scadenza 01/06/2029	187	
Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250%, scadenza 27/04/2029	185	
Dominican Republic International Bond, 4,875%, scadenza 23/09/2032	182	
Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875%, 01/09/2026	179	
CSC Holdings LLC, 144A, 3,375%, scadenza 15/02/2031	172	
Titan International Inc, 7,000%, scadenza 30/04/2028	159	
Ashtead Capital Inc, 144A, 2,450%, scadenza 12/08/2031	156	
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198%, scadenza 01/06/2032	151	
Bombardier Inc, 144A, 7,125%, scadenza 15/06/2026	148	
Southwestern Energy Co, 5,375%, scadenza 15/03/2030	135	
Ecopetrol SA, 5,875%, scadenza 28/05/2045	132	
Gatwick Airport Finance Plc, 4,375%, scadenza 07/04/2026	119	
Las Vegas Sands Corp, 3,200%, scadenza 08/08/2024	116	
VENDITE PRINCIPALI		
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, scadenza 01/10/2026		992
Ford Motor Credit Co LLC, 2,900%, scadenza 16/02/2028		765
VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000%, scadenza 15/01/2032		631
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250%, scadenza 15/01/2034		598
Turkey Government International Bond, 4,250%, scadenza 14/04/2026		539
Saga Plc, 5,500%, scadenza 15/07/2026		508
United States Treasury Note/Bond, 0,750%, scadenza 31/12/2023		487
United States Treasury Note/Bond, 1,875%, scadenza 28/02/2027		470
Carriage Services Inc, 144A, 4,250%, scadenza 15/05/2029		440
Level 3 Financing Inc, 144A, 3,625%, scadenza 15/01/2029		364
NCL Finance Ltd, 144A, 6,125%, scadenza 15/03/2028		344
Sands China Ltd, 3,500%, scadenza 08/08/2031		332
United States Treasury Note/Bond, 0,750%, scadenza 30/04/2026		318
Carnival Corp, 144A, 10,500%, scadenza 01/06/2030		296
United Airlines Inc, 144A, 4,625%, scadenza 15/04/2029		288
MGM China Holdings Ltd, 144A, 4,750%, scadenza 01/02/2027		255
Ghana Government International Bond, 144A, 10,750%, scadenza 14/10/2030		246
CSC Holdings LLC, 11,250%, scadenza 15/05/2028		243
Altice France SA/France, 144A, 5,500%, scadenza 15/10/2029		223
Credit Suisse Group AG, 144A, 6,537%, scadenza 12/08/2033		218
United States Treasury Note/Bond, 1,500%, scadenza 29/02/2024		195
Altice France Holding SA, 144A, 6,000%, scadenza 15/02/2028		191
NCL Corp Ltd, 144A, 3,625%, scadenza 15/12/2024		191
Dominican Republic International Bond, 144A, 6,000%, scadenza 22/02/2033		189
APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625%, scadenza 15/01/2027		186
Wheel Bidco Ltd, 6,750%, scadenza 15/07/2026		185
StoneMor Inc, 144A, 8,500%, scadenza 15/05/2029		180
Marks & Spencer Plc, 3,750%, scadenza 19/05/2026		173
Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375%, scadenza 04/12/2029		167
Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625%, scadenza 01/10/2031		166
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250%, scadenza 15/08/2027		157
Ford Motor Co, 3,250%, scadenza 12/02/2032		152
Altice Financing SA, 144A, 5,000%, scadenza 15/01/2028		151
ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875%, scadenza 14/04/2028		150
Southwestern Energy Co, 5,375%, scadenza 15/03/2030		139
Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc - Western Asset European Loan Fund - Classe LM ad accumulazione in Euro		136
Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 6,375%, scadenza 01/09/2037		129

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Classe WA (Distribuzione)	74.563	75.780
Singapore Government Bond, 2,625%, scadenza 01/08/2032	11.183	8.856
Indonesia Treasury Bond, Serie FR89, 6,875%, scadenza 15/08/2051	10.613	8.524
European Bank for Reconstruction & Development, 5,150%, scadenza 16/02/2024	9.564	7.920
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 07/07/2023	8.924	7.880
United States Treasury Note/Bond, 1,250%, scadenza 31/07/2023	7.914	7.607
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 21/07/2023	7.846	7.413
Australia Government Bond, 3,750%, scadenza 21/04/2037	6.514	6.896
VENDITE PRINCIPALI		
Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Classe WA (Distribuzione)		75.780
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 07/07/2023		8.856
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 04/10/2023		8.524
United States Treasury Note/Bond, 1,250%, scadenza 31/07/2023		7.920
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 21/07/2023		7.880
Korea Treasury Bond, Serie 2409, 3,125%, scadenza 10/09/2024		7.607
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 10/03/2023		7.413
United Overseas Bank Ltd, 3,875%, Perpetual		6.896

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – (segue)

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDETE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 28/04/2023	4.506	Indonesia Treasury Bond, Series FR56, 8,375%, scadenza 15/09/2026	6.868
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 23/06/2023	4.478	Mercatus Co-operative Ltd, Serie DMTN, 2,800%, scadenza 26/07/2024	6.752
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 31/03/2023	4.288	Korea Treasury Bond, Serie 3206, 3,375%, scadenza 10/06/2032	6.604
HSBC Holdings Plc, 5,300%, scadenza 14/03/2023	3.692	Malaysia Government Bond, Serie 0411, 4,232%, scadenza 30/06/2031	6.157
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 13/10/2023	3.445	United States Treasury Note/Bond, 0,125%, scadenza 15/12/2023	5.192
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 15/09/2023	2.949	India Government Bond, 7,380%, scadenza 20/06/2027	4.857
Vietnam Government International Bond, 4,800%, scadenza 19/11/2024	2.947	United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/02/2048	4.679
Korea Electric Power Corp, 5,375%, scadenza 31/07/2026	2.595	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 28/04/2023	4.497
Banca Mandiri, 5,500%, scadenza 04/04/2026	2.539	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 23/06/2023	4.436
Singapore Government Bond, 3,375%, scadenza 01/09/2033	2.302	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 31/03/2023	4.358
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 28/07/2023	745	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 03/03/2023	4.241
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, zero coupon, scadenza 14/07/2023	744	HSBC Holdings Plc, 5,300%, scadenza 14/03/2023	3.753
		Singapore Government Bond, 2,625%, scadenza 01/08/2032	3.550
		Indonesia Treasury Bond, Serie FR77, 8,125%, scadenza 15/05/2024	3.499
		Banca Mandiri, 5,500%, scadenza 04/04/2026	2.550
		Coastal Emerald Ltd, 4,300%, Perpetuo	2.433
		Minejesa Capital BV, 5,625%, scadenza 10/08/2037	2.357
		Singapore Government Bond, 3,375%, scadenza 01/09/2033	2.316

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDETE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	144.801	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	157.885
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,650%, scadenza 19/05/2030	7.986	United States Treasury Note/Bond, 1,000%, scadenza 15/12/2024	25.035
United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 15/02/2033	5.380	United States Treasury Note/Bond, 0,625%, scadenza 15/05/2030	12.540
Bank of New York Mellon Corp/The, 4,947%, scadenza 26/04/2027	5.200	Exxon Mobil Corp, 0,142%, scadenza 26/06/2024	6.157
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3,375%, scadenza 21/10/2025	4.698	Charles Schwab Corp/The, 1,950%, scadenza 01/12/2031	5.813
Cargill Inc, 144A, 4,500%, scadenza 24/06/2026	3.992	Nykredit Realkredit AS, 0,250%, scadenza 13/01/2026	5.587
Banco Santander SA, 4,250%, scadenza 12/06/2030	3.425	United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 15/02/2033	5.302
Nestle Holdings Inc, 144A, 5,250%, scadenza 13/03/2026	3.001	United States Treasury Note/Bond, 1,500%, scadenza 15/02/2030	4.632
Linde Plc, 3,375%, scadenza 12/06/2029	2.989	Siemens Financieringsmaatschappij, 3,375%, scadenza 24/08/2031	3.929
ABN AMRO Bank NV, 5,250%, scadenza 26/05/2026	2.987	Verizon Communications Inc, 4,329%, scadenza 21/09/2028	3.816
Robert Bosch GmbH, 3,625%, scadenza 02/06/2027	2.681	ABN AMRO Bank NV, 0,875%, scadenza 15/01/2024	3.133
Bank of America Corp, 4,134%, scadenza 12/06/2028	2.678	Home Depot Inc/The, 2,500%, scadenza 15/04/2027	2.609
Bundesrepublik Deutschland, 0,500%, scadenza 15/02/2036	2.224	UBS Group AG, 2,125%, scadenza 04/03/2024	2.524
Nationwide Building Society, 6,125%, scadenza 21/08/2028	2.010	Merck & Co Inc, 1,900%, scadenza 10/12/2028	2.395
HSBC Holdings Plc, 6,161%, scadenza 09/03/2029	1.800	NIKE Inc, 2,400%, scadenza 27/03/2025	2.394
Sika Capital BV, 3,750%, scadenza 03/11/2026	1.710	Roche Holdings Inc, 144A, 1,930%, scadenza 13/12/2028	2.389
Cargill Inc, 3,875%, scadenza 24/04/2030	1.481	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3,375%, scadenza 21/10/2025	2.383
Neste Oyj, 3,875%, scadenza 16/03/2029	1.286	EssilorLuxottica SA, 0,000%, scadenza 27/05/2023	2.360
Sika Capital BV, 3,750%, scadenza 03/05/2030	1.146	AstraZeneca Plc, 3,625%, scadenza 03/03/2027	2.343
		Bank of Nova Scotia/The, 0,500%, scadenza 30/04/2024	2.328

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDETE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
United States Treasury Note/Bond, 0,375%, scadenza 15/04/2024	12.754	United States Treasury Note/Bond, 1,125%, scadenza 28/02/2025	11.101
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250%, scadenza 15/08/2028	8.312	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	6.231
United States Treasury Note/Bond, 0,250%, scadenza 31/08/2025	6.271	United States Treasury Note/Bond, 0,125%, scadenza 30/06/2023	4.716
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	6.258	United States Treasury Note/Bond, 0,375%, scadenza 15/04/2024	3.988
United States Treasury Note/Bond, 0,250%, scadenza 31/08/2025	4.706	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, 2,500%	3.660
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	3.676	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	3.576
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	3.595	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,000%	3.562
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,000%	3.581	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	3.350
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,000%	3.569	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,000%	3.229
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	3.394	United States Treasury Note/Bond, zero coupon, scadenza 30/11/2023	3.121
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,000%	3.256	United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/10/2027	2.898
United States Treasury Note/Bond, 1,375%, scadenza 31/10/2028	3.176	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,000%	2.658
United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/10/2027	2.928	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 21, 0,100%, scadenza 20/03/2026	2.585
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,000%	2.418	Obbligazioni governative giapponesi CPI Linked, Serie 21, 0,100%, scadenza 10/03/2026	2.388
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,000%	2.260	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,000%	2.385
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,000%	2.251	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,000%	2.248
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,000%	2.172	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	2.169
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	2.117	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,000%	2.153
Franklin Templeton China Funds - Western Asset China Bond Fund - Classe LM	2.028	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,500%	1.995
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 3,500%	1.997	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,000%	1.879
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,000%	1.893	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	1.854
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,000%	1.766	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,000%	1.758
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,000%	1.761	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 4,000%	1.680

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDETE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	11.451	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	11.788
JPMorgan Chase & Co, 0,389%, scadenza 24/02/2028	607	Bundesobligation, Serie 182, 0,000%, scadenza 10/10/2025	569
Morgan Stanley, 4,656%, scadenza 02/03/2029	581	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, scadenza 15/08/2029	547
McDonald's Corp, 5,450%, scadenza 14/08/2053	379	Banco Santander SA, 1,750%, scadenza 17/02/2027	430
Danske Bank A/S, 4,750%, scadenza 21/06/2030	367	BNP Paribas SA, 1,875%, scadenza 14/12/2027	430
Bank of America Corp, 1,662%, scadenza 25/04/2028	284	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250%, scadenza 15/02/2027	418

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^] – (segue)

