FRANKLIN TEMPLETON

Halbjahresbericht (Ungeprüft)

Legg Mason Global Funds Plc

Ein Dachfonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds

Für die sechs Monate bis 31. August 2020

Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Informationen 3

Brief an die Anteilsinhaber 16

Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund 17
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund 18
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund 47
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund 50
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset US High Yield Fund 59
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund 64
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund 67
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund 70
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund 74
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund 76
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund 79
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ 83
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^ 88
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund 92
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ 94
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ 103
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ 113
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ 119
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ 125
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^ 128
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund 134
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ 138
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^ 141
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund 143
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^ 147
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ 150
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ 153
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ 155
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ 157
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ 159
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge Value Fund 161
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund 162
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund 163
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund 164
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund 165
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund 166
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ 167
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^ 168
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ 169
Anlagenportfolio – Emerging Markets Infrastructure Fund^ 171
Anlagenportfolio – Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund 172
Anlagenportfolio – Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund 175
Anlagenportfolio – Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund 176
Anlagenportfolio – Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund 177
Anlagenportfolio – Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund 179
Anlagenportfolio – Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund 183
Anlagenportfolio – Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^ 185
Anlagenportfolio – Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ 186
Anlagenportfolio – Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^ 188
Anlagenportfolio – Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund 189
Anlagenportfolio – Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^ 191

Bilanz – Legg Mason Global Funds Plc 192
Gesamtergebnisrechnung – Legg Mason Global Funds Plc 212
Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – Legg Mason Global Funds Plc 220

Anlagenportfolio – Erläuterungen zum Abschluss 248

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) – Legg Mason Global Funds Plc 268

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund 276
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund 276
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund 277
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund 277
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund 277
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund 278
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US High Yield Fund 278
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund 279
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund 279
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund 280
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund 280
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund 281
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund 281
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ 282
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^ 282
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund 282
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ 283
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ 283
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ 283
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ 284
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ 284
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^ 285
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund 285
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ 285
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^ 285
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund 286
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^ 286
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ 287
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ 287
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ 287
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ 288
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ 288
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge Value Fund 289
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund 289
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund 289
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund 290
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund 290
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ 290
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^ 291
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ 291
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^ 292
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund 292
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund 293
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund 293
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund 293
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund 294
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund 294
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^ 294
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ 295
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^ 296
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund 296
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ 296
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^ 297

Anhang: EU-Verordnung zur Erhöhung der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTR-Verordnung) 298

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Allgemeine Informationen

Verwaltungsrat

Joseph Carrier (Vereinigte Staaten)
Fionnuala Doris (Irland) (unabhängig)
Joseph Keane (Irland) (unabhängig)
Joseph LaRocque (Vereinigte Staaten)
Jane Trust (Vereinigte Staaten)
Jaspal Sagger (Großbritannien)
Victoria Rock (Großbritannien)[1]

[1]Ausgeschieden am 30. September 2020

Geschäftssitz

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

Secretary

Bradwell Limited
Ten Earlsfort Terrace
Dublin 2, Irland

Hauptvertriebs- und Hauptinformationsstelle

Legg Mason Investor Services, LLC
100 International Drive
Baltimore, Maryland 21202
USA

Weitere Vertriebs- und Informationsstellen

Legg Mason Investments (Europe) Limited
201 Bishopsgate
London EC2M 3AB
Großbritannien

Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited
Suites 1202-03
12/F, York House
15 Queen's Road Central
Hongkong

Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited
1 George Street, #23-02
Singapur 049145

Legg Mason Investments (Taiwan) Ltd.
55 Floor – 1, Taipei 101 Tower
No. 7 Xin Yi Road
Section 5, Taipei, 110
Taiwan

Berichtsfondsstatus und Ausschüttungsfondsstatus (nur für britische Anteilsinhaber)

Britische Anteilsinhaber können auf der Berichtsfondsliste von HM Revenue and Customs auf der Website http://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds prüfen, welche Anteilsklassen der Gesellschaft als britische Berichtsfonds zugelassen sind und welche Anteilsklassen den Status eines britischen Berichtsfonds haben. Diese Liste wird von HM Revenue and Customs monatlich aktualisiert.

Weitere Informationen entnehmen Sie bitte dem Ergänzungsprospekt für Anleger aus Großbritannien, oder wenden Sie sich an die Legg Mason Investments (Europe) Limited.

Schweizer Vertreter

First Independent Fund Services Ltd
Klausstrasse 33
CH-8008 Zürich
Schweiz

Schweizer Zahlstelle

NPB Neue Privat Bank Ltd
Limmatquai 1/am Bellevue
CH-8024 Zürich
Schweiz

Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Gründungsurkunde sowie die Jahres- und Halbjahresberichte der Gesellschaft und eine Liste der Käufe und Verkäufe der Fonds sind kostenlos bei der schweizerischen Vertretungsstelle erhältlich.

Irischer Rechtsberater

Arthur Cox
Ten Earlsfort Terrace
Dublin 2, Irland

Verwahrstelle

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

Unabhängige Wirtschaftsprüfer

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

Verwaltungsstelle

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

Verwalter und Promoter

Legg Mason Investments (Ireland) Limited
6th Floor, Building Three
Number One Ballsbridge
126 Pembroke Road
Dublin 4, Irland

Allgemeine Informationen *(Fortsetzung)*

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund[µ]	27. Februar 2004	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund*	30. August 2002	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund*	20. April 2007	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund*	1. Oktober 2003	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund*	24. Februar 2004	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund*	29. August 2002	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145

Allgemeine Informationen *(Fortsetzung)*

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund*	27. Februar 2004	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund*	24. Februar 2004	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund*	21. Oktober 2011	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145 Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo - Brasilien
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund*	20. April 2007	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^*þ	20. April 2007 (Handel eingestellt am 8. November 2019)	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA

Allgemeine Informationen *(Fortsetzung)*

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^*Þ	20. April 2007 (Handel eingestellt am 2. August 2019)	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund*	20. April 2007	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund*	12. Juni 2008	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund*	3. Juni 2009	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145

Allgemeine Informationen *(Fortsetzung)*

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset Global Credit Absolute Return Fund^*þ	20. Mai 2010 (Handel eingestellt am 29. April 2016)	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145 Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo - Brasilien
Legg Mason Western Asset UK£ Core Plus Bond Fund^*þ	19. November 2010 (Handel eingestellt am 24. Februar 2014)	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^*	3. Dezember 2010	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145 Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan

Allgemeine Informationen — *(Fortsetzung)*

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset UK£ Long Duration Fund^*♭	19. November 2010 (Handel eingestellt am 24. Februar 2014)	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^*	19. November 2010	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145 Western Asset Management Company Pty Limited Stufe 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australien
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund*	3. Dezember 2010	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^*	5. September 2013	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145

Allgemeine Informationen — *(Fortsetzung)*

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^*þ	16. Dezember 2015 (Handel eingestellt am 10. Dezember 2019)	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^*	16. Dezember 2015	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo - Brasilien Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145 Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^*þ	31. Dezember 2015 (Handel eingestellt am 13. November 2019)	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145 Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan Western Asset Management Company Pty Limited Stufe 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australien Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo - Brasilien
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^*	13. Januar 2016	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA

Allgemeine Informationen — *(Fortsetzung)*

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^*	13. Januar 2016	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^*	17. November 2016	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^*	17. November 2016	**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Infrastructure Debt Fund†*^		**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145 Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo - Brasilien
Legg Mason Western Asset Short-Dated High Yield Fund†*^		**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA

Allgemeine Informationen — *(Fortsetzung)*

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset Asian Income Fund*†		**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145
Legg Mason Western Asset US Dollar Liquidity Fundμ†^		**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien **Unteranlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund*	1. Oktober 2003	**Anlageverwalter:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^*	3. April 2012	**Anlageverwalter:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^*	30. November 2012	**Anlageverwalter:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund*	25. Juni 2010	**Anlageverwalter:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^*	10. Mai 2012	**Anlageverwalter:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^*	3. Juni 2013	**Anlageverwalter:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^*	30. Juni 2014	**Anlageverwalter:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^**	31. Dezember 2015	**Anlageverwalter:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA

Allgemeine Informationen — *(Fortsetzung)*

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Brandywine Global Macro Fund*†^**		**Anlageverwalter:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund*^	6. April 2017	**Anlageverwalter:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund*^þ	30. Oktober 2017 (Handel eingestellt 29. Januar 2020)	**Anlageverwalter:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund*^	16. August 2018	**Anlageverwalter:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global – EM Macro Bond Fund*†^		**Anlageverwalter:** Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason ClearBridge Value Fund**	23. März 1998	**Anlageverwalter:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Growth Fund^þ**	25. Februar 2004 (Handel eingestellt am 15. Februar 2019)	**Anlageverwalter:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^þ**	1. September 2006 (Handel eingestellt am 22. November 2019)	**Anlageverwalter:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund^þ**	15. September 2014 (Handel eingestellt am 22. Juli 2019)	**Anlageverwalter:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund**	20. April 2007	**Anlageverwalter:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund**	20. April 2007	**Anlageverwalter:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund**	20. April 2007	**Anlageverwalter:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund**	3. Juni 2013	**Anlageverwalter:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^**	30. September 2015	**Anlageverwalter:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA

Allgemeine Informationen — *(Fortsetzung)*

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^**	29. Juni 2018	**Anlageverwalter:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Global SRI Equity Fund†^**		**Anlageverwalter:** ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^** (ehemals Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund)	9. Dezember 2016	**Anlageverwalter:** ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^** (ehemals Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund)	31. März 2017	**Anlageverwalter:** ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund†^** (ehemals Legg Mason RARE Global Infrastructure Income Fund)		**Anlageverwalter:** ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund**	8. November 2002	**Anlageverwalter:** Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund**	1. März 2004	**Anlageverwalter:** Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund**	30. August 2002	**Anlageverwalter**: QS Investors, LLC 880 Third Avenue, 7th Floor New York, NY 10022 USA
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund**	25. Februar 2004	**Anlageverwalter**: QS Investors, LLC 880 Third Avenue, 7th Floor New York, NY 10022 USA
Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^þ**	20. April 2007 (Handel eingestellt am 25. Februar 2015)	
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund**	28. April 2008	**Anlageverwalter**: QS Investors, LLC 880 Third Avenue, 7th Floor New York, NY 10022 USA
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund**	29. Dezember 2010	**Anlageverwalter**: QS Investors, LLC 880 Third Avenue, 7th Floor New York, NY 10022 USA
Legg Mason QS US Large Cap Fund^†**		**Anlageverwalter**: QS Investors, LLC 880 Third Avenue, 7th Floor New York, NY 10022 USA
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^~**	11. März 2016	**Anlageverwalter**: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland **Unteranlageverwalter:** Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited 1 George Street, #23-02 Singapur 049145

Allgemeine Informationen — *(Fortsetzung)*

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^þ**	11. März 2016 (Handel eingestellt am 21. August 2019)	**Anlageverwalter**: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland **Unteranlageverwalter:** Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited 1 George Street, #23-02 Singapur 049145
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^~**	11. März 2016	**Anlageverwalter**: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^þ**	11. März 2016 (Handel eingestellt am 31. Juli 2017)	
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^~þ**	11. März 2016 (Handel eingestellt am 15. November 2019)	**Anlageverwalter**: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund^þ**	11. März 2016 (Handel eingestellt am 31. Mai 2019)	**Anlageverwalter**: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
Legg Mason Martin Currie North American Fund^þ**	11. März 2016 (Handel eingestellt am 5. Oktober 2017)	**Anlageverwalter**: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^~**	28. Juni 2016	**Anlageverwalter**: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund**	28. Juni 2016	**Anlageverwalter**: Legg Mason Asset Management Australia Limited (firmiert unter „Martin Currie Australia“) Stufe 47 120 Collins Street, Melbourne VIC 3000 Australien
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^~**	24. November 2017	**Anlageverwalter**: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
Legg Mason Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund†^~**		**Anlageverwalter**: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund^~þ**	1. März 2018 (Handel eingestellt am 20. September 2019)	**Anlageverwalter**: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^~**	9. November 2018	**Anlageverwalter**: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland

Allgemeine Informationen — *(Fortsetzung)*

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Multi-Asset Infrastructure Income Fund*†^**		**Anlageverwalter:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
Legg Mason PCM US Equity Fund^þ	8. Januar 2008 (Handel eingestellt am 24. August 2010, erneut aufgelegt am 13. April 2012 und Handel eingestellt am 30. August 2013)	
Legg Mason Congruix Japan Equity Fund^þ	2. Oktober 2008 (Handel eingestellt am 30. November 2010)	

† *Am 31. August 2020 hatten diese Fonds den Handel noch nicht aufgenommen.*
^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*
~ *Bewertungszeitpunkt ist 12.00 Uhr mittags in London an jedem Handelstag (die Handelsfrist und der Bewertungszeitpunkt haben sich von 12.00 Uhr mittags in London auf 16.00 Uhr in New York (Eastern Time) in den Vereinigten Staaten im Rahmen der Ausgabe des aktualisierten Haupt- und Expertenprospektes am 28. April 2020 geändert).*
µ *US Money Market Fund*
* *Rentenfonds (Fonds, die überwiegend in Rentenwerte und verzinsliche Wertpapiere investieren).*
** *Aktienfonds (Fonds, die überwiegend in Aktien investieren).*
*** *Multi-Asset Fund (jeder Fonds, der als „Multi-Asset Fund" im jeweiligen Nachtrag des Prospekts definiert wurde).*
þ *Bis zum Widerruf der Genehmigung durch die Zentralbank.*

Weitere Informationen

Weitere Informationen zum Fondsangebot der Legg Mason Global Funds Plc erhalten Sie von den folgenden Stellen:

Für professionelle Anleger in Europa (außer VK und Schweiz)

Legg Mason Investments (Ireland) Limited
6th Floor, Building Three
Number One Ballsbridge
126 Pembroke Road
Dublin 4, Irland

www.leggmasonglobal.com

Für zugelassene Broker in Nord-, Süd- und Mittelamerika

Legg Mason Investments
1395 Brickell Avenue
Suite 1550
Miami, Florida 33131, USA
Tel.: + 305 529 4400

www.leggmasonamericas.com

Auf den jeweiligen Internetseiten finden Sie Informationen über:
- Tägliche Quotierungen
- Literatur, einschließlich Datenblätter sowie die neuesten Informationen über die einzelnen Fonds
- Zusätzliche Informationen über Legg Masons Vermögensverwaltungsunternehmen, die die Fonds verwalten

Brief an die Anteilsinhaber

Sehr geehrte Anteilsinhaberin, sehr geehrter Anteilsinhaber,

Wir freuen uns, Ihnen den Halbjahresbericht für Legg Mason Global Funds Plc (die „Gesellschaft") für den am 31. August 2020 zu Ende gegangenen Sechsmonatszeitraum vorzustellen. In diesem Bericht heben wir die Haupttreiber der Entwicklung der Anleihe- und Aktienmärkte während des Berichtszeitraums hervor.

Bericht über die Weltwirtschaft

Die Weltwirtschaft erlebte in den sechs Monaten vor dem 31. August 2020 einen schnellen und starken Rückgang, was hauptsächlich auf die Auswirkungen der COVID-19-Pandemie zurückzuführen ist. In seinem World Economic Outlook Update im Juni *2020*, erklärte der Internationale Währungsfonds (International Monetary Fund, „IMF"): „Die COVID-19-Pandemie hat sich in der ersten Jahreshälfte 2020 stärker als erwartet negativ auf die Aktivität ausgewirkt, und die Erholung wird voraussichtlich langsamer ausfallen als vorher prognostiziert. Wie beim WEO [World Economic Outlook] von *April* 2020 ist die Unsicherheit in Bezug auf diese Prognose höher als üblich. Die Basisprojektion basiert auf den wichtigsten Annahmen über die Auswirkungen der Pandemie. In Volkswirtschaften mit sinkenden Infektionsraten spiegelt der langsamere Erholungspfad in der aktualisierten Prognose die anhaltende räumliche Distanzierung bis in die zweite Jahreshälfte 2020 wider. Für die Volkswirtschaften, die Schwierigkeiten haben, die Infektionsraten unter Kontrolle zu halten, wird ein längerer Lockdown eine zusätzliche Belastung für die Aktivität bedeuten." Aus regionaler Sicht geht der IWF davon aus, dass die US-Wirtschaft 2020 um 8,0 % schrumpfen wird, verglichen mit 2,3 % Prozent Wachstum des BIP in 2019. An anderer Stelle erwartet der IWF für das Jahr 2020 einen Rückgang des BIP in der Eurozone, Großbritannien und Japan um -10,2 %, -10,2 % bzw. -5,8 %. Zum Vergleich: Diese Volkswirtschaften wuchsen im Jahr 2019 um 1,3 %, 1,4 % bzw. 0,7 %.

Marktüberblick - Rentenmärkte [i]

Der globale Rentenmarkt verzeichnete während des Berichtszeitraums positive Ergebnisse, da er durch Phasen mit erhöhter Risikoaversion der Anleger unterstützt wurde. In den USA ergriff das Federal Reserve Board („Fed")[ii] eine Reihe beispielloser Maßnahmen, um die Wirtschaft zu unterstützen und das einwandfreie Funktionieren der Finanzmärkte aufrechtzuerhalten. Im März 2020 führte die US-Notenbank zwei Zinssenkungen durch, die den Leitzins auf einen Bereich zwischen 0,00 % und 0,25 % drückten – was einem historischen Tief entspricht. Die US-Notenbank kündigte außerdem an, dass sie unbegrenzt Schatz- und Hypothekenpapiere kaufen sowie einzelne Unternehmensanleihen kaufen werde. Schließlich aktualisierte die US-Notenbank im August 2020 ihre geldpolitische Strategie, die eine höhere Inflation und eine höhere Beschäftigungsrate ermöglicht, was bedeuten könnte, dass die Zinssätze länger als erwartet niedrig bleiben. Vor diesem Hintergrund gingen die Renditen der US-Treasury[iii] zurück (Renditen und Preise bewegen sich in die entgegengesetzte Richtung) und die Spread-Sektoren (Nicht-US-Treasury) erholten sich. Die aggressive Anpassung der Geldpolitik durch eine Reihe anderer Zentralbanken führte auch dazu, dass die längerfristigen Renditen von Staatsanleihen in Europa niedrig blieben. Anderswo verzeichneten Investment-Grade[iv] Unternehmensanleihen [v] und Unternehmensanleihen mit niedrigerem Rating positive Renditen, ebenso wie auf US-Dollar lautende Staatsanleihen von Schwellenländern.

Marktüberblick - Globale Aktien[vi]

Nach einem starken Rückgang im März 2020 erholte sich der globale Aktienmarkt in den letzten fünf Monaten des Berichtszeitraums stark. Dieser Umschwung wurde durch eine Reihe von Faktoren ausgelöst, darunter die aggressiven Maßnahmen der globalen Zentralbanken, die wirtschaftlichen Wiedereröffnungen einer Reihe von Ländern, Unternehmensgewinne, die oft die bescheidenen Erwartungen übertrafen, und Hoffnungen auf einen COVID-19-Impfstoff. Am Aktienmarkt waren Technologieaktien die Marktführer, da sie tendenziell von den COVID-19-induzierten Lockdowns profitierten. Auch Aktien der Industrie- und Schwellenländer außerhalb der USA legten zu, wenn auch nicht in dem in den USA beobachteten Ausmaß.

Wir danken Ihnen für Ihr anhaltendes Vertrauen.

Mit freundlichen Grüßen

Legg Mason Investments (Ireland) Limited

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein zuverlässiger Hinweis auf zukünftige Ergebnisse. Diese Information ist weder als Prognose für künftige Ereignisse, Garantie für künftige Ergebnisse noch als Anlageberatung zu werten.

Alle Daten entsprechen dem Stand vom 31. August 2020, sofern nichts anderes angegeben ist.

Legg Mason Global Funds plc ist ein als offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital konstituierter Umbrellafonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds, der in Irland von der Central Bank of Ireland als an Organismus für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren zugelassen ist.

Sämtliche Anlagen sind mit einem Risiko verbunden, einschließlich des möglichen Verlustes des Anlagekapitals. Die historische Wertentwicklung lässt keine Schlussfolgerungen auf künftige Wertentwicklungen zu und wird unter Umständen nicht wiederholt.

Diese Informationen wurden auf der Grundlage von Quellen erstellt, die für zuverlässig erachtet werden. Legg Mason garantiert diese jedoch nicht und sie stellen keine vollständige Zusammenfassung oder Aufstellung aller verfügbaren Daten dar.

Genannte einzelne Wertpapiere sollen als Beispiele für Portfoliopositionen dienen und sind nicht als Kauf- oder Verkaufsempfehlungen gedacht.

Zum Ausdruck gebrachte Meinungen können sich ohne Vorankündigung ändern und berücksichtigen nicht die spezifischen Anlageziele, finanzielle Lage oder die Bedürfnisse einzelner Anleger.

Vor der Investition sollten Sie die wesentlichen Anlegerinformationen und den Prospekt lesen, die das vollständige Anlageziel und die Risikofaktoren des Teilfonds enthalten. Diese und sonstige relevante Unterlagen sind in einer Reihe von Sprachen von BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company, One Dockland Central, Guild Street, IFSC, Dublin 1, Irland, www.leggmasonglobal.com und am eingetragenen Sitz erhältlich.

Herausgegeben und genehmigt von Legg Mason Investments (Ireland) Limited mit eingetragenem Sitz in 6th Floor, Building Three, Number One Ballsbridge, 126 Pembroke Road, Dublin 4, D04 EP27, Irland. Eingetragen in Irland unter der Register-Nr. 271887. Zugelassen und beaufsichtigt durch die Central Bank of Ireland.

Dieses Dokument ist nicht für Personen oder Verwendungszwecke bestimmt, wenn dies gegen örtliche Gesetze oder aufsichtsrechtliche Vorschriften verstößt. Legg Mason ist nicht verantwortlich und haftet nicht, wenn dieses Dokument weiterverteilt wird.

[i] Rentenwerte – Anleihen.

[ii] US Federal Reserve - die Zentralbank der Vereinigten Staaten und das mächtigste Finanzinstitut der Welt.

[iii] Treasury-Rendite - Zinsen auf Kredite, die von der Regierung gezahlt werden.

[iv] Investment Grade - ein Kreditrating, das bedeutet, dass eine Staats- oder Unternehmensanleihe ein relativ geringes Ausfallrisiko hat.

[v] Unternehmensanleihe - eine Anleihe, die von einem Unternehmen begeben wird, um zur Expansion seines Geschäfts effektiv Geld zu beschaffen.

[vi] Aktien - Eigentumsbeteiligung an einer Gesellschaft in Form von Stammaktien oder Vorzugsaktien.

Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 86,81 % (29. Februar 2020: 82,56 %)			
USA — 86,81 % (29. Februar 2020: 82,56 %)			
2.222	Fannie Mae Discount Notes, Null-Coupon, fällig 15.09.2020	2.222	0,21
25.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0, 0,187 %, fällig 18.09.2020 *	25.000	2,30
48.675	Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 16.11.2020	48.618	4,48
12.000	Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 08.03.2021	11.973	1,10
50.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 04.09.2020	49.999	4,60
17.350	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 23.09.2020	17.349	1,60
1.752	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 202.10.2020	1.751	0,16
25.000	Federal Home Loan Banks, 0,120 %, fällig 04.09.2020 *	25.000	2,30
6.580	Federal Home Loan Banks, Series 00, 0,072 %, fällig 28.10.2020 *	6.580	0,61
19.700	Federal Home Loan Banks, Series 0, 0,112 %, fällig 16.02.2021 *	19.700	1,81
30.000	Federal Home Loan Banks, 0,130 %, fällig 03.03.2021 *	30.000	2,76
25.000	Federal Home Loan Banks, 0,150 %, fällig 27.04.2021	25.000	2,30
25.000	Federal Home Loan Banks, Series 00, 0,140 %, fällig 26.05.2021 *	25.000	2,30
30.000	Federal Home Loan Banks, Series 0, 0,135 %, fällig 24.06.2021 *	30.000	2,76
25.000	Federal Home Loan Mortgage Corp, 0,130 %, fällig 04.12.2020 *	25.000	2,30
30.000	United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 15.12.2020	29.986	2,76
55.195	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 03.09.2020	55.195	5,08
25.000	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 15.09.2020	24.998	2,30
64.614	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 17.09.2020	64.611	5,95
50.286	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 22.09.2020	50.282	4,63
45.000	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 24.09.2020	44.997	4,14
20.579	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 29.09.2020	20.578	1,90
35.015	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 01.10.2020	35.011	3,22
25.250	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 13.10.2020	25.246	2,32
30.000	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 27.10.2020	29.993	2,76
9.093	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 19.11.2020	9.091	0,84
20.000	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 17.12.2020	19.993	1,84
30.000	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 21.01.2021	29.985	2,76
50.000	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 18.02.2021	49.972	4,60
50.000	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 25.02.2021	49.971	4,60
15.000	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 12.08.2021	14.980	1,38
20.000	United States Treasury Bill – When Issued, Null-Coupon, fällig 06.10.2020	19.998	1,84
25.000	United States Treasury Bill – WI Post Auction, Null-Coupon, fällig 03.12.2020	24.993	2,30
		943.072	86,81
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 943.072 USD)		943.072	86,81
Umgekehrte Pensionsgeschäfte — 18,31 % (29. Februar 2020: 20,06 %)			
USA — 18,31 % (29. Februar 2020: 20,06 %)			
100.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, umgekehrtes Pensionsgeschäft zum Rückkauf zu 100,000,194 USD (besichert durch US-Staatsanleihen und US-Schatzwechsel im Gesamtwert von 102,000,263 USD), 0.070 %, fällig am 01.09.2020	100.000	9,21
98.855	JP Morgan, umgekehrtes Pensionsgeschäft zum Rückkauf zu 98,855,192 USD (besichert durch US-Staatsanleihen und US-Schatzwechsel im Gesamtwert von 100,832,355 USD), 0,070 %, fällig am 01.09.2020	98.855	9,10
		198.855	18,31
Summe umgekehrte Pensionsvereinbarung (Kosten 198.855 USD)		198.855	18,31
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		1.141.927	105,12
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(55.659)	(5,12)
Gesamtnettovermögen		1.086.268 $	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	82,58
Geldmarktinstrumente	17,41
Sonstige Vermögenswerte	0,01
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 7,27 % (29. Februar 2020: 3,20 %)			
542	Apex Credit CLO 2017 Ltd, Series 2017 1A, Klasse A1, 144A, 1,734 %, fällig 24.04.2029 *	541	0,17
310	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2019 1A, Klasse A2I,144A, 4,194 %, fällig 07.06.2049	270	0,09
500	Ares XLIII CLO Ltd, Series 2017 43A, Klasse A, 144A, 1,495 %, fällig 15.10.2029 *	499	0,16
415	Argent Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2003-W7, Series 2003 W3, Klasse M1, 1,300 %, fällig 25.09.2033 *	392	0,12
186	Avery Point V CLO Ltd, Series 2014 5A, Klasse AR, 144A, 1,253 %, fällig 17.07.2026 *	185	0,06
490	Benefit Street Partners CLO VII Ltd, Series 2015 VIIA, Klasse A2R, 144A, 1,472 %, fällig 18.07.2027 *	483	0,15
500	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd, Series 2015 8A, Klasse A1AR, 144A, 1,372 %, fällig 20.01.2031 *	493	0,16
250	Black Diamond Clo 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Klasse A1A, 144A, 1,554 %, fällig 24.04.2029 *	248	0,08
500	BLUEMOUNTAIN CLO 2012-2 Ltd, Series 2012 2A, Klasse AR2, 144A, 1,303 %, fällig 20.11.2028 *	498	0,16
600	BlueMountain CLO XXII Ltd, Series 2018 22A, Klasse A1, 144A, 1,355 %, fällig 15.07.2031 *	590	0,19
250	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-3 Ltd, Series 2015 3A, Klasse A1R, 144A, 1,247 %, fällig 28.07.2028 *	249	0,08
500	CBAM 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Klasse A1, 144A, 1,522 %, fällig 20.07.2030 *	498	0,16
500	CIFC Funding 2013-II Ltd, Series 2013 2A, Klasse A1LR, 144A, 1,482 %, fällig 18.10.2030 *	497	0,16
132	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Series 2001 HE22, Klasse A1, 0,655 %, fällig 25.02.2032 *	126	0,04
87	Cutwater 2014-I Ltd, Series 2014 1A, Klasse A1AR, 144A, 1,525 %, fällig 15.07.2026 *	87	0,03
500	CVP CLO 2017-2 Ltd, Series 2017 2A, Klasse A, 144A, 1,462 %, fällig 20.01.2031 *	495	0,16
50	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2007-13, Series 2007 13, Klasse 2A2, 0,975 %, fällig 25.10.2047 *	49	0,02
196	CWABS Inc Asset-Backed Certificates Trust 2004-5, Series 2004 5, Klasse 2A, 0,675 %, fällig 25.10.2034 *	191	0,06
60	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-F, Series 2006 F, Klasse 2A1A, 0,302 %, fällig 15.07.2036 *	55	0,02
440	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I, Series 2006 I, Klasse 1A, 0,302 %, fällig 15.01.2037 *	419	0,13
325	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I, Series 2006 I, Klasse 2A, 0,302 %, fällig 15.01.2037 *	310	0,1
580	Denali Capital CLO X LLC, Series 2013 1A, Klasse A1LR, 144A, 1,295 %, fällig 26.10.2027 *	579	0,19
225	Dryden XXV Senior Loan Fund, Series 2012 25A, Klasse ARR, 144A, 1,175 %, fällig 15.10.2027 *	223	0,07
387	EFS Volunteer No 2 LLC, Series 2012 1, Klasse A2, 144A, 1,525 %, fällig 25.03.2036 *	386	0,12
1.090	Enterprise Fleet Financing LLC, Series 2017 3, Klasse A3, 144A, 2,360 %, fällig 20.05.2023	1.103	0,35
160	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Series 2018 4, Klasse A, 4,060 %, fällig 15.11.2030	181	0,06
500	GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd, Series 2014 9A, Klasse AR2, 144A, 1,380 %, fällig 29.10.2029 *	497	0,16
250	Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Klasse A2, 144A, 1,285 %, fällig 15.04.2031 *	247	0,08
500	Grippen Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Klasse A, 144A, 1,532 %, fällig 20.01.2030 *	499	0,16
1.570	Home Equity Asset Trust 2006-4, Series 2006 4, Klasse 2A4, 0,455 %, fällig 25.08.2036 *	1.547	0,49
529	Jackson Mill CLO Ltd, Series 2015 1A, Klasse AR, 144A, 1,105 %, fällig 15.04.2027 *	525	0,17
1.261	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Series 2004 1, Klasse M1, 0,925 %, fällig 25.02.2034 *	1.229	0,39
514	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-4, Series 2004 4, Klasse M1, 1,075 %, fällig 25.10.2034 *	504	0,16
664	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2004-WMC5, Series 2004 WMC5, Klasse M1, 1,105 %, fällig 25.07.2035 *	653	0,21
232	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006-HE1, Series 2006 HE1, Klasse M1, 0,565 %, fällig 25.12.2036 *	231	0,07
634	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2004-NC8, Series 2004 NC8, Klasse M1, 1,090 %, fällig 25.09.2034 *	617	0,20
427	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-NC2, Series 2005 NC2, Klasse M4, 1,090 %, fällig 25.03.2035 *	425	0,14
1.480	Navient Private Education Refi Loan Trust 2018-C, Series 2018 CA, Klasse B, 144A, 4,220 %, fällig 16.06.2042	1.538	0,49
150	Navient Student Loan Trust 2016-6, Series 2016 6A, Klasse A3, 144A, 1,475 %, fällig 25.03.2066 *	149	0,05
200	Navient Student Loan Trust 2017-1, Series 2017 1A, Klasse A3, 144A, 1,325 %, fällig 26.07.2066 *	199	0,06
800	Navient Student Loan Trust 2018-EA, Series 2018 EA, Klasse B, 144A, 4,440 %, fällig 15.12.2059	832	0,27
163	NovaStar Mortgage Funding Trust Series 2003-3, Series 2003 3, Klasse A1, 0,885 %, fällig 25.12.2033 *	159	0,05
500	Ocean Trails CLO IX, Series 2020 9A, Klasse A1, 144A, 0,000 %, fällig 15.10.2029 * ∞	500	0,16
325	Recette Clo Ltd, Series 2015 1A, Klasse AR, 144A, 1,192 %, fällig 20.10.2027 *	324	0,10
590	Regatta VI Funding Ltd, Series 2016 1A, Klasse AR, 144A, 1,352 %, fällig 20.07.2028 *	589	0,19
136	SBA Small Business Investment Cos, Series 2018 10B, Klasse 1, 3,548 %, fällig 10.09.2028	147	0,05
505	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2005-OP1, Series 2005 OP1, Klasse M1, 0,790 %, fällig 25.01.2035 *	485	0,15
373	Seven Sticks CLO Ltd, Series 2016 1A, Klasse A1R, 144A, 1,325 %, fällig 15.07.2028 *	369	0,12
151	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A, Series 2007 A, Klasse A4A, 0,553 %, fällig 16.12.2041 *	144	0,05
319	Tralee CLO III Ltd, Series 2014 3A, Klasse AR, 144A, 1,302 %, fällig 20.10.2027 *	317	0,10
360	Voya CLO 2016-3 Ltd, Series 2016 3A, Klasse A1R, 144A, 1,462 %, fällig 18.10.2031 *	358	0,11
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 22.709 USD)		22.731	7,27
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 28,21 % (29. Februar 2020: 46,15 %)			
166	Banc of America Mortgage 2003-C Trust, Series 2003 C, Klasse B1, 4,092 %, fällig 25.04.2033 *	44	0,01
630	BANK 2018-BNK12, Series 2018 BN12, Klasse A4, 4,255 %, fällig 15.05.2061 *	751	0,24
113	Bear Stearns ALT-A Trust 2004-6, Series 2004 6, Klasse M1, 1,000 %, fällig 25.07.2034 *	112	0,04
11.012	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust, Series 2018 B5, Klasse XA, 0,642 %, fällig 15.07.2051 *	333	0,11
879	BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Klasse A, 144A, 1,412 %, fällig 15.07.2035 *†	844	0,27
330	BXMT 2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2, Klasse A, 144A, 1,062 %, fällig 16.02.2037 *	323	0,10
100	CD 2017-CD3 Mortgage Trust, Series 2017 CD3, Klasse A4, 3,631 %, fällig 10.02.2050	114	0,04
700	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P3, Series 2016 P3, Klasse A3, 3,063 %, fällig 15.04.2049	758	0,24
150	COMM 2012-CCRE4 Mortgage Trust, Series 2012 CR4, Klasse AM, 3,251 %, fällig 15.10.2045	151	0,05
10	COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Series 2013 CR12, Klasse AM, 4,300 %, fällig 10.10.2046	11	–
192	Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, Series 2014 UBS2, Klasse XA, 1,319 %, fällig 10.03.2047 *	6	–
135	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust, Series 2015 LC19, Klasse ASB, 3,040 %, fällig 10.02.2048	141	0,05
100	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C1, Klasse AS, 3,791 %, fällig 15.04.2050 *	109	0,04
340	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Klasse A2, 144A, 3,953 %, fällig 15.09.2037 †	342	0,11
420	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Klasse B, 144A, 4,185 %, fällig 15.09.2037 †	375	0,12
1.188	CSMC Trust 2018-J1, Series 2018 J1, Klasse A2.144A, 3,500 %, fällig 25.02.2048 *	1.237	0,40
1.095	CSMC Trust 2018-J1, Series 2018 J1, Klasse B2, 144A, 3,653 %, fällig 25.02.2048 *	1.010	0,32
333	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C03, Klasse 1M2, 3,175 %, fällig 25.07.2024 *	295	0,09
64	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C04, Klasse 2M2, 5,175 %, fällig 25.11.2024 *	66	0,02
2	Fannie Mae Interest Strip 390, Klasse C3, 6,000 %, fällig 25.07.2038	–	–
7	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 41, 6,000 %, fällig 25.01.2038	1	–
20	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C13, 3,500 %, fällig 25.11.2041	2	–
19	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C18, 4,000 %, fällig 25.04.2042	3	–
16	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C2, 3,000 %, fällig 25.04.2027	1	–