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Corning Inc, 4,125%, scadenza 15/05/2031	284	United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 15/11/2052	390
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, scadenza 15/08/2031	272	Stellantis NV, 5,250%, scadenza 15/04/2023	360
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, scadenza 15/02/2031	254	United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 15/11/2052	345
CRH SMW Finance DAC, 4,000%, scadenza 11/07/2031	250	United States Treasury Note/Bond, 2,875%, scadenza 15/05/2052	336
Wells Fargo & Co, 5,389%, scadenza 24/04/2034	250	United States Treasury Note/Bond, 2,000%, scadenza 15/11/2026	328
Vodafone Group Plc, 8,000%, scadenza 30/08/2086	246	Suzano Austria GmbH, 7,000%, scadenza 16/03/2047	303
UBS Group AG, 144A, 1,305%, scadenza 02/02/2027	229	HSBC Holdings Plc, 5,875%, Perpetuo	291
United Kingdom Gilt, 4,125%, scadenza 29/01/2027	223	Volkswagen Financial Services AG, 1,500%, scadenza 01/10/2024	290
Floene Energias SA, 4,875%, scadenza 03/07/2028	218	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500%, scadenza 15/02/2025	286
Bouygues SA, 3,875%, scadenza 17/07/2031	214	Glencore Finance Europe Ltd, 1,875%, scadenza 13/09/2023	282
United States Treasury Note/Bond, 3,875%, scadenza 15/05/2043	207	Corning Inc, 4,125%, scadenza 15/05/2031	281
United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 15/11/2052	203	CPUK Finance Ltd, 7,239%, scadenza 28/02/2024	281
Electricite de France SA, 9,125%, Perpetuo	200	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500%, scadenza 15/05/2028	268
HSBC Holdings Plc, 6,332%, scadenza 09/03/2044	200	Danske Bank A/S, 5,375%, scadenza 12/01/2024	268

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Classe WA (Distribuzione)	862.344	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Classe WA (Distribuzione)	877.107
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	115.959	United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 31/01/2028	148.666
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	114.318	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	115.959
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/03/2028	101.356	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	114.318
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	97.556	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/03/2028	101.058
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/05/2053	88.311	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	97.577
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	79.123	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/05/2053	83.113
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/05/2028	72.352	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	79.176
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 6,000%	58.165	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/05/2028	72.115
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	57.983	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	58.176
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 5,500%	57.413	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 6,000%	57.795
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	57.159	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 0,000%	57.420
United States Treasury Note/Bond, 3,750%, scadenza 31/05/2030	54.085	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 5,500%	56.905
United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/08/2030	49.629	United States Treasury Note/Bond, 3,750%, scadenza 31/05/2030	54.317
United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 30/04/2028	42.250	United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/08/2030	49.643
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,500%	40.630	United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 30/04/2028	42.042
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 5,500%	40.210	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 5,500%	40.649
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,500%	39.926	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,500%	39.924
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 6,000%	36.660	United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 31/10/2029	35.932
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/02/2053	34.620	Indonesia Treasury Bond, Serie FR82, 8,375%, scadenza 15/03/2024	35.025
United States Treasury Note/Bond, 3,375%, scadenza 15/05/2023	28.449	United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 15/11/2052	33.382
		United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/02/2053	31.107

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	3.466	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	3.526
Cinemark USA Inc, 9,069%, scadenza 24/05/2030	1.734	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	2.383
Occidental Petroleum Corp, 7,950%, scadenza 15/06/2039	1.556	United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/10/2027	1.605
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	1.369	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	1.365
Comerica Bank, 2,500%, scadenza 23/07/2024	1.306	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	1.259
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 7,375%, scadenza 01/03/2031	1.295	Hardee's Funding LLC, 3,981%, scadenza 20/12/2050	1.199
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	1.264	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	1.151
Triumph Group Inc, 144A, 9,000%, scadenza 15/03/2028	1.220	MPLX LP, Serie A	1.137
CSC Holdings LLC, 144A, 11,250%, scadenza 15/05/2028	1.192	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750%, scadenza 20/01/2026	1.068
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	1.151	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000%, scadenza 01/05/2025	973
Carnival Corp, 144A, 5,750%, scadenza 01/03/2027	1.052	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875%, scadenza 15/11/2025	972
NCL Corp Ltd, 144A, 5,875%, scadenza 15/03/2026	1.030	Voya CLO 2017-1 Ltd FRN, Serie 2017 1A, Classe C, 144A, 6,070%, scadenza 17/04/2030	961
VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 9,500%, scadenza 01/06/2028	900	ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750%, scadenza 29/04/2025	897
Harbor Freight Tools USA Inc, 8,196%, scadenza 19/10/2027	864	XPO CNW Inc, 6,700%, scadenza 01/05/2034	873
GFL Environmental Inc, 144A, 4,750%, scadenza 15/06/2029	846	Cinemark USA Inc, 9,069%, scadenza 24/05/2030	867
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625%, scadenza 01/06/2031	840	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities FRN, Serie 2017 C05, Classe 1B1, 6,044%, scadenza 25/01/2030	834
Tutor Perini Corp, 144A, 6,875%, scadenza 01/05/2025	821	Structured Asset Investment Loan Trust FRN, 5,550%, scadenza 25/03/2034	823
CIFC Funding 2018-I Ltd, Serie 2018 1A, Classe C, 144A, 7,322%, scadenza 18/04/2031	815	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500%, scadenza 01/02/2029	719
Goldentree Loan Management US Clo 3 Ltd, Serie 2018 3A, Classe D, 144A, 8,438%, scadenza 20/04/2030	801	Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250%, scadenza 15/08/2026	716
Gatwick Airport Finance Plc, 4,375%, scadenza 07/04/2026	794	Magallanes Inc, 144A, 3,755%, scadenza 15/03/2027	714

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Classe WA (Distribuzione)	81.441	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Classe WA (Distribuzione)	82.766
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	4.985	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	4.983
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 5,000%	4.711	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 5,000%	4.705
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	4.492	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	4.478
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	4.090	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C06, Classe 1B1, 6,594%, scadenza 25/02/2030	4.288
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	3.801	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C06, Classe 1B1, 9,152%, scadenza 25/03/2031	4.156
Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Classe A3, 144A, 6,319%, scadenza 25/05/2068	3.620		

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^] – (segue)

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Chase Mortgage Finance Trust Serie 2007-A1, Serie 2007 A1, Classe 11M1, 4,081%, scadenza 25/03/2037	3.199	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	4.093
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	2.963	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	3.807
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	2.898	BHMS 2018-MZB, Serie 2018 MZB, Classe MZB, 144A, 12,244%, scadenza 15/07/2025	3.511
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1, Serie 2015 JP1, Classe C, 4,881%, scadenza 15/01/2049	2.880	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 DNA2, Classe B2, 16,652%, scadenza 25/10/2029	3.459
GS Mortgage Securities Trust 2015-GC28, Serie 2015 GC28, Classe D, 144A, 4,452%, scadenza 10/02/2048	2.732	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C07, Classe 1B1, 6,444%, scadenza 25/05/2030	3.436
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Serie 2014 GC23, Classe C, 4,572%, scadenza 10/07/2047	2.717	Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Serie 2015 4R, Classe 4A7, 144A, 3,359%, scadenza 26/03/2037	3.383
Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Classe B1, 144A, 8,239%, scadenza 25/05/2068	2.640	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-3, Serie 2017 3, Classe M2, 144A, 4,750%, scadenza 25/07/2056	2.983
Fannie Mae o Freddie Mac, 4,500%, scadenza 01/10/2052 zero coupon	2.061	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	2.943
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C41, Serie 2015 C28, Classe B, 4,216%, scadenza 15/05/2048	2.000	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	2.875
Freddie Mac Pool, 4,000%, scadenza 01/04/2053	1.234	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA2, Serie 2019 DNA2, Classe B2, 144A, 12,944%, scadenza 25/03/2049	2.643
GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32, Serie 2015 GC32, Classe D, 3,345%, scadenza 10/07/2048	1.223	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2005-B, Serie 2005 B, Classe M6, 3,509%, scadenza 25/08/2035	2.455
Pool Freddie Mac, 4,000%, scadenza 01/05/2053	1.220	National Collegiate Student Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Classe B, 5,929%, scadenza 27/07/2037	2.213
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 anni, TBA, zero coupon	1.097	Titoli Fannie Mae Connecticut Avenue, Serie 2018 C03, Classe 1B1, 6,194%, scadenza 25/10/2030	2.198
		FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Serie 2018 SB48, Classe B, 144A, 4,285%, scadenza 25/02/2038	2.129
		Fannie Mae o Freddie Mac, 4,500%, scadenza 01/10/2052	2.041
		RBSGC Mortgage Loan Trust 2007-A, Serie 2007 A, Classe 3A1, 2,794%, scadenza 25/01/2037	1.806

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

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	134.544	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	131.986
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	24.658	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	26.971
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	20.902	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	20.911
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	19.922	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	17.979
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	17.968	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	17.871
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	17.853	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	17.758
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	17.757	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	16.815
Pool Freddie Mac 'SD2245', 5,500%, scadenza 01/12/2052	17.352	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	16.249
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	16.243	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	16.006
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	16.031	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 3,000%	15.812
Ginnie Mae II Pool 'MA7768', 3,000%, scadenza 20/12/2051	15.856	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	13.778
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 3,000%	15.812	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	13.699
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	13.718	Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000%, scadenza 20/09/2051	13.064
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	13.601	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	13.028
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	13.048	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	11.953
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	11.946	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	11.830
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	11.857	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	11.762
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	11.744	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	11.493
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	11.484	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 2,500%	11.456
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	10.198	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	10.261
Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	9.076	Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	9.229
Pool Freddie Mac 'S12048', 2,500%, scadenza 01/07/2050	8.558	Pool Fannie Mae 'CB0414', 2,500%, scadenza 01/05/2051	8.469
Pool Ginnie Mae II, 5,000%, scadenza 20/07/2053	8.230	United States Treasury Note/Bond, 0,000%, scadenza 09/05/2023	8.239
		United States Treasury Note/Bond, 0,000%, scadenza 20/07/2023	8.171
		Pool Ginnie Mae II, 5,000%, scadenza 20/07/2053	8.148
		Fannie Mae o Freddie Mac, a 30 anni, TBA, 2,500%	8.147

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) £	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) £
Intesa Sanpaolo SpA, 6,500%, scadenza 14/03/2029	359	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500%, scadenza 02/05/2025	362
Tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875%, scadenza 02/11/2028	354	Barclays Plc, 3,375%, scadenza 02/04/2025	317
Engie SA, 5,625%, scadenza 03/04/2053	296	UniCredit SpA, 7,296%, scadenza 02/04/2034	297
United Kingdom Gilt, 4,250%, scadenza 07/12/2027	267	Close Brothers Group Plc, 2,000%, scadenza 11/09/2031	267
ABN AMRO Bank NV, 5,250%, scadenza 26/05/2026	199	South Eastern Power Networks Plc, 5,500%, scadenza 05/06/2026	255
United Kingdom Gilt, 0,375%, scadenza 22/10/2026	198	BNP Paribas SA, 1,875%, scadenza 14/12/2027	253
United Kingdom Gilt, 1,500%, scadenza 22/07/2026	196	AT&T Inc, Serie GBP, 7,000%, scadenza 30/04/2040	206
CPUK Finance Ltd, 5,876%, scadenza 28/08/2027	190	AT&T Inc, Serie GBP, 2,900%, scadenza 04/12/2026	197
Northern Gas Networks Finance Plc, 6,125%, scadenza 02/06/2033	179	HSBC Holdings Plc, 5,875%, Perpetuo	189
United Kingdom Gilt, 4,250%, scadenza 07/12/2040	178	Deutsche Bank AG, 4,000%, scadenza 24/06/2026	187
United Kingdom Gilt, 0,500%, scadenza 31/01/2029	176	AT&T Inc, Serie GBP, 4,375%, scadenza 14/09/2029	172
HSBC Holdings Plc, 6,332%, scadenza 09/03/2044	167	United States Treasury Note/Bond, 3,375%, scadenza 15/08/2042	153
Cadent Finance Plc, 5,750%, scadenza 14/03/2034	150	United States Treasury Note/Bond, 2,250%, scadenza 15/08/2049	141
United Utilities Water Finance Plc, 5,125%, scadenza 06/10/2038	139	National Express Group Plc, 2,375%, scadenza 20/11/2028	124
Gilt del Regno Unito, 1,625%, scadenza 22/10/2028	122	Crh Finance UK Plc, 4,125%, scadenza 02/12/2029	109
Weir Group Plc/The, 6,875%, scadenza 14/06/2028	110	United States Treasury Note/Bond, 2,000%, scadenza 15/02/2050	40
NatWest Group Plc, 3,619%, scadenza 29/03/2029	106	Aspire Defence Finance Plc, Serie A, 4,674%, scadenza 31/03/2040	6
National Gas Transmission Plc, 5,750%, scadenza 05/04/2035	100	Greene King Finance Plc, Serie A2, 5,318%, scadenza 15/09/2031	5
		Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411%, scadenza 13/07/2044	4
		Mitchells & Butlers Finance Plc, Serie B2, 6,013%, scadenza 15/12/2028	3

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	19.007	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	18.257
United States Treasury Note/Bond, 3,375%, scadenza 15/05/2033	1.820	United States Treasury Note/Bond, 3,375%, scadenza 15/05/2033	1.811
United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 15/02/2033	1.053	Credit Suisse AG/New York, 1,000%, scadenza 05/05/2023	1.250
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/02/2053	1.032	United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 15/02/2033	1.099
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/05/2053	686	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/02/2053	992
Credit Suisse AG/New York, 1,000%, scadenza 05/05/2023	490	Credit Suisse AG/New York, 1,000%, scadenza 05/05/2023	930
HSCB Holdings Plc, 6,254%, scadenza 09/03/2034	460	JPMorgan Chase & Co, 5,546%, scadenza 15/12/2025	709
HEICO Corp, 5,250%, scadenza 01/08/2028	459	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/05/2053	617
Bank of America Corp, 2,972%, scadenza 04/02/2033	446	Enel Finance International NV, 144A, 6,800%, scadenza 14/10/2025	603
HCA Inc, 5,500%, scadenza 01/06/2033	420	Sands China Ltd, 5,375%, scadenza 08/08/2025	563
Bank of America Corp, 5,288%, scadenza 25/04/2034 VAR	410	Amgen Inc, 5,250%, scadenza 02/03/2033	560
Electricite de France SA, 6,250%, scadenza 23/05/2033	400	Credit Agricole SA, 144A, 5,301%, scadenza 12/07/2028	558
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750%, scadenza 19/05/2033	395	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750%, scadenza 20/01/2026	543
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017%, scadenza 26/06/2024	390	DISH DBS Corp, 144A, 5,000%, scadenza 15/03/2023	520
Morgan Stanley Bank NA, 4,754%, scadenza 21/04/2026	390	UBS Group AG, 144A, 6,537%, scadenza 08/12/2033	499
United Airlines 2023-1 Class A Pass Through Trust, 5,800%, scadenza 15/01/2036	390	DNB Bank ASA, 144A, 2,968%, scadenza 28/03/2025	482
ONEOK Inc, 6,050%, scadenza 01/09/2033	370	Danske Bank A/S, 144A, 6,466%, scadenza 09/01/2026	480
Morgan Stanley, 5,449%, scadenza 20/07/2029	360	BNP Paribas SA, 144A, 5,125%, scadenza 13/01/2029	450
ONEOK Inc, 6,625%, scadenza 01/09/2053	358	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855%, scadenza 12/02/2026	436
General Electric Co, 6,750%, scadenza 15/03/2032	347	Verizon Communications Inc, 4,272%, scadenza 15/01/2036	428

Western Asset UCITS Serie SMASH Core Plus Fondo di Completamento[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	3.473	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	4.684
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/03/2028	938	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/03/2028	655
United States Treasury Note/Bond, 4,125%, scadenza 31/08/2030	686	United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 30/04/2028	470
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/05/2053	582	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	199
United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 15/05/2053	470	Ameriquest Mortgage Securities Inc, FRN, 6,672%, scadenza 25/11/2034	198
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125%, scadenza 15/01/2033	261	United States Treasury Note/Bond, 1,875%, scadenza 15/02/2051	163
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 31/03/2030	250	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800%, scadenza 21/07/2023	119
United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 31/07/2030	209	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	100
United States Treasury Note/Bond, 4,375%, scadenza 15/08/2043	157	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	100
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/02/2053	157	Ginnie Mae II, 5,000%, scadenza 20/12/2052	100
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2015 C03, Classe 1M2, 10,402%, scadenza 25/07/2025	141	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	99
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Serie 2022 DNA3, Classe B1, 144A, 10,938%, scadenza 25/04/2042	104	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	98
Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Classe 1B1, 144A, 8,388%, scadenza 25/10/2041	100	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	96
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	100	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	94
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	100	Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	93
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	100	United States Treasury Note/Bond, 2,875%, scadenza 15/05/2052	92
Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Classe A1, 144A, 5,811%, scadenza 25/05/2068	100	United States Treasury Note/Bond, 4,000%, scadenza 31/07/2030	90
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	99	Saxon Asset Securities Trust 2006-3, Serie 2006 3, Classe A4, 3,220%, scadenza 25/10/2046	83
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,000%	99	Citadel Securities, 7,422%, scadenza 27/02/2028	49
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	98	RAMP Series 2006-NC3 Trust, Serie 2006 NC3, Classe M1, 5,195%, scadenza 25/08/2036	47
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 5,000%	96		
United States Treasury Note/Bond, 3,000%, scadenza 15/02/2049	95		
Ginnie Mae II Pool, 3,500%, scadenza 20/11/2052	94		
Ginnie Mae, 30 anni, TBA, 0,000%	93		

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	1.620	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	1.285
European Investment Bank, 0,050%, scadenza 15/11/2029	401	United States Treasury Note/Bond, 3,375%, scadenza 15/05/2033	249
United States Treasury Note/Bond, 3,375%, scadenza 15/05/2033	381	Danske Bank A/S, 144A, 5,375%, scadenza 12/01/2024	199
European Investment Bank, 3,750%, scadenza 14/02/2033	303	HSCB Holdings Plc, 4,950%, scadenza 31/03/2030	195
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, scadenza 15/08/2031	264	BNP Paribas SA, 144A, 3,052%, scadenza 13/01/2031	194
McDonald's Corp, 5,450%, scadenza 15/08/2053	189	Bundesrepublik Deutschland, 0,000%, scadenza 15/08/2031	171
Tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875%, scadenza 02/11/2028	115	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198%, scadenza 01/06/2032	149
E.ON SE, 3,750%, scadenza 01/03/2029	108	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500%, scadenza 02/05/2025	121
Danske Bank AS, 4,750%, scadenza 21/06/2030	108	Verizon Communications Inc, 5,250%, scadenza 16/03/2037	118
Intesa Sanpaolo SpA, 5,125%, scadenza 29/08/2031	108	AXA SA, 5,125%, scadenza 04/07/2043	110
Bouygues SA, 3,875%, scadenza 17/07/2031	107	Intesa Sanpaolo SpA, 5,125%, scadenza 29/08/2031	109
Morgan Stanley, 4,656%, scadenza 02/03/2029	106	Pandora A/S, 4,500%, scadenza 10/04/2028	109
Pandora A/S, 4,500%, scadenza 10/04/2028	106	Svenska Handelsbanken AB, 1,250%, scadenza 02/03/2028	106
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/02/2053	102	Bundesrepublik Deutschland, 0,500%, scadenza 15/02/2028	99
Bundesrepublik Deutschland, 0,500%, scadenza 15/02/2028	99	Bundesrepublik Deutschland, 4,750%, scadenza 04/07/2034	93
Bank of America Corp, 1,662%, scadenza 25/04/2028	98	UCB SA, 1,000%, scadenza 30/03/2028	92
Pfizer Investment Enterprises Pte, 5,300%, scadenza 19/05/2053	50	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250%, scadenza 15/02/2029	92
Pfizer Investment Enterprises Pte, 4,750%, scadenza 19/05/2033	50	Bundesrepublik Deutschland, 0,000%, scadenza 15/08/2029	86
Wells Fargo & Co, 5,389%, scadenza 24/04/2034	40	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 1,375%, scadenza 26/01/2032	86
Citigroup Inc, 6,174%, scadenza 25/05/2034	30	Vonovia SE, 0,750%, scadenza 01/09/2032	77
		Bank of America Corp, 3,550%, scadenza 05/03/2024	60

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^] – (segue)

VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
McDonald's Corp, 5,45%, scadenza 15/08/2053	60
AT&T Inc, 3,500%, scadenza 15/09/2053	48
United States Treasury Note/Bond, 2,875%, scadenza 15/05/2032	47
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, scadenza 15/02/2053	45

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	42.843	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	38.487
United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 15/02/2033	17.149	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250%, scadenza 19/10/2023	11.250
Australia Government Bond, Serie 137, 2,750%, scadenza 21/04/2024	9.290	United States Treasury Note/Bond, 4,850%, scadenza 31/07/2024	10.711
German Treasury Bill, zero coupon, scadenza 20/09/2023	9.094	Bundesrepublik. Deutschland, 1,700%, scadenza 15/08/2032	9.086
Norway Government Bond, Serie 476, 144A, 3,000%, due 14/03/2024	8.727	Korea Treasury Bond, Serie 4412, 2,750%, scadenza 10/12/2044	9.008
United Kingdom Gilt, 3,250%, scadenza 31/01/2033	8.316	Colombian TES, Serie B, 6,000%, scadenza 28/04/2028	8.416
United Kingdom Gilt, 1,50%, scadenza 31/07/2051	7.875	Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750%, scadenza 25/04/2032	7.884
Colombian TES, Serie B, 9,250%, scadenza 28/05/2042	7.395	United States Treasury Note/Bond, 0,750%, scadenza 22/07/2023	7.223
France Government International Bond, 0,750%, scadenza 25/05/2053	6.697	France Government International Bond, 0,750%, scadenza 25/05/2053	6.839
Mexican Bonos, Serie MS, 8,000%, scadenza 24/05/2035	5.121	United States Treasury Note/Bond, 1,875%, scadenza 15/11/2051	6.125
United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 4,931%, scadenza 31/01/2025	4.388	Norway Government Bond, Serie 476, 144A, 2,000%, scadenza 24/05/2023	5.833
Chile Government International Bond, 4,950%, scadenza 05/01/2036	3.285	Bonos messicani, Serie M 30, 8,500%, scadenza 18/11/2038	5.745
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250%, scadenza 19/10/2023	2.448	Mexican Bonos, Serie M 20, 8,500%, scadenza 31/05/2029	5.485
Mexican Bonos, Serie M, 8,000%, scadenza 31/07/2053	2.306	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Classe istituzionale	4.256
United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 5,498%, scadenza 31/07/2025	880	Australia Government Bond, Serie 137, 2,750%, scadenza 21/04/2024	3.824
United States Treasury Note/Bond, 2,250%, scadenza 15/02/2052	839	German Treasury Bill, zero coupon, scadenza 20/09/2023	3.694
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Classe istituzionale	161	Norway Government Bond, Serie 476, 144A, 3,000%, scadenza 14/03/2024	3.385
		Nota a tasso variabile del Tesoro degli Stati Uniti - All'emissione, 4,931%, scadenza 31/01/2025	2.504
		Banca Internazionale per la Ricostruzione e lo Sviluppo, 7,250%, scadenza 21/01/2027	579
		Colombian TES, Serie B, 9,250%, scadenza 28/05/2042	366