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 — *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
500	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA,1,500 % ±	512	0,16
3.700	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA,2,000 % ±	3.850	1,23
600	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA,4,500 % ±	648	0,21
7.700	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 % ±	7.941	2,54
2	Fannie Mae Pool ‘888795’, 5,500 %, fällig 01.11.2036	3	–
67	Fannie Mae Pool ‘890604’, 4,500 %, fällig 01.10.2044	75	0,02
120	Fannie Mae Pool ‘AB6201’, 3,000 %, fällig 01.09.2042	131	0,04
44	Fannie Mae Pool ‘AB9594’, 4,000 %, fällig 01.06.2043	50	0,02
325	Fannie Mae Pool ‘AH4536’, 4,000 %, fällig 01.02.2041	361	0,12
16	Fannie Mae Pool ‘AL4324’, 6,500 %, fällig 01.05.2040	18	0,01
133	Fannie Mae Pool ‘AL9397’, 3,000 %, fällig 01.10.2046	142	0,05
203	Fannie Mae Pool ‘AL9546’, 3,500 %, fällig 01.11.2046	219	0,07
70	Fannie Mae Pool ‘AL9631’, 3,000 %, fällig 01.12.2046	76	0,02
20	Fannie Mae Pool ‘AM8674’, 2,810 %, fällig 01.04.2025	22	0,01
97	Fannie Mae Pool ‘AO7501’, 4,000 %, fällig 01.06.2042	107	0,03
40	Fannie Mae Pool ‘AP4781’, 3,000 %, fällig 01.09.2042	43	0,01
128	Fannie Mae Pool ‘AS6328’, 3,500 %, fällig 01.12.2045	137	0,04
706	Fannie Mae Pool ‘AS7313’, 3,500 %, fällig 01.06.2046	768	0,25
154	Fannie Mae Pool ‘AS7738’, 3,000 %, fällig 01.08.2046	167	0,05
124	Fannie Mae Pool ‘AS7844’, 3,000 %, fällig 01.09.2046	132	0,04
119	Fannie Mae Pool ‘AS8359’, 3,000 %, fällig 01.11.2046	126	0,04
70	Fannie Mae Pool ‘AS8745’, 3,000 %, fällig 01.02.2047	76	0,02
112	Fannie Mae Pool ‘AS9588’, 4,000 %, fällig 01.05.2047	121	0,04
38	Fannie Mae Pool ‘AT4281’, 4,000 %, fällig 01.06.2043	42	0,01
74	Fannie Mae Pool ‘BC0884’, 3,000 %, fällig 01.05.2046	80	0,03
130	Fannie Mae Pool ‘BC1509’, 3,000 %, fällig 01.08.2046	139	0,04
190	Fannie Mae Pool ‘BC2817’, 3,000 %, fällig 01.09.2046	201	0,06
69	Fannie Mae Pool ‘BD2455’, 3,000 %, fällig 01.01.2047	74	0,02
67	Fannie Mae Pool ‘BD8104’, 3,000 %, fällig 01.10.2046	73	0,02
202	Fannie Mae Pool ‘BE2981’, 3,000 %, fällig 01.02.2032	216	0,07
316	Fannie Mae Pool ‘BF0104’, 4,000 %, fällig 01.02.2056	357	0,11
379	Fannie Mae Pool ‘BF0133’, 4,000 %, fällig 01.08.2056	426	0,14
201	Fannie Mae Pool ‘BF0145’, 3,500 %, fällig 01.03.2057	221	0,07
100	Fannie Mae Pool ‘BF0163’, 5,000 %, fällig 01.11.2046	113	0,04
137	Fannie Mae Pool ‘BF0183’, 4,000 %, fällig 01.01.2057	155	0,05
342	Fannie Mae Pool ‘BF0191’, 4,000 %, fällig 01.06.2057	385	0,12
203	Fannie Mae Pool ‘BF0222’, 4,500 %, fällig 01.09.2057	229	0,07
486	Fannie Mae Pool ‘BH2623’, 4,000 %, fällig 01.08.2047	522	0,17
1.040	Fannie Mae Pool ‘BH4101’, 3,500 %, fällig 01.10.2047	1.101	0,35
211	Fannie Mae Pool ‘BH9923’, 3,500 %, fällig 01.09.2047	224	0,07
39	Fannie Mae Pool ‘BL2454’, 3,160 %, fällig 01.05.2029	45	0,01
100	Fannie Mae Pool ‘BL5656’, 2,260 %, fällig 01.02.2030	109	0,04
100	Fannie Mae Pool ‘BL5742’, 2,320 %, fällig 01.02.2032	109	0,04
199	Fannie Mae Pool ‘BL5850’, 2,260 %, fällig 01.04.2030	216	0,07
100	Fannie Mae Pool ‘BL6083’, 2,060 %, fällig 01.03.2030	109	0,04
99	Fannie Mae Pool ‘BL6160’, 2,060 %, fällig 01.03.2030	108	0,03
246	Fannie Mae Pool ‘BM3473’, 3,500 %, fällig 01.11.2047	270	0,09
48	Fannie Mae Pool ‘BM3904’, 5,000 %, fällig 01.05.2048	53	0,02
603	Fannie Mae Pool ‘BM4579’, 3,000 %, fällig 01.04.2047	651	0,21
73	Fannie Mae Pool ‘BM4751’, 3,500 %, fällig 01.03.2043	79	0,03
151	Fannie Mae Pool ‘BM4897’, 3,500 %, fällig 01.12.2046	162	0,05
254	Fannie Mae Pool ‘BM5521’, 3,500 %, fällig 01.07.2048	269	0,09
1.548	Fannie Mae Pool ‘BM5526’, 3,500 %, fällig 01.02.2048	1.639	0,52
258	Fannie Mae Pool ‘BN0341’, 5,000 %, fällig 01.12.2048	283	0,09
143	Fannie Mae Pool ‘BN1623’, 4,500 %, fällig 01.11.2048	158	0,05
2.584	Fannie Mae Pool ‘BN3898’, 4,500 %, fällig 01.12.2048	2.847	0,91
174	Fannie Mae Pool ‘BN7652’, 3,000 %, fällig 01.07.2049	185	0,06
91	Fannie Mae Pool ‘BO2252’, 3,500 %, fällig 01.10.2049	98	0,03
297	Fannie Mae Pool ‘BO7625’, 3,000 %, fällig 01.03.2050	317	0,10
15	Fannie Mae Pool ‘BO9692’, 3,000 %, fällig 01.01.2050	16	0,01
94	Fannie Mae Pool ‘BP1662’, 3,500 %, fällig 01.02.2050	99	0,03
100	Fannie Mae Pool ‘BP9421’, 3,000 %, fällig 01.07.2050	107	0,03
184	Fannie Mae Pool ‘CA0858’, 3,500 %, fällig 01.12.2047	195	0,06
183	Fannie Mae Pool ‘CA1053’, 3,500 %, fällig 01.01.2048	194	0,06
858	Fannie Mae Pool ‘CA1692’, 4,000 %, fällig 01.05.2048	921	0,29
193	Fannie Mae Pool ‘CA2047’, 4,500 %, fällig 01.07.2048	212	0,07
323	Fannie Mae Pool ‘CA2199’, 4,500 %, fällig 01.08.2048	354	0,11
1.915	Fannie Mae Pool ‘CA2207’, 4,500 %, fällig 01.08.2048	2.068	0,66
44	Fannie Mae Pool ‘CA2251’, 5,000 %, fällig 01.08.2048	49	0,02
248	Fannie Mae Pool ‘CA2471’, 4,000 %, fällig 01.10.2048	265	0,09
265	Fannie Mae Pool ‘CA2482’, 4,500 %, fällig 01.10.2048	290	0,09
361	Fannie Mae Pool ‘CA2652’, 5,000 %, fällig 01.11.2048	396	0,13
784	Fannie Mae Pool ‘CA2798’, 4,500 %, fällig 01.12.2048	858	0,27
1.148	Fannie Mae Pool ‘CA2799’, 4,500 %, fällig 01.12.2048	1.256	0,40
48	Fannie Mae Pool ‘CA2805’, 4,500 %, fällig 01.12.2048	51	0,02
84	Fannie Mae Pool ‘CA3809’, 3,000 %, fällig 01.07.2049	90	0,03
966	Fannie Mae Pool ‘CA3860’, 3,500 %, fällig 01.07.2049	1.038	0,33
709	Fannie Mae Pool ‘CA4110’, 3,000 %, fällig 01.09.2049	751	0,24
362	Fannie Mae Pool ‘CA4133’, 3,000 %, fällig 01.09.2049	389	0,12
479	Fannie Mae Pool ‘CA4979’, 3,000 %, fällig 01.01.2050	505	0,16
1.317	Fannie Mae Pool ‘CA5164’, 3,500 %, fällig 01.02.2050	1.388	0,44
222	Fannie Mae Pool ‘CA5216’, 3,000 %, fällig 01.02.2050	236	0,08
869	Fannie Mae Pool ‘CA5225’, 3,000 %, fällig 01.02.2050	937	0,30
474	Fannie Mae Pool ‘CA5226’, 3,000 %, fällig 01.02.2050	503	0,16
1.332	Fannie Mae Pool ‘CA5561’, 3,500 %, fällig 01.04.2050	1.422	0,45
197	Fannie Mae Pool ‘CA6000’, 3,000 %, fällig 01.06.2050	209	0,07
60	Fannie Mae Pool ‘FM1468’, 5,000 %, fällig 01.08.2049	66	0,02
64	Fannie Mae Pool ‘FM1789’, 3,000 %, fällig 01.11.2049	68	0,02
748	Fannie Mae Pool ‘FM2075’, 3,000 %, fällig 01.12.2049	795	0,25
88	Fannie Mae Pool ‘FM2158’, 4,000 %, fällig 01.10.2049	95	0,03
280	Fannie Mae Pool ‘FM2333’, 3,500 %, fällig 01.02.2050	296	0,10
89	Fannie Mae Pool ‘FM2745’, 4,500 %, fällig 01.03.2050	96	0,03
345	Fannie Mae Pool ‘FM3141’, 3,500 %, fällig 01.11.2048	368	0,12
85	Fannie Mae Pool ‘FM3154’, 5,000 %, fällig 01.09.2049	93	0,03
84	Fannie Mae Pool ‘FM3155’, 5,000 %, fällig 01.12.2049	92	0,03
91	Fannie Mae Pool ‘FM3158’, 4,000 %, fällig 01.11.2048	99	0,03
416	Fannie Mae Pool ‘FM3347’, 3,500 %, fällig 01.05.2047	445	0,14
587	Fannie Mae Pool ‘FM3773’, 3,500 %, fällig 01.11.2048	628	0,20
200	Fannie Mae Pool ‘FM3957’, 5,000 %, fällig 01.03.2050	219	0,07
74	Fannie Mae Pool ‘MA1217’, 4,000 %, fällig 01.10.2042	82	0,03
36	Fannie Mae Pool ‘MA1253’, 4,000 %, fällig 01.11.2042	40	0,01
45	Fannie Mae Pool ‘MA1591’, 4,500 %, fällig 01.09.2043	50	0,02
817	Fannie Mae Pool ‘MA2806’, 3,000 %, fällig 01.11.2046	862	0,28
279	Fannie Mae Pool ‘MA3501’, 5,000 %, fällig 01.10.2048	306	0,10
274	Fannie Mae Pool ‘MA3527’, 5,000 %, fällig 01.11.2048	301	0,10
17	Fannie Mae REMICS, Series 2001 81, Klasse GE, 6,000 %, fällig 25.01.2032	20	0,01
29	Fannie Mae REMICS, Series 2005 29, Klasse ZA, 5,500 %, fällig 25.04.2035	34	0,01
20	Fannie Mae REMICS, Series 2011 87, Klasse SG, 6,375 %, fällig 25.04.2040 *	2	–
55	Fannie Mae REMICS, Series 2012 101, Klasse AI, 3,000 %, fällig 25.06.2027	2	–
155	Fannie Mae REMICS, Series 2012 134, Klasse SK, 5,975 %, fällig 25.12.2042 *	33	0,01
11	Fannie Mae REMICS, Series 2012 46, Klasse BA, 6,000 %, fällig 25.05.2042	13	–
13	Fannie Mae REMICS, Series 2012 70, Klasse YS, 6,475 %, fällig 25.02.2041 *	1	–
15	Fannie Mae REMICS, Series 2012 75, Klasse NS, 6,425 %, fällig 25.07.2042 *	3	–
831	Fannie Mae REMICS, Series 2012 96, Klasse SB, 5,875 %, fällig 25.09.2042 *	143	0,05
15	Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Klasse BC, 6,500 %, fällig 25.07.2042	19	0,01
22	Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Klasse CB, 5,500 %, fällig 25.04.2042	25	0,01
100	Fannie Mae REMICS, Series 2020 47, Klasse GZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	101	0,03
199	Fannie Mae REMICS, Series 2020 56, Klasse DI, 2,500 %, fällig 25.08.2050	27	0,01
85	Fannie Mae-Aces, Series 2013 M6, Klasse 1AC, 3,548 %, fällig 25.02.2043 *	94	0,03
400	Fannie Mae-Aces, Series 2018 M15, Klasse 1A2, 3,700 %, fällig 25.01.2036	483	0,15
200	Fannie Mae-Aces, Series 2018 M9, Klasse APT2, 3,228 %, fällig 25.04.2028 *	225	0,07
200	Fannie Mae-Aces, Series 2019 M23, Klasse 3A3, 2,720 %, fällig 25.10.2031 *	216	0,07
600	Fannie Mae-Aces, Series 2020 M36, Klasse X1, 1,564 %, fällig 25.09.2034 *	66	0,02
53	Freddie Mac Gold Pool ‘C91240’, 4,500 %, fällig 01.01.2029	57	0,02
18	Freddie Mac Gold Pool ‘G06409’, 6,000 %, fällig 01.11.2039	21	0,01
8	Freddie Mac Gold Pool ‘G06669’, 6,500 %, fällig 01.09.2039	10	–
265	Freddie Mac Gold Pool ‘G61637’, 3,000 %, fällig 01.09.2047	287	0,09

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
316	Freddie Mac Gold Pool ‘G61739’, 3,000 %, fällig 01.09.2048	342	0,11
125	Freddie Mac Gold Pool ‘G67721’, 4,500 %, fällig 01.04.2049	137	0,04
532	Freddie Mac Gold Pool ‘J39656’, 3,000 %, fällig 01.09.2033	559	0,18
40	Freddie Mac Gold Pool ‘Q17792’, 3,500 %, fällig 01.05.2043	44	0,01
92	Freddie Mac Gold Pool ‘Q29184’, 4,000 %, fällig 01.10.2044	100	0,03
71	Freddie Mac Gold Pool ‘Q45560’, 3,000 %, fällig 01.01.2047	76	0,02
137	Freddie Mac Gold Pool ‘Q45737’, 3,000 %, fällig 01.01.2047	148	0,05
71	Freddie Mac Gold Pool ‘Q45819’, 3,000 %, fällig 01.01.2047	77	0,03
126	Freddie Mac Gold Pool ‘Q46955’, 4,500 %, fällig 01.03.2047	137	0,04
309	Freddie Mac Gold Pool ‘Q56683’, 3,000 %, fällig 01.04.2048	326	0,10
37	Freddie Mac Gold Pool ‘U90316’, 4,000 %, fällig 01.10.2042	41	0,01
49	Freddie Mac Gold Pool ‘U90503’, 3,500 %, fällig 01.11.2042	53	0,02
42	Freddie Mac Gold Pool ‘U99045’, 3,500 %, fällig 01.03.2043	45	0,01
113	Freddie Mac Gold Pool ‘U99124’, 3,500 %, fällig 01.03.2045	122	0,04
80	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K016, Klasse X1, 1,638 %, fällig 25.10.2021 *	1	–
90	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates Q006, Klasse A2, 4,677 %, fällig 25.04.2028 *	101	0,03
208	Freddie Mac Non Gold Pool ‘840698’, 2,503 %, fällig 01.03.2047 *	215	0,07
95	Freddie Mac Pool ‘QA7238’, 3,500 %, fällig 01.02.2050	103	0,03
167	Freddie Mac Pool ‘RA1103’, 3,000 %, fällig 01.07.2049	177	0,06
179	Freddie Mac Pool ‘RA1293’, 3,000 %, fällig 01.09.2049	192	0,06
92	Freddie Mac Pool ‘RA1341’, 3,000 %, fällig 01.09.2049	98	0,03
91	Freddie Mac Pool ‘RA1493’, 3,000 %, fällig 01.10.2049	96	0,03
570	Freddie Mac Pool ‘RA2117’, 3,000 %, fällig 01.02.2050	606	0,19
86	Freddie Mac Pool ‘RA2141’, 4,000 %, fällig 01.02.2050	92	0,03
485	Freddie Mac Pool ‘RA2313’, 3,500 %, fällig 01.03.2050	514	0,16
770	Freddie Mac Pool ‘RA2335’, 3,000 %, fällig 01.03.2050	820	0,26
89	Freddie Mac Pool ‘RA2358’, 4,000 %, fällig 01.03.2050	96	0,03
190	Freddie Mac Pool ‘RA2362’, 3,500 %, fällig 01.03.2050	202	0,07
900	Freddie Mac Pool ‘RA3474’, 3,000 %, fällig 01.09.2050	962	0,31
381	Freddie Mac Pool ‘SD0291’, 5,000 %, fällig 01.03.2050	417	0,13
378	Freddie Mac Pool ‘ZA5454’, 4,000 %, fällig 01.06.2048	405	0,13
615	Freddie Mac Pool ‘ZA6342’, 4,500 %, fällig 01.03.2049	672	0,22
14	Freddie Mac Pool ‘ZI7269’, 5,000 %, fällig 01.03.2038	17	0,01
354	Freddie Mac Pool ‘ZM5146’, 4,000 %, fällig 01.12.2047	379	0,12
52	Freddie Mac Pool ‘ZM8774’, 5,000 %, fällig 01.10.2048	57	0,02
50	Freddie Mac Pool ‘ZN1436’, 5,000 %, fällig 01.11.2048	55	0,02
8	Freddie Mac Pool ‘ZS3059’, 5,500 %, fällig 01.12.2038	9	–
13	Freddie Mac Pool ‘ZS3569’, 6,000 %, fällig 01.10.2036	15	0,01
201	Freddie Mac Pool ‘ZS4699’, 4,000 %, fällig 01.01.2047	218	0,07
24	Freddie Mac Pool ‘ZS6518’, 4,000 %, fällig 01.10.2025	26	0,01
46	Freddie Mac Pool ‘ZT0714’, 5,000 %, fällig 01.10.2048	50	0,02
421	Freddie Mac Pool ‘ZT1596’, 5,000 %, fällig 01.01.2049	462	0,15
7	Freddie Mac REMICS 3621, Klasse SB, 6,068 %, fällig 15.01.2040 *	2	–
41	Freddie Mac REMICS 3947, Klasse SG, 5,788 %, fällig 15.10.2041 *	7	–
10	Freddie Mac REMICS 4057, Klasse CS, 5,888 %, fällig 15.04.2039 *	–	–
29	Freddie Mac REMICS 4194, Klasse BI, 3,500 %, fällig 15.04.2043	3	–
16	Freddie Mac REMICS 4298, Klasse PI, 4,000 %, fällig 15.04.2043	1	–
126	Freddie Mac REMICS 4813, Klasse CJ, 3,000 %, fällig 15.08.2048	131	0,04
100	Freddie Mac REMICS 5010, Klasse IK, 2,500 %, fällig 25.09.2050 ∞	12	–
300	Freddie Mac REMICS 5010, Klasse JI, 2,500 %, fällig 25.09.2050 ∞	38	0,01
100	Freddie Mac REMICS 5013, Klasse IN, 2,500 %, fällig 25.09.2050 ∞	12	–
41	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2014 DN1, Klasse M2, 2,375 %, fällig 25.02.2024 *	41	0,01
840	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2017 DNA2, Klasse M2, 3,625 %, fällig 25.10.2029 *	868	0,28
89	Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates, Series T 56, Klasse 2AF, 0,575 %, fällig 25.05.2043 *	89	0,03
23	Ginnie Mae I Pool ‘557522’, 7,000 %, fällig 15.07.2031	28	0,01
12	Ginnie Mae I Pool ‘565347’, 7,000 %, fällig 15.08.2031	12	–
10	Ginnie Mae I Pool ‘584344’, 7,000 %, fällig 15.04.2032	11	–
138	Ginnie Mae I Pool ‘784571’, 3,500 %, fällig 15.06.2048	147	0,05
68	Ginnie Mae I Pool ‘AA5649’, 3,000 %, fällig 15.09.2042	72	0,02
121	Ginnie Mae I Pool ‘AB2892’, 3,000 %, fällig 15.09.2042	128	0,04
230	Ginnie Mae I Pool ‘AB9108’, 3,000 %, fällig 15.10.2042	242	0,08
17	Ginnie Mae II Pool ‘4837’, 6,000 %, fällig 20.10.2040	19	0,01
13	Ginnie Mae II Pool ‘4923’, 4,500 %, fällig 20.01.2041	15	0,01
12	Ginnie Mae II Pool ‘4961’, 6,000 %, fällig 20.02.2041	14	0,01
33	Ginnie Mae II Pool ‘4978’, 4,500 %, fällig 20.03.2041	36	0,01
15	Ginnie Mae II Pool ‘5240’, 6,000 %, fällig 20.11.2041	17	0,01
1.091	Ginnie Mae II Pool ‘784577’, 4,000 %, fällig 20.07.2047	1.175	0,38
133	Ginnie Mae II Pool ‘784825’, 3,500 %, fällig 20.10.2049	137	0,04
198	Ginnie Mae II Pool ‘784905’, 3,000 %, fällig 20.01.2050	209	0,07
73	Ginnie Mae II Pool ‘BC4732’, 3,500 %, fällig 20.10.2047	79	0,03
99	Ginnie Mae II Pool ‘BM7534’, 3,500 %, fällig 20.02.2050	105	0,03
197	Ginnie Mae II Pool ‘BM9743’, 4,000 %, fällig 20.11.2049	214	0,07
98	Ginnie Mae II Pool ‘BS1742’, 4,000 %, fällig 20.02.2050	106	0,03
71	Ginnie Mae II Pool ‘MA1995’, 3,500 %, fällig 20.06.2044	76	0,02
100	Ginnie Mae II Pool ‘MA2677’, 3,000 %, fällig 20.03.2045	106	0,03
27	Ginnie Mae II Pool ‘MA2678’, 3,500 %, fällig 20.03.2045	29	0,01
46	Ginnie Mae II Pool ‘MA3937’, 3,500 %, fällig 20.09.2046	49	0,02
53	Ginnie Mae II Pool ‘MA4068’, 3,000 %, fällig 20.11.2046	56	0,02
258	Ginnie Mae II Pool ‘MA4511’, 4,000 %, fällig 20.06.2047	278	0,09
298	Ginnie Mae II Pool ‘MA4838’, 4,000 %, fällig 20.11.2047	320	0,10
36	Ginnie Mae II Pool ‘MA4899’, 3,000 %, fällig 20.12.2047	38	0,01
194	Ginnie Mae II Pool ‘MA4901’, 4,000 %, fällig 20.12.2047	209	0,07
33	Ginnie Mae II Pool ‘MA5018’, 3,000 %, fällig 20.02.2048	35	0,01
343	Ginnie Mae II Pool ‘MA5019’, 3,500 %, fällig 20.02.2048	366	0,12
99	Ginnie Mae II Pool ‘MA5020’, 4,000 %, fällig 20.02.2048	108	0,03
142	Ginnie Mae II Pool ‘MA5078’, 4,000 %, fällig 20.03.2048	152	0,05
89	Ginnie Mae II Pool ‘MA5137’, 4,000 %, fällig 20.04.2048	95	0,03
364	Ginnie Mae II Pool ‘MA5193’, 4,500 %, fällig 20.05.2048	395	0,13
341	Ginnie Mae II Pool ‘MA5265’, 4,500 %, fällig 20.06.2048	369	0,12
162	Ginnie Mae II Pool ‘MA5331’, 4,500 %, fällig 20.07.2048	176	0,06
452	Ginnie Mae II Pool ‘MA5467’, 4,500 %, fällig 20.09.2048	490	0,16
254	Ginnie Mae II Pool ‘MA5529’, 4,500 %, fällig 20.10.2048	275	0,09
433	Ginnie Mae II Pool ‘MA5530’, 5,000 %, fällig 20.10.2048	472	0,15
114	Ginnie Mae II Pool ‘MA5652’, 4,500 %, fällig 20.12.2048	123	0,04
1.018	Ginnie Mae II Pool ‘MA5711’, 4,500 %, fällig 20.01.2049	1.096	0,35
602	Ginnie Mae II Pool ‘MA5712’, 5,000 %, fällig 20.01.2049	653	0,21
51	Ginnie Mae II Pool ‘MA5762’, 3,500 %, fällig 20.02.2049	54	0,02
256	Ginnie Mae II Pool ‘MA5818’, 4,500 %, fällig 20.03.2049	276	0,09
199	Ginnie Mae II Pool ‘MA5877’, 4,500 %, fällig 20.04.2049	215	0,07
1.100	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000 % ±	1.140	0,36
1.200	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500 % ±	1.265	0,40
8	Government National Mortgage Association, Series 2007 51, Klasse SG, 6,422 %, fällig 20.08.2037 *	1	–
26	Government National Mortgage Association, Series 2009 H01, Klasse FA, 1,308 %, fällig 20.11.2059 *	26	0,01
6	Government National Mortgage Association, Series 2010 85, Klasse HS, 6,492 %, fällig 20.01.2040 *	1	–
36	Government National Mortgage Association, Series 2010 H26, Klasse LF, 0,514 %, fällig 20.08.2058 *	36	0,01
58	Government National Mortgage Association, Series 2011 H01, Klasse AF, 0,614 %, fällig 20.11.2060 *	58	0,02
82	Government National Mortgage Association, Series 2011 H09, Klasse AF, 0,664 %, fällig 20.03.2061 *	82	0,03
210	Government National Mortgage Association, Series 2012 112, Klasse IO, 0,200 %, fällig 16.02.2053 *	2	–
131	Government National Mortgage Association, Series 2012 27, Klasse IO, 0,910 %, fällig 16.04.2053 *	3	–
30	Government National Mortgage Association, Series 2012 34, Klasse SA, 5,892 %, fällig 20.03.2042 *	8	–
107	Government National Mortgage Association, Series 2012 44, Klasse IO, 0,223 %, fällig 16.03.2049 *	1	–
41	Government National Mortgage Association, Series 2012 66, Klasse CI, 3,500 %, fällig 20.02.2038	1	–