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	201.918	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	194.208
Nota a tasso variabile del Tesoro degli Stati Uniti - All'emissione, 4,931%, scadenza 31/01/2025	55.362	United States Treasury Note/Bond, 2,750%, scadenza 15/08/2032	70.945
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2033	21.435	United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 4,931%, scadenza 31/01/2025	53.835
United States Treasury Note/Bond, 2,750%, scadenza 15/08/2032	20.098	United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 4,931%, scadenza 31/03/2024 FRN	46.137
Nota a tasso variabile del Tesoro degli Stati Uniti - All'emissione, 5,418%, scadenza 30/04/2025	17.145	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Classe istituzionale	31.630
Colombian TES, Serie B, 9,250%, scadenza 28/05/2042	11.646	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2031	31.072
United Kingdom Gilt, 1,250%, scadenza 31/07/2051	10.949	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2033	26.331
General Motors Financial Co Inc, 5,400%, scadenza 06/04/2026	10.802	Republic of Poland Government bond 1,750%, scadenza 25/04/2032	26.079
Toyota Motor Credit Corp, 4,450%, scadenza 18/05/2026	8.602	Colombian TES, Serie B, 9,250%, scadenza 28/05/2042	19.808
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500%, scadenza 20/04/2053	8.582	Mexican Bonos, Serie M, 8,000%, scadenza 31/07/2053	12.910
Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000%, scadenza 20/06/2053	6.707	Peru Government Bond, 6,150%, scadenza 12/08/2032	12.087
Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500%, scadenza 20/05/2053	5.892	Colombian TES, Serie B, 7,250%, scadenza 26/10/2050	11.277
Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750%, scadenza 28/02/2048	5.608	Macquarie Group Ltd, 6,207%, scadenza 22/11/2024	10.651
Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500%, scadenza 20/02/2053	4.759	Commercial Mortgage Backed Securities, 3,510%, scadenza 10/09/2050	10.608
Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500%, scadenza 20/06/2053	4.540	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Classe istituzionale 5,700%, scadenza 01/11/2024	10.263
Petroleos Mexicanos, 6,950%, scadenza 28/01/2060	4.390	Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750%, scadenza 28/02/2048	10.256
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Classe istituzionale	1.065	Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500%, scadenza 01/12/2052	9.400
		Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,955%, scadenza 4/03/2025	9.163
		Colombian TES, Serie B, 6,000%, scadenza 28/04/2028	8.536
		Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, 3,276%, scadenza 15/11/2052	7.593
		New Zealand Government Bond, Serie 0551, 2,750%, scadenza 15/05/2051	7.459

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	10.383	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	9.537
Sabre GLBL Inc, 144A, 9,250%, scadenza 15/04/2025	945	Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000%, scadenza 15/05/2025	629
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875%, scadenza 01/10/2026	774	Sabre GLBL Inc, 144A, 9,250%, scadenza 15/04/2025	591
Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875%, scadenza 01/05/2029	751	Sabre GLBL Inc, 144A, 7,375%, scadenza 01/09/2025	563
Petroleos Mexicanos, 5,950%, scadenza 28/01/2031	673	Lindblad Expeditions Holdings Inc, 9,000%, scadenza 15/05/2028	521
Athabasca Oil Corp, 144A, 9,750%, scadenza 01/11/2026	666	PRA Group Inc, 144A, 8,375%, scadenza 01/02/2028	502
Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 7,250%, scadenza 30/04/2030	632	Arko Corp, 144A, 5,125%, scadenza 15/11/2029	501
Valvoline Inc, 144A, 4,250%, scadenza 15/02/2030	589	MercadoLibre Inc, 3,125%, scadenza 14/01/2031	473
GrubHub Holdings Inc, 144A, 5,500%, scadenza 01/07/2027	588	Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750%, scadenza 01/02/2028	472
Vector Group Ltd, 144A, 5,750%, scadenza 01/02/2029	588	Petroleos Mexicanos, 5,950%, scadenza 28/01/2031	459
Station Casinos LLC, 144A, 4,625%, scadenza 01/12/2031	578	Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875%, scadenza 01/05/2029	453
Lindblad Expeditions Holdings Inc, 9,000%, scadenza 15/05/2028	512	Electricite de France SA, 6,250%, scadenza 23/05/2033	452

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^] – (segue)

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
PRA Group Inc, 144A, 8,375%, scadenza 01/02/2028	495	United States Cellular Corp, 6,700%, scadenza 15/12/2033	433
Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750%, scadenza 01/02/2028	476	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000%, scadenza 01/08/2026	428
United States Cellular Corp, 6,700%, scadenza 15/12/2033	463	Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875%, scadenza 01/10/2026	418
FirstCash Inc, 144A, 5,625%, scadenza 01/01/2030	459	Syneos Health Inc, 3,625%, scadenza 15/01/2029	413
Affinity Interactive, 144A, 6,875%, scadenza 15/12/2027	458	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Classe istituzionale	403
Sabre Global Inc, 144A, 7,375%, scadenza 01/09/2025	455	Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536%, scadenza 27/07/2032	400
Electricite de France SA, 6,250%, scadenza 23/05/2033	450	ANGI Group LLC, 144A, 3,875%, scadenza 15/08/2028	349
ANGI Group LLC, 144A, 3,875%, scadenza 15/08/2028	444	Playtika Holding Corp, 144A, 4,250%, scadenza 15/03/2029	342

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	75.952	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	67.081
United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 15/02/2033	26.713	United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 4,931%, scadenza 31/01/2025	27.101
United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 4,931%, scadenza 31/01/2025	17.864	Bundesrepublik Deutschland, 1,700%, scadenza 15/08/2032	10.807
Australia Government Bond, Serie 137, 2,750%, scadenza 21/04/2024	15.608	Korea Treasury Bond, Serie 3106, 2,000%, scadenza 10/06/2031	10.611
German Treasury Bill, zero coupon, scadenza 20/09/2023	15.436	United States Treasury Note/Bond, 1,875%, scadenza 15/11/2051	10.301
Norway Government Bond, Serie 476, 144A, 3,000%, scadenza 14/03/2024	14.847	Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750%, scadenza 25/04/2032	9.640
United Kingdom Gilt, 3,250%, scadenza 31/01/2023	11.006	France Government Bond, 0,750%, scadenza 25/05/2053	8.759
United Kingdom Gilt, 1,250%, scadenza 31/07/2051	10.428	German Treasury Bill, zero coupon, scadenza 20/09/2023	7.145
France Government Bond, 0,750%, scadenza 25/05/2053	8.590	United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 2,796%, scadenza 31/07/2024	7.073
United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 5,498%, scadenza 31/07/2025	4.840	Mexican Bonos, Serie M 20, 8,500%, scadenza 31/05/2029	6.869
Canada Government Bond, 2,000%, scadenza 01/09/2023	4.561	Australia Government Bond, Serie 137, 2,750%, scadenza 21/04/2024	6.728
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2033	3.577	Canada Government Bond, 2,000%, scadenza 01/09/2023	6.410
Mexican Bonos, Serie M, 8,000%, scadenza 31/07/2053	3.338	Norway Government Bond, Serie 476, 144A, 3,000%, scadenza 14/03/2024	5.910
Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750%, scadenza 28/02/2048	2.752	Colombian TES, Serie B, 6,000%, scadenza 28/04/2028	4.573
Norway Government Bond, Serie 475, 144 A, 2,000%, scadenza 24/05/2023	2.670	Commonwealth Bank of Australia Floating Rate Note - All'emissione, 5,650%, scadenza 14/03/2025	4.243
Bundesrepublik Deutschland, 1,500%, scadenza 15/05/2023	2.530	Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207%, scadenza 22/11/2024	4.225
UK Treasury Note/Bond, 0,750%, scadenza 22/07/2023	2.493	UK Treasury Note/Bond, 0,750%, scadenza 22/07/2023	4.190
Colombian TES, Serie B, 9,250%, scadenza 28/05/2042	2.260	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Classe istituzionale	4.174
Petroleos Mexicanos, 6,950%, scadenza 28/01/2060	1.951	Bundesrepublik Deutschland, 1,500%, scadenza 15/05/2023	4.100
Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500%, scadenza 01/10/2052	1.834	Norway Government Bond, 2,000%, scadenza 24/05/2023	4.020
		Jackson National Life Global Funding Floating Rate Note - All'emissione, 5,950%, scadenza 28/06/2024	3.913
		Korea Treasury Bond, Serie 5103, 1,875%, scadenza 10/03/2051	3.623
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2033	3.578
		Malaysia Government Bond, Serie 0313, 3,480%, scadenza 15/03/2023	2.995
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2027	2.748

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	479.031	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	417.631
United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 4,931%, scadenza 31/01/2025	227.318	United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 4,931%, scadenza 31/01/2025	174.134
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,375%, scadenza 18/07/2025	37.616	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Classe istituzionale	109.237
United States Treasury Note/Bond, 3,500%, scadenza 15/02/2033	35.584	Mexican Bonos, Serie M, 8,000%, scadenza 31/07/2053	46.281
United Kingdom Gilt 3,750%, scadenza 22/10/2053	33.429	United Kingdom Gilt 3,750%, scadenza 22/10/2053	31.802
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Classe istituzionale	23.883	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2,125%, scadenza 08/07/2023	23.315
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2,125%, scadenza 08/07/2023	23.248	Bundesrepublik Deutschland, 1,800%, scadenza 15/08/2053	20.600
Peru Government Bond, 6,150%, scadenza 12/08/2032	22.929	Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500%, scadenza 01/09/2052	20.519
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500%, scadenza 20/04/2053	20.748	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2021 DNA2, Classe M2, 144A, 7,588%, scadenza 25/08/2033	19.391
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250%, scadenza 08/03/2024	19.029	Colombian TES, Serie B, 7,000%, scadenza 26/03/2031	15.798
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2,625%, scadenza 28/02/2024	18.813	Spain Government Bond, 3,550%, scadenza 31/10/2033	14.505
Colombian TES, Serie B, 7,000%, scadenza 26/03/2031	17.776	Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Serie 2018 2, Classe B1, 144A, 3,308%, scadenza 25/03/2058	13.291
Spain Government Bond, 3,550%, scadenza 31/10/2033	14.402	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC, 144A, 7,875%, scadenza 15/02/2025	13.113
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2033	10.732	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Serie 2014 LC14, Classe D, 144A, 4,586%, scadenza 15/03/2047	11.943
Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500%, scadenza 01/04/2026	10.608	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500%, scadenza 01/03/2025	9.759
UBS Group AG, 144A, 6,537%, scadenza 08/12/2033	9.238	AT&T Inc, 2,750%, scadenza 01/06/2031	9.671
GGAM Finance Ltd, 144A, 7,750%, scadenza 15/05/2026	8.945	Valero Energy Corp, 3,650%, scadenza 01/12/2051	9.552
Mexican Bonos, Serie M, 8,000%, scadenza 31/07/2053	8.807	Triangle Re 2021-3 Ltd, Serie 2021 3, Classe M1A, 144A, 7,188%, scadenza 25/02/2034	9.056
Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125%, scadenza 01/06/2028	8.100	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Classe B1, 144A, 10,502%, scadenza 25/06/2050	9.010
KeyBank NA/Cleveland OH, Serie BKNt, 5,535%, scadenza 14/06/2024	7.327	Arab Petroleum Investments Corp, 1,483%, scadenza 06/10/2026	7.817

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDETE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	17.261	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	16.631
United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 4,931%, scadenza 31/01/2025	7.702	United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 4,931%, scadenza 31/01/2025	4.408
United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 5,418%, scadenza 30/04/2025	2.493	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Classe istituzionale	2.216
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Classe B1, 144A, 10,502%, scadenza 25/06/2050	1.997	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC15, Serie 2013 GC15, Classe C, 5,335%, scadenza 10/09/2046	2.091
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA3, Serie 2020 HQA3, Classe B1, 144A, 11,152%, scadenza 25/07/2050	1.659	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021 Floating Rate Note, 7,073%, scadenza 25/10/2033	1.863
PDC Energy Inc, 5,750%, scadenza 15/05/2026	1.030	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C14, Serie 2014 C14, Classe A5, 4,064%, scadenza 15/02/2047	1.805
Connecticut Avenue Securities Trust Floating Rate Note, zero coupon, scadenza 25/04/2043	780	GC Pastor Hipotecario 5 FTA 5, Classe A2, 3,721%, scadenza 21/06/2046	1.658
Mexico Government International Bond, 8,000%, scadenza 31/07/2053	660	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Classe 1M2, 7,652%, scadenza 25/07/2030	1.642
Dream Finders Homes Inc, 144A, 8,250%, scadenza 15/08/2028	415	Fannie Mae Pool 'MA4876', 6,000%, scadenza 01/12/2052	1.523
Fannie Mae - CAS Floating Rate Note, zero coupon, scadenza 25/06/2043	370	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Classe 1B1, 6,194%, scadenza 25/10/2030	1.500
FirstCash Inc, 144A, 4,625%, scadenza 01/09/2028	358	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Classe 1B1, 5,994%, scadenza 25/07/2030	1.369
Allegiant Travel Co, 144A, 7,250%, scadenza 15/08/2027	350	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Class 1B1, 144A, 5,844%, due 25/10/2039	1.173
Freddie Mac STACR REMIC Trust 202 Floating Rate Note, zero coupon, scadenza 25/05/2043	350	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC17, Serie 2013 GC17, Classe C, 5,252%, scadenza 10/11/2046	1.226
Ford Motor Credit Co LLC, 5,584%, scadenza 18/03/2024	348	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R06, Serie 2019 R06, Classe 2B1, 144A, 6,194%, scadenza 25/09/2039	1.171
Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 8,875%, scadenza 15/07/2028	335	Colombian TES, Serie B, 7,250%, scadenza 26/10/2050	969
Ecopetrol SA, 8,625%, scadenza 19/01/2029	330	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2033	950
Petroleos Mexicanos, 6,950%, scadenza 28/01/2060	321	Bellemeade Re 2020-2 Ltd, Serie 2020 2A, Classe M2, 144A, 8,444%, scadenza 26/08/2030	924
Freddie Mac Structured Agency Credit Floating Rate Note, zero coupon, scadenza 25/06/2043	320	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C28, Serie 2015 C28, Classe C, 4,281%, scadenza 15/10/2048	795
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875%, scadenza 15/10/2027	313	Connecticut Avenue Securities Trus Floating Rate Note, zero coupon, scadenza 25/04/2043	782
Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000%, scadenza 15/02/2026	309	Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500%, scadenza 01/09/2052	761
		COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust, Serie 2014 CR18, Classe AM, 4,103%, scadenza 15/07/2047	719
		Allegiant Travel Co, 144A, 7,250%, scadenza 15/08/2027	715
		Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C01, Classe 1B1, 8,194%, scadenza 25/07/2029	665
		Mexico Government International Bond, 8,000%, scadenza 31/07/2053	633
		Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000%, scadenza 15/05/2025	556
		Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C06, Classe 1B1, 6,594%, scadenza 25/02/2030	460

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDETE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	1.058	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	1.058
Openlane inc, 5,125%, scadenza 01/06/2025	97	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Classe istituzionale	411
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875%, scadenza 01/10/2026	63	Uber Technologies Inc, 7,500%, scadenza 15/05/2025	366
Sabre GBL Inc, 144A, 9,250%, scadenza 15/04/2025	61	Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625%, scadenza 01/09/2028	309
Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000%, scadenza 01/02/2026	60	TransDigm Inc, 144A, 6,250%, scadenza 15/03/2026	272
FirstCash Inc, 144A, 4,625%, scadenza 01/09/2028	39	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800%, scadenza 21/07/2023	248
Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375%, scadenza 30/03/2028	18	Horizon Therapeutics USA Inc, 5,500%, scadenza 01/08/2027	227
Nordstrom Inc, 4,250%, scadenza 01/08/2031	18	Vector Group Ltd, 144A, 5,750%, scadenza 01/02/2029	227
		Affinity Gaming, 144A, 6,875%, scadenza 15/12/2027	218
		Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625%, scadenza 01/05/2026	206
		Arko Corp, 144A, 5,125%, scadenza 15/11/2029	201
		First Quantum Minerals Ltd, 6,500%, scadenza 01/03/2024	199
		Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536%, scadenza 27/07/2032	198
		Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625%, scadenza 15/02/2026	196
		MercadoLibre Inc, 3,125%, scadenza 14/01/2031	187
		LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750%, scadenza 15/10/2027	183
		Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000%, scadenza 01/08/2026	178
		ANGI Group LLC, 144A, 3,875%, scadenza 15/08/2028	174
		Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875%, scadenza 01/10/2026	172
		Playtika Holding Corp, 144A, 4,250%, scadenza 15/03/2029	168
		Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875%, scadenza 15/04/2030	167
		Nissan Motor Acceptance Co LLC, 3,450%, scadenza 15/03/2023	167
		Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250%, scadenza 15/08/2026	153
		Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000%, scadenza 15/02/2026	151
		Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 6,750%, scadenza 01/10/2026	148
		Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450%, scadenza 15/11/2029	146
		United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500%, scadenza 15/04/2029	140
		Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125%, scadenza 31/12/2024	134
		PDC Energy Inc, 5,750%, scadenza 15/05/2026	129
		Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750%, scadenza 30/06/2030	126
		Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000%, scadenza 01/02/2026	120
		Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625%, scadenza 15/01/2027	117
		Carnival Corp, 4,000%, scadenza 01/08/2028	107

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] – (segue)

	PROVENTI (in migliaia) \$
VENDITE PRINCIPALI	
Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375%, scadenza 30/03/2028	102
Allegiant Travel Co, 144A, 7,250%, scadenza 15/08/2027	101
Ciramex Energy Co, 4,375%, scadenza 15/03/2029	98
Home BancShares Inc/AR, 3,125%, scadenza 30/01/2032	98
Teine Energy Ltd, 144A, 6,875%, scadenza 15/04/2029	98

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
United States Treasury Floating Rate Note-All'emissione, 4,931%, scadenza 31/01/2025	9.323	United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 2,796%, scadenza 31/07/2024	7.556
Petroleos Mexicanos, 6,950%, scadenza 28/01/2060	2.126	United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 4,931%, scadenza 31/01/2025	4.637
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500%, scadenza 20/04/2053	1.605	Korea Treasury Bond, Serie 3106, 2,000%, scadenza 10/06/2031	3.468
General Motors Financial Co Inc, 5,400%, scadenza 06/04/2026	1.416	Mexican Bonos, Serie M 20, 8,500%, scadenza 31/05/2029	2.269
Toyota Motor Credit Corp, 4,450%, scadenza 18/05/2026	1.298	Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207%, scadenza 22/11/2024	1.439
Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000%, scadenza 20/06/2053	1.108	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700%, scadenza 01/11/2024	1.383
Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500%, scadenza 20/05/2053	910	Korea Treasury Bond, Serie 5103, 1,875%, scadenza 10/03/2051	1.146
Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500%, scadenza 20/06/2053	891	Jackson National Life Global Funding, 144A, 6,403%, scadenza 28/06/2024	970
Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500%, scadenza 20/02/2053	230	Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480%, scadenza 15/03/2023	910
Mexican Bonos, Serie M, 7,750%, scadenza 13/11/2042	138	Malaysia Government Bond, Series 0417, 3,899%, scadenza 16/11/2027	703
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2029	121	Mexican Bonos, Serie M, 7,750%, scadenza 13/11/2042	580
Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700%, scadenza 01/11/2024	111	Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750%, scadenza 28/02/2048	259
Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750%, scadenza 28/02/2048	105	Colombian TES, Series B, 7,000%, scadenza 30/06/2032	224
Colombian TES, Serie B, 7,000%, scadenza 30/06/2032	102	Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955%, scadenza 15/09/2025	210
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2031	93	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2029	192
Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500%, scadenza 01/09/2052	92	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000%, scadenza 01/01/2031	186
Czech Republic Government Bond, Serie 138, 1,750%, scadenza 23/06/2032	71	Czech Republic Government Bond, Serie 138, 1,750%, scadenza 23/06/2032	182
Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207%, scadenza 22/11/2024	67	Mexican Bonos, Series M, 8,500%, scadenza 18/11/2038	155
Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000%, scadenza 01/08/2052		Mexican Bonos, Series M, 8,000%, scadenza 07/11/2047	117
		Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500%, scadenza 01/12/2052	78

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	4.433	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	3.502
United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 5,243%, scadenza 31/01/2025	3.946	Freddie Mac Structured Agency, Credit Risk Debt Notes, Serie 2042, 9,066%, scadenza 25/07/2042	622
Mexican Bonos, Series M, 8,000%, scadenza 24/05/2035	311	Mexican Bonos, Series M, 8,000%, scadenza 31/07/2053	618
Colombian TES, Serie B, 7,000%, scadenza 26/03/2031	215	Connecticut Avenue Securities Trust, Serie 2041, 6,966%, scadenza 25/12/2041	584
Banco Do Brasil SA/Cayman, 144A, 6,250%, scadenza 18/04/2030	197	Mexican Bonos, Serie M, 8,000%, scadenza 24/05/2035	300
Spain Government Bond, 3,550%, scadenza 31/10/2033	182	Connecticut Avenue Securities Trust, Series 2042, 6,484%, scadenza 25/03/2042	249
Brazil Notas do Tesoro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000% scadenza 01/01/2033	148	Var Energi Asa, 144A, 7,500%, scadenza 15/01/2028	211
Mexican Bonos, Serie M, 8,000%, scadenza 31/07/2053	148	World Acceptance Corp, 7,000%, scadenza 01/11/2026	206
Venture Global Lng Inc, 8,125%, scadenza 01/06/2028	105	BRF SA, 144A, 3,950%, scadenza 22/05/2023	200
Iaa Inc, 5,500%, scadenza 15/06/2027	81	Natwest Group Plc, 2,359%, scadenza 22/05/2024	200
ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125%, scadenza 14/04/2030	80	Stellantis NV, 5,250%, scadenza 15/04/2023	200
Civitas Resources Inc, 8,375%, scadenza 01/07/2028	60	Arab Petroleum Investments Corp, 144A, 1,483%, scadenza 06/10/2026	198
Leviathan Bond Ltd, 6,125%, scadenza 30/06/2025	39	Kenbourne Invest SA, 6,875%, scadenza 26/11/2024	186
Emerald Debt Merger Sub LLC, 6,625%, scadenza 15/12/2030	30	Spain Government Bond, 3,550%, scadenza 31/10/2033	183
Charles Schwab Corp/The, 5,853%, scadenza 19/05/2034	20	Blue Owl Capital Corp, 2,625%, scadenza 15/01/2027	153
		Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc, 7,875%, scadenza 15/02/2025	153
		AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Group, 5,625%, scadenza 20/05/2024	152
		HP Inc, 4,750%, scadenza 15/01/2028	152
		AT&T Inc, 2,750%, scadenza 01/06/2031	151
		Colombian TES, Serie B, 7,000% scadenza 26/03/2031	150
		United States Treasury Floating Rate Note - All'emissione, 5,489%, scadenza 31/01/2025	150
		Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742%, scadenza 31/12/2039	106

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	74	Cisco Systems Inc	111
Amgen Inc	40	Union Pacific Corp	84
Norfolk Southern Corp	20	Chubb Ltd	80
CSX Corp	18	3M Co	79
Marathon Petroleum Corp	17	Caterpillar Inc	76
The Cigna Group	16	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	74
Williams Companies Inc	15	Amgen Inc	71
Chubb Ltd	10	KLA Corp	67
3M Co	9	Aflac Inc	63
Exelon Corp	9	Kroger Co/The	63
KLA Corp	9	Travelers Cos Inc/The	62
Pioneer Natural Resources	9	iShares Russell 1000 Value ETF	61
Union Pacific Corp	9	American International Group Inc	59
Lyondellbasell Industries NV	8	PIONEER NATURAL RESOURCES CO 0,01\$	57

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ - (segue)

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Mosaic Co /The	5	The Cigna Group	56
Aflac Inc	4	Ulta Beauty Inc	52
American International Group Inc	4	Ameriprise Financial Inc	51
Expeditors Intern of Washington Inc	4	Marathon Petroleum Corp	51
Marathon Oil Corp	4	CSX Corp	49
Reinsurance Group Of America Inc	4	Laboratory Corp of America Holdings	48
Travelers Cos Inc/The	4	Fed Ex Corporation	47
		Quest Diagnostics Inc	47
		Exelon Corp	42
		Target Corp	42
		Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Classe istituzionale	41
		Omnicom Group Inc	41
		Capital One Financial Corp	39
		Southern Copper Corp	36
		Johnson & Johnson	35
		Hartford Financial Services Group Inc/The	34
		LKQ Corp	34
		Tyson Foods Inc 'A'	32
		Builders FirstSource Inc	31
		Discover Financial Services	30
		Principal Financial Group Inc	29
		Fifth Third Bancorp	27
		Lyondellbasell Industries NV	27