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
37	Government National Mortgage Association, Series 2012 H18, Klasse NA, 0,684 %, fällig 20.08.2062 *	37	0,01
79	Government National Mortgage Association, Series 2012 H27, Klasse AI, 1,749 %, fällig 20.10.2062 *	4	–
46	Government National Mortgage Association, Series 2012 H30, Klasse GA, 0,514 %, fällig 20.12.2062 *	46	0,02
175	Government National Mortgage Association, Series 2013 107, Klasse AD, 2,693 %, fällig 16.11.2047 *	186	0,06
6	Government National Mortgage Association, Series 2013 145, Klasse IO, 1,034 %, fällig 16.09.2044 *	–	–
78	Government National Mortgage Association, Series 2013 163, Klasse IO, 1,264 %, fällig 16.02.2046 *	4	–
147	Government National Mortgage Association, Series 2013 H08, Klasse BF, 0,564 %, fällig 20.03.2063 *	146	0,05
626	Government National Mortgage Association, Series 2014 105, Klasse IO, 0,901 %, fällig 16.06.2054 *	23	0,01
68	Government National Mortgage Association, Series 2014 17, Klasse AM, 2,595 %, fällig 16.06.2048 *	72	0,02
28	Government National Mortgage Association, Series 2014 47, Klasse IA, 0,125 %, fällig 16.02.2048 *	–	–
111	Government National Mortgage Association, Series 2014 50, Klasse IO, 0,694 %, fällig 16.09.2055 *	5	–
349	Government National Mortgage Association, Series 2014 92, Klasse IX, 0,418 %, fällig 16.05.2054 *	5	–
745	Government National Mortgage Association, Series 2014 H20, Klasse FA, 0,594 %, fällig 20.10.2064 *	745	0,24
86	Government National Mortgage Association, Series 2015 167, Klasse OI, 4,000 %, fällig 16.04.2045	14	–
58	Government National Mortgage Association, Series 2015 36, Klasse MI, 5,500 %, fällig 20.03.2045	12	–
1.284	Government National Mortgage Association, Series 2015 5, Klasse IK, 0,625 %, fällig 16.11.2054 *	40	0,01
758	Government National Mortgage Association, Series 2016 128, Klasse IO, 0,921 %, fällig 16.09.2056 *	47	0,02
79	Government National Mortgage Association, Series 2019 123, Klasse A, 3,000 %, fällig 20.10.2049	83	0,03
100	Government National Mortgage Association, Series 2020 122, Klasse IM, 2,500 %, fällig 20.08.2050 ∞	13	–
200	Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Klasse NI, 2,500 %, fällig 20.08.2050 ∞	27	0,01
393	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Klasse MI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	67	0,02
98	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Klasse NI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	17	0,01
289	Government National Mortgage Association, Series 2020 H04, Klasse FP, 0,664 %, fällig 20.06.2069 *	290	0,09
300	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Klasse FL, 1,308 %, fällig 20.05.2070 *	315	0,10
193	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Klasse NF, 1,408 %, fällig 20.04.2070 *	198	0,06
100	Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Klasse FA, 0,611 %, fällig 20.07.2070 * ∞	99	0,03
520	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Klasse A, 144A, 1,462 %, fällig 15.09.2031 *∞	500	0,16
900	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Klasse B, 144A, 2,662 %, fällig 15.09.2031 *∞	854	0,27
570	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, Series 2018 3PCK, Klasse B, 144A, 2,412 %, fällig 15.09.2031 *	407	0,13
10	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16, Series 2013 GC16, Klasse B, 5,161 %, fällig 10.11.2046 *	11	–
112	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-9, Series 2005 9, Klasse 2A1B, 0,528 %, fällig 20.06.2035 *	109	0,04
450	Independence Plaza Trust 2018-INDP, Series 2018 INDP, Klasse A, 144A, 3,763 %, fällig 10.07.2035	480	0,15
10	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, Series 2013 C17, Klasse B, 5,054 %, fällig 15.01.2047 *	11	–
120	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23, Series 2014 C23, Klasse AS, 4,202 %, fällig 15.09.2047 *	131	0,04
13.653	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2018-C8, Series 2018 C8, Klasse XA, 0,802 %, fällig 15.06.2051 *	482	0,15
100	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18, Series 2014 C18, Klasse AS, 4,110 %, fällig 15.10.2047 *	108	0,04
80	Morgan Stanley Capital I Trust 2012-C4, Series 2012 C4, Klasse A4, 3,244 %, fällig 15.03.2045	81	0,03
235	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-ASHF, Series 2017 ASHF, Klasse A, 144A, 1,012 %, fällig 15.11.2034 *	221	0,07
550	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Klasse A, 144A, 3,047 %, fällig 15.08.2036	547	0,18
513	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Klasse A1B, 144A, 3,250 %, fällig 25.09.2056 *	548	0,18
657	Rosslyn Portfolio Trust 2017-ROSS, Series 2017 ROSS, Klasse A, 144A, 1,939 %, fällig 15.06.2033 *	647	0,21
11	Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-4, Series 2007 4, Klasse 1A1, 2,592 %, fällig 25.09.2037 *	11	–
658	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR6 Trust, Series 2005 AR6, Klasse 2A1A, 0,635 %, fällig 25.04.2045 *	652	0,21
1.118	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1, Series 2015 NXS1, Klasse XA, 1,235 %, fällig 15.05.2048 *	44	0,01
1.697	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Series 2016 C36, Klasse XA, 1,433 %, fällig 15.11.2059 *	99	0,03
460	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41, Series 2017 C41, Klasse B, 4,188 %, fällig 15.11.2050 *	492	0,16
139	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RC1, Series 2017 RC1, Klasse A2, 3,118 %, fällig 15.01.2060	142	0,05
1.748	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C23, Series 2014 C23, Klasse XA, 0,711 %, fällig 15.10.2057 *	33	0,01
70	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Series 2014 LC14, Klasse ASB, 3,522 %, fällig 15.03.2047	72	0,02
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 86.917 USD)		88.247	28,21
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 37,15 % (29. Februar 2020: 25,87 %)			
Australien — 0,31 % (29. Februar 2020: 0,11 %)			
105	BHP Billiton Finance USA Ltd, 2,875 %, fällig 24.02.2022	109	0,03
140	BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, fällig 30.09.2043	199	0,06
280	Glencore Funding LLC, 144A, 4,125 %, fällig 12.03.2024	305	0,10
10	Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, fällig 27.03.2027	11	–
280	Glencore Funding LLC, 144A, 3,875 %, fällig 27.10.2027	307	0,10
50	Westpac Banking Corp, 2,600 %, fällig 23.11.2020	50	0,02
		981	0,31
Belgien — 0,61 % (29. Februar 2020: 0,42 %)			
370	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650 %, fällig 01.02.2026	419	0,13
10	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,150 %, fällig 23.01.2025	11	–
160	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000 %, fällig 13.04.2028	186	0,06
390	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,750 %, fällig 23.01.2029	476	0,15
70	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 01.06.2030	80	0,03
180	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	210	0,07
100	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439 %, fällig 06.10.2048	117	0,04
340	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01.06.2050	413	0,13
		1.912	0,61
Brasilien — 0,64 % (29. Februar 2020: 0,56 %)			
10	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17.03.2024	11	–
50	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05.06.2115	55	0,02
690	Suzano Austria GmbH, 6,000 %, fällig 15.01.2029	784	0,25
270	Vale Overseas Ltd, 6,250 %, fällig 10.08.2026	321	0,10
20	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 21.11.2036	26	0,01
600	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 10.11.2039	812	0,26
		2.009	0,64
Kanada — 0,42 % (29. Februar 2020: 0,14 %)			
240	Bank of Montreal, 1,850 %, fällig 01.05.2025	252	0,08
30	Bank of Montreal, 3,803 %, fällig 15.12.2032 *	33	0,01
130	Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, fällig 11.06.2025	133	0,04
40	Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30.05.2041	57	0,02
110	Barrick PD Australie Finance Pty Ltd, 5,950 %, fällig 15.10.2039	158	0,05

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Kanada – (Fortsetzung)			
130	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,950 %, fällig 23.06.2023	132	0,04
40	Royal Bank of Canada, 2,150 %, fällig 26.10.2020	40	0,01
50	Royal Bank of Canada, 3,200 %, fällig 30.04.2021	51	0,02
210	Royal Bank of Canada, 1,600 %, fällig 17.04.2023	217	0,07
130	Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig 10.06.2025	132	0,04
110	Toronto-Dominion Bank/The, 3,250 %, fällig 11.06.2021	113	0,04
		1.318	0,42
Chile — 0,17 % (29. Februar 2020: 0,07 %)			
500	Corp Nacional del Cobre de Chile, 3,625 %, fällig 01.08.2027	547	0,17
China — 0,23 % (29. Februar 2020: 0,23 %)			
200	CNOOC Finance 2015 USA LLC, 3,500 %, fällig 05.05.2025	221	0,07
200	CNOOC Finance 2015 USA LLC, 4,375 %, fällig 02.05.2028	236	0,07
250	Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 4,375 %, fällig 10.04.2024	278	0,09
		735	0,23
Kolumbien — 0,24 % (29. Februar 2020: 0,25 %)			
650	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	739	0,24
Dänemark — 0,34 % (29. Februar 2020: 0,27 %)			
400	Danske Bank A/S, 144A, 5,000 %, fällig 12.01.2022	422	0,14
200	Danske Bank A/S,1 44A, 3,875 %, fällig 12.09.2023	216	0,07
200	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig 12.01.2024	227	0,07
200	Danske Bank A/S, 144A, 1,226 %, fällig 22.06.2024	202	0,06
		1.067	0,34
Finnland — 0,08 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
250	Nordea Bank Abp, 144A, 1,000 %, fällig 09.06.2023	253	0,08
Frankreich — 0,61 % (29. Februar 2020: 0,45 %)			
470	BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, fällig 10.01.2025 *	526	0,17
400	BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *	418	0,13
200	BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14.08.2028	237	0,08
200	BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, fällig 10.01.2030 *	249	0,08
250	Credit Agricole SA/London, 144A, 1,907 %, fällig 16.06.2026 *	258	0,08
200	Danone SA, 2,589 %, fällig 02.11.2023	211	0,07
		1.899	0,61
Indonesien — 0,26 % (29. Februar 2020: 0,26 %)			
700	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 5,250 %, fällig 24.10.2042	824	0,26
Irland — 0,09 % (29. Februar 2020: 0,09 %)			
280	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 5,000 %, fällig 01.10.2021	288	0,09
Italien — 0,22 % (29. Februar 2020: 0,22 %)			
180	Intesa Sanpaolo SpA, Series 0000, 144A, 6,500 %, fällig 24.02.2021	184	0,06
500	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,125 %, fällig 14.07.2022	514	0,16
		698	0,22
Kasachstan — 0,25 % (29. Februar 2020: 0,24 %)			
650	KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig 24.04.2030	782	0,25
Kuwait — 0,14 % (29. Februar 2020: 0,14 %)			
400	Equate Petrochemical BV, 4,250 %, fällig 03.11.2026	429	0,14
Luxemburg — 0,18 % (29. Februar 2020: 0,17 %)			
220	ArcelorMittal SA, 3,600 %, fällig 16.07.2024	231	0,07
300	ArcelorMittal SA, 4,550 %, fällig 11.03.2026	329	0,11
		560	0,18
Macau — 0,07 % (29. Februar 2020: 0,07 %)			
200	Sands China Ltd, 5,125 %, fällig 08.08.2025	222	0,07
Mexiko — 0,22 % (29. Februar 2020: 0,26 %)			
200	Comision Federal de Electricidad, 4,750 %, fällig 23.02.2027	216	0,07
440	Petroleos Mexicanos, 6,625 %, fällig 15.06.2035	389	0,12
20	Petroleos Mexicanos, 6,375 %, fällig 23.01.2045	16	0,01
70	Petroleos Mexicanos, 5,625 %, fällig 23.01.2046	55	0,02
		676	0,22
Niederlande — 0,70 % (29. Februar 2020: 0,54 %)			
20	Cooperatieve Rabobank UA, 3,875 %, fällig 08.02.2022	21	0,01
250	Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, fällig 04.08.2025	285	0,09
300	Cooperatieve Rabobank UA, 3,750 %, fällig 21.07.2026	339	0,11
530	Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,375 %, fällig 21.05.2025	597	0,19
80	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144A, 2,700 %, fällig 01.05.2025	85	0,03
120	Shell International Finance BV, 1,875 %, fällig 10.05.2021	121	0,04
110	Shell International Finance BV, 2,875 %, fällig 10.05.2026	123	0,04
120	Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030	132	0,04
10	Shell International Finance BV, 4,550 %, fällig 12.08.2043	13	0,01
140	Shell International Finance BV, 4,000 %, fällig 10.05.2046	168	0,05
270	Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	292	0,09
		2.176	0,70
Peru — 0,42 % (29. Februar 2020: 0,39 %)			
400	Petroleos del Peru SA, 4,750 %, fällig 19.06.2032	450	0,14
680	Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	871	0,28
		1.321	0,42
Südafrika — 0,11 % (29. Februar 2020: 0,10 %)			
290	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10.04.2027	334	0,11
Spanien — 0,47 % (29. Februar 2020: 0,25 %)			
200	Banco Santander SA, 3,848 %, fällig 12.04.2023	215	0,07
1.000	Banco Santander SA, 2,746 %, fällig 28.05.2025	1.065	0,34
150	Telefonica Emisiones SA, 5,213 %, fällig 08.03.2047	182	0,06
		1.462	0,47
Schweden — 0,15 % (29. Februar 2020: 0,08 %)			
250	Svenska Handelsbanken AB, 3,350 %, fällig 24.05.2021	256	0,08
200	Swedbank AB, 144A, 1,300 %, fällig 02.06.2023	204	0,07
		460	0,15
Schweiz — 0,74 % (29. Februar 2020: 0,56 %)			
560	Credit Suisse AG/New York NY, 1,000 %, fällig 05.05.2023	569	0,18
250	Credit Suisse AG/New York NY, 2,950 %, fällig 09.04.2025	275	0,09
500	Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	584	0,19
230	UBS AG/London, 144A, 1,750 %, fällig 21.04.2022	235	0,07
200	UBS Group AG, 144A, 2,859 %, fällig 15.08.2023 *	208	0,07
400	UBS Group AG, 144A, 3,126 %, fällig 13.08.2030 *	445	0,14
		2.316	0,74
Vereinigte Arabische Emirate — 0,20 %(29. Februar 2020: 0,19 %)			
530	DP World Plc, 144A, 5,625 %, fällig 25.09.2048	628	0,20
Großbritannien — 1,64 % (29. Februar 2020: 1,61 %)			
200	Barclays Bank Plc, 1,700 %, fällig 12.05.2022	204	0,06
200	Barclays Plc, 4,972 %, fällig 16.05.2029 *	238	0,08
130	BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig 15.08.2047	142	0,04
10	BP Capital Markets Plc, 3,535 %, fällig 04.11.2024	11	–
400	HSBC Holdings Plc, 2,633 %, fällig 07.11.2025 *	420	0,13
350	HSBC Holdings Plc, 4,300 %, fällig 08.03.2026	402	0,13
200	HSBC Holdings Plc, 2,099 %, fällig 04.06.2026 *	205	0,07
200	HSBC Holdings Plc, 4,041 %, fällig 13.03.2028 *	225	0,07
400	HSBC Holdings Plc, 4,583 %, fällig 19.06.2029 *	468	0,15
200	HSBC Holdings Plc, 4,950 %, fällig 31.03.2030	247	0,08
200	HSBC Holdings Plc, 3,973 %, fällig 22.05.2030 *	227	0,07
200	Lloyds Banking Group Plc, 3,100 %, fällig 06.07.2021	205	0,07
200	Lloyds Banking Group Plc, 2,907 %, fällig 07.11.2023 *	209	0,07
200	Lloyds Banking Group Plc, 4,650 %, fällig 24.03.2026	227	0,07
200	Lloyds Banking Group Plc, 4,375 %, fällig 22.03.2028	237	0,08
200	Nationwide Building Society, 144A, 4,363 %, fällig 01.08.2024 *	219	0,07
200	Natwest Group Plc, 4,519 %, fällig 25.06.2024 *	218	0,07
200	Natwest Group Plc, 4,269 %, fällig 22.03.2025 *	220	0,07
200	Natwest Group Plc, 4,892 %, fällig 18.05.2029 *	239	0,08
270	Reynolds American Inc, 5,850 %, fällig 15.08.2045	336	0,11
190	Vodafone Group Plc, 4,375 %, fällig 30.05.2028	228	0,07
		5.127	1,64
USA — 27,64 % (29. Februar 2020: 18,20 %)			
260	3M Co, 2,375 %, fällig 26.08.2029	281	0,09
100	3M Co, 3,050 %, fällig 15.04.2030	114	0,04
250	3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050	305	0,10
208	Abbott Laboratories, 3,750 %, fällig 30.11.2026	244	0,08
10	Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30.11.2036	14	–
100	Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig 30.11.2046	144	0,05
20	AbbVie Inc, 144A, 3,450 %, fällig 15.03.2022	21	0,01
420	AbbVie Inc, 144A, 2,300 %, fällig 21.11.2022	437	0,14
30	AbbVie Inc, 3,750 %, fällig 14.11.2023	33	0,01
380	AbbVie Inc, 144A, 2,600 %, fällig 21.11.2024	407	0,13
100	AbbVie Inc, 144A, 3,800 %, fällig 15.03.2025	112	0,04
20	AbbVie Inc, 3,600 %, fällig 14.05.2025	22	0,01
90	AbbVie Inc, 144A, 2,950 %, fällig 21.11.2026	99	0,03
740	AbbVie Inc, 144A, 3,200 %, fällig 21.11.2029	823	0,26
20	AbbVie Inc, 144A, 4,250 %, fällig 21.11.2049	24	0,01
370	Adobe Inc, 2,300 %, fällig 01.02.2030	400	0,13

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
10	Aetna Inc, 2,800 %, fällig 15.06.2023	11	–
10	Aetna Inc, 3,875 %, fällig 15.08.2047	12	–
90	Air Lease Corp, 3,375 %, fällig 01.07.2025	92	0,03
30	Alphabet Inc, 0,450 %, fällig 15.08.2025	30	0,01
50	Alphabet Inc, 0,800 %, fällig 15.08.2027	50	0,02
60	Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15.08.2030	60	0,02
110	Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15.08.2050	105	0,03
110	Altria Group Inc, 4,750 %, fällig 05.05.2021	113	0,04
40	Altria Group Inc, 3,490 %, fällig 14.02.2022	42	0,01
40	Altria Group Inc, 2,850 %, fällig 09.08.2022	42	0,01
40	Altria Group Inc, 3,800 %, fällig 14.02.2024	44	0,01
40	Altria Group Inc, 2,350 %, fällig 06.05.2025	43	0,01
130	Altria Group Inc, 4,400 %, fällig 14.02.2026	151	0,05
290	Altria Group Inc, 4,800 %, fällig 14.02.2029	347	0,11
100	Altria Group Inc, 5,800 %, fällig 14.02.2039	128	0,04
100	Altria Group Inc, 3,875 %, fällig 16.09.2046	105	0,03
340	Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14.02.2049	463	0,15
60	Altria Group Inc, 6,200 %, fällig 14.02.2059	82	0,03
160	Amazon.com Inc, 0,800 %, fällig 03.06.2025	162	0,05
200	Amazon.com Inc, 1,200 %, fällig 03.06.2027	204	0,07
200	Amazon.com Inc, 3,150 %, fällig 22.08.2027	229	0,07
180	Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	184	0,06
80	Amazon.com Inc, 4,950 %, fällig 05.12.2044	115	0,04
410	Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	418	0,13
30	Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057	41	0,01
210	American Express Co, 2,500 %, fällig 30.07.2024	225	0,07
250	American Express Co, 3,625 %, fällig 05.12.2024	278	0,09
70	American International Group Inc, 2,500 %, fällig 30.06.2025	75	0,02
100	American International Group Inc, 6,250 %, fällig 15.03.2037 *	111	0,04
150	American International Group Inc, 4,750 %, fällig 01.04.2048	184	0,06
11	Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15.06.2051	15	–
20	Anthem Inc, 3,125 %, fällig 15.05.2022	21	0,01
30	Anthem Inc, 2,950 %, fällig 01.12.2022	32	0,01
20	Anthem Inc, 3,350 %, fällig 01.12.2024	22	0,01
170	Anthem Inc, 3,650 %, fällig 01.12.2027	195	0,06
180	Apple Inc, 2,000 %, fällig 13.11.2020	181	0,06
10	Apple Inc, 1,550 %, fällig 04.08.2021	10	–
310	Apple Inc, 1,125 %, fällig 11.05.2025	318	0,10
130	Apple Inc, 2,450 %, fällig 04.08.2026	142	0,05
370	Applied Materials Inc, 1,750 %, fällig 01.06.2030	385	0,12
70	AT&T Inc, 3,800 %, fällig 15.02.2027	80	0,03
260	AT&T Inc, 2,300 %, fällig 01.06.2027	276	0,09
130	AT&T Inc, 1,650 %, fällig 01.02.2028	132	0,04
60	AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	61	0,02
100	AT&T Inc, 3,100 %, fällig 01.02.2043	100	0,03
140	AT&T Inc, 4,350 %, fällig 15.06.2045	161	0,05
207	AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	244	0,08
10	Bank of America Corp, 3,300 %, fällig 11.01.2023	11	–
35	Bank of America Corp, 3,004 %, fällig 20.12.2023 *	37	0,01
90	Bank of America Corp, 3,550 %, fällig 05.03.2024 *	96	0,03
30	Bank of America Corp, 4,000 %, fällig 01.04.2024	34	0,01
110	Bank of America Corp, 4,200 %, fällig 26.08.2024	123	0,04
310	Bank of America Corp, 4,000 %, fällig 22.01.2025	348	0,11
10	Bank of America Corp, 4,450 %, fällig 03.03.2026	12	–
50	Bank of America Corp, 3,500 %, fällig 19.04.2026	57	0,02
600	Bank of America Corp, 1,319 %, fällig 19.06.2026 *	608	0,19
320	Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22.10.2026	371	0,12
180	Bank of America Corp, 3,593 %, fällig 21.07.2028 *	203	0,07
333	Bank of America Corp, 3,419 %, fällig 20.12.2028 *	373	0,12
450	Bank of America Corp, 3,970 %, fällig 05.03.2029 *	519	0,17
200	Bank of America Corp, 3,974 %, fällig 07.02.2030 *	234	0,08
450	Bank of America Corp, 2,592 %, fällig 29.04.2031 *	480	0,15
140	Bank of America Corp, 5,000 %, fällig 21.01.2044	195	0,06
290	Bank of America Corp, 3,946 %, fällig 23.01.2049 *	357	0,11
400	Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	503	0,16
70	Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600 %, fällig 24.04.2025	73	0,02
160	Becton Dickinson and Co, 3,363 %, fällig 06.06.2024	174	0,06
19	Becton Dickinson and Co, 3,734 %, fällig 15.12.2024	21	0,01
94	Becton Dickinson and Co, 4,685 %, fällig 15.12.2044	119	0,04
130	Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	169	0,05
430	Boeing Co/The, 4,875 %, fällig 01.05.2025	468	0,15
320	Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030	359	0,12
340	Boeing Co/The, 3,250 %, fällig 01.02.2035	320	0,10
100	Boeing Co/The, 5,875 %, fällig 15.02.2040	115	0,04
170	Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01.05.2040	198	0,06
140	Boeing Co/The, 3,750 %, fällig 01.02.2050	126	0,04
390	Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01.05.2050	469	0,15
140	Boeing Co/The, 5,930 %, fällig 01.05.2060	172	0,06
50	BP Capital Markets America Inc, 3,245 %, fällig 06.05.2022	53	0,02
10	BP Capital Markets America Inc, 2,937 %, fällig 06.04.2023	11	–
160	BP Capital Markets America Inc, 3,216 %, fällig 28.11.2023	173	0,06
30	BP Capital Markets America Inc, 3,790 %, fällig 06.02.2024	33	0,01
40	BP Capital Markets America Inc, 3,410 %, fällig 11.02.2026	45	0,01
220	BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, fällig 04.05.2026	244	0,08
80	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	92	0,03
400	BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig 24.02.2050	395	0,13
40	Bristol-Myers Squibb Co, 2,250 %, fällig 15.08.2021	41	0,01
90	Bristol-Myers Squibb Co, 2,600 %, fällig 16.05.2022	94	0,03
10	Bristol-Myers Squibb Co, 3,550 %, fällig 15.08.2022	11	–
100	Bristol-Myers Squibb Co, 3,625 %, fällig 15.05.2024	111	0,04
280	Bristol-Myers Squibb Co, 2,900 %, fällig 26.07.2024	305	0,10
90	Bristol-Myers Squibb Co, 3,875 %, fällig 15.08.2025	104	0,03
130	Bristol-Myers Squibb Co, 3,200 %, fällig 15.06.2026	148	0,05
270	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	316	0,10
10	Bristol-Myers Squibb Co, 5,250 %, fällig 15.08.2043	14	–
150	Bristol-Myers Squibb Co, 4,250 %, fällig 26.10.2049	200	0,06
200	Broadcom Inc, 2,250 %, fällig 15.11.2023	208	0,07
300	Broadcom Inc, 4,700 %, fällig 15.04.2025	343	0,11
240	Broadcom Inc, 3,150 %, fällig 15.11.2025	260	0,08
130	Cameron LNG LLC, 144A, 2,902 %, fällig 15.07.2031	143	0,05
480	Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig 15.01.2035	542	0,17
130	Cargill Inc, 144A, 1,375 %, fällig 23.07.2023	133	0,04
50	Carrier Global Corp, 144A, 1,923 %, fällig 15.02.2023	51	0,02
130	Carrier Global Corp, 144A, 2,242 %, fällig 15.02.2025	136	0,04
20	Carrier Global Corp, 144A, 2,493 %, fällig 15.02.2027	21	0,01
170	Carrier Global Corp, 144A, 2,722 %, fällig 15.02.2030	179	0,06
60	Carrier Global Corp, 144A, 2,700 %, fällig 15.02.2031	63	0,02
60	Carrier Global Corp, 144A, 3,377 %, fällig 05.04.2040	63	0,02
70	Carrier Global Corp, 144A, 3,577 %, fällig 05.04.2050	74	0,02
430	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	501	0,16
460	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	527	0,17
230	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	278	0,09
200	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	244	0,08
90	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, fällig 23.10.2045	123	0,04
100	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	126	0,04
40	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	46	0,01
160	Chevron Corp, 1,554 %, fällig 11.05.2025	167	0,05
140	Chevron Corp, 2,954 %, fällig 16.05.2026	156	0,05
40	Chevron Corp, 1,995 %, fällig 11.05.2027	42	0,01
210	Chevron Corp, 2,978 %, fällig 11.05.2040	228	0,07
10	Chubb INA Holdings Inc, 2,300 %, fällig 03.11.2020	10	–
10	Chubb INA Holdings Inc, 3,350 %, fällig 03.05.2026	11	–

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
60	Cigna Corp, 3,400 %, fällig 17.09.2021	62	0,02
173	Cigna Corp, 3,750 %, fällig 15.07.2023	188	0,06
150	Cigna Corp, 4,125 %, fällig 15.11.2025	174	0,06
520	Cigna Corp, 4,375 %, fällig 15.10.2028	623	0,20
210	Cimarex Energy Co, 3,900 %, fällig 15.05.2027	217	0,07
250	Cimarex Energy Co, 4,375 %, fällig 15.03.2029	267	0,09
20	Cintas Corp No 2, 2,900 %, fällig 01.04.2022	21	0,01
30	Cintas Corp No 2, 3,700 %, fällig 01.04.2027	34	0,01
70	Citigroup Inc, 4,500 %, fällig 14.01.2022	74	0,02
80	Citigroup Inc, 3,500 %, fällig 15.05.2023	86	0,03
150	Citigroup Inc, 1,678 %, fällig 15.05.2024 *	154	0,05
180	Citigroup Inc, 3,300 %, fällig 27.04.2025	200	0,06
60	Citigroup Inc, 4,400 %, fällig 10.06.2025	68	0,02
120	Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13.09.2025	143	0,05
90	Citigroup Inc, 3,106 %, fällig 08.04.2026 *	98	0,03
60	Citigroup Inc, 4,300 %, fällig 20.11.2026	69	0,02
360	Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	419	0,13
150	Citigroup Inc, 3,520 %, fällig 27.10.2028 *	168	0,05
200	Citigroup Inc, 3,980 %, fällig 20.03.2030 *	232	0,07
420	Citigroup Inc, 4,412 %, fällig 31.03.2031 *	512	0,16
280	Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	297	0,10
570	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	1.007	0,32
77	Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 30.07.2045	100	0,03
10	Citigroup Inc, 4,750 %, fällig 18.05.2046	13	–
60	Coca-Cola Co/The, 2,950 %, fällig 25.03.2025	66	0,02
90	Coca-Cola Co/The, 3,375 %, fällig 25.03.2027	104	0,03
140	Coca-Cola Co/The, 1,450 %, fällig 01.06.2027	145	0,05
20	Coca-Cola Co/The, 4,125 %, fällig 25.03.2040	26	0,01
60	Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	62	0,02
160	Coca-Cola Co/The, 4,200 %, fällig 25.03.2050	212	0,07
90	Coca-Cola Co/The, 2,600 %, fällig 01.06.2050	92	0,03
10	Comcast Corp, 3,100 %, fällig 01.04.2025	11	–
30	Comcast Corp, 3,950 %, fällig 15.10.2025	35	0,01
70	Comcast Corp, 3,150 %, fällig 01.03.2026	79	0,03
120	Comcast Corp, 3,300 %, fällig 01.04.2027	137	0,04
320	Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	388	0,12
80	Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	92	0,03
100	Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	124	0,04
121	Comcast Corp, 7,050 %, fällig 15.03.2033	185	0,06
140	Comcast Corp, 3,900 %, fällig 01.03.2038	168	0,05
30	Comcast Corp, 6,550 %, fällig 01.07.2039	47	0,02
10	Comcast Corp, 3,250 %, fällig 01.11.2039	11	–
10	Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	12	–
20	Comcast Corp, 3,400 %, fällig 15.07.2046	22	0,01
20	Comcast Corp, 4,000 %, fällig 01.03.2048	24	0,01
140	Comcast Corp, 4,700 %, fällig 15.10.2048	189	0,06
310	Comcast Corp, 3,450 %, fällig 01.02.2050	350	0,11
40	Concho Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.01.2025	41	0,01
40	Concho Resources Inc, 3,750 %, fällig 01.10.2027	44	0,01
350	Concho Resources Inc, 4,300 %, fällig 15.08.2028	396	0,13
20	ConocoPhillips Co, 6,950 %, fällig 15.04.2029	28	0,01
50	Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	58	0,02
30	Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20B, 3,950 %, fällig 01.04.2050	36	0,01
230	Costco Wholesale Corp, 1,375 %, fällig 20.06.2027	235	0,08
120	Costco Wholesale Corp, 1,600 %, fällig 20.04.2030	122	0,04
100	Costco Wholesale Corp, 1,750 %, fällig 20.04.2032	103	0,03
107	CVS Health Corp, 3,350 %, fällig 09.03.2021	109	0,04
50	CVS Health Corp, 2,750 %, fällig 01.12.2022	52	0,02
95	CVS Health Corp, 3,700 %, fällig 09.03.2023	102	0,03
39	CVS Health Corp, 4,100 %, fällig 25.03.2025	44	0,01
8	CVS Health Corp, 3,875 %, fällig 20.07.2025	9	–
40	CVS Health Corp, 3,625 %, fällig 01.04.2027	45	0,01
897	CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	1.057	0,34
110	CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	127	0,04
200	CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	246	0,08
40	CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	47	0,02
40	CVS Health Corp, 5,125 %, fällig 20.07.2045	52	0,02
370	CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	483	0,15
5	CVS Pass-Through Trust, 5,880 %, fällig 10.01.2028	5	–
20	Deere & Co, 3,100 %, fällig 15.04.2030	23	0,01
380	Deere & Co, 3,750 %, fällig 15.04.2050	468	0,15
322	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 4,420 %, fällig 15.06.2021	330	0,11
26	Delta Air Lines 2007-1 Klasse A Pass Through Trust, Series 071A, 6,821 %, fällig 10.08.2022	26	0,01
160	Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	184	0,06
20	Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	21	0,01
310	Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	311	0,10
50	Diamondback Energy Inc, 2,875 %, fällig 01.12.2024	52	0,02
40	Diamondback Energy Inc, 5,375 %, fällig 31.05.2025	42	0,01
10	Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	10	–
10	Dollar General Corp, 3,250 %, fällig 15.04.2023	11	–
10	Duke Energy Corp, 3,550 %, fällig 15.09.2021	10	–
50	Duke Energy Corp, 2,400 %, fällig 15.08.2022	52	0,02
50	Duke Energy Corp, 3,150 %, fällig 15.08.2027	56	0,02
150	Eaton Corp, 2,750 %, fällig 02.11.2022	158	0,05
50	Eaton Corp, 4,150 %, fällig 02.11.2042	63	0,02
100	El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, fällig 15.06.2032	138	0,04
120	Energy Transfer Operating LP, 4,500 %, fällig 15.04.2024	129	0,04
40	Energy Transfer Operating LP, 4,950 %, fällig 15.06.2028	43	0,01
50	Energy Transfer Operating LP, 5,250 %, fällig 15.04.2029	55	0,02
450	Energy Transfer Operating LP, 3,750 %, fällig 15.05.2030	448	0,14
30	Energy Transfer Operating LP, 6,250 %, fällig 15.04.2049	32	0,01
20	Enterprise Products Operating LLC, 3,900 %, fällig 15.02.2024	22	0,01
210	Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig 16.10.2028	247	0,08
350	Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig 31.01.2030	375	0,12
20	Enterprise Products Operating LLC, 7,550 %, fällig 15.04.2038	28	0,01
60	Enterprise Products Operating LLC, 5,700 %, fällig 15.02.2042	76	0,02
20	Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, fällig 15.03.2044	23	0,01
150	Enterprise Products Operating LLC, 4,200 %, fällig 31.01.2050	164	0,05
10	Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, fällig 31.01.2051	10	–
130	EOG Resources Inc, 4,150 %, fällig 15.01.2026	151	0,05
140	EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	168	0,05
160	EOG Resources Inc, 3,900 %, fällig 01.04.2035	189	0,06
320	EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	411	0,13
20	Exxon Mobil Corp, 1,571 %, fällig 15.04.2023	21	0,01
340	Exxon Mobil Corp, 2,992 %, fällig 19.03.2025	375	0,12
140	Exxon Mobil Corp, 3,043 %, fällig 01.03.2026	156	0,05
130	Exxon Mobil Corp, 3,482 %, fällig 19.03.2030	151	0,05
130	Exxon Mobil Corp, 4,114 %, fällig 01.03.2046	158	0,05
260	Exxon Mobil Corp, 4,327 %, fällig 19.03.2050	335	0,11
10	FirstEnergy Corp, Series B, 4,250 %, fällig 15.03.2023	11	–
50	FirstEnergy Corp, Series A, 1,600 %, fällig 15.01.2026	50	0,02
180	FirstEnergy Corp, Series B, 3,900 %, fällig 15.07.2027	198	0,06
650	FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, fällig 15.11.2031	921	0,29
200	FirstEnergy Corp, Series C, 4,850 %, fällig 15.07.2047	245	0,08
200	Ford Motor Credit Co LLC, 3,200 %, fällig 15.01.2021	200	0,06
50	Fox Corp, 4,030 %, fällig 25.01.2024	55	0,02
80	Fox Corp, 4,709 %, fällig 25.01.2029	96	0,03
280	Fox Corp, 5,476 %, fällig 25.01.2039	372	0,12
30	Fox Corp, 5,576 %, fällig 25.01.2049	41	0,01
10	General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2040	13	–
440	General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2050	576	0,18
30	General Electric Co, 3,450 %, fällig 01.05.2027	32	0,01
50	General Electric Co, 3,625 %, fällig 01.05.2030	52	0,02
40	General Electric Co, 6,750 %, fällig 15.03.2032	50	0,02
110	General Electric Co, 5,875 %, fällig 14.01.2038	127	0,04
700	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10.01.2039	893	0,29
10	General Motors Co, 5,150 %, fällig 01.04.2038	11	–
30	General Motors Co, 6,250 %, fällig 02.10.2043	35	0,01
10	General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	12	–
20	General Motors Financial Co Inc, 2,450 %, fällig 06.11.2020	20	0,01
20	General Motors Financial Co Inc, 3,450 %, fällig 10.04.2022	21	0,01