FTGF ClearBridge Value Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Johnson & Johnson	35.490	Meta Platforms Inc 'A'	36.259
Pioneer Natural Resources Co	22.606	Bank of America Corp	26.037
Eastman Chemical Co	15.232	BioMarin Pharmaceutical Inc	19.519
Union Pacific Corp	15.131	Hess Corp	18.336
Gilead Sciences Inc	15.045	Zimmer Biomet Holdings Inc	17.968
American Tower Corp	14.643	Vertex Pharmaceuticals Inc	15.570
First Horizon Corp	14.573	Airbus Group	14.599
Apollo Global Management Inc	14.480	T-Mobile US Inc	13.949
Block Inc	11.328	M&T Bank Corp	12.654
Canadian Pacific Kansas City Ltd	11.049	CVS Health Corp	11.742
UnitedHealth Group Inc	10.562	Oracle Corp	11.272
Microsoft Corp	9.778	Black Knight Inc	10.969
Alibaba Group Holding Ltd	9.052	Uber Technologies Inc	10.595
Clean Harbors Inc	8.404	EQT Corp	9.442
Flowserve Corp	7.867	MGM Resorts International	9.277
Western Alliance Bancorporation	7.596	Tenet Healthcare Corp	9.231
Teck Resources Ltd.	7.251	SolarEdge Technologies Inc	8.786
Ross Stores Inc	7.096	Coty Inc 'A'	8.685
Everest Group Ltd	6.189	TotalEnergies SE ADR	8.046
BioNTech SE ADR	5.765	Mosaic Co/The	8.045
Micron Technology Inc	5.218	Signature Bank/New York NY	7.998
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	4.610	Alcoa Corp	7.548
United Airlines Holdings Inc	4.582	OneMain Holdings Inc	7.084
Siemens AG	4.264	General Motors Co	6.832
Meta Platforms Inc 'A'	3.800	Baker Hughes Co 'A'	5.590
APA Corp	3.464	Micron Technology Inc	5.017
Biogen Inc	3.198	Western Alliance Bancorporation	4.694
		CNH Industrial NV	4.577
		Royal Gold Inc	4.199
		Freeport-McMoRan Inc	4.075

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Netflix Inc	1.945	Microsoft Corp	1.650
AbbVie Inc	1.185	T-Mobile US Inc	1.362
Apple Inc	1.067	Verizon Communications Inc	1.287
Meta Platforms Inc 'A'	986	Bank of America Corp	1.147
Becton Dickinson & Co	865	Apple Inc	1.049
Microsoft Corp	830	JPMorgan Chase & Co	1.049
Marvell Technology Inc	816	UnitedHealth Group Inc	1.026
US Bancorp	773	Amazon.com Inc	879
NVIDIA Corp	763	General Motors Co	745
Emerson Electric Co	631	Marriott International Inc/MD	744
Progressive Corp/The	611	Pfizer Inc	697
Amazon.com Inc	398	Pioneer Natural Resources Co	693
ASML Holding NV	302	Home Depot Inc/The	670
Hartford Financial Services Group Inc/The	288	Thermo Fisher Scientific Inc	660
Intercontinental Exchange Inc	280	Johnson & Johnson	639
UnitedHealth Group Inc	257	ArcelorMittal SA	622
Visa Inc 'A'	241	Travelers Cos Inc/The	532
NextEra Energy Inc	238	Air Products & Chemicals Inc	523
Merck & Co Inc	224	Alphabet Inc	513
JPMorgan Chase & Co	207		

^ Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund – (segue)

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
ArcelorMittal SA	202	Enphase Energy Inc	505
Honeywell International Inc	198	Comcast Corp	504
TJX Cos Inc/The	191	Alphabet Inc 'A'	482
Johnson & Johnson	190	Visa Inc 'A'	464
Thermo Fisher Scientific Inc	189	United Parcel Service Inc 'B'	434
		Merck & Co Inc	427
		Walt Disney Co/The	413
		Eaton Corp Plc	405
		TJX Cos Inc/The	382
		Honeywell International Inc	377
		Automatic Data Processing Inc	309
		Waste Management Inc	277

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
S&P Global Inc	26.035	S&P Global Inc	26.035
Atlassian Corp	21.384	Atlassian Corp	21.384
Intuit Inc	17.648	Unity Software Inc	13.673
Union Pacific Corp	16.529	Visa Inc 'A'	11.604
Unity Software Inc	13.673	Advance Auto Parts Inc	11.180
Meta Platforms Inc 'A'	11.650	Honeywell International Inc	8.220
Eli Lilly & Co	10.196	Zoetis Inc	8.029
Microsoft Corp	8.461	Eaton Corp Plc	7.470
Adobe Inc	7.646	Palo Alto Networks Inc	6.772
Amazon.com Inc	7.018	WW Grainger Inc	6.575
Apple Inc	6.735	Thermo Fisher Scientific Inc	5.855
NextEra Energy Inc	6.141	NVIDIA Corp	5.684
Visa Inc 'A'	5.943	S&P Global Inc	5.271
NVIDIA Corp	5.827	Stryker Corp	4.626
Sherwin-Williams Co/The	5.713	UnitedHealth Group Inc	4.547
Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	5.018	Monster Beverage Corp	4.336
Honeywell International Inc	4.023	NIKE Inc	3.608
UnitedHealth Group Inc	3.928	Microsoft Corp	3.551
Target Corp	3.428	United Parcel Service Inc 'B'	3.484
Netflix Inc	3.077	Marsh & McLennan Cos Inc	2.938
WW Grainger Inc	2.895	Amazon.com Inc	2.902
S&P Global Inc	2.701	Alcon Inc	2.681
Monster Beverage Corp	2.697	Sea Ltd ADR	2.254
Palo Alto Networks Inc	2.688	Apple Inc	2.131
Salesforce Inc	2.558		
Zoetis Inc	2.441		
Thermo Fisher Scientific Inc	2.432		
Eaton Corp Plc	2.398		

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
TJX Cos Inc/The	2.833	Broadcom Inc	5.967
Pinterest Inc	2.598	TE Connectivity Ltd	4.508
Broadcom Inc	2.476	Liberty Broadband Corp	2.540
Starbucks Corp	1.691	Vertex Pharmaceuticals Inc	2.222
Accenture Plc 'A'	1.370	Seagate Technology Holdings Plc	2.084
Freeport-McMoRan Inc	872	Broadcom Inc	2.006
Diageo Plc ADR	613	Madison Square Garden Entertainment Corp	1.380
Etsy Inc	349	Guardant Health Inc	1.165
Airbnb Inc	312	HubSpot Inc	1.120
CrowdStrike Holdings Inc	303	Lyft Inc	965
Warner Bros Discovery Inc	285	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	887
HubSpot Inc	266	Ionis Pharmaceuticals Inc	834
Match Group Inc	147	Match Group Inc	706
Doximity Inc	102	Doximity Inc	656
AbbVie Inc	82	AMC Networks Inc	581
		Comcast Corp	456
		UnitedHealth Group Inc	440
		Autodesk Inc	426
		Liberty Media Corp-Liberty	264
		Western Digital Corp	247

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Apollo Global Management Inc	724	Bank of America Corp	593
Digital Realty Trust Inc	450	Danaher Corp	586
Blackstone Inc	439	American Airlines Group Inc, 6,500%, due 01/07/2025	513
Extra Space Storage Inc	366	RTX Corp	459
Prologis Inc	322	Microsoft Corp	439
Union Pacific Corp	308	AGNC Investment Corp	429
AbbVie Inc	278	Aptiv Plc, Series A	411
PPL Corp	295	Verizon Communications Inc	411

^ Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – (continued)

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Pioneer Natural Resources Co	275	Kimberly-Clark Corp	402
Amphenol Corp 'A'	265	Texas Instruments Inc	368
Sempra	241	TC Energy Corp	358
Chubb Ltd	230	Broadcom Inc	349
US Bancorp Delaware	203	American Tower Corp	326
Starwood Property Trust Inc	195	Equitrans Midstream Corp	302
ConocoPhillips	193	KKR & Co Inc, Series C	276
L3Harris Technologies Inc	187	Apollo Global Management Inc	255
Goldman Sachs Group Inc/The	185	Otis Worldwide Corp	200
American Homes 4 Rent 'A'	184	Starwood Property Trust Inc	191
Ares Capital Corp	152	TE Connectivity Ltd	189
American Tower Corp	106	Barings BDC Inc	170
NextEra Energy Partners LP	105	Apple Inc	167
QUALCOMM Inc	93	US Bancorp Delaware	164
Gaming and Leisure Properties Inc	79	SBA Communications Corp 'A'	162
Blue Owl Capital Inc 'A'	74	Stanley Black & Decker Inc	161
		Crown Castle Inc	157
		Trinity Capital Inc	155
		Boston Scientific Corp	150
		Blackstone Inc	116
		Pfizer Inc	116
		Amgen Inc	113
		NextEra Energy Inc	107

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
JPMorgan Chase & Co	42.685	ON Semiconductor Corp	37.734
Procter & Gamble Co/The	28.499	Bank of America Corp	37.054
Colgate-Palmolive Co	27.781	TE Connectivity Ltd	33.484
Lam Research Corp	16.859	Booking Holdings Inc	13.381
Ormat Technologies Inc	16.692	Trane Technologies Plc	10.755
NextEra Energy Partners LP	5.128	Progressive Corp/The	10.741
Microsoft Corp	3.680	Microsoft Corp	10.728
NIKE Inc	3.382	Apple Inc	10.521
UnitedHealth Group Inc	3.168	Hartford Financial Services Group Inc/The	10.068
CVS Health Corp	2.800	Regal Rexnord Corp	8.938
Apple Inc	2.721	Novo Nordisk A/S ADR	8.929
Walt Disney Co/The	2.400	Costco Wholesale Corp	8.726
Morgan Stanley	2.279	Morgan Stanley	7.160
Equinix Inc	2.261	Synopsys Inc	7.107
Shoals Technologies Group Inc 'A'	2.226	Visa Inc 'A'	6.809
Deere & Co	1.955	First Republic Bank/CA	6.352
Hartford Financial Services Group Inc/The	1.876	Charles Schwab Corp/The	6.112
Charles Schwab Corp/The	1.817	Salesforce Inc	5.907
Home Depot Inc/The	1.762	McCormick & Co Inc/MD	5.617
Johnson & Johnson	1.449	ASML Holding NV	5.133
		Williams-Sonoma Inc	4.805
		Progyny Inc	4.770
		Aptiv Plc	4.322
		Brookfield Renewable Corp	4.314
		UnitedHealth Group Inc	3.855
		BioMarin Pharmaceutical Inc	3.794
		JPMorgan Chase & Co	3.618
		Alphabet Inc 'A'	3.505

FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Marvell Technology Inc	254	BNP Paribas SA	172
Apple Inc	225	Marvell Technology Inc	170
Adobe Inc	215	Nestle SA	170
Tokyo Electron Ltd	202	Rentokil Initial Plc	170
HDFC Bank Ltd ADR	193	Raymond James Financial Inc	161
Kering SA	169	Arista Networks Inc	147
Haleon Plc	160	NVIDIA Corp	146
Walt Disney Co/The	159	Thomson Reuters Corp	146
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	146	Straumann Holding AG	144
Intuit Inc	143	RELX Plc	143
Amazon.com Inc	141	Keyence Corp	133
Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	140	CRH Plc ADR	127
Arista Networks Inc	124	United Parcel Service Inc 'B'	122
Trex Co Inc	115	Sensient Technologies Corp	120
Waste Connections Inc	115	Target Corp	120
Amphenol Corp 'A'	108	United Rentals Inc	112
Grupo Bimbo SAB de CV	107	Avantor Inc	111
Alphabet Inc 'A'	105	Iberdrola SA ADR	109
London Stock Exchange Group Plc	104	Kroger Co/The	98
Netflix Inc	104	Old Dominion Freight Line Inc	96

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^] – (segue)

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
SAP SE	102	Microsoft Corp	92
Salesforce Inc	100	Aflac Inc	85
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	84	SolarEdge Technologies Inc	84
Daiichi Sankyo Co Ltd	83	Tesla Inc	83
SMC Corp	73	Workday Inc 'A'	69
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	70	EDP - Energias de Portugal SA	66
Deere & Co	68	Haleon Plc	66
Microsoft Corp	66	EssilorLuxottica SA	65
Xero Ltd	66	Apple Inc	59
Alcon Inc	63	Marriott International Inc/MD	59
Tesla Inc	61	Alcon Inc	47
UnitedHealth Group Inc	58		
ASML Holding NV	57		
Karuna Therapeutics Inc	57		
MercadoLibre Inc	52		

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) €	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) €
CenterPoint Energy Inc	39.852	Iberdrola SA	39.128
Enel SpA	38.232	TC Energy Corp	34.797
Aéroports de Paris	21.834	SSE Plc	27.763
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	20.112	Union Pacific Corp	27.094
Ferrovial SA	14.662	Vinci SA	25.884
Norfolk Southern Corp	13.873	Aena SME SA, 144A	25.787
Rumo SA	13.277	Southwest Gas Holdings Inc	19.545
PG&E Corp	10.571	Severn Trent Plc	17.942
Union Pacific Corp	10.095	East Japan Railway Co	16.930
Entergy Corp	8.244	Terna - Rete Elettrica Nazionale	10.235
American Tower Corp	7.554	NextEra Energy Inc	9.711
PPL Corp	7.514	Centrais Eletricas Brasileiras SA	9.120
CSX Corp	6.198	American Tower Corp	8.189
Terna - Rete Elettrica Nazionale	5.288	Getlink SE	8.111
NextEra Energy Inc	4.546	CSX Corp	7.452
Centrais Eletricas Brasileiras SA	3.283	PG&E Corp	7.284
Gibson Energy Inc	2.856	PPL Corp	6.931
Severn Trent Plc	2.698	Public Service Enterprise Group Inc	6.561
SSE Plc	750	Cellnex Telecom SA, 144A	6.236
		EDP - Energias de Portugal SA	6.146
		United Utilities Group Plc	5.997
		Transurban Group	5.816
		Constellation Energy Corp	5.563
		Entergy Corp	5.555
		CenterPoint Energy Inc	5.353
		OGE Energy Corp	4.992
		Pembina Pipeline Corp	4.804
		Cheniere Energy Inc	4.556
		Central Japan Railway Co	4.408
		Gibson Energy Inc	4.338
		American Water Works Co Inc	4.158

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Williams Cos Inc/The	22.914	Williams Cos Inc/The	28.499
Enel SpA	22.117	Iberdrola SA	25.255
NextEra Energy Inc	14.464	SSE Plc	16.819
Enbridge Inc	14.148	TC Energy Corp	15.922
Iberdrola SA	12.256	Enbridge Inc	15.351
Edison International	9.528	United Utilities Group Plc	8.013
Snam SpA	8.431	National Grid Plc	7.633
National Grid Plc	7.450	Snam SpA	7.356
Redeia Corp SA	6.467	Southwest Gas Holdings Inc	6.699
TC Energy Corp	6.157	Clearway Energy Inc 'C'	6.231
SSE Plc	5.575	Enel SpA	5.995
Union Pacific Corp	5.076	Enagas SA	5.762
China Resources Gas Group Ltd	4.459	Redeia Corp SA	4.547
Entergy Corp	4.110	Engie Brasil Energia SA	3.937
NextEra Energy Partners LP	3.406	Public Service Enterprise Group Inc	3.621
Southern Co/The	3.368	Centrais Eletricas Brasileiras SA	3.621
OGE Energy Corp	3.092	Union Pacific Corp	3.620
Centrais Eletricas Brasileiras SA	2.697	Gibson Energy Inc	2.678
Severn Trent Plc	2.496	Italgas SpA	2.667
Gibson Energy Inc	2.048	CPFL Energia SA	2.432
Brookfield Renewable Corp	1.934	Transurban Group	2.361
CCR SA	1.904	West Japan Railway Co	2.265
American Tower Corp	1.898	EDP - Energias de Portugal SA	2.097
Pembina Pipeline Corp	1.883		

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	89.158	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	82.381
Alpha & Omega Semiconductor Ltd	4.325	Earthstone Energy Inc 'A'	5.769
CECO Environmental Corp	3.221	CIRCOR International Inc	5.221
Fabrinet	2.606	Modine Manufacturing Co	4.603
Brighthouse Financial Inc	2.570	Heritage-Crystal Clean Inc	4.331
Clearfield Inc	2.527	Hexcel Corp	4.142
Leonardo DRS Inc	2.438	Avid Technology Inc	3.919
Udemy Inc	2.399	Limbach Holdings Inc	3.877
Canaccord Genuity Group Inc	2.246	Dorian LPG Ltd	3.850
Xerox Holdings Corp	2.222	Option Care Health Inc	3.671
Patterson-UTI Energy Inc	2.178	Sterling Infrastructure Inc	3.265
Mativ Holdings Inc	2.089	Ruth's Hospitality Group Inc	3.108
IMAX Corp	1.999	Cleveland-Cliffs Inc	2.946
Capstone Copper Corp	1.927	Barnes Group Inc	2.915
Select Water Solutions Inc	1.901	EnPro Industries Inc	2.889
Perella Weinberg Partners 'A'	1.875	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	2.842
GCM Grosvenor Inc	1.839	Coherent Corp	2.765
Azenta Inc	1.772	Macerich Co/The	2.744
Terex Corp	1.755	Fabrinet	2.695
TTEC Holdings Inc	1.649	Leonardo DRS Inc	2.523

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	14.862	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	14.917
EnPro Industries Inc	1.156	Avid Technology Inc	1.550
Ziff Davis Inc	966	Ironwood Pharmaceuticals Inc 'A'	988
iShares Russell 2000 Value ETF - ETF	907	Forward Air Corp	951
Korn Ferry	896	Computer Task Group Inc	895
Catalyst Pharmaceuticals Inc	868	iShares Russell 2000 Value ETF - ETF	834
Ryerson Holding Corp	823	Cohu Inc	658
John Bean Technologies Corp	811	Inter Parfums Inc	608
Lazard Ltd 'A'	775	Heritage-Crystal Clean Inc	597
Steven Madden Ltd	764	FormFactor Inc	582
FormFactor Inc	739	Harmony Biosciences Holdings Inc	570
Marcus & Millichap Inc	720	Onto Innovation Inc	570
Inter Parfums Inc	703	Louisiana-Pacific Corp	548
MKS Instruments Inc	687	Simulations Plus Inc	524
Cirrus Logic Inc	653	FARO Technologies Inc	481
Innospec Inc	645	Wolverine World Wide Inc	479
Skyline Champion Corp	629	MKS Instruments Inc	448
Dun & Bradstreet Holdings Inc	628	Kulicke & Soffa Industries Inc	408
Brady Corp 'A'	603	IAA Inc	404
White Mountains Insurance Group Ltd	582	Enovis Corp	381
Fabrinet	569	Arcosa Inc	346
Cass Information Systems Inc	553	Skyline Champion Corp	333
Houlihan Lokey Inc 'A'	552	Bio-Techne Corp	329
AMN Healthcare Services Inc	540	Esab Corp	328
Carter's Inc	539		
Kadant Inc	533		
Kennedy-Wilson Holdings Inc	528		
Louisiana-Pacific Corp	512		
ESCO Technologies Inc	492		
Brunswick Corp/DE	449		
Crane NXT Co	442		
Vishay Precision Group Inc	434		
Bio-Techne Corp	432		

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	297	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	306
FirstService Corp	109	FirstService Corporation	103
Colliers International Group Inc	95	Colliers International Group Inc	86
Auction Technology Group Plc	66	Forward Air Corp	59
Azelis Group NV	46	OBIC Business Consultants Co Ltd	59
Miura Co Ltd	46	Inter Parfums Inc	43
Fox Factory Holding Corp	35	Douzone Bizon Co Ltd	29
Lectra	33	Ralph Lauren Corp 'A'	28
TOTVS SA	33	Meitec Corp	27
EnPro Industries Inc	22	Fukui Computer Holdings Inc	24
Rogers Corp	21	Esab Corp	23
Marlowe Plc	19	DiscoverIE Group Plc	20
New Work SE	19	GVS SpA, 144A	20
NICE Information Service Co Ltd	19	FormFactor Inc	19
Marel hf, 144A	18	New Work SE	19
Restore Plc	18	Avid Technology Inc	18
Learning Technologies Group Plc	17	Marlowe Plc	18

^ Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^] – (segue)

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Hansen Technologies Ltd	15	RB Global Inc	18
MKS Instruments Inc	14	Croda International Plc	17
Karnov Group AB	13	TechTarget Inc	15
As One Corp	12	Arcosa Inc	14
Croda International Plc	12	Gentex Corp	13
		IAA Inc	13

Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	3.356	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	3.356
NTPC Ltd	240	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.262
Hon Hai Precision Industry Co Ltd	174	Samsung Electronics Co Ltd	1.191
		Lite-On Technology Corp	464
		BHP Group Ltd	435
		PetroChina Co Ltd	411
		NHPC Ltd	393
		REC Ltd	387
		Rio Tinto Ltd	382
		China Construction Bank Corp	372
		McMillan Shakespeare Ltd	367
		Bank of China Ltd	366
		Uni-President Enterprises Corp	366
		Power Grid Corp of India Ltd	338
		Giordano International Ltd	335
		China Shenhua Energy Co Ltd	331
		Infosys Ltd	322
		PICC Property & Casualty Co Ltd	320
		Aurizon Holdings Ltd	304
		Coles Group Ltd	303
		Aboitiz Power Corp	301
		AIA Group Ltd	297
		Jardine Cycle & Carriage Ltd	295
		Bank of Communications Co Ltd	293
		Uni-President China Holdings Ltd	289
		CITIC Telecom International Holdings Ltd	287
		Indofood Sukses Makmur Tbk PT	287
		Far East Horizon Ltd	280
		Tisco Financial Group PCL, NVDR	277
		Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	270
		NTPC Ltd	267
		Jardine Matheson Holdings Ltd	260
		Telkom Indonesia Persero Tbk PT	260
		China Communications Services Corp Ltd	259
		Orora Ltd	259
		Stella International Holdings Ltd	259
		Astra International Tbk PT	254

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

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENDITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Innox Advanced Materials Co Ltd	35	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	302
LG Chem Ltd	30	Samsung Electronics Co Ltd	255
Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	21	Tencent Holdings Ltd	238
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	17	HDFC Bank Limited	209
		AIA Group Limited	186
		LG Chem Ltd	170
		Alibaba Group Holding Limited	164
		United Overseas Bank Limited	156
		Singapore Telecommunications Ltd	153
		Ishares Core Msci Asia E-HKD	149
		Singapore Technologies Engineering Ltd	131
		Venture Corporation Limited	131
		Accton Technology Corporation	130
		ENN Energy Holdings Limited	117
		CSPC Pharmaceutical Group LTD	115
		Mintch Group Ltd	112
		Hansol Chemical Co Ltd	103
		Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	97
		Ping An Insurance Group	94
		Techtronic Industries Company Limited	89
		Guangdong Investment Limited	86
		LG Energy Solution Ltd	84
		Tongcheng Travel Holdings Ltd	79
		Telkom Indonesia Persero Tbk	76
		TravelSky Technology Limited	76
		Shenzhen International Group Holdings Limited	63
		LEENO Industrial Inc	60
		JD.com, Inc	57
		TATA Consultancy Services Limited	53
		Innox Advanced Materials Co Ltd	43

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

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

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENTITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	15.505	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	14.932
Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	5.133	Alia Group Ltd	4.417
Mettler-Toledo International Inc	4.898	Kerry Group Plc	3.252
Adyen NV, 144A	4.849	NVIDIA Corp	2.678
Croda International Plc	2.371	ASML Holding NV	1.202
CSL Ltd	1.292	Microsoft Corp	1.144
Moncler SpA	766	Linde Plc	1.023
NVIDIA Corp	591	Moncler SpA	977
ASML Holding NV	496	L'Oreal SA	900
Microsoft Corp	461	Ferrari NV	897
Linde Plc	424	Atlas Copco AB	818
L'Oreal SA	382	ResMed Inc	783
Ferrari NV	363	Mastercard Inc	774
Atlas Copco AB	337	Kingspan Group Plc	729
ResMed Inc	337	Coloplast A/S	708
Mastercard Inc	322	ANSYS Inc	620
Coloplast A/S	312	Pernod Ricard SA	604
Kingspan Group Plc	294	Hexagon AB	593
ANSYS Inc	252	Adobe Inc	585
Pernod Ricard SA	260	Zoetis Inc	585
		CSL Ltd	581
		NIKE Inc	559
		Masimo Corp	545
		Asa Abloy AB	533
		Veeva Systems Inc 'A'	517
		Kering SA	502
		Autodesk Inc	468
		Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	454
		Croda International Plc	452
		Adyen NV, 144A	446