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
120	General Motors Financial Co Inc, 4,350 %, fällig 17.01.2027	130	0,04
10	Gilead Sciences Inc, 2,550 %, fällig 01.09.2020	10	–
40	Gilead Sciences Inc, 3,700 %, fällig 01.04.2024	44	0,01
100	Gilead Sciences Inc, 3,650 %, fällig 01.03.2026	115	0,04
100	Gilead Sciences Inc, 4,750 %, fällig 01.03.2046	134	0,04
3	Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, Perpetual *	3	–
280	Goldman Sachs Group Inc/ The, 2,876 %, fällig 31.10.2022 *	287	0,09
50	Goldman Sachs Group Inc/ The, 3,625 %, fällig 22.01.2023	54	0,02
70	Goldman Sachs Group Inc/ The, 3,200 %, fällig 23.02.2023	75	0,02
150	Goldman Sachs Group Inc/ The, 3,500 %, fällig 01.04.2025	166	0,05
140	Goldman Sachs Group Inc/ The, 4,250 %, fällig 21.10.2025	160	0,05
90	Goldman Sachs Group Inc/ The, 3,500 %, fällig 16.11.2026	100	0,03
500	Goldman Sachs Group Inc/ The, 3,814 %, fällig 23.04.2029 *	574	0,18
730	Goldman Sachs Group Inc/ The, 4,223 %, fällig 01.05.2029 *	859	0,27
30	Goldman Sachs Group Inc/ The, 6,250 %, fällig 01.02.2041	45	0,01
440	Goldman Sachs Group Inc/ The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	587	0,19
10	Goldman Sachs Group Inc/ The, 4,750 %, fällig 21.10.2045	13	–
50	Guardian Life Global Funding, 144A, 1,100 %, fällig 23.06.2025	51	0,02
10	Halliburton Co, 3,800 %, fällig 15.11.2025	11	–
40	Hershey Co/The, 0,900 %, fällig 01.06.2025	40	0,01
90	Home Depot Inc/The, 2,500 %, fällig 15.04.2027	99	0,03
10	Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 06.12.2028	12	–
80	Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	89	0,03
110	Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	126	0,04
20	Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 15.06.2047	24	0,01
190	Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	218	0,07
90	Honeywell International Inc, 1,350 %, fällig 01.06.2025	93	0,03
30	Humana Inc, 3,150 %, fällig 01.12.2022	32	0,01
20	Humana Inc, 4,500 %, fällig 01.04.2025	23	0,01
130	Humana Inc, 3,950 %, fällig 15.03.2027	150	0,05
10	Humana Inc, 4,950 %, fällig 01.10.2044	13	–
250	Humana Inc, 3,950 %, fällig 15.08.2049	303	0,10
10	Intel Corp, 3,700 %, fällig 29.07.2025	11	–
60	Intel Corp, 4,600 %, fällig 25.03.2040	80	0,03
390	Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	542	0,17
130	Intel Corp, 4,950 %, fällig 25.03.2060	188	0,06
310	International Business Machines Corp, 3,000 %, fällig 15.05.2024	337	0,11
80	Johnson & Johnson, 0,550 %, fällig 01.09.2025	80	0,03
160	Johnson & Johnson, 0,950 %, fällig 01.09.2027	162	0,05
130	Johnson & Johnson, 3,700 %, fällig 01.03.2046	162	0,05
110	JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, fällig 15.10.2020	111	0,04
10	JPMorgan Chase & Co, 4,350 %, fällig 15.08.2021	10	–
50	JPMorgan Chase & Co, 3,625 %, fällig 13.05.2024	55	0,02
380	JPMorgan Chase & Co, 1,514 %, fällig 01.06.2024 *	389	0,12
230	JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, fällig 05.12.2024 *	255	0,08
220	JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, fällig 22.04.2026 *	231	0,07
170	JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, fällig 15.12.2026	199	0,06
270	JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, fällig 01.10.2027	316	0,10
110	JPMorgan Chase & Co, 3,625 %, fällig 01.12.2027	124	0,04
110	JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	130	0,04
180	JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05.12.2029 *	217	0,07
440	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	472	0,15
195	JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01.06.2045	268	0,09
50	JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	55	0,02
30	Kimberly-Clark Corp, 3,100 %, fällig 26.03.2030	34	0,01
20	Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,500 %, fällig 01.03.2021	20	0,01
40	Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig 01.06.2025	45	0,01
570	Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig 01.03.2028	661	0,21
30	Kinder Morgan Inc, 5,550 %, fällig 01.06.2045	37	0,01
120	L3Harris Technologies Inc, 4,854 %, fällig 27.04.2035	159	0,05
160	L3Harris Technologies Inc, 5,054 %, fällig 27.04.2045	215	0,07
240	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	243	0,08
20	Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25.06.2025	20	0,01
280	Lehman Brothers Escrow, Null-Coupon, Perpetual †∞Ƹ	–	–
270	Lehman Brothers Holding Inc, Null-Coupon, Perpetual †∞Ƹ	–	–
140	Lehman Brothers Holdings Capital Trust Escrow, Null-Coupon, Perpetual †∞Ƹ	–	–
127	Lehman Escrow Receipt, Null-Coupon, Perpetual †∞	2	–
104	Lehman Swap Receipt, Null-Coupon, Perpetual †∞	1	–
20	Lockheed Martin Corp, 3,100 %, fällig 15.01.2023	21	0,01
50	Lockheed Martin Corp, 3,550 %, fällig 15.01.2026	57	0,02
100	Lockheed Martin Corp, 4,500 %, fällig 15.05.2036	130	0,04
50	Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig 15.04.2030	62	0,02
50	Lowe's Cos Inc, 5,000 %, fällig 15.04.2040	66	0,02
140	Lowe's Cos Inc, 5,125 %, fällig 15.04.2050	195	0,06
60	März Inc, 144A, 2,700 %, fällig 01.04.2025	65	0,02
260	März Inc, 144A, 3,200 %, fällig 01.04.2030	298	0,10
400	MassMutual Global Funding II, 144A, 0,850 %, fällig 09.06.2023	405	0,13
500	Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	631	0,20
90	McDonald's Corp, 3,300 %, fällig 01.07.2025	101	0,03
150	McDonald's Corp, 1,450 %, fällig 01.09.2025	155	0,05
70	McDonald's Corp, 3,700 %, fällig 30.01.2026	80	0,03
30	McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.03.2027	34	0,01
30	McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.07.2027	34	0,01
30	McDonald's Corp, 3,800 %, fällig 01.04.2028	35	0,01
80	McDonald's Corp, 2,125 %, fällig 01.03.2030	83	0,03
80	McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	93	0,03
180	McDonald's Corp, 4,875 %, fällig 09.12.2045	235	0,08
20	McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	23	0,01
140	McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	171	0,06
45	Medtronic Inc, 3,500 %, fällig 15.03.2025	51	0,02
15	Medtronic Inc, 4,625 %, fällig 15.03.2045	21	0,01
150	Merck & Co Inc, 0,750 %, fällig 24.02.2026	151	0,05
80	Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	81	0,03
215	MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	272	0,09
270	Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 0,900 %, fällig 08.06.2023	273	0,09
120	Micron Technology Inc, 2,497 %, fällig 24.04.2023	125	0,04
70	Microsoft Corp, 1,550 %, fällig 08.08.2021	71	0,02
90	Microsoft Corp, 2,400 %, fällig 06.02.2022	93	0,03
300	Microsoft Corp, 2,400 %, fällig 08.08.2026	328	0,11
240	Microsoft Corp, 3,300 %, fällig 06.02.2027	275	0,09
100	Microsoft Corp, 3,700 %, fällig 08.08.2046	126	0,04
60	Microsoft Corp, 2,525 %, fällig 01.06.2050	63	0,02
140	MidAmerican Energy Co, 3,650 %, fällig 15.04.2029	167	0,05
40	Mondelez International Inc, 2,125 %, fällig 13.04.2023	42	0,01
290	Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig 04.05.2025	301	0,10
370	Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28.04.2026 *	390	0,12
290	Morgan Stanley, 3,772 %, fällig 24.01.2029 *	334	0,11
480	Morgan Stanley, 2,699 %, fällig 22.01.2031 *	519	0,17
200	Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	233	0,07
190	MPLX LP, 4,000 %, fällig 15.03.2028	210	0,07
100	MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	106	0,03
180	MPLX LP, 4,700 %, fällig 15.04.2048	194	0,06
250	National Securities Clearing Corp, 144A, 1,200 %, fällig 23.04.2023	255	0,08
100	New York Life Global Funding, 144A, 0,950 %, fällig 24.06.2025	101	0,03
100	Newell Brands Inc, 4,700 %, fällig 01.04.2026	108	0,03
60	NIKE Inc, 2,400 %, fällig 27.03.2025	65	0,02
110	NIKE Inc, 2,750 %, fällig 27.03.2027	122	0,04
110	NIKE Inc, 2,850 %, fällig 27.03.2030	123	0,04
80	NIKE Inc, 3,250 %, fällig 27.03.2040	90	0,03
250	NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	289	0,09
70	Noble Energy Inc, 3,850 %, fällig 15.01.2028	80	0,03
330	Noble Energy Inc, 4,950 %, fällig 15.08.2047	436	0,14
150	Northrop Grumman Corp, 2,550 %, fällig 15.10.2022	157	0,05
200	Northrop Grumman Corp, 2,930 %, fällig 15.01.2025	218	0,07
20	Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig 15.01.2028	23	0,01

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
630	Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01.05.2050	909	0,29
60	NVIDIA Corp, 2,850 %, fällig 01.04.2030	67	0,02
370	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	428	0,14
430	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	489	0,16
110	NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	129	0,04
60	Otis Worldwide Corp, 144A, 2,056 %, fällig 05.04.2025	63	0,02
60	Otis Worldwide Corp, 144A, 2,293 %, fällig 05.04.2027	64	0,02
190	Otis Worldwide Corp, 144A, 2,565 %, fällig 15.02.2030	203	0,07
200	Pacific Gas and Electric Co, 1,750 %, fällig 16.06.2022	201	0,06
50	Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01.08.2027	49	0,02
70	Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01.02.2031	67	0,02
20	Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.08.2040	19	0,01
30	Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01.08.2050	28	0,01
110	PayPal Holdings Inc, 1,350 %, fällig 01.06.2023	113	0,04
110	PayPal Holdings Inc, 1,650 %, fällig 01.06.2025	115	0,04
150	PepsiCo Inc, 0,750 %, fällig 01.05.2023	152	0,05
10	PepsiCo Inc, 2,250 %, fällig 19.03.2025	11	–
10	PepsiCo Inc, 2,625 %, fällig 19.03.2027	11	–
120	PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig 01.05.2030	124	0,04
40	PepsiCo Inc, 2,875 %, fällig 15.10.2049	43	0,01
20	PepsiCo Inc, 3,625 %, fällig 19.03.2050	24	0,01
30	PepsiCo Inc, 3,875 %, fällig 19.03.2060	38	0,01
190	Pfizer Inc, 0,800 %, fällig 28.05.2025	192	0,06
110	Pfizer Inc, 2,625 %, fällig 01.04.2030	123	0,04
110	Pfizer Inc, 1,700 %, fällig 28.05.2030	114	0,04
80	Pfizer Inc, 2,550 %, fällig 28.05.2040	84	0,03
500	Pfizer Inc, 2,700 %, fällig 28.05.2050	523	0,17
20	Philip Morris International Inc, 2,900 %, fällig 15.11.2021	21	0,01
20	Philip Morris International Inc, 2,500 %, fällig 22.08.2022	21	0,01
230	Philip Morris International Inc, 2,500 %, fällig 02.11.2022	240	0,08
80	Philip Morris International Inc, 1,125 %, fällig 01.05.2023	81	0,03
80	Philip Morris International Inc, 2,100 %, fällig 01.05.2030	83	0,03
40	Philip Morris International Inc, 6,375 %, fällig 16.05.2038	60	0,02
10	Philip Morris International Inc, 4,500 %, fällig 20.03.2042	12	–
60	Philip Morris International Inc, 4,250 %, fällig 10.11.2044	73	0,02
50	Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, fällig 23.06.2025	51	0,02
50	Procter & Gamble Co/The, 2,450 %, fällig 25.03.2025	54	0,02
30	Procter & Gamble Co/The, 2,800 %, fällig 25.03.2027	34	0,01
50	Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, fällig 25.03.2030	58	0,02
90	Procter & Gamble Co/The, 3,550 %, fällig 25.03.2040	110	0,04
436	Procter & Gamble Co/The, 3,600 %, fällig 25.03.2050	555	0,18
10	Progress Energy Inc, 3,150 %, fällig 01.04.2022	10	–
10	Raytheon Co, 3,125 %, fällig 15.10.2020	10	–
60	Raytheon Technologies Corp, 144A, 3,150 %, fällig 15.12.2024	65	0,02
120	Raytheon Technologies Corp, 2,250 %, fällig 01.07.2030	127	0,04
100	Raytheon Technologies Corp, 4,500 %, fällig 01.06.2042	127	0,04
230	Raytheon Technologies Corp, 3,125 %, fällig 01.07.2050	248	0,08
160	Republic Services Inc, 2,500 %, fällig 15.08.2024	171	0,05
50	salesforce.com Inc, 3,250 %, fällig 11.04.2023	54	0,02
250	salesforce.com Inc, 3,700 %, fällig 11.04.2028	293	0,09
100	Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01.03.2032	143	0,05
10	State Street Corp, 3,300 %, fällig 16.12.2024	11	–
10	Sunoco Logistics Partners Operations LP, 5,300 %, fällig 01.04.2044	10	–
130	Target Corp, 2,250 %, fällig 15.04.2025	140	0,04
2	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig 16.12.2039	3	–
60	Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01.03.2030	63	0,02
50	Texas Instruments Inc, 2,250 %, fällig 04.09.2029	54	0,02
70	Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig 04.05.2030	72	0,02
100	Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2039	126	0,04
80	Texas Instruments Inc, 4,150 %, fällig 15.05.2048	105	0,03
170	The Vanguard Group Inc, 3,050 %, fällig 22.08.2050 †∞	162	0,05
80	Time Warner Cable LLC, 4,125 %, fällig 15.02.2021	81	0,03
100	Time Warner Cable LLC, 5,875 %, fällig 15.11.2040	128	0,04
80	TJX Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15.04.2025	89	0,03
20	TJX Cos Inc/The, 2,250 %, fällig 15.09.2026	21	0,01
20	TJX Cos Inc/The, 3,750 %, fällig 15.04.2027	23	0,01
130	T-Mobile USA Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.04.2025	144	0,05
20	T-Mobile USA Inc, 144A, 3,750 %, fällig 15.04.2027	23	0,01
300	T-Mobile USA Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.04.2030	344	0,11
400	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01.02.2026	524	0,17
70	Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 15.07.2025	80	0,03
140	Union Pacific Corp, 2,150 %, fällig 05.02.2027	150	0,05
170	Union Pacific Corp, 3,950 %, fällig 10.09.2028	202	0,06
140	Union Pacific Corp, 2,400 %, fällig 05.02.2030	152	0,05
90	Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig 20.03.2060	106	0,03
130	Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05.02.2070	148	0,05
20	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.10.2020	20	0,01
30	UnitedHealth Group Inc, 2,875 %, fällig 15.12.2021	31	0,01
20	UnitedHealth Group Inc, 2,375 %, fällig 15.10.2022	21	0,01
40	UnitedHealth Group Inc, 3,500 %, fällig 15.06.2023	43	0,01
50	UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, fällig 15.07.2025	57	0,02
60	UnitedHealth Group Inc, 1,250 %, fällig 15.01.2026	62	0,02
30	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.12.2028	36	0,01
30	UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	31	0,01
110	UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15.05.2040	117	0,04
50	UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.03.2043	64	0,02
40	UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.06.2048	52	0,02
20	UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	27	0,01
50	UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	61	0,02
110	UnitedHealth Group Inc, 2,900 %, fällig 15.05.2050	117	0,04
210	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.08.2059	264	0,08
20	UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, fällig 15.05.2060	22	0,01
50	US Bancorp, 3,600 %, fällig 11.09.2024	56	0,02
290	US Bancorp, 1,450 %, fällig 12.05.2025	301	0,10
250	US Bank NA/Cincinnati OH, 3,150 %, fällig 26.04.2021	254	0,08
150	USAA Capital Corp, 144A, 2,125 %, fällig 01.05.2030	159	0,05
180	Verizon Communications Inc, 3,376 %, fällig 15.02.2025	202	0,06
40	Verizon Communications Inc, 2,625 %, fällig 15.08.2026	44	0,01
40	Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig 16.03.2027	47	0,02
30	Verizon Communications Inc, 3,000 %, fällig 22.03.2027	34	0,01
205	Verizon Communications Inc, 4,329 %, fällig 21.09.2028	248	0,08
30	Verizon Communications Inc, 3,875 %, fällig 08.02.2029	36	0,01
100	Verizon Communications Inc, 3,150 %, fällig 22.03.2030	113	0,04
380	Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	483	0,15
60	Verizon Communications Inc, 4,400 %, fällig 01.11.2034	75	0,02
20	Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	27	0,01
200	Verizon Communications Inc, 3,850 %, fällig 01.11.2042	240	0,08
70	Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig 15.08.2046	87	0,03
70	Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21.08.2046	95	0,03
570	Verizon Communications Inc, 4,522 %, fällig 15.09.2048	751	0,24
130	Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22.03.2050	164	0,05
20	Visa Inc, 2,200 %, fällig 14.12.2020	20	0,01
180	Visa Inc, 3,150 %, fällig 14.12.2025	203	0,07
30	Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	40	0,01
150	Visa Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2047	185	0,06
110	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual *	111	0,04
40	Walmart Inc, 3,400 %, fällig 26.06.2023	43	0,01
40	Walmart Inc, 3,550 %, fällig 26.06.2025	46	0,01
90	Walmart Inc, 3,050 %, fällig 08.07.2026	102	0,03
180	Walmart Inc, 3,700 %, fällig 26.06.2028	213	0,07
20	Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig 15.11.2037	30	0,01
10	Waste Management Inc, 4,600 %, fällig 01.03.2021	10	–
10	Waste Management Inc, 3,500 %, fällig 15.05.2024	11	–
50	Waste Management Inc, 4,150 %, fällig 15.07.2049	63	0,02
60	Wells Fargo & Co, 4,125 %, fällig 15.08.2023	66	0,02
61	Wells Fargo & Co, 4,480 %, fällig 16.01.2024	68	0,02
40	Wells Fargo & Co, 3,750 %, fällig 24.01.2024	44	0,01
300	Wells Fargo & Co, 1,654 %, fällig 02.06.2024 *	307	0,10
240	Wells Fargo & Co, 2,188 %, fällig 30.04.2026 *	251	0,08

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
200	Wells Fargo & Co, 4,100 %, fällig 03.06.2026	226	0,07
180	Wells Fargo & Co, 3,000 %, fällig 23.10.2026	198	0,06
360	Wells Fargo & Co, 4,300 %, fällig 22.07.2027	415	0,13
420	Wells Fargo & Co, 2,393 %, fällig 02.06.2028 *	439	0,14
150	Wells Fargo & Co, 4,150 %, fällig 24.01.2029	177	0,06
200	Wells Fargo & Co, 2,879 %, fällig 30.10.2030 *	215	0,07
330	Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04.04.2031 *	403	0,13
20	Wells Fargo & Co, 4,650 %, fällig 04.11.2044	24	0,01
50	Wells Fargo & Co, 4,900 %, fällig 17.11.2045	64	0,02
430	Wells Fargo & Co, 4,400 %, fällig 14.06.2046	516	0,17
350	Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig 07.12.2046	444	0,14
930	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	1.274	0,41
280	Williams Cos Inc/The, 3,750 %, fällig 15.06.2027	310	0,10
60	Williams Cos Inc/The, 4,850 %, fällig 01.03.2048	70	0,02
30	Wyeth LLC, 5,950 %, fällig 01.04.2037	45	0,01
		86.468	27,64
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 106.917 USD)		116.231	37,15
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 23,63 % (29. Februar 2020: 22,91 %)			
China — 0,02 % (29. Februar 2020: 0,02 %)			
CNY 500	China Government Bond, 3,310 %, fällig 30.11.2025	75	0,02
Kolumbien — 0,32 % (29. Februar 2020: 0,55 %)			
220	Colombia Government International Bond, 3,125 %, fällig 15.04.2031	228	0,07
600	Colombia Government International Bond, 5,625 %, fällig 26.02.2044	765	0,25
		993	0,32
Indien — 0,07 % (29. Februar 2020: 0,07 %)			
200	Export-Import Bank of India, 3,375 %, fällig 05.08.2026	212	0,07
Indonesien — 0,49 % (29. Februar 2020: 0,54 %)			
1.300	Indonesia Government International Bond, 4,350 %, fällig 11.01.2048	1.546	0,49
Israel — 0,14 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
400	Israel Government International Bond, 2,750 %, fällig 03.07.2030	442	0,14
Kasachstan — 0,09 % (29. Februar 2020: 0,08 %)			
200	Kazakhstan Government International Bond, 4,875 %, fällig 14.10.2044	273	0,09
Kuwait — 0,17 % (29. Februar 2020: 0,16 %)			
460	Kuwait International Government Bond, 3,500 %, fällig 20.03.2027	522	0,17
Mexiko — 0,48 % (29. Februar 2020: 0,75 %)			
1.340	Mexico Government International Bond, 4,750 %, fällig 08.03.2044	1.509	0,48
Niederlande — 0,04 % (29. Februar 2020: 0,04 %)			
120	BNG Bank NV, 4,375 %, fällig 16.02.2021	122	0,04
Panama — 0,42 % (29. Februar 2020: 0,41 %)			
190	Panama Government International Bond, 6,700 %, fällig 26.01.2036	281	0,09
200	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 15.05.2047	258	0,08
620	Panama Government International Bond, 4,300 %, fällig 29.04.2053	790	0,25
		1.329	0,42
Peru — 0,30 % (29. Februar 2020: 0,36 %)			
180	Peruvian Government International Bond, 6,550 %, fällig 14.03.2037	280	0,09
390	Peruvian Government International Bond, 5,625 %, fällig 18.11.2050	647	0,21
		927	0,30
Polen — 0,19 % (29. Februar 2020: 0,18 %)			
130	Republic of Poland Government International Bond, 5,000 %, fällig 23.03.2022	140	0,05
400	Republic of Poland Government International Bond, 4,000 %, fällig 22.01.2024	447	0,14
		587	0,19
Katar — 0,34 % (29. Februar 2020: 0,31 %)			
770	Qatar Government International Bond, 144A, 4,817 %, fällig 14.03.2049	1.056	0,34
Russland — 0,44 % (29. Februar 2020: 0,42 %)			
800	Russian Foreign Bond – Eurobond, 5,625 %, fällig 04.04.2042	1.091	0,35
200	Russian Foreign Bond – Eurobond, 5,875 %, fällig 16.09.2043	283	0,09
	1.374	0,44	
Saudi Arabien — 0,13 % (29. Februar 2020: 0,13 %)			
400	Saudi Government International Bond, 2,875 %, fällig 04.03.2023	418	0,13
Vereinigte Arabische Emirate — 0,32 % (29. Februar 2020: 0,31 %)			
950	Abu Dhabi Government International Bond, 2,500 %, fällig 11.10.2022	985	0,32
USA — 19,39 % (29. Februar 2020: 18,32 %)			
210	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 28.10.2020	210	0,07
570	Federal Home Loan Banks, Series 0, 0,210 %, fällig 07.10.2020 *	570	0,18
120	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri, 3,229 %, fällig 15.05.2050	141	0,05
200	Tennessee Valley Authority, 3,875 %, fällig 15.02.2021	203	0,07
140	Tennessee Valley Authority, 1,875 %, fällig 15.08.2022	145	0,05
1.070	United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 10.11.2020	1.070	0,34
1.070	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 13.10.2020	1.070	0,34
940	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2,125 %, fällig 15.02.2040 β	1.714	0,55
220	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2,125 %, fällig 15.02.2041 β	400	0,13
20	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,750 %, fällig 15.02.2042 β	29	0,01
1.100	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375 %, fällig 15.02.2044 β	1.725	0,55
290	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,750 %, fällig 15.02.2045 β	404	0,13
430	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, fällig 15.02.2046 β	632	0,20
860	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, fällig 15.02.2048 β	1.255	0,40
3.910	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, fällig 15.02.2049 β	5.646	1,80
10	United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, fällig 15.05.2022	10	–
20	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 30.04.2024	22	0,01
510	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30.04.2025	513	0,16
4.570	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.05.2025	4.571	1,46
110	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 30.06.2025	110	0,04
70	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 31.03.2026	77	0,02
680	United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, fällig 31.05.2026	749	0,24
2.340	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 31.12.2026	2.536	0,81
4.290	United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 30.04.2027	4.304	1,38
6.220	United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 30.06.2027	6.234	1,99
2.200	United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 31.08.2027	2.203	0,70
540	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.05.2030	537	0,17
2.930	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.08.2030	2.911	0,93
110	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.08.2045	144	0,05
640	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2048	869	0,28
1.790	United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 15.05.2048	2.488	0,80
280	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2049	383	0,12
2.010	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.08.2049	2.392	0,76
5.390	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	6.102	1,95
5.970	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15.05.2050	5.672	1,81
2.680	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	2.630	0,84
		60.671	19,39
Uruguay — 0,28 % (29. Februar 2020: 0,26 %)			
390	Uruguay Government International Bond, 4,375 %, fällig 23.01.2031	468	0,15
300	Uruguay Government International Bond, 5,100 %, fällig 18.06.2050	415	0,13
		883	0,28
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 69.025 USD)		73.924	23,63
Kollektive Kapitalanlagen — 5,54 % (29. Februar 2020: 8,92 %)			
17.331	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	17.331	5,54
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 17.331 USD)		17.331	5,54

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 302.899 USD)	318.464	101,80
Gekaufte Optionen — 0,02 % (29. Februar 2020: 0,18 %)		
– U.S. 10 Year Dezember 2020 Call 141,00, fällig 23.10.2020	6	–
– U.S. 10 Year November 2020 Call 142,00, fällig 25.09.2020	13	0,01
– U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 139,25, fällig 25.09.2020	26	0,01
– U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 140,00, fällig 25.09.2020	6	–
– U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 141,00, fällig 25.09.2020	1	–
– U.S. 10 Year Oktober 2020 Put 139,25, fällig 25.09.2020	8	–
– U.S. 10 Year Oktober 2020 Put 140,00, fällig 25.09.2020	5	–
– U.S. Bond Oktober 2020 Call 181,00, fällig 25.09.2020	3	–
Summe gekaufte Optionen (Kosten 76 USD)	68	0,02
Kreditausfallversicherungen — 0,01 % (29. Februar 2020: 0,11 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	32	0,01
Zinsswaps — 0,15 % (29. Februar 2020: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	476	0,15
Devisenterminkontrakte — 0,01 % (29. Februar 2020: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	41	0,01
Termingeschäfte — 0,08 % (29. Februar 2020: 0,69 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	239	0,08
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	319.320	102,07
Geschriebene Optionen — (0,03 %) (29. Februar 2020: (0,47 %))		
– U.S. 10 Year Dezember 2020 Call 141,00, fällig 20.11.2020	(11)	(0,01)
– U.S. 10 Year Dezember 2020 Call 141,50, fällig 20.11.2020	(9)	–
– U.S. 10 Year Dezember 2020 Put 135,50, fällig 20.11.2020	(6)	–
– U.S. 10 Year Dezember 2020 Put 137,50, fällig 20.11.2020	(6)	–
– U.S. 10 Year November 2020 Call 142,00, fällig 23.10.2020	(2)	–
– U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 140,00, due 25/09/2020	(4)	–
– U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 141,00, due 25/09/2020	(1)	–
– U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 142,00, due 25/09/2020	–	–
– U.S. Bond Dezember 2020 Put 172,00, due 20/11/2020	(23)	(0,01)
U.S. Bond Oktober 2020 Call 181,00, due 25/09/2020	(2)	–
– U.S. Bond Oktober 2020 Call 181,50, fällig 25.09.2020	(1)	–
– U.S. Bond Oktober 2020 Call 184,00, fällig 25.09.2020	–	–
– U.S. Bond Oktober 2020 Put 173,00, fällig 25.09.2020	(5)	–
– U.S. Bond Oktober 2020 Put 175,00, fällig25.09.2020	(5)	–
– U.S. Bond Oktober 2020 Put 177,00, fällig 25.09.2020	(9)	(0,01)
Geschriebene Optionen insgesamt (Kosten (106) USD)	(84)	(0,03)
Swaps de taux d'intérêt :(0,14 %) (29. Februar 2020: (1,11 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(455)	(0,14)
Kontrakte de change à terme : 0,00 % (29. Februar 2020: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	–	–
Kontrakte à terme standardisés : (0,16 %) (29. Februar 2020: (0,13 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(502)	(0,16)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(1.041)	(0,33)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt	318.279	101,74
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	(5.458)	(1,74)
Gesamtnettovermögen	$312.821	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 37.814.000 USD und machten 12.14% des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

† Illiquide.

∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

ε Das Wertpapier ist seit dem 31. August 2020 in Verzug (entweder Kapital und/oder Zinsen).

± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (VPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihzins entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

TBA – wird noch bekannt gegeben

CNY – Chinesischer Renminbi

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	89,45
Organismen für gemeinsame Anlagen	5,15
Finanzderivate	0,25
Sonstige Vermögenswerte	5,15
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 %	Verkauf	20.06.2025	1.960	$ 32
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (29. Februar 2020 (in Tsd.) :341 USD)					$ 32
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)					–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): 341 USD)					$ 32

Aufstellung der Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,190 %	15.06.2022	11.149	$ (6)
Goldman Sachs	Pay Floating USD Fed Funds Rate, Receive Fixed 0,100 %	30.11.2024	9.078	8
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,260 %, Receive Floating USD Fed Funds Rate	15.05.2027	5.555	–
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,450 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.05.2027	5.928	8
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,850 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.2044	2.570	(449)
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,560 %, Receive Floating USD Sofr Compound	20.07.2045	2.880	165
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,740 %, Receive Floating USD Sofr Compound	19.08.2045	1.170	18
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,800 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.2045	1.784	112
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,900 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	17.03.2050	1.110	54
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,792 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	18.03.2050	556	43
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,818 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	19.03.2050	549	39
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,885 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	13.07.2050	545	29
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)				$ 476
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (3.515) USD)				(455)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (3.515) USD)				$ 21

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/(Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	37	Verkauf	EUR	31		$ –
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.046	Verkauf	USD	3.596		41
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 8 USD)									41
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (-) USD)									–
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 8 USD)									$ 41

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/(Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro$ Dezember 2021	(191)	$ (47.645)	$ (298)
90 Day Euro$ Juni 2021	(35)	(8.733)	(101)
90 Day Euro$ März 2021	(83)	(20.709)	(30)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	(89)	(12.393)	1
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2020	(53)	(8.450)	47
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2020	(35)	(7.733)	(2)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	536	67.553	84
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	(54)	(9.489)	107
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	22	4.860	(71)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 2.187 USD)			$ 239
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(412) USD)			(502)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 1.775 USD)			$ (263)

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 4,81 % (29. Februar 2020: 3,37 %)			
252	Aegis Asset Backed Sec Corp Mort Pass Thr Certs Series 2003-3, Series 2003 3, Klasse M2, 2,650 %, fällig 25.01.2034 *	241	0,01
5.920	American Tower Trust #1 13, Klasse 2A, 144A, 3,070 %, fällig 15.03.2048	6.069	0,36
789	Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Ctfs Ser 2005-R7, Series 2005 R7, Klasse M2, 0,675 %, fällig 25.09.2035 *	788	0,05
1.350	AMMC CLO XII Ltd, Series 2013 12A, Klasse AR, 144A, 1,443 %, fällig 10.11.2030 *	1.343	0,08
1.250	Apidos CLO XII, Series 2013 12A, Klasse AR, 144A, 1,355 %, fällig 15.04.2031 *	1.238	0,07
2.080	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2019 1A, Klasse A2I, 144A, 4,194 %, fällig 07.06.2049	1.810	0,11
6.827	Asset Backed Securities Corp Home Equity Loan Trust Series RFC 2007-HE1, Series 2007 HE1, Klasse A4, 0,315 %, fällig 25.12.2036 *	6.530	0,38
2.390	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Series 1996 1, Klasse B1, 7,875 %, fällig 10.10.2026	379	0,02
2.000	BlueMountain CLO XXII Ltd, Series 2018 22A, Klasse A1, 144A, 1,355 %, fällig 15.07.2031 *	1.968	0,12
3.465	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-3 Ltd, Series 2015 3A, Klasse A1R, 144A, 1,247 %, fällig 28.07.2028 *	3.449	0,20
1.750	Cedar Funding VIII Clo Ltd, Series 2017 8A, Klasse A1, 144A, 1,523 %, fällig 17.10.2030 *	1.743	0,10
975	Community Funding CLO 2015-1A, Series 2015 1A, Klasse A, 144A, 5,750 %, fällig 01.11.2027 †	1.040	0,06
32	ContiMortgage Home Equity Loan Trust 1999-1, Series 1999 1, Klasse B, 9,000 %, fällig 25.04.2030	33	–
1.404	Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2005 8, Klasse M4, 1,105 %, fällig 25.12.2035 *	1.403	0,08
80	Countrywide Home Equity Loan Trust, Series 2006 HW, Klasse 2A1B, 0,312 %, fällig 15.11.2036 *	70	–
1.960	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Klasse M2, 144A, 3,065 %, fällig 25.07.2057 *	1.576	0,09
244	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-13, Series 2004 13, Klasse MF1, 5,071 %, fällig 25.04.2035 *	246	0,02
1.908	Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Series 2018 2, Klasse A, 144A, 3,720 %, fällig 20.12.2038	1.953	0,12
2.672	Encore Credit Receivables Trust 2005-3, Series 2005 3, Klasse M5, 1,135 %, fällig 25.10.2035 *	2.504	0,15
299	Fannie Mae Grantor Trust 2017-T1, Series 2017 T1, Klasse A, 2,898 %, fällig 25.06.2027	331	0,02
8.581	Fieldstone Mortgage Investment Trust Series 2005-2, Series 2005 2, Klasse M3, 0,955 %, fällig 25.12.2035 *	7.849	0,46
2.060	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Series 2018 4, Klasse A, 4,060 %, fällig 15.11.2030	2.334	0,14
200	Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates FRESR 2017-SR01, Series 2017 SR01, Klasse A3, 3,089 %, fällig 25.11.2027	219	0,01
1.059	Goal Capital Funding Trust, Series 2005 2, Klasse A4, 0,450 %, fällig 25.08.2044 *	1.031	0,06
1.100	Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Klasse A2, 144A, 1,285 %, fällig 15.04.2031 *	1.087	0,06
1.726	GSAMP Trust 2005-NC1, Series 2005 NC1, Klasse M2, 1,270 %, fällig 25.02.2035 *	1.352	0,08
2.660	Hertz Vehicle Financing II LP, Series 2017 2A, Klasse B, 144A, 4,200 %, fällig 25.10.2023	2.657	0,16
973	Jackson Mill CLO Ltd, Series 2015 1A, Klasse AR, 144A, 1,105 %, fällig 15.04.2027 *	966	0,06
2.707	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Series 2004 1, Klasse M1, 0,925 %, fällig 25.02.2034 *	2.638	0,16
2.005	MP CLO VIII Ltd, Series 2015 2A, Klasse AR, 144A, 1,157 %, fällig 28.10.2027 *	1.992	0,12
3.260	Nelnet Student Loan Trust 2007-1, Series 2007 1, Klasse A4, 0,360 %, fällig 27.08.2036 *	3.080	0,18
4.000	Ocean Trails CLO IX, Series 2020 9A, Klasse A1, 144A, 0,000 %, fällig 15.10.2029 * ∞	4.000	0,24
2.500	Octagon Investment Partners 36 Ltd, Series 2018 1A, Klasse A1, 144A, 1,245 %, fällig 15.04.2031 *	2.464	0,14
1.550	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Series 2007 FXD1, Klasse 1A1, 5,866 %, fällig 25.01.2037	1.513	0,09
607	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2006-A, Series 2006 A, Klasse A2, 1,738 %, fällig 15.10.2037 *	583	0,03
1.798	Recette Clo Ltd, Series 2015 1A, Klasse AR, 144A, 1,192 %, fällig 20.10.2027 *	1.790	0,10
1.750	Regatta VI Funding Ltd, Series 2016 1A, Klasse AR, 144A, 1,352 %, fällig 20.07.2028 *	1.746	0,10
2.433	Renaissance Home Equity Loan Trust 2004-1, Series 2004 1, Klasse AV3, 1,115 %, fällig 25.05.2034 *	2.400	0,14
193	SBA Small Business Investment Cos, Series 2018 10B, Klasse 1, 3,548 %, fällig 10.09.2028	207	0,01
466	Shackleton 2014-VI-R CLO Ltd, Series 2014 6RA, Klasse A, 144A, 1,293 %, fällig 17.07.2028 *	463	0,03
970	SMB Private Education Loan Trust 2014-A, Series 2014 A, Klasse A3, 144A, 1,662 %, fällig 15.04.2032 *	972	0,06
2	SMB Private Education Loan Trust 2015-A, Series 2015 A, Klasse R, 144A, 0,000 %, fällig 15.10.2048	829	0,05
830	SMB Private Education Loan Trust 2020-B, Series 2020 BA, Klasse A1A, 144A, 1,290 %, fällig 15.07.2053	830	0,05
750	TCI-Flatiron Clo 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Klasse A, 144A, 1,480 %, fällig 18.11.2030 *	746	0,04
563	Towd Point Mortgage Trust 2016-3, Series 2016 3, Klasse A1, 144A, 2,250 %, fällig 25.04.2056 *	573	0,03
1.818	Tralee CLO III Ltd, Series 2014 3A, Klasse AR, 144A, 1,302 %, fällig 20.10.2027 *	1.808	0,11
1.000	Voya CLO 2018-3 Ltd, Series 2018 3A, Klasse A1A, 144A, 1,425 %, fällig 15.10.2031 *	996	0,06
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 80.880 USD)		81.839	4,81
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 25,05 % (29. Februar 2020: 38,86 %)			
89	Alternative Loan Trust 2005-14, Series 2005 14, Klasse 2A2, 0,425 %, fällig 25.05.2035 *	76	–
283	Alternative Loan Trust 2005-56, Series 2005 56, Klasse 4A1, 0,485 %, fällig 25.11.2035 *	269	0,02
214	Alternative Loan Trust 2005-IM1, Series 2005 IM1, Klasse A1, 0,775 %, fällig 25.01.2036 *	197	0,01
53	Alternative Loan Trust 2005-IM1, Series 2005 IM1, Klasse A1, 0,775 %, fällig 25.01.2036 *	90	0,01
240	APS Resecuritization Trust 2015-3, Series 2015 3, Klasse 1A, 144A, 1,035 %, fällig 27.10.2046 *	249	0,02
2.235	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Series 2016 GG10, Klasse AJA, 144A, 6,015 %, fällig 10.08.2045 *	985	0,06
2.609	Banc of America Funding 2014-R2 Trust, Series 2014 R2, Klasse 2A2, 144A, 0,384 %, fällig 26.05.2037 *	2.268	0,13
780	BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Klasse A5, 3,435 %, fällig 15.09.2060	881	0,05
13.130	BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Klasse XA, 0,920 %, fällig 15.09.2060 *	532	0,03
2.570	BBCCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Klasse E, 144A, 4,715 %, fällig 10.08.2033 *	2.316	0,14
406	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR1, Series 2007 AR1, Klasse 1A1, 0,335 %, fällig 25.01.2037 *	364	0,02
497	BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND, Series 2018 IND, Klasse G, 144A, 2,212 %, fällig 15.11.2035 *	493	0,03
2.324	BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND, Series 2018 IND, Klasse H, 144A, 3,162 %, fällig 15.11.2035 *	2.274	0,13
3.100	BXP Trust 2017-CQHP, Series 2017 CQHP, Klasse A, 144A, 1,012 %, fällig 15.11.2034 *	2.997	0,18
84	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-3, Series 2005 3, Klasse 1A2, 0,755 %, fällig 25.04.2035 *	76	–
300	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27, Series 2015 GC27, Class AS, 3,571 %, due 10.02.2048	322	0,02
8.968	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Series 2006 AR6, Klasse 2A4, 0,395 %, fällig 25.09.2036 *	2.896	0,17
20	COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Series 2013 CR12, Klasse B, 4,762 %, fällig 10.10.2046 *	20	–
10	COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Series 2013 CR12, Klasse C, 5,240 %, fällig 10.10.2046 *	10	–
726	COMM 2013-CCRE6 Mortgage Trust, Series 2013 CR6, Klasse B, 144A, 3,397 %, fällig 10.03.2046	736	0,04
90	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1, Klasse B, 4,035 %, fällig 10.02.2048 *	93	0,01
70	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1, Klasse C, 4,454 %, fällig 10.02.2048 *	66	–
3.237	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Klasse 1M2, 144A, 2,275 %, fällig 25.10.2039 *	3.247	0,19

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 — *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
17	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series 2006-C3, Series 2006 C3, Klasse AJ, 6,635 %, fällig 15.06.2038 *	9	–
11	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series 2006-C5, Series 2006 C5, Klasse AJ, 5,373 %, fällig 15.12.2039	5	–
500	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C1, Klasse AS, 3,791 %, fällig 15.04.2050 *	543	0,03
1.050	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Klasse A2, 144A, 3,953 %, fällig 15.09.2037 †	1.057	0,06
140	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Klasse E, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037	86	0,01
5.170	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Klasse F, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037	2.918	0,17
600	CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Klasse G, 144A, 5,512 %, fällig 15.07.2032 *†	393	0,02
1.680	DBCG 2017-BBG Mortgage Trust, Series 2017 BBG, Klasse A, 144A, 0,862 %, fällig 15.06.2034 *	1.665	0,10
520	DBUBS 2011-LC1 Mortgage Trust, Series 2011 LC1A, Klasse C, 144A, 5,790 %, fällig 10.11.2046 *	522	0,03
206	Deutsche Mortgage Securities Inc Mortgage Loan Trust Series 2006-PR1, Series 2006 PR1, Klasse 3AF1, 144A, 0,442 %, fällig 15.04.2036 *	173	0,01
795	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C03, Klasse 1M2, 3,175 %, fällig 25.07.2024 *	703	0,04
1.022	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C04, Klasse 1M2, 4,425 %, fällig 25.01.2029 *	1.060	0,06
2.340	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Klasse 1B1, 3,925 %, fällig 25.10.2030 *	2.200	0,13
2.603	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Klasse 1M2, 2,325 %, fällig 25.10.2030 *	2.570	0,15
560	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05, Klasse 1B1, 4,425 %, fällig 25.01.2031 *	525	0,03
22	Fannie Mae Interest Strip 390, Klasse C3, 6,000 %, fällig 25.07.2038	4	–
11	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 22, 5,000 %, fällig 25.01.2039	2	–
6	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 23, 5,000 %, fällig 25.01.2039 *	1	–
13	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 27, 5,500 %, fällig 25.01.2039 *	2	–
10	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 34, 5,000 %, fällig 25.01.2038	1	–
28	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 41, 6,000 %, fällig 25.01.2038	5	–
122	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C13, 3,500 %, fällig 25.11.2041	11	–
133	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C18, 4,000 %, fällig 25.04.2042	19	–
181	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C2, 3,000 %, fällig 25.04.2027	10	–
113	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C22, 4,500 %, fällig 25.11.2039	17	–
2.900	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 1,500 % ±	2.969	0,18
38.400	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 2,000 % ±	39.958	2,35
1.000	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 % ±	1.080	0,06
31.400	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 % ±	32.384	1,90
16	Fannie Mae Pool ‘254793’, 5,000 %, fällig 01.07.2033	18	–
19	Fannie Mae Pool ‘555743’, 5,000 %, fällig 01.09.2033	22	–
2	Fannie Mae Pool ‘725162’, 6,000 %, fällig 01.02.2034	2	–
8	Fannie Mae Pool ‘745000’, 6,000 %, fällig 01.10.2035	9	–
13	Fannie Mae Pool ‘843997’, 3,291 %, fällig 01.11.2035 *	14	–
18	Fannie Mae Pool ‘865915’, 3,481 %, fällig 01.03.2036 *	18	–
23	Fannie Mae Pool ‘888560’, 6,000 %, fällig 01.11.2035	28	–
54	Fannie Mae Pool ‘889117’, 5,000 %, fällig 01.10.2035	62	–
49	Fannie Mae Pool ‘890248’, 6,000 %, fällig 01.08.2037	59	–
704	Fannie Mae Pool ‘890604’, 4,500 %, fällig 01.10.2044	792	0,05
76	Fannie Mae Pool ‘890876’, 3,500 %, fällig 01.02.2049	83	0,01
11	Fannie Mae Pool ‘985626’, 6,000 %, fällig 01.04.2033	13	–
25	Fannie Mae Pool ‘995072’, 5,500 %, fällig 01.08.2038	29	–
841	Fannie Mae Pool ‘AB6201’, 3,000 %, fällig 01.09.2042	919	0,05
65	Fannie Mae Pool ‘AB9683’, 4,000 %, fällig 01.06.2043	71	–
57	Fannie Mae Pool ‘AE0758’, 7,000 %, fällig 01.02.2039	66	–
53	Fannie Mae Pool ‘AK8441’, 4,000 %, fällig 01.04.2042	58	–
1	Fannie Mae Pool ‘AL2931’, 6,000 %, fällig 01.06.2023	1	–
732	Fannie Mae Pool ‘AL3024’, 3,500 %, fällig 01.01.2043	793	0,05
60	Fannie Mae Pool ‘AL3026’, 3,500 %, fällig 01.12.2042	65	–
46	Fannie Mae Pool ‘AL3508’, 4,000 %, fällig 01.04.2043	52	–
41	Fannie Mae Pool ‘AL4741’, 4,500 %, fällig 01.01.2044	45	–
177	Fannie Mae Pool ‘AL6613’, 2,500 %, fällig 01.06.2028	186	0,01
133	Fannie Mae Pool ‘AL9397’, 3,000 %, fällig 01.10.2046	142	0,01
863	Fannie Mae Pool ‘AL9546’, 3,500 %, fällig 01.11.2046	929	0,06
561	Fannie Mae Pool ‘AL9631’, 3,000 %, fällig 01.12.2046	607	0,04
10	Fannie Mae Pool ‘AM8674’, 2,810 %, fällig 01.04.2025	11	–
31	Fannie Mae Pool ‘AO2711’, 4,000 %, fällig 01.05.2042	33	–
31	Fannie Mae Pool ‘AO6086’, 4,000 %, fällig 01.06.2042	34	–
27	Fannie Mae Pool ‘AO9859’, 4,000 %, fällig 01.07.2042	30	–
26	Fannie Mae Pool ‘AP0692’, 4,000 %, fällig 01.07.2042	29	–
25	Fannie Mae Pool ‘AP2530’, 4,000 %, fällig 01.08.2042	27	–
25	Fannie Mae Pool ‘AP2958’, 4,000 %, fällig 01.08.2042	28	–
104	Fannie Mae Pool ‘AP4710’, 3,500 %, fällig 01.08.2042	113	0,01
396	Fannie Mae Pool ‘AP4781’, 3,000 %, fällig 01.09.2042	433	0,03
42	Fannie Mae Pool ‘AP4903’, 4,000 %, fällig 01.09.2042	46	–
105	Fannie Mae Pool ‘AP7399’, 4,000 %, fällig 01.09.2042	116	0,01
40	Fannie Mae Pool ‘AP9229’, 4,000 %, fällig 01.10.2042	43	–
130	Fannie Mae Pool ‘AP9766’, 4,000 %, fällig 01.10.2042	143	0,01
84	Fannie Mae Pool ‘AP9862’, 4,000 %, fällig 01.10.2042	91	0,01
51	Fannie Mae Pool ‘AQ0100’, 4,000 %, fällig 01.10.2042	56	–
171	Fannie Mae Pool ‘AQ1641’, 4,000 %, fällig 01.10.2042	189	0,01
20	Fannie Mae Pool ‘AQ3599’, 4,000 %, fällig 01.11.2042	22	–
42	Fannie Mae Pool ‘AQ4078’, 4,000 %, fällig 01.06.2043	48	–
37	Fannie Mae Pool ‘AQ4080’, 4,000 %, fällig 01.06.2043	42	–
60	Fannie Mae Pool ‘AQ4555’, 4,000 %, fällig 01.12.2042	66	–
28	Fannie Mae Pool ‘AQ5137’, 4,000 %, fällig 01.11.2042	31	–
83	Fannie Mae Pool ‘AQ7003’, 4,000 %, fällig 01.12.2042	91	0,01
117	Fannie Mae Pool ‘AQ7082’, 4,000 %, fällig 01.01.2043	129	0,01
43	Fannie Mae Pool ‘AS0070’, 4,000 %, fällig 01.08.2043	47	–
43	Fannie Mae Pool ‘AS4271’, 4,500 %, fällig 01.01.2045	50	–
81	Fannie Mae Pool ‘AS4347’, 4,000 %, fällig 01.01.2045	90	0,01
1.235	Fannie Mae Pool ‘AS6328’, 3,500 %, fällig 01.12.2045	1.323	0,08
224	Fannie Mae Pool ‘AS6340’, 3,500 %, fällig 01.12.2045	242	0,01
169	Fannie Mae Pool ‘AS6541’, 3,500 %, fällig 01.01.2046	186	0,01
163	Fannie Mae Pool ‘AS6562’, 3,500 %, fällig 01.01.2046	177	0,01
1.004	Fannie Mae Pool ‘AS7738’, 3,000 %, fällig 01.08.2046	1.084	0,06
124	Fannie Mae Pool ‘AS7844’, 3,000 %, fällig 01.09.2046	132	0,01
46	Fannie Mae Pool ‘AS8072’, 3,000 %, fällig 01.10.2046	48	–
1.430	Fannie Mae Pool ‘AS8359’, 3,000 %, fällig 01.11.2046	1.514	0,09
354	Fannie Mae Pool ‘AS8623’, 3,000 %, fällig 01.01.2047	382	0,02
1.326	Fannie Mae Pool ‘AS8745’, 3,000 %, fällig 01.02.2047	1.435	0,08
108	Fannie Mae Pool ‘AS9453’, 4,000 %, fällig 01.04.2047	117	0,01
56	Fannie Mae Pool ‘AS9588’, 4,000 %, fällig 01.05.2047	61	–
37	Fannie Mae Pool ‘AT7208’, 4,000 %, fällig 01.06.2043	42	–
40	Fannie Mae Pool ‘AT8394’, 4,000 %, fällig 01.06.2043	45	–
126	Fannie Mae Pool ‘AT9637’, 4,000 %, fällig 01.07.2043	140	0,01
88	Fannie Mae Pool ‘AT9653’, 4,000 %, fällig 01.07.2043	100	0,01
71	Fannie Mae Pool ‘AT9657’, 4,000 %, fällig 01.07.2043	78	0,01
16	Fannie Mae Pool ‘AU9537’, 4,500 %, fällig 01.10.2043	17	–
48	Fannie Mae Pool ‘AV0894’, 4,500 %, fällig 01.11.2043	52	–
439	Fannie Mae Pool ‘AW0318’, 4,500 %, fällig 01.02.2044	490	0,03
670	Fannie Mae Pool ‘BC0884’, 3,000 %, fällig 01.05.2046	723	0,04
65	Fannie Mae Pool ‘BC1509’, 3,000 %, fällig 01.08.2046	70	–
190	Fannie Mae Pool ‘BC2817’, 3,000 %, fällig 01.09.2046	201	0,01
1.104	Fannie Mae Pool ‘BD2455’, 3,000 %, fällig 01.01.2047	1.190	0,07
405	Fannie Mae Pool ‘BD8104’, 3,000 %, fällig 01.10.2046	438	0,03
1.329	Fannie Mae Pool ‘BF0104’, 4,000 %, fällig 01.02.2056	1.501	0,09
3.492	Fannie Mae Pool ‘BF0145’, 3,500 %, fällig 01.03.2057	3.822	0,23
62	Fannie Mae Pool ‘BF0148’, 4,500 %, fällig 01.04.2056	70	–
1.249	Fannie Mae Pool ‘BF0163’, 5,000 %, fällig 01.11.2046	1.418	0,08
755	Fannie Mae Pool ‘BF0183’, 4,000 %, fällig 01.01.2057	853	0,05
1.506	Fannie Mae Pool ‘BF0191’, 4,000 %, fällig 01.06.2057	1.693	0,10
1.286	Fannie Mae Pool ‘BF0222’, 4,500 %, fällig 01.09.2057	1.447	0,09
432	Fannie Mae Pool ‘BH2623’, 4,000 %, fällig 01.08.2047	464	0,03
9.303	Fannie Mae Pool ‘BH4101’, 3,500 %, fällig 01.10.2047	9.840	0,58
188	Fannie Mae Pool ‘BJ2544’, 3,000 %, fällig 01.12.2037	199	0,01
1.901	Fannie Mae Pool ‘BK7700’, 4,500 %, fällig 01.10.2048	2.087	0,12
187	Fannie Mae Pool ‘BL2454’, 3,160 %, fällig 01.05.2029	216	0,01
200	Fannie Mae Pool ‘BL4525’, 2,240 %, fällig 01.10.2031	218	0,01
300	Fannie Mae Pool ‘BL5656’, 2,260 %, fällig 01.02.2030	328	0,02

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
200	Fannie Mae Pool 'BL5742', 2,320 %, fällig 01.02.2032	217	0,01
100	Fannie Mae Pool 'BL5796', 2,300 %, fällig 01.02.2030	110	0,01
994	Fannie Mae Pool 'BL5850', 2,260 %, fällig 01.04.2030	1.082	0,06
200	Fannie Mae Pool 'BL6028', 2,140 %, fällig 01.04.2030	216	0,01
200	Fannie Mae Pool 'BL6083', 2,060 %, fällig 01.03.2030	217	0,01
298	Fannie Mae Pool 'BL6160', 2,060 %, fällig 01.03.2030	323	0,02
200	Fannie Mae Pool 'BL6295', 1,950 %, fällig 01.04.2032	212	0,01
200	Fannie Mae Pool 'BL6352', 1,850 %, fällig 01.04.2032	211	0,01
1.276	Fannie Mae Pool 'BM1565', 3,000 %, fällig 01.04.2047	1.381	0,08
246	Fannie Mae Pool 'BM3473', 3,500 %, fällig 01.11.2047	270	0,02
74	Fannie Mae Pool 'BM3799', 3,000 %, fällig 01.08.2047	80	0,01
482	Fannie Mae Pool 'BM3904', 5,000 %, fällig 01.05.2048	532	0,03
285	Fannie Mae Pool 'BM3934', 4,500 %, fällig 01.05.2048	311	0,02
345	Fannie Mae Pool 'BM4579', 3,000 %, fällig 01.04.2047	372	0,02
77	Fannie Mae Pool 'BM4750', 3,500 %, fällig 01.02.2045	83	0,01
512	Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, fällig 01.03.2043	555	0,03
755	Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, fällig 01.12.2046	812	0,05
1.840	Fannie Mae Pool 'BM5521', 3,500 %, fällig 01.07.2048	1.950	0,12
2.894	Fannie Mae Pool 'BM5526', 3,500 %, fällig 01.02.2048	3.064	0,18
1.161	Fannie Mae Pool 'BN0341', 5,000 %, fällig 01.12.2048	1.272	0,08
788	Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500 %, fällig 01.11.2048	871	0,05
2.584	Fannie Mae Pool 'BN3898', 4,500 %, fällig 01.12.2048	2.847	0,17
3.834	Fannie Mae Pool 'BN7652', 3,000 %, fällig 01.07.2049	4.073	0,24
182	Fannie Mae Pool 'BO1858', 3,000 %, fällig 01.08.2049	199	0,01
1.449	Fannie Mae Pool 'BO2252', 3,500 %, fällig 01.10.2049	1.565	0,09
275	Fannie Mae Pool 'BO8932', 3,000 %, fällig 01.01.2050	296	0,02
196	Fannie Mae Pool 'BO9692', 3,000 %, fällig 01.01.2050	207	0,01
188	Fannie Mae Pool 'BP1662', 3,500 %, fällig 01.02.2050	199	0,01
399	Fannie Mae Pool 'BP7009', 3,000 %, fällig 01.08.2050	427	0,03
200	Fannie Mae Pool 'BP9421', 3,000 %, fällig 01.07.2050	213	0,01
100	Fannie Mae Pool 'BQ1402', 3,000 %, fällig 01.08.2050	107	0,01
797	Fannie Mae Pool 'CA0858', 3,500 %, fällig 01.12.2047	844	0,05
122	Fannie Mae Pool 'CA1053', 3,500 %, fällig 01.01.2048	129	0,01
964	Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500 %, fällig 01.07.2048	1.061	0,06
1.680	Fannie Mae Pool 'CA2199', 4,500 %, fällig 01.08.2048	1.838	0,11
221	Fannie Mae Pool 'CA2251', 5,000 %, fällig 01.08.2048	242	0,01
3.839	Fannie Mae Pool 'CA2471', 4,000 %, fällig 01.10.2048	4.113	0,24
1.258	Fannie Mae Pool 'CA2482', 4,500 %, fällig 01.10.2048	1.378	0,08
1.393	Fannie Mae Pool 'CA2652', 5,000 %, fällig 01.11.2048	1.528	0,09
3.857	Fannie Mae Pool 'CA2798', 4,500 %, fällig 01.12.2048	4.218	0,25
5.930	Fannie Mae Pool 'CA2799', 4,500 %, fällig 01.12.2048	6.491	0,38
1.481	Fannie Mae Pool 'CA2805', 4,500 %, fällig 01.12.2048	1.600	0,09
84	Fannie Mae Pool 'CA3809', 3,000 %, fällig 01.07.2049	90	0,01
1.046	Fannie Mae Pool 'CA3860', 3,500 %, fällig 01.07.2049	1.125	0,07
1.898	Fannie Mae Pool 'CA4133', 3,000 %, fällig 01.09.2049	2.044	0,12
1.820	Fannie Mae Pool 'CA4979', 3,000 %, fällig 01.01.2050	1.920	0,11
847	Fannie Mae Pool 'CA5164', 3,500 %, fällig 01.02.2050	893	0,05
4.153	Fannie Mae Pool 'CA5225', 3,000 %, fällig 01.02.2050	4.476	0,26
1.404	Fannie Mae Pool 'CA5226', 3,000 %, fällig 01.02.2050	1.488	0,09
856	Fannie Mae Pool 'CA5561', 3,500 %, fällig 01.04.2050	914	0,05
1.180	Fannie Mae Pool 'CA6000', 3,000 %, fällig 01.06.2050	1.256	0,07
831	Fannie Mae Pool 'FM1789', 3,000 %, fällig 01.11.2049	880	0,05
4.023	Fannie Mae Pool 'FM2075', 3,000 %, fällig 01.12.2049	4.272	0,25
555	Fannie Mae Pool 'FM2091', 3,500 %, fällig 01.12.2049	600	0,04
263	Fannie Mae Pool 'FM2158', 4,000 %, fällig 01.10.2049	284	0,02
97	Fannie Mae Pool 'FM2173', 4,000 %, fällig 01.09.2048	106	0,01
748	Fannie Mae Pool 'FM2333', 3,500 %, fällig 01.02.2050	789	0,05
887	Fannie Mae Pool 'FM2745', 4,500 %, fällig 01.03.2050	961	0,06
2.244	Fannie Mae Pool 'FM3141', 3,500 %, fällig 01.11.2048	2.389	0,14
169	Fannie Mae Pool 'FM3154', 5,000 %, fällig 01.09.2049	186	0,01
243	Fannie Mae Pool 'FM3155', 5,000 %, fällig 01.12.2049	266	0,02
453	Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000 %, fällig 01.11.2048	494	0,03
5.455	Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500 %, fällig 01.05.2047	5.828	0,34
186	Fannie Mae Pool 'FM3542', 4,000 %, fällig 01.05.2049	202	0,01
7.578	Fannie Mae Pool 'FM3773', 3,500 %, fällig 01.11.2048	8.111	0,48
900	Fannie Mae Pool 'FM3957', 5,000 %, fällig 01.03.2050	988	0,06
22	Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, fällig 01.04.2031	24	–
82	Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, fällig 01.05.2031	91	0,01
24	Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, fällig 01.06.2031	27	–
36	Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, fällig 01.11.2031	40	–
40	Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, fällig 01.12.2031	44	–
167	Fannie Mae Pool 'MA1146', 4,000 %, fällig 01.08.2042	182	0,01
38	Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500 %, fällig 01.09.2042	41	–
1.190	Fannie Mae Pool 'MA1217', 4,000 %, fällig 01.10.2042	1.305	0,08
253	Fannie Mae Pool 'MA1253', 4,000 %, fällig 01.11.2042	278	0,02
639	Fannie Mae Pool 'MA1283', 3,500 %, fällig 01.12.2042	692	0,04
452	Fannie Mae Pool 'MA1437', 3,500 %, fällig 01.05.2043	490	0,03
47	Fannie Mae Pool 'MA1547', 4,000 %, fällig 01.08.2043	52	–
89	Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, fällig 01.09.2043	100	0,01
87	Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500 %, fällig 01.10.2043	97	0,01
45	Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500 %, fällig 01.11.2043	50	–
89	Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500 %, fällig 01.12.2043	99	0,01
416	Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, fällig 01.12.2036	441	0,03
1.210	Fannie Mae Pool 'MA3501', 5,000 %, fällig 01.10.2048	1.326	0,08
1.463	Fannie Mae Pool 'MA3527', 5,000 %, fällig 01.11.2048	1.605	0,09
115	Fannie Mae REMICS, Series 2005 29, Klasse ZA, 5,500 %, fällig 25.04.2035	136	0,01
534	Fannie Mae REMICS, Series 2011 59, Klasse NZ, 5,500 %, fällig 25.07.2041	630	0,04
165	Fannie Mae REMICS, Series 2012 133, Klasse CS, 5,975 %, fällig 25.12.2042 *	31	–
26	Fannie Mae REMICS, Series 2012 28, Klasse B, 6,500 %, fällig 25.06.2039	29	–
296	Fannie Mae REMICS, Series 2012 35, Klasse SC, 6,325 %, fällig 25.04.2042 *	64	–
75	Fannie Mae REMICS, Series 2012 46, Klasse BA, 6,000 %, fällig 25.05.2042	88	0,01
109	Fannie Mae REMICS, Series 2012 51, Klasse B, 7,000 %, fällig 25.05.2042	135	0,01
13	Fannie Mae REMICS, Series 2012 70, Klasse YS, 6,475 %, fällig 25.02.2041 *	1	–
98	Fannie Mae REMICS, Series 2012 74, Klasse SA, 6,475 %, fällig 25.03.2042 *	19	–
279	Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Klasse BC, 6,500 %, fällig 25.07.2042	340	0,02
348	Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Klasse CB, 5,500 %, fällig 25.04.2042	403	0,02
1.900	Fannie Mae REMICS, Series 2016 23, Klasse ST, 5,825 %, fällig 25.11.2045 *	410	0,02
716	Fannie Mae REMICS, Series 2016 60, Klasse QS, 5,925 %, fällig 25.09.2046 *	145	0,01
313	Fannie Mae REMICS, Series 2016 61, Klasse BS, 5,925 %, fällig 25.09.2046 *	62	–
1.535	Fannie Mae REMICS, Series 2017 76, Klasse SB, 5,925 %, fällig 25.10.2057 *	348	0,02
411	Fannie Mae REMICS, Series 2017 85, Klasse SC, 6,025 %, fällig 25.11.2047 *	82	0,01
602	Fannie Mae REMICS, Series 2020 47, Klasse GZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	604	0,04
897	Fannie Mae REMICS, Series 2020 56, Klasse DI, 2,500 %, fällig 25.08.2050	123	0,01
423	Fannie Mae-Aces, Series 2013 M6, Klasse 1AC, 3,548 %, fällig 25.02.2043 *	472	0,03
200	Fannie Mae-Aces, Series 2017 M8, Klasse A2, 3,061 %, fällig 25.05.2027 *	224	0,01
800	Fannie Mae-Aces, Series 2018 M15, Klasse 1A2, 3,700 %, fällig 25.01.2036	965	0,06
900	Fannie Mae-Aces, Series 2018 M9, Klasse APT2, 3,228 %, fällig 25.04.2028 *	1.011	0,06
1.443	Fannie Mae-Aces, Series 2019 M19, Klasse A2, 2,560 %, fällig 25.09.2029	1.600	0,09
1.300	Fannie Mae-Aces, Series 2019 M23, Klasse 3A3, 2,720 %, fällig 25.10.2031 *	1.405	0,08
437	Fannie Mae-Aces, Series 2019 M28, Klasse AV, 2,232 %, fällig 25.02.2027	470	0,03
1.899	Fannie Mae-Aces, Series 2020 M36, Klasse X1, 1,564 %, fällig 25.09.2034 *	209	0,01
1.719	Flagstar Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Klasse A4, 144A, 3,500 %, fällig 25.04.2048 *	1.750	0,10
189	Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000 %, fällig 01.02.2038	199	0,01
187	Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, fällig 01.04.2038	197	0,01
6	Freddie Mac Gold Pool 'G01737', 5,000 %, fällig 01.12.2034	6	–
10	Freddie Mac Gold Pool 'G04222', 5,500 %, fällig 01.04.2038	12	–
221	Freddie Mac Gold Pool 'G06409', 6,000 %, fällig 01.11.2039	261	0,02
25	Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, fällig 01.09.2039	29	–
865	Freddie Mac Gold Pool 'G08682', 4,000 %, fällig 01.12.2045	943	0,06
18	Freddie Mac Gold Pool 'G13888', 5,000 %, fällig 01.06.2025	19	–
61	Freddie Mac Gold Pool 'G30257', 5,000 %, fällig 01.07.2025	67	–
2.269	Freddie Mac Gold Pool 'G60985', 3,000 %, fällig 01.05.2047	2.457	0,14