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENTITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Link REIT	674	NHPC Ltd	774
Indus Towers Ltd	647	AGL Energy Ltd	648
Aurizon Holdings Ltd	539	Transurban Group	622
CLP Holdings Ltd	433	CLP Holdings Ltd	603
Guangdong Investment Ltd	388	Capitaland Integrated Commercial Trust	577
Chorus Ltd	329	Contact Energy Ltd	497
Scentre Group	274	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	402
Vicinity Ltd	246	Region RE Ltd	398
Charter Hall Retail REIT	203	China Tower Corp Ltd, 144A	319
Embassy Office Parks REIT	194	Power Grid Corp of India Ltd	318
AGL Energy Ltd	190	Chorus Ltd	239
Digital Telecommunications Infrastructure Fund	167	Charter Hall Retail REIT	214
NETLINK NBN TRUST	141	China Merchants Port Holdings Co Ltd	208
Manila Electric Co	121	Link REIT	204
Capitaland India Trust	109	Indus Towers Ltd	188
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	64	Guangdong Investment Ltd	184
Fortune Real Estate Investment Trust	51	Vicinity Ltd	183
Wharf Real Estate Investment Co Ltd	47	Scentre Group	182
APA Group	40	Aurizon Holdings Ltd	178
Westports Holdings Bhd	31	GPT Group/The	172
		Embassy Office Parks REIT	165
		Fortune Real Estate Investment Trust	143
		Digital Telecommunications Infrastructure Fund	112
		Westports Holdings Bhd	112
		Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	103
		Capitaland India Trust	98
		Mapletree Industrial Trust	95

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) \$	VENTITE PRINCIPALI	PROVENTI (in migliaia) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	2.694	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribuzione)	2.453
HDFC Bank Ltd	528	ICICI Bank Ltd	465
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	303	Samsung Electronics Co Ltd	314
Capitec Bank Holdings Ltd	209	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	250
Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	209	EPAM Systems Inc	212
Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	178	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	207
		SK Hynix Inc	179
		Tencent Holdings Ltd	157
		Globalwafers Co Ltd	95
		HDFC Bank Ltd	92
		Alibaba Group Holding Ltd ADR	86
		Jio Financial Services Ltd	82
		Reliance Industries Ltd	78
		Titan Co Ltd	77

[^] Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ - (continued)

VENDITE PRINCIPALI

AIA Group Ltd	
Meituan 'B', 144A	
WEG SA	
Antofagasta Plc	
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	
Grupo Financiero Banorte SAB de CV	

PROVENTI (in migliaia) \$

65
60
59
54
54
51

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^

ACQUISTI PRINCIPALI

Adyen NV, 144A	
BE Semiconductor Industries NV	
Croda International Plc	
Sartorius Stedim Biotech	
Moncler SpA	
ASML Holding NV	
L'Oreal SA	
Atlas Copco AB	
Linde Plc	
Mettler-Toledo International Inc	
Hexagon AB	
Dassault Systemes SE	
Assa Abloy AB	
Kering SA	
Nemetschek SE	
Coloplast A/S	
Kingspan Group	
Partners Group Holding AG	
Pernod Ricard SA	
Infineon Technologies AG	

COSTO (in migliaia) €

6.153
4.205
3.558
2.401
2.007
928
498
470
454
438
421
415
407
394
368
361
347
297
288
248

VENDITE PRINCIPALI

Kerry Group Plc	
Infineon Technologies AG	
Ferrari NV	
Allfunds Group Plc	
Mettler-Toledo International Inc	
Dr. Martens Plc	
ASML Holding NV	
Moncler SpA	
L'Oreal SA	
Kering SA	
Linde Plc	
Sartorius Stedim Biotech	
Atlas-Copco AB	
Kingspan Group	
Assa Abloy AB	
Dassault Systemes SE	
Hexagon AB	
Coloplast A/S	
Nemetschek SE	
Pernod Ricard SA	
Partners Group Holding AG	

PROVENTI (in migliaia) €

5.337
4.214
3.406
3.283
2.543
1.295
734
580
435
406
392
376
367
361
350
334
330
328
324
288
268

FTGF Martin Currie Improving Society Fund^

ACQUISTI PRINCIPALI

Intuitive Surgical Inc	
Xylem Inc/NY	
HDFC Bank Ltd ADR	
Valmont Industries Inc	
Ecolab Inc	
Novozymes A/S	
Croda International Plc	
Illumina Inc	
Revvity Inc	
Veolia Environnement SA	
Amplifon SpA	
Airtel Africa Plc, 144A	
Masimo Corp	
Deere & Co	
Veeva Systems Inc 'A'	
MercadoLibre Inc	
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	
Vistry Group Plc	
Verra Mobility Corp 'A'	
Energy Recovery Inc	
Planet Fitness Inc 'A'	
MIPS AB	
Coursera Inc	
Everbridge Inc	
Stride Inc	

COSTO (in migliaia) \$

314
305
294
265
251
248
247
246
244
238
236
222
218
213
202
201
148
109
105
89
82
73
63
59
51

VENDITE PRINCIPALI

Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	
Verra Mobility Corp 'A'	
Ecolab Inc	

PROVENTI (in migliaia) \$

302
35
20

Franklin Responsible Income 2028 Fund^

ACQUISTI PRINCIPALI

ING Groep NV, 4,875%, due 14/11/2027	
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,375%, due 21/06/2028	
Thermo Fisher Scientific Inc, 0,500%, due 01/03/2028	
Schneider Electric SE, 1,500%, due 15/01/2028	
Abertis Infraestructuras SA, 4,125%, due 31/01/2028	
Telenor ASA, 0,250%, due 14/02/2028	
BNP Paribas SA, 0,500%, due 19/02/2028	
UBS Group AG, 4,625%, due 17/03/2028	
Werfen SA/Spain, 4,625%, due 06/06/2028	
Werfen SA/Spain, 4,625%, due 06/06/2028	
Tele2 AB, 2,125%, due 15/05/2028	
Teleperformance SE, 0,250%, due 26/11/2027	
TenneT Holding BV, 1,375%, due 05/06/2028	
NTT Finance Corp, 0,399%, due 13/12/2028	
Motability Operations Group Plc, 0,125%, due 20/07/2028	
Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1,625%, due 27/11/2027	

COSTO (in migliaia) €

1.317
1.313
1.309
1.297
1.296
1.295
1.294
1.293
1.290
1.290
1.286
1.284
1.280
1.270
1.264
1.255

VENDITE PRINCIPALI

Werfen SA/Spain, 4,625%, due 06/06/2028	
International Business Machines Co, 0,300%, due 11/02/2028	
Banco Santander SA, 3,875%, scadenza 16/01/2028	
UBS Group AG, VAR, due 17/03/2028	
Thames Water Utilities Finance PLC, 0,875%, due 31/01/2028	
Vonovia Finance BV, 1,500%, scadenza 14/01/2028	
Abanca Corp Bancaria SA, VAR, due 14/09/2028	
UBS Group AG, VAR, due 14/01/2028	
Apple Inc, 2,000%, due 17/09/2027	
Eurobank SA, VAR, due 14/03/2028	
NatWest Markets PLC, 1,375%, due 02/03/2027	
SBB Treasury Oyj, 0,750%, due 14/12/2028	
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,000%, scadenza 04/05/2028	

PROVENTI (in migliaia) €

1.290
1.130
1.091
999
924
768
689
630
477
425
371
241
155

^ Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Prospetto delle principali variazioni di portafoglio – (segue)

Franklin Responsible Income 2028 Fund^ – (segue)

ACQUISTI PRINCIPALI	COSTO (in migliaia) €
H Lundbeck A/S, 0,875%, due 14/10/2027	1.223
Cooperatieve Rabobank UA, 4,625%, due 27/01/2028	1.217
HSBC Holdings Plc, 4,752%, due 10/03/2028	1.202
TDF Infrastructure SASU, 5,625%, due 21/07/2028	1.198
LKQ European Holdings BV, 4,125%, due 01/04/2028	1.183
Credit Agricole SA, 0,375%, due 20/04/2028	1.168
Verizon Communications Inc, 1,375%, due 02/11/2028	1.073
UBS Group AG, VAR, due 17/03/2028	1.001
Crown European Holdings SA, 5,000%, due 15/05/2028	1.000
Romanian Government International Bond, 2,125%, scadenza 07/03/2028	947
Deutsche Lufthansa AG, 3,750%, due 11/02/2028	919
Azelis Finance NV, 5,750%, due 15/03/2028	908
Bank of Ireland Group Plc, 4,875%, scadenza 16/07/2028	904
Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500%, scadenza 15/12/2028	881
Volvo Car AB, 4,250%, due 31/05/2028	855
Svenska Handelsbanken AB, 3,750%, scadenza 01/11/2027	798
DXC Capital Funding DAC, 0,450%, scadenza 15/09/2027	793
National Grid Plc, 0,163%, scadenza 20/01/2028	760
Macquarie Group Ltd, 0,350%, scadenza 03/03/2028	744
PVH Corp, 3,125%, scadenza 15/12/2027	727
OP Corporate Bank plc, 0,375%, scadenza 16/06/2028	667
Prosus NV, 1,539%, due 03/08/2028	658
JPMorgan Chase & Co, 1,638%, due 18/05/2028	634
Intesa Sanpaolo SpA, 1,750%, scadenza 20/03/2028	629
Barclays Plc, 0,877%, scadenza 28/01/2028	609
RCI Banque SA, 4,875%, scadenza 21/09/2028	608
International Business Machines Co, 0,300%, due 11/02/2028	606

^ Non autorizzato per la vendita al pubblico a Hong Kong.

Appendice: Securities Financing Transactions Regulation (SFTR)

Le tabelle seguenti illustrano il valore nozionale lordo aggregato delle operazioni di riacquisto inverso e il valore equo assoluto in proporzione al valore patrimoniale netto di ciascun Fondo, analizzato per controparte, al 31 agosto 2023:

Operazioni di riacquisto inverso

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Controparte	Paese di costituzione	Valore nozionale lordo aggregato (in migliaia) \$	Valore equo assoluto (in migliaia) \$	% of Net Asset Value
Canadian Imperial Bank of Commerce	Canada	50.000	50.000	5,39
HSBC Bank (USA)	Regno Unito	55.000	55.000	5,92
JP Morgan Securities LLC	Stati Uniti	80.000	80.000	8,61
Royal Bank of Canada	Canada	50.000	50.000	5,38
TD Securities (USA) LLC	Canada	12.520	12.520	1,35
		247.520	247.520	26,65

La seguente tabella elenca i dieci maggiori emittenti di garanzie in base al valore delle garanzie non liquide ricevute e alla valuta delle garanzie non liquide ricevute al 31 agosto 2023:

Fondo	Emittente della garanzia collaterale*	Valuta	Valore aggregato delle garanzie detenute (in migliaia)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Stati Uniti**	Dollaro USA	252.499\$

* Laddove al 31 agosto 2023 vi siano meno di dieci emittenti di garanzie, sono stati inclusi tutti gli emittenti.

** Underlying bonds & notes held as collateral are issued by the United States Treasury.

La tabella seguente fornisce un'analisi del tipo e della qualità delle garanzie non liquide ricevute al 31 agosto 2023:

Fondo	Tipo di garanzia	Qualità della garanzia	Valore aggregato delle garanzie detenute (in migliaia)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Obbligazioni ed effetti governativi	Investment Grade	252.499\$

L'analisi delle scadenze di seguito riportata si basa sulla data di scadenza contrattuale delle operazioni di pronti contro termine e sulle relative garanzie ricevute/fornite al 31 agosto 2023:

Fondo	Tipo di derivato/garanzia	Meno di 1 giorno (in migliaia)	Da 1 giorno a 1 settimana (in migliaia)	1 week to 1 month (in migliaia)	Da 1 mese a 3 mesi (in migliaia)	3 months to 1 year (in migliaia)	Sopra 1 anno (in migliaia)	Scadenza indeterminata (in migliaia)	Totale (in migliaia)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Operazioni di riacquisto inverso	-	247.520\$	-	-	-	-	-	247.520\$
	Garanzia non liquida ricevuta	-	-	-	13.005\$	33.500\$	205.994\$	-	252.499\$

Gli accordi di riacquisto inverso detenuti su FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund sono accordi trilaterali. Le garanzie ricevute dal Fondo in relazione alle operazioni di riacquisto inverso aperte al 31 agosto 2023, sono detenute presso la Bank of New York Mellon, in conti segregati intestati alla Società. La garanzia ricevuta non viene riutilizzata.

Tutti i costi e i rendimenti delle operazioni di riacquisto inverso spettano interamente al Fondo.

[Pagina lasciata intenzionalmente vuota]