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
1.593	Freddie Mac Gold Pool ‘G61637’, 3,000 %, fällig 01.09.2047	1.719	0,10
1.423	Freddie Mac Gold Pool ‘G61739’, 3,000 %, fällig 01.09.2048	1.540	0,09
1.479	Freddie Mac Gold Pool ‘G67701’, 3,000 %, fällig 01.10.2046	1.599	0,09
564	Freddie Mac Gold Pool ‘G67721’, 4,500 %, fällig 01.04.2049	618	0,04
42	Freddie Mac Gold Pool ‘Q19135’, 4,000 %, fällig 01.06.2043	47	–
40	Freddie Mac Gold Pool ‘Q19254’, 4,000 %, fällig 01.06.2043	46	–
43	Freddie Mac Gold Pool ‘Q19611’, 4,000 %, fällig 01.07.2043	49	–
39	Freddie Mac Gold Pool ‘Q19615’, 4,000 %, fällig 01.07.2043	44	–
19	Freddie Mac Gold Pool ‘Q27298’, 4,000 %, fällig 01.07.2044	21	–
786	Freddie Mac Gold Pool ‘Q40356’, 4,000 %, fällig 01.05.2046	855	0,05
428	Freddie Mac Gold Pool ‘Q43128’, 4,500 %, fällig 01.09.2046	466	0,03
565	Freddie Mac Gold Pool ‘Q45560’, 3,000 %, fällig 01.01.2047	609	0,04
1.369	Freddie Mac Gold Pool ‘Q45737’, 3,000 %, fällig 01.01.2047	1.483	0,09
356	Freddie Mac Gold Pool ‘Q45819’, 3,000 %, fällig 01.01.2047	386	0,02
300	Freddie Mac Gold Pool ‘Q45827’, 3,000 %, fällig 01.01.2047	323	0,02
1.012	Freddie Mac Gold Pool ‘Q48149’, 4,500 %, fällig 01.05.2047	1.101	0,07
185	Freddie Mac Gold Pool ‘U90316’, 4,000 %, fällig 01.10.2042	203	0,01
97	Freddie Mac Gold Pool ‘U91254’, 4,000 %, fällig 01.04.2043	106	0,01
46	Freddie Mac Gold Pool ‘U95137’, 4,000 %, fällig 01.08.2043	50	–
502	Freddie Mac Gold Pool ‘U99045’, 3,500 %, fällig 01.03.2043	544	0,03
1.277	Freddie Mac Gold Pool ‘U99054’, 4,000 %, fällig 01.06.2043	1.401	0,08
49	Freddie Mac Gold Pool ‘U99114’, 3,500 %, fällig 01.02.2044	53	–
168	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K016, Klasse X1, 1,638 %, fällig 25.10.2021 *	2	–
6.772	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K058, Klasse X1, 1,053 %, fällig 25.08.2026 *	330	0,02
5.564	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates KW01, Klasse X1, 1,172 %, fällig 25.01.2026 *	234	0,01
156	Freddie Mac Non Gold Pool ‘840698’, 2,503 %, fällig 01.03.2047 *	161	0,01
197	Freddie Mac Pool ‘QA5768’, 3,000 %, fällig 01.01.2050	212	0,01
99	Freddie Mac Pool ‘QA5770’, 3,000 %, fällig 01.01.2050	105	0,01
380	Freddie Mac Pool ‘QA7238’, 3,500 %, fällig 01.02.2050	411	0,02
100	Freddie Mac Pool ‘QB2667’, 3,000 %, fällig 01.08.2050	106	0,01
100	Freddie Mac Pool ‘QB2927’, 3,000 %, fällig 01.09.2050	106	0,01
917	Freddie Mac Pool ‘RA1103’, 3,000 %, fällig 01.07.2049	971	0,06
1.255	Freddie Mac Pool ‘RA1293’, 3,000 %, fällig 01.09.2049	1.347	0,08
458	Freddie Mac Pool ‘RA1341’, 3,000 %, fällig 01.09.2049	488	0,03
428	Freddie Mac Pool ‘RA2141’, 4,000 %, fällig 01.02.2050	460	0,03
3.008	Freddie Mac Pool ‘RA2313’, 3,500 %, fällig 01.03.2050	3.184	0,19
123	Freddie Mac Pool ‘RA2353’, 4,500 %, fällig 01.03.2050	132	0,01
356	Freddie Mac Pool ‘RA2358’, 4,000 %, fällig 01.03.2050	382	0,02
761	Freddie Mac Pool ‘RA2362’, 3,500 %, fällig 01.03.2050	808	0,05
4.300	Freddie Mac Pool ‘RA3474’, 3,000 %, fällig 01.09.2050	4.597	0,27
2.055	Freddie Mac Pool ‘SD0291’, 5,000 %, fällig 01.03.2050	2.251	0,13
1.888	Freddie Mac Pool ‘ZA5454’, 4,000 %, fällig 01.06.2048	2.023	0,12
3.257	Freddie Mac Pool ‘ZA6342’, 4,500 %, fällig 01.03.2049	3.563	0,21
2.063	Freddie Mac Pool ‘ZA6680’, 4,000 %, fällig 01.04.2049	2.230	0,13
195	Freddie Mac Pool ‘ZI7269’, 5,000 %, fällig 01.03.2038	224	0,01
403	Freddie Mac Pool ‘ZM1278’, 3,500 %, fällig 01.06.2046	439	0,03
296	Freddie Mac Pool ‘ZM3481’, 3,500 %, fällig 01.06.2047	317	0,02
455	Freddie Mac Pool ‘ZM3746’, 5,000 %, fällig 01.07.2047	503	0,03
1.654	Freddie Mac Pool ‘ZM5146’, 4,000 %, fällig 01.12.2047	1.768	0,10
90	Freddie Mac Pool ‘ZM5722’, 3,500 %, fällig 01.02.2048	95	0,01
446	Freddie Mac Pool ‘ZM7733’, 5,000 %, fällig 01.08.2048	490	0,03
94	Freddie Mac Pool ‘ZN0480’, 3,500 %, fällig 01.10.2042	102	0,01
251	Freddie Mac Pool ‘ZN1436’, 5,000 %, fällig 01.11.2048	275	0,02
1.789	Freddie Mac Pool ‘ZN4476’, 3,500 %, fällig 01.12.2048	1.889	0,11
34	Freddie Mac Pool ‘ZS3059’, 5,500 %, fällig 01.12.2038	40	–
217	Freddie Mac Pool ‘ZS3204’, 5,000 %, fällig 01.06.2041	245	0,01
91	Freddie Mac Pool ‘ZS3412’, 5,500 %, fällig 01.12.2038	106	0,01
704	Freddie Mac Pool ‘ZS4699’, 4,000 %, fällig 01.01.2047	761	0,05
54	Freddie Mac Pool ‘ZS4748’, 4,000 %, fällig 01.12.2047	58	–
37	Freddie Mac Pool ‘ZS6518’, 4,000 %, fällig 01.10.2025	39	–
270	Freddie Mac Pool ‘ZS8669’, 3,000 %, fällig 01.09.2032	283	0,02
119	Freddie Mac Pool ‘ZT0474’, 4,500 %, fällig 01.08.2048	129	0,01
99	Freddie Mac Reference REMIC R007, Klasse ZA, 6,000 %, fällig 15.05.2036	118	0,01
63	Freddie Mac REMICS 3621, Klasse SB, 6,068 %, fällig 15.01.2040 *	13	–
816	Freddie Mac REMICS 4813, Klasse CJ, 3,000 %, fällig 15.08.2048	850	0,05
600	Freddie Mac REMICS 5010, Klasse IK, 2,500 %, fällig 25.09.2050 ∞	70	–
1.300	Freddie Mac REMICS 5010, Klasse JI, 2,500 %, fällig 25.09.2050 ∞	165	0,01
500	Freddie Mac REMICS 5013, Klasse IN, 2,500 %, fällig 25.09.2050 ∞	60	–
91	Freddie Mac Strips 334, Klasse S7, 5,938 %, fällig 15.08.2044 *	20	–
659	Freddie Mac Strips 353, Klasse S1, 5,838 %, fällig 15.12.2046 *	145	0,01
1.331	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2015 HQ2, Klasse B, 8,125 %, fällig 25.05.2025 *	1.347	0,08
282	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA2, Klasse M3, 4,825 %, fällig 25.10.2028 *	295	0,02
4.097	FREMF 2012-K20 Mortgage Trust, Series 2012 K20, Klasse X2A, 144A, 0,200 %, fällig 25.05.2045	11	–
61	Ginnie Mae I Pool ‘733600’, 5,000 %, fällig 15.04.2040	69	–
96	Ginnie Mae I Pool ‘733627’, 5,000 %, fällig 15.05.2040	108	0,01
827	Ginnie Mae I Pool ‘784571’, 3,500 %, fällig 15.06.2048	879	0,05
135	Ginnie Mae I Pool ‘AA5649’, 3,000 %, fällig 15.09.2042	144	0,01
389	Ginnie Mae I Pool ‘AB2892’, 3,000 %, fällig 15.09.2042	410	0,02
719	Ginnie Mae I Pool ‘AB9108’, 3,000 %, fällig 15.10.2042	758	0,05
471	Ginnie Mae I Pool ‘AB9109’, 3,000 %, fällig 15.10.2042	496	0,03
3	Ginnie Mae I Pool ‘AB9205’, 3,000 %, fällig 15.11.2042	3	–
409	Ginnie Mae I Pool ‘AB9207’, 3,000 %, fällig 15.11.2042	431	0,03
28	Ginnie Mae II Pool ‘4040’, 6,500 %, fällig 20.10.2037	33	–
43	Ginnie Mae II Pool ‘4617’, 4,500 %, fällig 20.01.2040	48	–
51	Ginnie Mae II Pool ‘4696’, 4,500 %, fällig 20.05.2040	56	–
160	Ginnie Mae II Pool ‘4747’, 5,000 %, fällig 20.07.2040	182	0,01
29	Ginnie Mae II Pool ‘4772’, 5,000 %, fällig 20.08.2040	33	–
20	Ginnie Mae II Pool ‘4802’, 5,000 %, fällig 20.09.2040	23	–
11	Ginnie Mae II Pool ‘4871’, 6,000 %, fällig 20.11.2040	13	–
37	Ginnie Mae II Pool ‘4905’, 6,000 %, fällig 20.12.2040	42	–
7	Ginnie Mae II Pool ‘4928’, 6,000 %, fällig 20.01.2041	8	–
39	Ginnie Mae II Pool ‘4961’, 6,000 %, fällig 20.02.2041	44	–
347	Ginnie Mae II Pool ‘4978’, 4,500 %, fällig 20.03.2041	386	0,02
9	Ginnie Mae II Pool ‘783050’, 5,000 %, fällig 20.07.2040	10	–
104	Ginnie Mae II Pool ‘783368’, 4,500 %, fällig 20.07.2041	115	0,01
2.300	Ginnie Mae II Pool ‘784674’, 3,500 %, fällig 20.04.2048	2.513	0,15
928	Ginnie Mae II Pool ‘784825’, 3,500 %, fällig 20.10.2049	956	0,06
693	Ginnie Mae II Pool ‘784905’, 3,000 %, fällig 20.01.2050	731	0,04
2.277	Ginnie Mae II Pool ‘AP6338’, 4,000 %, fällig 20.10.2045	2.517	0,15
586	Ginnie Mae II Pool ‘BC4732’, 3,500 %, fällig 20.10.2047	629	0,04
393	Ginnie Mae II Pool ‘BD0384’, 3,500 %, fällig 20.10.2047	421	0,03
297	Ginnie Mae II Pool ‘BM7534’, 3,500G %, fällig 20.02.2050	315	0,02
296	Ginnie Mae II Pool ‘BM9734’, 4,000 %, fällig 20.10.2049	320	0,02
197	Ginnie Mae II Pool ‘BM9743’, 4,000 %, fällig 20.11.2049	214	0,01
198	Ginnie Mae II Pool ‘BS1728’, 4,000 %, fällig 20.01.2050	217	0,01
195	Ginnie Mae II Pool ‘BS1742’, 4,000 %, fällig 20.02.2050	212	0,01
377	Ginnie Mae II Pool ‘MA1995’, 3,500 %, fällig 20.06.2044	403	0,02
766	Ginnie Mae II Pool ‘MA2677’, 3,000 %, fällig 20.03.2045	812	0,05
108	Ginnie Mae II Pool ‘MA2678’, 3,500 %, fällig 20.03.2045	115	0,01
231	Ginnie Mae II Pool ‘MA3937’, 3,500 %, fällig 20.09.2046	246	0,01
320	Ginnie Mae II Pool ‘MA4068’, 3,000 %, fällig 20.11.2046	338	0,02
1.459	Ginnie Mae II Pool ‘MA4511’, 4,000 %, fällig 20.06.2047	1.574	0,09
48	Ginnie Mae II Pool ‘MA4836’, 3,000 %, fällig 20.11.2047	51	–
57	Ginnie Mae II Pool ‘MA4837’, 3,500 %, fällig 20.11.2047	61	–
1.936	Ginnie Mae II Pool ‘MA4838’, 4,000 %, fällig 20.11.2047	2.080	0,12
501	Ginnie Mae II Pool ‘MA4899’, 3,000 %, fällig 20.12.2047	529	0,03

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
824	Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, fällig 20.12.2047	886	0,05
1.602	Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500 %, fällig 20.02.2048	1.706	0,10
794	Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, fällig 20.02.2048	860	0,05
614	Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, fällig 20.03.2048	660	0,04
845	Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000 %, fällig 20.04.2048	904	0,05
1.861	Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, fällig 20.05.2048	2.018	0,12
510	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, fällig 20.06.2048	552	0,03
608	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, fällig 20.07.2048	661	0,04
2.078	Ginnie Mae II Pool 'MA5399', 4,500 %, fällig 20.08.2048	2.244	0,13
986	Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500 %, fällig 20.09.2048	1.068	0,06
1.185	Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, fällig 20.10.2048	1.283	0,08
2.241	Ginnie Mae II Pool 'MA5530', 5,000 %, fällig 20.10.2048	2.446	0,14
743	Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000 %, fällig 20.11.2048	808	0,05
531	Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, fällig 20.12.2048	573	0,03
1.742	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, fällig 20.01.2049	1.876	0,11
2.560	Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5,000 %, fällig 20.01.2049	2.774	0,16
456	Ginnie Mae II Pool 'MA5762', 3,500 %, fällig 20.02.2049	483	0,03
128	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, fällig 20.03.2049	138	0,01
838	Ginnie Mae II Pool 'MA5819', 5,000 %, fällig 20.03.2049	908	0,05
398	Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, fällig 20.04.2049	429	0,03
1.509	Ginnie Mae II Pool 'MA6342', 5,000 %, fällig 20.12.2049	1.634	0,10
911	Ginnie Mae II Pool 'MA6413', 5,000 %, fällig 20.01.2050	988	0,06
780	Ginnie Mae II Pool 'MA6603', 5,000 %, fällig 20.04.2050	849	0,05
7.000	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000 % ±	7.253	0,43
7.800	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500 % ±	8.219	0,48
455	Government National Mortgage Association, Series 2009 H01, Klasse FA, 1,308 %, fällig 20.11.2059 *	459	0,03
2	Government National Mortgage Association, Series 2010 31, Klasse GS, 6,342 %, fällig 20.03.2039 *	–	–
9	Government National Mortgage Association, Series 2010 42, Klasse BS, 6,322 %, fällig 20.04.2040 *	2	–
11	Government National Mortgage Association, Series 2010 85, Klasse HS, 6,492 %, fällig 20.01.2040 *	1	–
470	Government National Mortgage Association, Series 2010 H11, Klasse FA, 1,173 %, fällig 20.06.2060 *	477	0,03
527	Government National Mortgage Association, Series 2010 H20, Klasse AF, 0,494 %, fällig 20.10.2060 *	526	0,03
16	Government National Mortgage Association, Series 2010 H22, Klasse FE, 0,514 %, fällig 20.05.2059 *	16	–
832	Government National Mortgage Association, Series 2010 H24, Klasse FA, 0,514 %, fällig 20.10.2060 *	829	0,05
36	Government National Mortgage Association, Series 2010 H26, Klasse LF, 0,514 %, fällig 20.08.2058 *	36	–
313	Government National Mortgage Association, Series 2011 H01, Klasse AF, 0,614 %, fällig 20.11.2060 *	313	0,02
82	Government National Mortgage Association, Series 2011 H09, Klasse AF, 0,664 %, fällig 20.03.2061 *	82	0,01
68	Government National Mortgage Association, Series 2012 66, Klasse CI, 3,500 %, fällig 20.02.2038	2	–
700	Government National Mortgage Association, Series 2013 107, Klasse AD, 2,693 %, fällig 16.11.2047 *	743	0,04
16.880	Government National Mortgage Association, Series 2013 50, Klasse IO, 0,189 %, fällig 16.10.2048 *	210	0,01
1.731	Government National Mortgage Association, Series 2014 169, Klasse IO, 0,769 %, fällig 16.10.2056 *	66	–
308	Government National Mortgage Association, Series 2014 17, Klasse AM, 2,595 %, fällig 16.06.2048 *	322	0,02
476	Government National Mortgage Association, Series 2014 176, Klasse IA, 4,000 %, fällig 20.11.2044	66	–
2.928	Government National Mortgage Association, Series 2014 H20, Klasse FA, 0,594 %, fällig 20.10.2064 *	2.927	0,17
907	Government National Mortgage Association, Series 2015 167, Klasse OI, 4,000 %, fällig 16.04.2045	144	0,01
2.336	Government National Mortgage Association, Series 2015 183, Klasse IO, 0,869 %, fällig 16.09.2057 *	125	0,01
292	Government National Mortgage Association, Series 2016 135, Klasse SB, 5,938 %, fällig 16.10.2046 *	82	0,01
1.419	Government National Mortgage Association, Series 2016 21, Klasse ST, 5,992 %, fällig 20.02.2046 *	318	0,02
711	Government National Mortgage Association, Series 2016 84, Klasse IG, 4,500 %, fällig 16.11.2045	128	0,01
2.317	Government National Mortgage Association, Series 2017 111, Klasse IO, 0,739 %, fällig 16.02.2059 *	135	0,01
3.616	Government National Mortgage Association, Series 2017 157, Klasse IO, 0,570 %, fällig 16.12.2059 *	183	0,01
1.690	Government National Mortgage Association, Series 2017 41, Klasse IO, 0,745 %, fällig 16.07.2058 *	92	0,01
181	Government National Mortgage Association, Series 2017 H15, Klasse KI, 2,302 %, fällig 20.07.2067 *	22	–
7.200	Government National Mortgage Association, Series 2017 H18, Klasse BI, 1,463 %, fällig 20.09.2067 *	614	0,04
92	Government National Mortgage Association, Series 2017 H20, Klasse IB, 2,157 %, fällig 20.10.2067 *	9	–
2.561	Government National Mortgage Association, Series 2018 119, Klasse IO, 0,670 %, fällig 16.05.2060 *	157	0,01
661	Government National Mortgage Association, Series 2018 H06, Klasse PF, 0,464 %, fällig 20.02.2068 *	659	0,04
1.135	Government National Mortgage Association, Series 2018 H07, Klasse FD, 0,464 %, fällig 20.05.2068 *	1.131	0,07
551	Government National Mortgage Association, Series 2019 123, Klasse A, 3,000 %, fällig 20.10.2049	584	0,03
790	Government National Mortgage Association, Series 2019 90, Klasse AB, 3,000 %, fällig 20.07.2049	824	0,05
400	Government National Mortgage Association, Series 2020 122, Klasse IM, 2,500 %, fällig 20.08.2050 ∞	54	–
1.200	Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Klasse NI, 2,500 %, fällig 20.08.2050 ∞	165	0,01
1.180	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Klasse MI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	201	0,01
393	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Klasse NI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	69	–
1.302	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Klasse FL, 1,308 %, fällig 20.05.2070 *	1.364	0,08
289	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Klasse NF, 1,408 %, fällig 20.04.2070 *	298	0,02
200	Government National Mortgage Association, Series 2020 H12, Klasse F, 0,658 %, fällig 20.07.2070 *	200	0,01
300	Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Klasse FA, 0,611 %, fällig 20.07.2070 * ∞	298	0,02
200	Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Klasse FC, 0,605 %, fällig 20.07.2070 * ∞	199	0,01
3.180	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Klasse A, 144A, 1,462 %, fällig 15.09.2031 *	3.058	0,18
2.410	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Klasse B, 144A, 2,662 %, fällig 15.09.2031 *	2.286	0,13
264	GS Mortgage Securities Trust 2006-GG8, Series 2006 GG8, Klasse AJ, 5,622 %, fällig 10.11.2039	183	0,01
80	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16, Series 2013 GC16, Klasse B, 5,161 %, fällig 10.11.2046 *	84	0,01
1.213	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20, Series 2014 GC20, Klasse XA, 1,220 %, fällig 10.04.2047 *	30	–
25	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-7, Series 2007 7, Klasse 2A1A, 1,175 %, fällig 25.10.2037 *	24	–
3.980	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHH, Series 2018 PHH, Klasse F, 144A, 4,510 %, fällig 15.06.2035 *†	2.970	0,18

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
4.070	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Klasse F, 144A, 3,012 %, fällig 15.12.2036 *	3.459	0,20
1.979	JP Morgan Mortgage Trust 2017-5, Series 2017 5, Klasse A2, 144A, 3,130 %, fällig 26.10.2048 *	2.013	0,12
1.005	JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Series 2018 4, Klasse A1, 144A, 3,500 %, fällig 25.10.2048 *	1.033	0,06
30	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, Series 2013 C17, Klasse B, 5,054 %, fällig 15.01.2047 *	32	–
160	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C31, Series 2015 C31, Klasse B, 4,773 %, fällig 15.08.2048 *	172	0,01
1.171	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Series 2019 BOLT, Klasse B, 144A, 2,362 %, fällig 15.07.2034 *	1.061	0,06
472	Magnolia Finance XI DAC, Series 2019 2, Klasse A, 144A, 2,925 %, fällig 31.07.2021 *	475	0,03
89	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2007-3, Series 2007 3, Klasse 12A1, 0,375 %, fällig 25.05.2047 *	102	0,01
124	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Series 2007 5, Klasse AJ, 5,450 %, fällig 12.08.2048 *	73	–
180	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-9, Series 2007 9, Klasse AJ, 4,893 %, fällig 12.09.2049 *	69	–
17	Morgan Stanley Capital I Trust 2006-IQ12, Series 2006 IQ12, Klasse AJ, 5,399 %, fällig 15.12.2043	11	–
7	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-IQ13, Series 2007 IQ13, Klasse AJ, 5,438 %, fällig 15.03.2044	7	–
32	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-IQ16, Series 2007 IQ16, Klasse AJ, 6,461 %, fällig 12.12.2049 *	19	–
2.115	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-2AR, Series 2005 2AR, Klasse B1, 0,675 %, fällig 25.04.2035 *	1.796	0,11
280	MSCG Trust 2015-ALDR, Series 2015 ALDR, Klasse A2, 144A, 3,577 %, fällig 07.06.2035 *	277	0,02
2.870	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Klasse A, 144A, 3,047 %, fällig 15.08.2036	2.853	0,17
732	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Klasse A1B, 144A, 3,250 %, fällig 25.09.2056 *	782	0,05
1.324	New Residential Mortgage Loan Trust 2017-6, Series 2017 6A, Klasse A1, 144A, 4,000 %, fällig 27.08.2057 *	1.441	0,09
1.481	Prime Mortgage Trust 2006-DR1, Series 2006 DR1, Klasse 2A1, 144A, 5,500 %, fällig 25.05.2035	1.234	0,07
203	Residential Asset Securitization Trust 2005-A15, Series 2005 A15, Klasse 1A4, 5,750 %, fällig 25.02.2036	210	0,01
8	Sequoia Mortgage Trust 2004-10, Series 2004 10, Klasse A1A, 0,778 %, fällig 20.11.2034 *	8	–
690	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2, Series 2017 C2, Klasse A4, 3,487 %, fällig 15.08.2050	763	0,05
83.009	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C9, Series 2018 C9, Klasse XA, 1,050 %, fällig 15.03.2051 *	4.700	0,28
100	VNDO 2012-6AVE Mortgage Trust, Series 2012 6AVE, Klasse A, 144A, 2,996 %, fällig 15.11.2030	103	0,01
3.198	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR6 Trust, Series 2005 AR6, Klasse 2A1A, 0,635 %, fällig 25.04.2045 *	3.169	0,19
295	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA2 Trust, Series 2007 OA2, Klasse 2A, 1,932 %, fällig 25.03.2047 *	275	0,02
253	Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Series 2015 SBC5, Klasse A, 144A, 4,104 %, fällig 14.09.2022 *	249	0,02
20	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2013-LC12, Series 2013 LC12, Klasse B, 4,411 %, fällig 15.07.2046 *	19	–
250	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC20, Series 2015 LC20, Klasse AS, 3,467 %, fällig 15.04.2050	268	0,02
160	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1, Series 2015 NXS1, Klasse AS, 3,406 %, fällig 15.05.2048	171	0,01
5.894	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RB1, Series 2017 RB1, Klasse XA, 1,402 %, fällig 15.03.2050 *	391	0,02
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 423,922 USD)		426.111	25,05
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 35,04 % (29. Februar 2020: 27,68 %)			
Australien — 0,43 % (29. Februar 2020: 0,19 %)			
35	BHP Billiton Finance USA Ltd, 2,875 %, fällig 24.02.2022	36	–
300	BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, fällig 30.09.2043	427	0,03
1.540	BHP Billiton Finance USA Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 19.10.2075 *	1.843	0,11
200	Commonwealth Bank of Australie, 144A, 3,900 %, fällig 12.07.2047	248	0,01
10	Glencore Funding LLC, 144A, 4,125 %, fällig 30.05.2023	11	–
2.190	Glencore Funding LLC, 144A, 4,125 %, fällig 12.03.2024	2.384	0,14
1.280	Glencore Funding LLC, 144A, 4,625 %, fällig 29.04.2024	1.432	0,08
470	Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, fällig 27.03.2027	517	0,03
30	Glencore Funding LLC, 144A, 3,875 %, fällig 27.10.2027	33	–
450	Westpac Banking Corp, 2,600 %, fällig 23.11.2020	452	0,03
		7.383	0,43
Belgien — 0,54 % (29. Februar 2020: 0,39 %)			
1.990	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650 %, fällig 01.02.2026	2.255	0,13
250	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, fällig 01.02.2046	310	0,02
170	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,150 %, fällig 23.01.2025	193	0,01
780	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000 %, fällig 13.04.2028	905	0,05
110	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,750 %, fällig 23.01.2029	134	0,01
350	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 01.06.2030	401	0,03
840	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	980	0,06
100	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048	119	0,01
1.400	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, fällig 23.01.2049	1.887	0,11
1.570	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01.06.2050	1.904	0,11
		9.088	0,54
Brasilien — 0,53 % (29. Februar 2020: 0,53 %)			
150	Petrobras Global Finance BV, 6,125 %, fällig 17.01.2022	159	0,01
57	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17.03.2024	63	–
6.520	Petrobras Global Finance BV, 5,299 %, fällig 27.01.2025	7.131	0,42
390	Petrobras Global Finance BV, 7,375 %, fällig 17.01.2027	463	0,03
840	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05.06.2115	925	0,05
210	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 21.11.2036	280	0,02
		9.021	0,53
Kanada — 0,39 % (29. Februar 2020: 0,14 %)			
240	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2024	245	0,01
1.190	Bank of Montreal, 1,850 %, fällig 01.05.2025	1.251	0,07
160	Bank of Montreal, 3,803 %, fällig 15.12.2032 *	177	0,01
290	Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30.05.2041	411	0,02
500	Barrick North America Finance LLC, 5,750 %, fällig 01.05.2043	733	0,04
690	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,950 %, fällig 23.06.2023	699	0,04
340	GFL Environmental Inc, 144A, 4,250 %, fällig 01.06.2025	347	0,02
1.060	Royal Bank of Canada, 1,600 %, fällig 17.04.2023	1.095	0,07
660	Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig 10.06.2025	672	0,04
20	Teck Resources Ltd, 6,000 %, fällig 15.08.2040	22	–
590	Toronto-Dominion Bank/The, 3,250 %, fällig 11.06.2021	604	0,04
390	Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig 15.12.2027	424	0,03
		6.680	0,39
Kaimaninseln — 0,00 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
17	Ambac LSNI LLC, 144A, 6,000 %, fällig 12.02.2023 *	17	–
China — 0,17 % (29. Februar 2020: 0,18 %)			
1.120	CNOOC Finance 2015 USA LLC, 3,500 %, fällig 05.05.2025	1.239	0,07
620	Prosus NV, 144A, 4,850 %, fällig 06.07.2027	718	0,04
820	Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 144A, 4,375 %, fällig 10.04.2024	911	0,06
		2.868	0,17
Kolumbien — 0,06 % (29. Februar 2020: 0,07 %)			
960	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	1.091	0,06
Dänemark — 0,26 % (29. Februar 2020: 0,24 %)			
1.380	Danske Bank A/S, 144A, 5,000 %, fällig 12.01.2022	1.456	0,08
510	Danske Bank A/S, 144A, 3,001 %, fällig 20.09.2022 *	521	0,03
300	Danske Bank A/S, 144A, 3,875 %, fällig 12.09.2023	324	0,02
1.020	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig 12.01.2024	1.156	0,07
600	Danske Bank A/S, 144A, 1,226 %, fällig 22.06.2024	607	0,04
280	Danske Bank A/S, 144A, 3,244 %, fällig 20.12.2025 *	301	0,02
		4.365	0,26
Finnland — 0,03 % (29. Februar 2020: 0,04 %)			
550	Nordea Bank Abp, 144A, 4,875 %, fällig 13.05.2021	566	0,03
Frankreich — 0,80 % (29. Februar 2020: 0,74 %)			
720	Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, fällig 01.05.2026	765	0,04
280	BNP Paribas SA, 144A, 3,375 %, fällig 09.01.2025	307	0,02

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Frankreich — (Fortsetzung)			
1.880	BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, fällig 10.01.2025 *	2.103	0,12
1.660	BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *	1.734	0,10
620	BNP Paribas SA, 144A, 4,625 %, fällig 13.03.2027	710	0,04
1.580	BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14.08.2028	1.871	0,11
1.040	BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, fällig 10.01.2030 *	1.293	0,08
550	BNP Paribas SA, 144A, 4,375 %, fällig 01.03.2033 *	622	0,04
500	BPCE SA, 144A, 5,150 %, fällig 21.07.2024	563	0,03
590	Credit Agricole SA, 144A, 4,000 %, fällig 10.01.2033 *	656	0,04
340	Danone SA, 144A, 2,077 %, fällig 02.11.2021	346	0,02
1.110	Danone SA, 144A, 2,589 %, fällig 02.11.2023	1.173	0,07
240	Danone SA, 144A, 2,947 %, fällig 02.11.2026	267	0,02
210	Pernod Ricard SA, 144A, 4,450 %, fällig 15.01.2022	221	0,01
940	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 3,750 %, fällig 17.09.2024	984	0,06
		13.615	0,80
Irland — 0,08 % (29. Februar 2020: 0,09 %)			
330	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,500 %, fällig 15.05.2021	336	0,02
160	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,625 %, fällig 01.07.2022	164	0,01
640	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2022	636	0,04
50	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2023	48	–
120	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 15.02.2024	118	0,01
		1.302	0,08
Israel — 0,28 % (29. Februar 2020: 0,27 %)			
480	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, Series 2, 3,650 %, fällig 10.11.2021	483	0,03
150	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, fällig 18.12.2022	146	0,01
180	Teva Pharmaceutical Finance IV BV, 3,650 %, fällig 10.11.2021	181	0,01
670	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,200 %, fällig 21.07.2021	670	0,04
1.200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21.07.2023	1.154	0,07
210	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,000 %, fällig 15.04.2024	221	0,01
790	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 144A, 7,125 %, fällig 31.01.2025	856	0,05
1.200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	1.102	0,06
		4.813	0,28
Italien — 0,36 % (29. Februar 2020: 0,40 %)			
1.030	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,125 %, fällig 14.07.2022	1.059	0,06
830	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,375 %, fällig 12.01.2023	864	0,05
1.160	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, fällig 26.06.2024	1.252	0,07
850	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig 15.01.2026	945	0,06
1.660	UniCredit SpA, 144A, 6,572 %, fällig 14.01.2022	1.765	0,11
200	UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, fällig 02.04.2034 *	234	0,01
		6.119	0,36
Japan — 0,04 % (29. Februar 2020: 0,04 %)			
250	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 2,998 %, fällig 22.02.2022	260	0,02
370	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 2,058 %, fällig 14.07.2021	375	0,02
		635	0,04
Kasachstan — 0,04 % (29. Februar 2020: 0,04 %)			
520	KazMunayGas National Co JSC, 144A, 6,375 %, fällig 24.10.2048	704	0,04
Kuwait — 0,03 % (29. Februar 2020: 0,04 %)			
520	Equate Petrochemical BV, 144A, 4,250 %, fällig 03.11.2026	558	0,03
Luxemburg — 0,13 % (29. Februar 2020: 0,27 %)			
70	ArcelorMittal SA, 3,600 %, fällig 16.07.2024	73	–
1.310	ArcelorMittal SA, 6,125 %, fällig 01.06.2025	1.514	0,09
410	ArcelorMittal SA, 4,550 %, fällig 11.03.2026	450	0,03
150	ArcelorMittal SA, 7,250 %, fällig 15.10.2039	193	0,01
		2.230	0,13
Macau — 0,15 % (29. Februar 2020: 0,13 %)			
730	Sands China Ltd, 4,600 %, fällig 08.08.2023	783	0,05
540	Sands China Ltd, 5,125 %, fällig 08.08.2025	599	0,03
580	Sands China Ltd, 5,400 %, fällig 08.08.2028	659	0,04
490	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26.08.2028	494	0,03
		2.535	0,15
Mexiko — 0,12 % (29. Februar 2020: 0,15 %)			
700	America Movil SAB de CV, 3,125 %, fällig 16.07.2022	730	0,04
20	America Movil SAB de CV, 6,375 %, fällig 01.03.2035	29	–
20	America Movil SAB de CV, 6,125 %, fällig 15.11.2037	29	–
590	Petroleos Mexicanos, 4,250 %, fällig 15.01.2025	570	0,04
260	Petroleos Mexicanos, 6,875 %, fällig 04.08.2026	266	0,02
25	Petroleos Mexicanos, 6,625 %, fällig 15.06.2035	22	–
510	Petroleos Mexicanos, 5,500 %, fällig 27.06.2044	399	0,02
		2.045	0,12
Marokko — 0,08 % (29. Februar 2020: 0,09 %)			
1.230	OCP SA, 144A, 4,500 %, fällig 22.10.2025	1.304	0,08
Niederlande — 0,64 % (29. Februar 2020: 0,52 %)			
200	ABN AMRO Bank NV, 144A, 4,750 %, fällig 28.07.2025	227	0,01
1.250	Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, fällig 01.12.2023	1.394	0,08
1.840	Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, fällig 04.08.2025	2.100	0,12
250	Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 1,339 %, fällig 24.06.2026 *	254	0,02
300	Cooperatieve Rabobank UA, 5,250 %, fällig 04.08.2045	423	0,03
940	Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,125 %, fällig 26.04.2021	958	0,06
370	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144A, 2,700 %, fällig 01.05.2025	395	0,02
1.490	Shell International Finance BV, 2,875 %, fällig 10.05.2026	1.661	0,10
600	Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030	661	0,04
160	Shell International Finance BV, 4,550 %, fällig 12.08.2043	201	0,01
770	Shell International Finance BV, 4,375 %, fällig 11.05.2045	959	0,06
270	Shell International Finance BV, 4,000 %, fällig 10.05.2046	323	0,02
1.160	Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	1.255	0,07
		10.811	0,64
Peru — 0,17 % (29. Februar 2020: 0,16 %)			
2.290	Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	2.934	0,17
Südafrika — 0,16 % (29. Februar 2020: 0,17 %)			
280	Anglo American Capital Plc, 144A, 3,750 %, fällig 10.04.2022	290	0,02
670	Anglo American Capital Plc, 144A, 3,625 %, fällig 11.09.2024	722	0,04
1.130	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10.04.2027	1.300	0,08
290	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,000 %, fällig 11.09.2027	320	0,02
		2.632	0,16
Spanien — 0,25 % (29. Februar 2020: 0,19 %)			
200	Banco Santander SA, 1,386 %, fällig 12.04.2023 *	201	0,01
400	Banco Santander SA, 3,848 %, fällig 12.04.2023	431	0,03
1.200	Banco Santander SA, 2,746 %, fällig 28.05.2025	1.277	0,08
1.000	Banco Santander SA, 4,379 %, fällig 12.04.2028	1.147	0,07
500	Telefonica Emisiones SA, 4,103 %, fällig 08.03.2027	573	0,03
210	Telefonica Emisiones SA, 5,213 %, fällig 08.03.2047	255	0,01
260	Telefonica Emisiones SA, 4,895 %, fällig 06.03.2048	309	0,02
		4.193	0,25
Schweiz — 0,71 % (29. Februar 2020: 0,83 %)			
710	Credit Suisse AG/New York NY, 2,950 %, fällig 09.04.2025	781	0,05
700	Credit Suisse Group AG, 144A, 2,593 %, fällig 11.09.2025 *	733	0,04
610	Credit Suisse Group AG, 144A, 2,193 %, fällig 05.06.2026 *	631	0,04
670	Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	783	0,05
490	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd, 4,875 %, fällig 15.05.2045	669	0,04
210	Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2041	250	0,01
700	Syngenta Finance NV, 144A, 3,933 %, fällig 23.04.2021	709	0,04
1.180	UBS AG/London, 144A, 1,750 %, fällig 21.04.2022	1.204	0,07
200	UBS AG/London, 144A, 4,500 %, fällig 26.06.2048	286	0,02
790	UBS Group AG, 144A, 3,491 %, fällig 23.05.2023	829	0,05
330	UBS Group AG, 144A, 4,125 %, fällig 24.09.2025	379	0,02
1.240	UBS Group AG, 144A, 4,253 %, fällig 23.03.2028	1.442	0,08
1.000	UBS Group AG, 144A, 3,126 %, fällig 13.08.2030 *	1.112	0,07
2.090	UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	2.267	0,13
		12.075	0,71
Vereinigte Arabische Emirate — 0,07 % (29. Februar 2020: 0,08 %)			
90	DAE Funding LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.11.2023	90	0,01
200	DP World Plc, 144A, 5,625 %, fällig 25.09.2048	237	0,01
760	DP World Plc, 5,625 %, fällig 25.09.2048	901	0,05
		1.228	0,07
Großbritannien — 1,44 % (29. Februar 2020: 1,55 %)			
410	Barclays Plc, 4,972 %, fällig 16.05.2029 *	488	0,03
3.540	Barclays Plc, 5,088 %, fällig 20.06.2030 *	4.118	0,24
160	BAT Capital Corp, 3,557 %, fällig 15.08.2027	175	0,01
2.380	BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig 15.08.2047	2.593	0,15
70	BP Capital Markets Plc, 3,561 %, fällig 01.11.2021	73	–
190	BP Capital Markets Plc, 3,535 %, fällig 04.11.2024	211	0,01
350	BP Capital Markets Plc, 3,506 %, fällig 17.03.2025	392	0,02

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Großbritannien — (Fortsetzung)			
430	HSBC Holdings Plc, 4,250 %, fällig 18.08.2025	477	0,03
330	HSBC Holdings Plc, 4,300 %, fällig 08.03.2026	379	0,02
400	HSBC Holdings Plc, 4,041 %, fällig 13.03.2028 *	450	0,03
2.120	HSBC Holdings Plc, 4,583 %, fällig 19.06.2029 *	2.479	0,15
200	HSBC Holdings Plc, 4,950 %, fällig 31.03.2030	247	0,01
1.200	HSBC Holdings Plc, 3,973 %, fällig 22.05.2030 *	1.363	0,08
340	HSBC Holdings Plc, 6,500 %, fällig 02.05.2036	470	0,03
600	HSBC Holdings Plc, 6,250 %, Perpetual *	614	0,04
800	HSBC Holdings Plc, 6,500 %, Perpetual *	863	0,05
1.500	Lloyds Banking Group Plc, 4,650 %, fällig 24.03.2026	1.706	0,10
780	Lloyds Banking Group Plc, 4,375 %, fällig 22.03.2028	924	0,05
100	Natwest Group Plc, 6,125 %, fällig 15.12.2022	110	0,01
230	Natwest Group Plc, 6,100 %, fällig 10.06.2023	256	0,02
460	Natwest Group Plc, 6,000 %, fällig 19.12.2023	519	0,03
1.300	Natwest Group Plc, 5,125 %, fällig 28.05.2024	1.441	0,09
200	Natwest Group Plc, 4,519 %, fällig 25.06.2024 *	218	0,01
630	Natwest Group Plc, 4,269 %, fällig 22.03.2025 *	693	0,04
230	Natwest Group Plc, 4,892 %, fällig 18.05.2029 *	274	0,02
1.000	Natwest Group Plc, 5,076 %, fällig 27.01.2030 *	1.220	0,07
290	Reynolds American Inc, 5,850 %, fällig 15.08.2045	361	0,02
500	Santander UK Group Holdings Plc, 144A, 5,625 %, fällig 15.09.2045	626	0,04
420	Standard Chartered Plc, 144A, 5,700 %, fällig 26.03.2044	548	0,03
110	Vodafone Group Plc, 5,250 %, fällig 30.05.2048	144	0,01
		24.432	1,44
USA — 27,08 % (29. Februar 2020: 20,11 %)			
470	3M Co, 2,375 %, fällig 26.08.2029	508	0,03
130	3M Co, 3,050 %, fällig 15.04.2030	148	0,01
920	3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050	1.121	0,07
872	Abbott Laboratories, 3,750 %, fällig 30.11.2026	1.021	0,06
230	Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30.11.2036	312	0,02
420	Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig 30.11.2046	603	0,04
190	AbbVie Inc, 144A, 3,450 %, fällig 15.03.2022	198	0,01
120	AbbVie Inc, 2,900 %, fällig 06.11.2022	126	0,01
2.460	AbbVie Inc, 144A, 2,300 %, fällig 21.11.2022	2.558	0,15
140	AbbVie Inc, 3,750 %, fällig 14.11.2023	154	0,01
2.150	AbbVie Inc, 144A, 2,600 %, fällig 21.11.2024	2.303	0,14
590	AbbVie Inc, 144A, 3,800 %, fällig 15.03.2025	660	0,04
250	AbbVie Inc, 3,600 %, fällig 14.05.2025	279	0,02
520	AbbVie Inc, 144A, 2,950 %, fällig 21.11.2026	573	0,03
1.810	AbbVie Inc, 144A, 3,200 %, fällig 21.11.2029	2.013	0,12
7	AbbVie Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.03.2045	9	–
110	AbbVie Inc, 144A, 4,250 %, fällig 21.11.2049	133	0,01
90	Aetna Inc, 2,800 %, fällig 15.06.2023	95	0,01
450	Air Lease Corp, 3,375 %, fällig 01.07.2025	459	0,03
160	Alphabet Inc, 0,450 %, fällig 15.08.2025	160	0,01
310	Alphabet Inc, 0,800 %, fällig 15.08.2027	310	0,02
370	Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15.08.2030	369	0,02
600	Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15.08.2050	574	0,03
290	Altria Group Inc, 4,750 %, fällig 05.05.2021	299	0,02
250	Altria Group Inc, 3,490 %, fällig 14.02.2022	261	0,02
420	Altria Group Inc, 2,850 %, fällig 09.08.2022	439	0,03
270	Altria Group Inc, 3,800 %, fällig 14.02.2024	296	0,02
170	Altria Group Inc, 2,350 %, fällig 06.05.2025	181	0,01
1.630	Altria Group Inc, 4,400 %, fällig 14.02.2026	1.891	0,11
1.440	Altria Group Inc, 4,800 %, fällig 14.02.2029	1.723	0,10
580	Altria Group Inc, 5,800 %, fällig 14.02.2039	740	0,04
330	Altria Group Inc, 3,875 %, fällig 16.09.2046	345	0,02
2.200	Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14.02.2049	2.995	0,18
190	Altria Group Inc, 6,200 %, fällig 14.02.2059	261	0,02
790	Amazon.com Inc, 0,800 %, fällig 03.06.2025	801	0,05
970	Amazon.com Inc, 1,200 %, fällig 03.06.2027	991	0,06
660	Amazon.com Inc, 3,150 %, fällig 22.08.2027	756	0,04
920	Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	941	0,06
860	Amazon.com Inc, 3,875 %, fällig 22.08.2037	1.077	0,06
340	Amazon.com Inc, 4,950 %, fällig 05.12.2044	489	0,03
320	Amazon.com Inc, 4,050 %, fällig 22.08.2047	417	0,02
790	Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	806	0,05
140	Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057	191	0,01
5	Ambac Assurance Corp, 144A, 5,100 %, Perpetual	6	–
370	American International Group Inc, 2,500 %, fällig 30.06.2025	396	0,02
70	American International Group Inc, 3,750 %, fällig 10.07.2025	79	–
234	American International Group Inc, 6,250 %, fällig 15.03.2037 *	260	0,02
330	Amgen Inc, 3,625 %, fällig 22.05.2024	364	0,02
34	Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15.06.2051	45	–
180	Anthem Inc, 3,125 %, fällig 15.05.2022	188	0,01
530	Anthem Inc, 2,950 %, fällig 01.12.2022	559	0,03
200	Anthem Inc, 3,350 %, fällig 01.12.2024	221	0,01
730	Anthem Inc, 3,650 %, fällig 01.12.2027	839	0,05
75	Apache Corp, 3,250 %, fällig 15.04.2022	75	–
370	Apache Corp, 4,375 %, fällig 15.10.2028	368	0,02
270	Apache Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2030	263	0,02
17	Apache Corp, 6,000 %, fällig 15.01.2037	18	–
1.280	Apache Corp, 5,100 %, fällig 01.09.2040	1.244	0,07
560	Apache Corp, 4,750 %, fällig 15.04.2043	528	0,03
180	Apache Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2044	161	0,01
430	Apple Inc, 2,000 %, fällig 13.11.2020	432	0,03
20	Apple Inc, 1,550 %, fällig 04.08.2021	20	–
1.500	Apple Inc, 1,125 %, fällig 11.05.2025	1.541	0,09
720	Apple Inc, 2,450 %, fällig 04.08.2026	788	0,05
400	AT&T Inc, 3,800 %, fällig 15.02.2027	457	0,03
1.300	AT&T Inc, 2,300 %, fällig 01.06.2027	1.382	0,08
820	AT&T Inc, 1,650 %, fällig 01.02.2028	833	0,05
240	AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	244	0,01
30	AT&T Inc, 6,100 %, fällig 15.07.2040	41	–
30	AT&T Inc, 6,250 %, fällig 29.03.2041	42	–
640	AT&T Inc, 3,100 %, fällig 01.02.2043	640	0,04
620	AT&T Inc, 4,350 %, fällig 15.06.2045	712	0,04
1.423	AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	1.679	0,10
280	Bank of America Corp, 3,300 %, fällig 11.01.2023	299	0,02
264	Bank of America Corp, 3,004 %, fällig 20.12.2023 *	278	0,02
680	Bank of America Corp, 3,550 %, fällig 05.03.2024 *	728	0,04
330	Bank of America Corp, 4,000 %, fällig 01.04.2024	369	0,02
520	Bank of America Corp, 4,200 %, fällig 26.08.2024	583	0,03
470	Bank of America Corp, 4,000 %, fällig 22.01.2025	527	0,03
130	Bank of America Corp, 4,450 %, fällig 03.03.2026	151	0,01
830	Bank of America Corp, 3,500 %, fällig 19.04.2026	942	0,06
1.980	Bank of America Corp, 1,319 %, fällig 19.06.2026 *	2.007	0,12
1.550	Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22.10.2026	1.797	0,11
940	Bank of America Corp, 3,593 %, fällig 21.07.2028 *	1.061	0,06
1.770	Bank of America Corp, 3,419 %, fällig 20.12.2028 *	1.981	0,12
4.250	Bank of America Corp, 3,970 %, fällig 05.03.2029 *	4.903	0,29
1.800	Bank of America Corp, 3,974 %, fällig 07.02.2030 *	2.105	0,12
1.500	Bank of America Corp, 2,884 %, fällig 22.10.2030 *	1.634	0,10
560	Bank of America Corp, 4,330 %, fällig 15.03.2050 *	726	0,04
2.510	Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	3.155	0,19
50	Bank of America Corp, Series AA, 6,100 %, Perpetual *	56	–
380	Bank of New York Mellon Corp/ The, 1,600 %, fällig 24.04.2025	397	0,02
30	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.11.2025	31	–
570	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029	596	0,04
360	Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,250 %, fällig 30.05.2029	396	0,02
250	BBVA USA, 3,875 %, fällig 10.04.2025	269	0,02
960	Becton Dickinson and Co, 3,363 %, fällig 06.06.2024	1.046	0,06
93	Becton Dickinson and Co, 3,734 %, fällig 15.12.2024	103	0,01
555	Becton Dickinson and Co, 4,685 %, fällig 15.12.2044	704	0,04
600	Becton Dickinson and Co, 4,669 %, fällig 06.06.2047	758	0,04
1.330	Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	1.732	0,10
180	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15.11.2022	180	0,01
2.010	Boeing Co/The, 4,875 %, fällig 01.05.2025	2.189	0,13
150	Boeing Co/The, 3,100 %, fällig 01.05.2026	150	0,01
320	Boeing Co/The, 2,700 %, fällig 01.02.2027	311	0,02
200	Boeing Co/The, 2,800 %, fällig 01.03.2027	195	0,01

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
690	Boeing Co/The, 3,200 %, fällig 01.03.2029	685	0,04
2.170	Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030	2.436	0,14
2.220	Boeing Co/The, 3,250 %, fällig 01.02.2035	2.087	0,12
180	Boeing Co/The, 3,550 %, fällig 01.03.2038	163	0,01
810	Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01.05.2040	944	0,06
1.290	Boeing Co/The, 3,750 %, fällig 01.02.2050	1.162	0,07
1.870	Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01.05.2050	2.249	0,13
600	Boeing Co/The, 5,930 %, fällig 01.05.2060	737	0,04
60	BP Capital Markets America Inc, 2,937 %, fällig 06.04.2023	64	–
690	BP Capital Markets America Inc, 3,216 %, fällig 28.11.2023	745	0,04
140	BP Capital Markets America Inc, 3,790 %, fällig 06.02.2024	154	0,01
330	BP Capital Markets America Inc, 3,410 %, fällig 11.02.2026	370	0,02
1.150	BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, fällig 04.05.2026	1.277	0,08
440	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	507	0,03
1.800	BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig 24.02.2050	1.778	0,10
130	Brighthouse Financial Inc, 4,700 %, fällig 22.06.2047	126	0,01
340	Bristol-Myers Squibb Co, 2,250 %, fällig 15.08.2021	347	0,02
550	Bristol-Myers Squibb Co, 2,600 %, fällig 16.05.2022	572	0,03
120	Bristol-Myers Squibb Co, 3,550 %, fällig 15.08.2022	128	0,01
1.380	Bristol-Myers Squibb Co, 2,900 %, fällig 26.07.2024	1.506	0,09
410	Bristol-Myers Squibb Co, 3,875 %, fällig 15.08.2025	472	0,03
810	Bristol-Myers Squibb Co, 3,200 %, fällig 15.06.2026	922	0,05
2.280	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	2.666	0,16
100	Bristol-Myers Squibb Co, 5,250 %, fällig 15.08.2043	144	0,01
700	Bristol-Myers Squibb Co, 5,000 %, fällig 15.08.2045	1.000	0,06
800	Broadcom Inc, 2,250 %, fällig 15.11.2023	832	0,05
1.270	Broadcom Inc, 4,700 %, fällig 15.04.2025	1.453	0,09
1.140	Broadcom Inc, 3,150 %, fällig 15.11.2025	1.237	0,07
220	Cameron LNG LLC, 144A, 2,902 %, fällig 15.07.2031	241	0,01
1.220	Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig 15.01.2035	1.379	0,08
450	Cargill Inc, 144A, 1,375 %, fällig 23.07.2023	461	0,03
190	Carrier Global Corp, 144A, 1,923 %, fällig 15.02.2023	196	0,01
700	Carrier Global Corp, 144A, 2,242 %, fällig 15.02.2025	735	0,04
90	Carrier Global Corp, 144A, 2,493 %, fällig 15.02.2027	95	0,01
910	Carrier Global Corp, 144A, 2,722 %, fällig 15.02.2030	957	0,06
300	Carrier Global Corp, 144A, 2,700 %, fällig 15.02.2031	315	0,02
310	Carrier Global Corp, 144A, 3,377 %, fällig 05.04.2040	323	0,02
330	Carrier Global Corp, 144A, 3,577 %, fällig 05.04.2050	351	0,02
70	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 15.08.2030	74	–
1.350	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.05.2032	1.433	0,08
300	Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	330	0,02
290	Centene Corp, 3,375 %, fällig 15.02.2030	302	0,02
2.210	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	2.573	0,15
1.820	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	2.087	0,12
1.200	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	1.450	0,09
740	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	904	0,05
260	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, fällig 23.10.2045	356	0,02
1.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	1.257	0,07
210	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	241	0,01
700	Chevron Corp, 1,554 %, fällig 11.05.2025	729	0,04
340	Chevron Corp, 2,954 %, fällig 16.05.2026	379	0,02
240	Chevron Corp, 1,995 %, fällig 11.05.2027	255	0,02
80	Chevron Corp, 3,078 %, fällig 11.05.2050	87	0,01
110	Chubb INA Holdings Inc, 2,300 %, fällig 03.11.2020	110	0,01
140	Chubb INA Holdings Inc, 3,350 %, fällig 03.05.2026	160	0,01
380	Cigna Corp, 3,400 %, fällig 17.09.2021	392	0,02
962	Cigna Corp, 3,750 %, fällig 15.07.2023	1.048	0,06
290	Cigna Corp, 4,125 %, fällig 15.11.2025	336	0,02
2.980	Cigna Corp, 4,375 %, fällig 15.10.2028	3.572	0,21
210	Cimarex Energy Co, 4,375 %, fällig 01.06.2024	226	0,01
1.790	Cimarex Energy Co, 3,900 %, fällig 15.05.2027	1.846	0,11
560	Cimarex Energy Co, 4,375 %, fällig 15.03.2029	598	0,04
270	Cintas Corp No 2, 2,900 %, fällig 01.04.2022	280	0,02
270	Cintas Corp No 2, 3,700 %, fällig 01.04.2027	309	0,02
10	Citigroup Inc, 4,500 %, fällig 14.01.2022	11	–
50	Citigroup Inc, 4,050 %, fällig 30.07.2022	53	–
250	Citigroup Inc, 3,500 %, fällig 15.05.2023	268	0,02
680	Citigroup Inc, 1,678 %, fällig 15.05.2024 *	698	0,04
330	Citigroup Inc, 3,300 %, fällig 27.04.2025	367	0,02
440	Citigroup Inc, 4,400 %, fällig 10.06.2025	502	0,03
220	Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13.09.2025	263	0,02
490	Citigroup Inc, 3,106 %, fällig 08.04.2026 *	533	0,03
110	Citigroup Inc, 4,300 %, fällig 20.11.2026	127	0,01
2.130	Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	2.478	0,15
60	Citigroup Inc, 4,125 %, fällig 25.07.2028	69	–
1.360	Citigroup Inc, 3,520 %, fällig 27.10.2028 *	1.522	0,09
1.750	Citigroup Inc, 4,075 %, fällig 23.04.2029 *	2.039	0,12
2.300	Citigroup Inc, 3,980 %, fällig 20.03.2030 *	2.672	0,16
1.590	Citigroup Inc, 4,412 %, fällig 31.03.2031 *	1.937	0,11
1.570	Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	1.664	0,10
1.456	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	2.572	0,15
255	Citigroup Inc, 5,300 %, fällig 06.05.2044	344	0,02
100	Citigroup Inc, 5,950 %, Perpetual *	105	0,01
700	Citigroup Inc, Series P, 5,950 %, Perpetual *	756	0,04
90	Citigroup Inc, Series M, 6,300 %, Perpetual *	96	0,01
160	Coca-Cola Co/The, 2,950 %, fällig 25.03.2025	177	0,01
720	Coca-Cola Co/The, 3,375 %, fällig 25.03.2027	832	0,05
670	Coca-Cola Co/The, 1,450 %, fällig 01.06.2027	694	0,04
110	Coca-Cola Co/The, 4,125 %, fällig 25.03.2040	142	0,01
20	Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	21	–
1.380	Coca-Cola Co/The, 4,200 %, fällig 25.03.2050	1.830	0,11
280	Coca-Cola Co/The, 2,600 %, fällig 01.06.2050	286	0,02
40	Comcast Corp, 3,100 %, fällig 01.04.2025	44	–
130	Comcast Corp, 3,950 %, fällig 15.10.2025	150	0,01
640	Comcast Corp, 3,150 %, fällig 01.03.2026	719	0,04
280	Comcast Corp, 3,300 %, fällig 01.04.2027	319	0,02
2.140	Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	2.597	0,15
390	Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	451	0,03
1.420	Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	1.758	0,10
60	Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2033	75	–
60	Comcast Corp, 5,650 %, fällig 15.06.2035	86	0,01
60	Comcast Corp, 6,500 %, fällig 15.11.2035	92	0,01
1.540	Comcast Corp, 3,900 %, fällig 01.03.2038	1.848	0,11
80	Comcast Corp, 3,250 %, fällig 01.11.2039	89	0,01
80	Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	95	0,01
80	Comcast Corp, 3,400 %, fällig 15.07.2046	89	0,01
14	Comcast Corp, 3,969 %, fällig 01.11.2047	17	–
110	Comcast Corp, 4,000 %, fällig 01.03.2048	134	0,01
580	Comcast Corp, 4,700 %, fällig 15.10.2048	781	0,05
203	Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01.11.2049	247	0,01
510	Comcast Corp, 3,450 %, fällig 01.02.2050	576	0,03
126	Comcast Corp, 4,049 %, fällig 01.11.2052	154	0,01
20	CommonSpirit Health, 4,350 %, fällig 01.11.2042	22	–
640	Concho Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.01.2025	661	0,04
350	Concho Resources Inc, 3,750 %, fällig 01.10.2027	385	0,02
720	Concho Resources Inc, 4,300 %, fällig 15.08.2028	814	0,05
85	ConocoPhillips Co, 6,950 %, fällig 15.04.2029	119	0,01
240	Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	278	0,02
190	Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20B, 3,950 %, fällig 01.04.2050	229	0,01
640	Constellation Brands Inc, 4,750 %, fällig 15.11.2024	742	0,04
188	Continental Airlines 2007-1 Klasse A Pass Through Trust, Series 071A, 5,983 %, fällig 19.04.2022	179	0,01
310	Continental Resources Inc/OK, 4,500 %, fällig 15.04.2023	313	0,02

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
370	Continental Resources Inc/OK, 3,800 %, fällig 01.06.2024	365	0,02
1.270	Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15.01.2028	1.212	0,07
10	Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, fällig 01.06.2044	9	–
1.020	Costco Wholesale Corp, 1,375 %, fällig 20.06.2027	1.044	0,06
650	Costco Wholesale Corp, 1,600 %, fällig 20.04.2030	663	0,04
1.871	Credit Suisse European Mortgage Capital, 0,000 %, fällig 09.08.2024 ∞	1.777	0,10
300	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	312	0,02
220	CVS Health Corp, 2,750 %, fällig 01.12.2022	231	0,01
449	CVS Health Corp, 3,700 %, fällig 09.03.2023	484	0,03
106	CVS Health Corp, 4,100 %, fällig 25.03.2025	121	0,01
761	CVS Health Corp, 3,875 %, fällig 20.07.2025	863	0,05
220	CVS Health Corp, 3,625 %, fällig 01.04.2027	250	0,01
3.050	CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	3.593	0,21
530	CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	614	0,04
400	CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	492	0,03
220	CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	256	0,02
440	CVS Health Corp, 5,125 %, fällig 20.07.2045	571	0,03
3.700	CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	4.833	0,28
70	CVS Health Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2050	84	–
20	CVS Pass-Through Trust, 144A, 5,298 %, fällig 11.01.2027	21	–
21	CVS Pass-Through Trust, 6,036 %, fällig 10.12.2028	24	–
37	CVS Pass-Through Trust, 6,943 %, fällig 10.01.2030	44	–
150	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03.11.2036	151	0,01
140	Deere & Co, 3,100 %, fällig 15.04.2030	160	0,01
740	Deere & Co, 3,750 %, fällig 15.04.2050	910	0,05
1.330	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 4,420 %, fällig 15.06.2021	1.365	0,08
238	Delta Air Lines 2007-1 Klasse A Pass Through Trust, Series 071A, 6,821 %, fällig 10.08.2022	238	0,01
1.690	Delta Air Lines Inc, 3,400 %, fällig 19.04.2021	1.694	0,10
710	Delta Air Lines Inc, 3,625 %, fällig 15.03.2022	706	0,04
190	Delta Air Lines Inc, 3,800 %, fällig 19.04.2023	183	0,01
320	Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig 28.10.2024	294	0,02
2.570	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	2.817	0,17
1.130	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	1.177	0,07
530	Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	609	0,04
40	Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	42	–
20	Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2042	19	–
1.920	Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	1.926	0,11
360	Diamondback Energy Inc, 5,375 %, fällig 31.05.2025	375	0,02
50	Diamondback Energy Inc, 3,250 %, fällig 01.12.2026	51	–
340	Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	347	0,02
450	DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	476	0,03
50	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	57	–
60	Dollar General Corp, 3,250 %, fällig 15.04.2023	64	–
130	Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, fällig 15.02.2040	185	0,01
640	Duke Energy Ohio Inc, 3,650 %, fällig 01.02.2029	752	0,04
660	Eaton Corp, 2,750 %, fällig 02.11.2022	693	0,04
420	Eaton Corp, 4,150 %, fällig 02.11.2042	526	0,03
36	El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, fällig 15.06.2032	50	–
800	Energy Transfer Operating LP, 4,500 %, fällig 15.04.2024	862	0,05
210	Energy Transfer Operating LP, 4,950 %, fällig 15.06.2028	225	0,01
530	Energy Transfer Operating LP, 5,250 %, fällig 15.04.2029	581	0,03
1.530	Energy Transfer Operating LP, 3,750 %, fällig 15.05.2030	1.522	0,09
150	Energy Transfer Operating LP, 6,250 %, fällig 15.04.2049	158	0,01
470	Energy Transfer Operating LP, Series F, 6,750 %, Perpetual *	391	0,02
90	Energy Transfer Partners LP / Regency Energy Finance Corp, 5,875 %, fällig 01.03.2022	95	0,01
290	Enterprise Products Operating LLC, 5,200 %, fällig 01.09.2020	290	0,02
1.080	Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig 16.10.2028	1.272	0,07
670	Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig 31.01.2030	717	0,04
2.150	Enterprise Products Operating LLC, 4,200 %, fällig 31.01.2050	2.352	0,14
420	Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, fällig 31.01.2051	429	0,03
90	Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31.01.2060	92	0,01
240	EOG Resources Inc, 4,150 %, fällig 15.01.2026	278	0,02
190	EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	228	0,01
690	EOG Resources Inc, 3,900 %, fällig 01.04.2035	813	0,05
180	EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	231	0,01
460	EQT Corp, 3,000 %, fällig 01.10.2022	455	0,03
110	Exxon Mobil Corp, 1,571 %, fällig 15.04.2023	114	0,01
1.700	Exxon Mobil Corp, 2,992 %, fällig 19.03.2025	1.875	0,11
470	Exxon Mobil Corp, 3,043 %, fällig 01.03.2026	524	0,03
650	Exxon Mobil Corp, 3,482 %, fällig 19.03.2030	757	0,04
1.130	Exxon Mobil Corp, 4,114 %, fällig 01.03.2046	1.370	0,08
80	Exxon Mobil Corp, 4,327 %, fällig 19.03.2050	103	0,01
110	FirstEnergy Corp, Series B, 4,250 %, fällig 15.03.2023	117	0,01
270	FirstEnergy Corp, Series A, 1,600 %, fällig 15.01.2026	268	0,02
3.460	FirstEnergy Corp, Series B, 3,900 %, fällig 15.07.2027	3.803	0,22
1.948	FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, fällig 15.11.2031	2.761	0,16
1.000	FirstEnergy Corp, Series C, 4,850 %, fällig 15.07.2047	1.223	0,07
240	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21.04.2023	266	0,02
180	Ford Motor Co, 9,000 %, fällig 22.04.2025	211	0,01
150	Ford Motor Co, 4,750 %, fällig 15.01.2043	139	0,01
200	Ford Motor Credit Co LLC, 3,336 %, fällig 18.03.2021	201	0,01
680	Ford Motor Credit Co LLC, 5,875 %, fällig 02.08.2021	695	0,04
200	Ford Motor Credit Co LLC, 3,339 %, fällig 28.03.2022	201	0,01
200	Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, fällig 16.06.2025	210	0,01
400	Ford Motor Credit Co LLC, 4,125 %, fällig 17.08.2027	400	0,02
340	Fox Corp, 4,030 %, fällig 25.01.2024	376	0,02
2.160	Fox Corp, 5,476 %, fällig 25.01.2039	2.868	0,17
160	Fox Corp, 5,576 %, fällig 25.01.2049	220	0,01
10	Freeport-McMoRan Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2023	10	–
30	Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, fällig 14.11.2024	32	–
260	Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig 01.08.2030	278	0,02
60	Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, fällig 14.11.2034	68	–
910	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	1.023	0,06
1.380	GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418 %, fällig 15.11.2035	1.427	0,08
230	General Dynamics Corp, 3,250 %, fällig 01.04.2025	256	0,02
90	General Dynamics Corp, 3,500 %, fällig 15.05.2025	101	0,01
40	General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2040	51	–
330	General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2050	432	0,03
140	General Electric Co, 3,450 %, fällig 01.05.2027	148	0,01
280	General Electric Co, 3,625 %, fällig 01.05.2030	289	0,02
230	General Electric Co, 6,750 %, fällig 15.03.2032	288	0,02
720	General Electric Co, 6,150 %, fällig 07.08.2037	855	0,05
450	General Electric Co, 5,875 %, fällig 14.01.2038	520	0,03
2.161	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10.01.2039	2.757	0,16
300	General Electric Co, 4,250 %, fällig 01.05.2040	303	0,02
360	General Electric Co, 4,350 %, fällig 01.05.2050	366	0,02
240	General Motors Co, 5,400 %, fällig 02.10.2023	266	0,02
440	General Motors Co, 6,125 %, fällig 01.10.2025	517	0,03
50	General Motors Co, 5,150 %, fällig 01.04.2038	53	–
230	General Motors Co, 6,250 %, fällig 02.10.2043	269	0,02
330	General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	390	0,02
360	General Motors Financial Co Inc, 4,375 %, fällig 25.09.2021	372	0,02
40	General Motors Financial Co Inc, 3,450 %, fällig 10.04.2022	41	–
10	General Motors Financial Co Inc, 4,250 %, fällig 15.05.2023	11	–
50	General Motors Financial Co Inc, 4,350 %, fällig 17.01.2027	54	–
110	Gilead Sciences Inc, 2,550 %, fällig 01.09.2020	110	0,01
200	Gilead Sciences Inc, 3,500 %, fällig 01.02.2025	224	0,01
250	Gilead Sciences Inc, 4,750 %, fällig 01.03.2046	335	0,02
10	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,250 %, fällig 01.06.2025	11	–
80	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,375 %, fällig 15.04.2026	89	0,01
3	Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, Perpetual *	3	–
380	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,250 %, fällig 27.07.2021	397	0,02
750	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,876 %, fällig 31.10.2022 *	770	0,05
440	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,200 %, fällig 23.02.2023	468	0,03
320	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,000 %, fällig 03.03.2024	355	0,02
800	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,850 %, fällig 08.07.2024	885	0,05
760	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01.04.2025	843	0,05
720	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, fällig 21.10.2025	821	0,05
1.970	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16.11.2026	2.199	0,13
4.750	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, fällig 23.04.2029 *	5.451	0,32

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
2.650	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, fällig 01.05.2029 *	3.118	0,18
670	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01.02.2041	1.015	0,06
560	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	747	0,04
1.050	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig 21.10.2045	1.403	0,08
270	Guardian Life Global Funding, 144A, 1,100 %, fällig 23.06.2025	274	0,02
29	Halliburton Co, 3,800 %, fällig 15.11.2025	32	–
60	Halliburton Co, 4,850 %, fällig 15.11.2035	67	–
320	Halliburton Co, 5,000 %, fällig 15.11.2045	353	0,02
50	Hanesbrands Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.05.2024	53	–
400	Hanesbrands Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.05.2025	427	0,03
200	Hanesbrands Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15.05.2026	218	0,01
150	HCA Inc, 4,750 %, fällig 01.05.2023	165	0,01
100	HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	113	0,01
270	HCA Inc, 5,375 %, fällig 01.02.2025	304	0,02
10	HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.04.2025	12	–
170	HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.06.2026	201	0,01
40	HCA Inc, 5,375 %, fällig 01.09.2026	45	–
100	HCA Inc, 4,500 %, fällig 15.02.2027	114	0,01
90	HCA Inc, 5,625 %, fällig 01.09.2028	107	0,01
660	HCA Inc, 5,875 %, fällig 01.02.2029	803	0,05
630	HCA Inc, 3,500 %, fällig 01.09.2030	664	0,04
400	HCA Inc, 5,500 %, fällig 15.06.2047	509	0,03
180	Hershey Co/The, 0,900 %, fällig 01.06.2025	182	0,01
500	Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.05.2025	525	0,03
200	Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,750 %, fällig 01.05.2028	212	0,01
30	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,625 %, fällig 01.04.2025	30	–
330	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.04.2027	339	0,02
380	Home Depot Inc/The, 2,500 %, fällig 15.04.2027	417	0,02
70	Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 06.12.2028	84	–
440	Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	490	0,03
490	Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	561	0,03
90	Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 15.06.2047	110	0,01
1.370	Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	1.573	0,09
440	Honeywell International Inc, 1,350 %, fällig 01.06.2025	454	0,03
120	Humana Inc, 4,500 %, fällig 01.04.2025	139	0,01
430	Humana Inc, 3,950 %, fällig 15.03.2027	496	0,03
1.700	Humana Inc, 3,125 %, fällig 15.08.2029	1.883	0,11
70	Humana Inc, 4,625 %, fällig 01.12.2042	89	0,01
90	Humana Inc, 4,950 %, fällig 01.10.2044	121	0,01
20	Humana Inc, 4,800 %, fällig 15.03.2047	27	–
50	ILFC E-Capital Trust II, 144A, 3,270 %, fällig 21.12.2065 *	28	–
80	Intel Corp, 3,700 %, fällig 29.07.2025	91	0,01
290	Intel Corp, 4,600 %, fällig 25.03.2040	387	0,02
130	Intel Corp, 3,734 %, fällig 08.12.2047	155	0,01
1.910	Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	2.655	0,16
650	Intel Corp, 4,950 %, fällig 25.03.2060	940	0,06
1.940	International Business Machines Corp, 3,000 %, fällig 15.05.2024	2.111	0,12
150	International Lease Finance Corp, 5,875 %, fällig 15.08.2022	162	0,01
460	Johnson & Johnson, 0,550 %, fällig 01.09.2025	462	0,03
930	Johnson & Johnson, 0,950 %, fällig 01.09.2027	940	0,06
1.040	Johnson & Johnson, 3,625 %, fällig 03.03.2037	1.272	0,07
320	JPMorgan Chase & Co, 4,350 %, fällig 15.08.2021	333	0,02
100	JPMorgan Chase & Co, 4,500 %, fällig 24.01.2022	106	0,01
1.880	JPMorgan Chase & Co, 1,514 %, fällig 01.06.2024 *	1.924	0,11
250	JPMorgan Chase & Co, 3,875 %, fällig 10.09.2024	279	0,02
1.400	JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, fällig 05.12.2024 *	1.549	0,09
1.160	JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, fällig 22.04.2026 *	1.219	0,07
970	JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, fällig 01.10.2027	1.135	0,07
1.000	JPMorgan Chase & Co, 3,509 %, fällig 23.01.2029 *	1.131	0,07
770	JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	911	0,05
780	JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05.12.2029 *	942	0,06
640	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	687	0,04
1.730	JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01.06.2045	2.381	0,14
300	JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	328	0,02
150	Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,500 %, fällig 01.03.2021	152	0,01
380	Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,500 %, fällig 01.09.2023	408	0,02
110	Kinder Morgan Energy Partners LP, 4,250 %, fällig 01.09.2024	123	0,01
130	Kinder Morgan Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2021	132	0,01
300	Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig 01.06.2025	341	0,02
680	Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig 01.03.2028	789	0,05
270	Kinder Morgan Inc, 5,300 %, fällig 01.12.2034	324	0,02
170	Kinder Morgan Inc, 5,550 %, fällig 01.06.2045	211	0,01
60	Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01.03.2048	74	–
30	KKR Group Finance Co II LLC, 144A, 5,500 %, fällig 01.02.2043	39	–
295	Kraft Heinz Foods Co, 3,950 %, fällig 15.07.2025	321	0,02
140	Kraft Heinz Foods Co, 3,000 %, fällig 01.06.2026	146	0,01
150	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 4,250 %, fällig 01.03.2031	166	0,01
20	Kraft Heinz Foods Co, 6,750 %, fällig 15.03.2032	27	–
80	Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig 15.07.2035	93	0,01
50	Kraft Heinz Foods Co, 6,875 %, fällig 26.01.2039	68	–
10	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 7,125 %, fällig 01.08.2039	14	–
10	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 4,625 %, fällig 01.10.2039	11	–
170	Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig 04.06.2042	189	0,01
440	Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, fällig 15.07.2045	501	0,03
210	Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, fällig 01.06.2046	216	0,01
370	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 4,875 %, fällig 01.10.2049	409	0,02
380	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 5,500 %, fällig 01.06.2050	451	0,03
770	L3Harris Technologies Inc, 4,854 %, fällig 27.04.2035	1.022	0,06
230	L3Harris Technologies Inc, 5,054 %, fällig 27.04.2045	309	0,02
270	Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,875 %, fällig 01.11.2026	283	0,02
1.250	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	1.267	0,07
100	Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25.06.2025	100	0,01
170	Lehman Brothers Escrow, Null-Coupon, Perpetual †∞Ɛ	–	–
160	Lehman Brothers Escrow, Series DMTN, Null-Coupon, Perpetual †∞Ɛ	–	–
1.110	Lehman Brothers Holding Inc, Null-Coupon, Perpetual †∞Ɛ	–	–
960	Lehman Brothers Holdings Capital Trust Escrow, Null-Coupon, Perpetual †∞Ɛ	–	–
207	Lehman Escrow Receipt, Null-Coupon, Perpetual †∞	3	–
79	Lehman Swap Receipt, Null-Coupon, Perpetual †∞	1	–
160	Lennar Corp, 4,500 %, fällig 30.04.2024	172	0,01
50	Lennar Corp, 4,750 %, fällig 30.05.2025	55	–
20	Lennar Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2027	23	–
530	Lennar Corp, 4,750 %, fällig 29.11.2027	605	0,04
400	Levi Strauss & Co, 5,000 %, fällig 01.05.2025	410	0,02
90	Lockheed Martin Corp, 3,100 %, fällig 15.01.2023	95	0,01
460	Lockheed Martin Corp, 3,550 %, fällig 15.01.2026	527	0,03
40	Lockheed Martin Corp, 4,500 %, fällig 15.05.2036	52	–
280	Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig 15.04.2030	348	0,02
240	Lowe's Cos Inc, 5,000 %, fällig 15.04.2040	318	0,02
920	Lowe's Cos Inc, 5,125 %, fällig 15.04.2050	1.280	0,08
200	LyondellBaVenta Industries NV, 6,000 %, fällig 15.11.2021	210	0,01
370	März Inc, 144A, 2,700 %, fällig 01.04.2025	402	0,02
1.090	März Inc, 144A, 3,200 %, fällig 01.04.2030	1.249	0,07
110	Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	139	0,01
290	McDonald's Corp, 3,375 %, fällig 26.05.2025	324	0,02
430	McDonald's Corp, 3,300 %, fällig 01.07.2025	481	0,03
100	McDonald's Corp, 1,450 %, fällig 01.09.2025	103	0,01
660	McDonald's Corp, 3,700 %, fällig 30.01.2026	755	0,04
510	McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.03.2027	579	0,03
160	McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.07.2027	183	0,01
260	McDonald's Corp, 3,800 %, fällig 01.04.2028	303	0,02
410	McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	477	0,03
80	McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	91	0,01
720	McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	882	0,05
220	MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	256	0,02
414	Medtronic Inc, 3,500 %, fällig 15.03.2025	466	0,03
750	Merck & Co Inc, 0,750 %, fällig 24.02.2026	756	0,04
450	Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	457	0,03

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
300	MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	379	0,02
580	Micron Technology Inc, 2,497 %, fällig 24.04.2023	606	0,04
530	Microsoft Corp, 1,550 %, fällig 08.08.2021	536	0,03
770	Microsoft Corp, 2,400 %, fällig 06.02.2022	792	0,05
820	Microsoft Corp, 2,875 %, fällig 06.02.2024	886	0,05
200	Microsoft Corp, 2,700 %, fällig 12.02.2025	218	0,01
2.230	Microsoft Corp, 2,400 %, fällig 08.08.2026	2.440	0,14
1.400	Microsoft Corp, 3,300 %, fällig 06.02.2027	1.605	0,09
20	Microsoft Corp, 3,450 %, fällig 08.08.2036	24	–
390	Microsoft Corp, 2,525 %, fällig 01.06.2050	411	0,02
207	Microsoft Corp, 3,950 %, fällig 08.08.2056	275	0,02
43	Microsoft Corp, 2,675 %, fällig 01.06.2060	45	–
730	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	761	0,04
30	Molson Coors Beverage Co, 3,500 %, fällig 01.05.2022	31	–
410	Mondelez International Holdings Netherlands BV, 144A, 2,125 %, fällig 19.09.2022	424	0,02
220	Mondelez International Inc, 2,125 %, fällig 13.04.2023	229	0,01
960	Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig 04.05.2025	996	0,06
1.770	Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28.04.2026 *	1.867	0,11
1.360	Morgan Stanley, 3,772 %, fällig 24.01.2029 *	1.565	0,09
50	Morgan Stanley, 4,431 %, fällig 23.01.2030 *	60	–
1.260	Morgan Stanley, 2,699 %, fällig 22.01.2031 *	1.361	0,08
2.090	Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	2.432	0,14
200	Morgan Stanley, 5,597 %, fällig 24.03.2051 *	309	0,02
380	MPLX LP, 4,875 %, fällig 01.12.2024	429	0,03
230	MPLX LP, 4,000 %, fällig 15.03.2028	254	0,01
1.750	MPLX LP, 4,800 %, fällig 15.02.2029	2.031	0,12
410	MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	436	0,03
940	MPLX LP, 4,700 %, fällig 15.04.2048	1.015	0,06
360	MPLX LP, 5,500 %, fällig 15.02.2049	428	0,03
560	National Securities Clearing Corp, 144A, 1,200 %, fällig 23.04.2023	571	0,03
470	National Securities Clearing Corp, 144A, 1,500 %, fällig 23.04.2025	488	0,03
100	Netflix Inc, 5,375 %, fällig 01.02.2021	102	0,01
490	New York Life Global Funding, 144A, 0,950 %, fällig 24.06.2025	496	0,03
160	Newell Brands Inc, 4,700 %, fällig 01.04.2026	173	0,01
360	NIKE Inc, 2,400 %, fällig 27.03.2025	389	0,02
580	NIKE Inc, 2,750 %, fällig 27.03.2027	645	0,04
590	NIKE Inc, 2,850 %, fällig 27.03.2030	660	0,04
390	NIKE Inc, 3,250 %, fällig 27.03.2040	440	0,03
1.300	NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	1.501	0,09
950	Noble Energy Inc, 3,850 %, fällig 15.01.2028	1.079	0,06
330	Noble Energy Inc, 5,250 %, fällig 15.11.2043	441	0,03
180	Noble Energy Inc, 4,950 %, fällig 15.08.2047	238	0,01
790	Northrop Grumman Corp, 2,930 %, fällig 15.01.2025	863	0,05
1.140	Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig 15.01.2028	1.291	0,08
490	Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01.05.2050	707	0,04
320	NVIDIA Corp, 2,850 %, fällig 01.04.2030	357	0,02
870	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	1.006	0,06
2.250	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	2.560	0,15
620	NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	729	0,04
620	Occidental Petroleum Corp, 3,125 %, fällig 15.02.2022	613	0,04
590	Occidental Petroleum Corp, 2,700 %, fällig 15.08.2022	582	0,03
30	Occidental Petroleum Corp, 6,950 %, fällig 01.07.2024	31	–
1.030	Occidental Petroleum Corp, 2,900 %, fällig 15.08.2024	950	0,06
130	Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, fällig 15.03.2026	128	0,01
410	Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, fällig 15.04.2026	364	0,02
610	Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, fällig 15.08.2026	536	0,03
260	Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, fällig 15.02.2027	223	0,01
600	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig 15.08.2029	517	0,03
260	Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2031	279	0,02
730	Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig 15.09.2036	717	0,04
200	Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, fällig 15.03.2040	191	0,01
240	Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, fällig 15.06.2045	190	0,01
520	Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig 15.03.2046	517	0,03
110	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.04.2046	88	0,01
510	Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, fällig 15.02.2047	384	0,02
260	Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig 15.03.2048	197	0,01
1.000	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.08.2049	773	0,05
300	Otis Worldwide Corp, 144A, 2,056 %, fällig 05.04.2025	317	0,02
310	Otis Worldwide Corp, 144A, 2,293 %, fällig 05.04.2027	330	0,02
900	Otis Worldwide Corp, 144A, 2,565 %, fällig 15.02.2030	963	0,06
990	Pacific Gas and Electric Co, 1,750 %, fällig 16.06.2022	993	0,06
310	Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01.08.2027	301	0,02
390	Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01.02.2031	376	0,02
80	Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.08.2040	75	–
190	Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01.08.2050	178	0,01
540	PayPal Holdings Inc, 1,350 %, fällig 01.06.2023	553	0,03
560	PayPal Holdings Inc, 1,650 %, fällig 01.06.2025	583	0,03
220	PepsiCo Inc, 3,125 %, fällig 01.11.2020	221	0,01
720	PepsiCo Inc, 0,750 %, fällig 01.05.2023	729	0,04
80	PepsiCo Inc, 2,250 %, fällig 19.03.2025	86	0,01
70	PepsiCo Inc, 2,625 %, fällig 19.03.2027	77	–
580	PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig 01.05.2030	600	0,04
220	PepsiCo Inc, 2,875 %, fällig 15.10.2049	236	0,01
100	PepsiCo Inc, 3,625 %, fällig 19.03.2050	122	0,01
180	PepsiCo Inc, 3,875 %, fällig 19.03.2060	230	0,01
940	Pfizer Inc, 0,800 %, fällig 28.05.2025	951	0,06
620	Pfizer Inc, 2,625 %, fällig 01.04.2030	693	0,04
580	Pfizer Inc, 1,700 %, fällig 28.05.2030	601	0,04
310	Philip Morris International Inc, 2,900 %, fällig 15.11.2021	320	0,02
160	Philip Morris International Inc, 2,500 %, fällig 22.08.2022	167	0,01
540	Philip Morris International Inc, 2,500 %, fällig 02.11.2022	564	0,03
360	Philip Morris International Inc, 1,125 %, fällig 01.05.2023	366	0,02
400	Philip Morris International Inc, 2,100 %, fällig 01.05.2030	416	0,02
160	Philip Morris International Inc, 4,500 %, fällig 20.03.2042	197	0,01
390	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.04.2026	432	0,03
240	Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, fällig 23.06.2025	245	0,01
300	Procter & Gamble Co/The, 2,450 %, fällig 25.03.2025	326	0,02
120	Procter & Gamble Co/The, 2,800 %, fällig 25.03.2027	135	0,01
340	Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, fällig 25.03.2030	393	0,02
450	Procter & Gamble Co/The, 3,550 %, fällig 25.03.2040	552	0,03
560	Procter & Gamble Co/The, 3,600 %, fällig 25.03.2050	713	0,04
270	Progress Energy Inc, 4,400 %, fällig 15.01.2021	271	0,02
30	QEP Resources Inc, 6,875 %, fällig 01.03.2021	31	–
19	Range Resources Corp, 5,875 %, fällig 01.07.2022	19	–
420	Range Resources Corp, 5,000 %, fällig 15.03.2023	419	0,02
200	Range Resources Corp, 4,875 %, fällig 15.05.2025	187	0,01
20	Raytheon Co, 3,125 %, fällig 15.10.2020	20	–
280	Raytheon Technologies Corp, 144A, 3,150 %, fällig 15.12.2024	305	0,02
650	Raytheon Technologies Corp, 3,950 %, fällig 16.08.2025	745	0,04
630	Raytheon Technologies Corp, 4,125 %, fällig 16.11.2028	751	0,04
590	Raytheon Technologies Corp, 2,250 %, fällig 01.07.2030	625	0,04
130	Raytheon Technologies Corp, 4,500 %, fällig 01.06.2042	166	0,01
370	Republic Services Inc, 2,500 %, fällig 15.08.2024	396	0,02
430	salesforce.com Inc, 3,250 %, fällig 11.04.2023	462	0,03
140	salesforce.com Inc, 3,700 %, fällig 11.04.2028	164	0,01
80	Santander Holdings USA Inc, 4,500 %, fällig 17.07.2025	89	0,01
220	Schlumberger Holdings Corp, 144A, 4,000 %, fällig 21.12.2025	244	0,01
322	Schlumberger Holdings Corp, 3,900 %, fällig 17.05.2028	352	0,02
430	Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01.03.2032	615	0,04
150	Southwestern Electric Power Co, 6,200 %, fällig 15.03.2040	208	0,01
20	Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15.11.2028	26	–
515	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	778	0,05
10	Sprint Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2023	12	–

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
220	Sprint Corp, 7,625 %, fällig 15.02.2025	264	0,02
60	Sunoco Logistics Partners Operations LP, 5,300 %, fällig 01.04.2044	57	–
290	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2030	306	0,02
340	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01.02.2031	345	0,02
640	Target Corp, 2,250 %, fällig 15.04.2025	687	0,04
16	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig 16.12.2039	24	–
1.010	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,900 %, fällig 15.09.2044	1.278	0,08
1.820	Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01.03.2030	1.907	0,11
380	Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig 04.05.2030	394	0,02
980	The Vanguard Group Inc, 3,050 %, fällig 22.08.2050 †∞	934	0,05
320	Time Warner Cable LLC, 4,125 %, fällig 15.02.2021	322	0,02
420	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	602	0,04
560	Time Warner Cable LLC, 5,875 %, fällig 15.11.2040	715	0,04
85	Time Warner Entertainment Co LP, 8,375 %, fällig 15.07.2033	132	0,01
420	TJX Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15.04.2025	469	0,03
50	TJX Cos Inc/The, 2,250 %, fällig 15.09.2026	53	–
130	TJX Cos Inc/The, 3,750 %, fällig 15.04.2027	150	0,01
20	T-Mobile USA Inc, 6,000 %, fällig 01.03.2023	20	–
10	T-Mobile USA Inc, 6,000 %, fällig 15.04.2024	10	–
2.640	T-Mobile USA Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.04.2025	2.920	0,17
120	T-Mobile USA Inc, 144A, 3,750 %, fällig 15.04.2027	136	0,01
1.520	T-Mobile USA Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.04.2030	1.744	0,10
150	Toll Brothers Finance Corp, 4,375 %, fällig 15.04.2023	158	0,01
1.350	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01.02.2026	1.767	0,10
170	TransDigm Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.12.2025	185	0,01
380	TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	402	0,02
340	Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 15.07.2025	387	0,02
110	Union Pacific Corp, 2,150 %, fällig 05.02.2027	118	0,01
1.090	Union Pacific Corp, 3,950 %, fällig 10.09.2028	1.298	0,08
1.260	Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig 20.03.2060	1.477	0,09
470	Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05.02.2070	536	0,03
180	United Rentals North America Inc, 5,875 %, fällig 15.09.2026	192	0,01
70	United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2027	73	–
160	United Rentals North America Inc, 4,875 %, fällig 15.01.2028	169	0,01
210	United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15.01.2030	234	0,01
1.230	United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.02.2031	1.276	0,08
30	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.10.2020	30	–
130	UnitedHealth Group Inc, 4,700 %, fällig 15.02.2021	131	0,01
230	UnitedHealth Group Inc, 2,875 %, fällig 15.12.2021	238	0,01
90	UnitedHealth Group Inc, 2,375 %, fällig 15.10.2022	94	0,01
210	UnitedHealth Group Inc, 3,500 %, fällig 15.06.2023	228	0,01
410	UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, fällig 15.07.2025	470	0,03
210	UnitedHealth Group Inc, 1,250 %, fällig 15.01.2026	216	0,01
660	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.12.2028	790	0,05
200	UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	210	0,01
160	UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.06.2048	207	0,01
130	UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	174	0,01
940	UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	1.142	0,07
300	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.08.2059	377	0,02
80	UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, fällig 15.05.2060	88	0,01
1.410	US Bancorp, 1,450 %, fällig 12.05.2025	1.463	0,09
470	US Bank NA/Cincinnati OH, 3,150 %, fällig 26.04.2021	478	0,03
150	USAA Capital Corp, 144A, 1,500 %, fällig 01.05.2023	154	0,01
1.190	Verizon Communications Inc, 3,376 %, fällig 15.02.2025	1.333	0,08
260	Verizon Communications Inc, 2,625 %, fällig 15.08.2026	287	0,02
190	Verizon Communications Inc, 3,000 %, fällig 22.03.2027	213	0,01
1.062	Verizon Communications Inc, 4,329 %, fällig 21.09.2028	1.287	0,08
190	Verizon Communications Inc, 3,875 %, fällig 08.02.2029	225	0,01
500	Verizon Communications Inc, 3,150 %, fällig 22.03.2030	567	0,03
1.390	Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	1.765	0,10
580	Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	789	0,05
510	Verizon Communications Inc, 3,850 %, fällig 01.11.2042	611	0,04
430	Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig 15.08.2046	535	0,03
550	Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21.08.2046	744	0,04
50	Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig 16.03.2047	73	–
910	Verizon Communications Inc, 4,522 %, fällig 15.09.2048	1.199	0,07
320	Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22.03.2050	403	0,02
830	Visa Inc, 3,150 %, fällig 14.12.2025	934	0,05
890	Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	1.189	0,07
390	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	325	0,02
480	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual *	483	0,03
470	Walgreens Boots Alliance Inc, 3,450 %, fällig 01.06.2026	517	0,03
240	Walmart Inc, 3,400 %, fällig 26.06.2023	260	0,02
200	Walmart Inc, 3,550 %, fällig 26.06.2025	228	0,01
1.590	Walmart Inc, 3,700 %, fällig 26.06.2028	1.884	0,11
40	Walt Disney Co/The, 4,500 %, fällig 15.02.2021	41	–
170	Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig 15.11.2037	258	0,02
140	Waste Management Inc, 3,500 %, fällig 15.05.2024	153	0,01
310	Waste Management Inc, 4,150 %, fällig 15.07.2049	391	0,02
140	Wells Fargo & Co, Series M, 3,450 %, fällig 13.02.2023	149	0,01
410	Wells Fargo & Co, 4,480 %, fällig 16.01.2024	457	0,03
240	Wells Fargo & Co, 3,750 %, fällig 24.01.2024	262	0,02
1.500	Wells Fargo & Co, 1,654 %, fällig 02.06.2024 *	1.534	0,09
1.150	Wells Fargo & Co, 2,188 %, fällig 30.04.2026 *	1.203	0,07
870	Wells Fargo & Co, 3,000 %, fällig 23.10.2026	959	0,06
3.940	Wells Fargo & Co, 4,300 %, fällig 22.07.2027	4.545	0,27
560	Wells Fargo & Co, 3,584 %, fällig 22.05.2028 *	629	0,04
750	Wells Fargo & Co, 2,393 %, fällig 02.06.2028 *	784	0,05
960	Wells Fargo & Co, 4,150 %, fällig 24.01.2029	1.134	0,07
1.620	Wells Fargo & Co, 2,879 %, fällig 30.10.2030 *	1.745	0,10
1.140	Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04.04.2031 *	1.392	0,08
580	Wells Fargo & Co, 4,900 %, fällig 17.11.2045	739	0,04
720	Wells Fargo & Co, 4,400 %, fällig 14.06.2046	864	0,05
1.890	Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig 07.12.2046	2.397	0,14
5.810	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	7.959	0,47
130	Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Perpetual *	144	0,01
170	Western Midstream Operating LP, 2,116 %, fällig 13.01.2023 *	162	0,01
460	Western Midstream Operating LP, 4,100 %, fällig 01.02.2025	459	0,03
110	Western Midstream Operating LP, 4,500 %, fällig 01.03.2028	111	0,01
1.890	Western Midstream Operating LP, 5,050 %, fällig 01.02.2030	1.937	0,11
50	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15.08.2048	45	–
310	Western Midstream Operating LP, 6,250 %, fällig 01.02.2050	311	0,02
40	WestRock RKT LLC, 4,000 %, fällig 01.03.2023	43	–
197	Williams Cos Inc/The, 7,875 %, fällig 01.09.2021	211	0,01
100	Williams Cos Inc/The, 3,700 %, fällig 15.01.2023	106	0,01
350	Williams Cos Inc/The, Series A, 7,500 %, fällig 15.01.2031	462	0,03
760	Williams Cos Inc/The, 7,750 %, fällig 15.06.2031	1.009	0,06
1.038	Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15.03.2032	1.500	0,09
40	Wm Wrigley Jr Co, 144A, 3,375 %, fällig 21.10.2020	40	–
70	WPX Energy Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2022	71	–
330	WPX Energy Inc, 8,250 %, fällig 01.08.2023	372	0,02
110	Wyeth LLC, 5,950 %, fällig 01.04.2037	163	0,01
		460.604	27,08
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 543.613 USD)		595.848	35,04
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 30,16 % (29. Februar 2020: 22,67 %)			
Argentinien — 0,19 % (29. Februar 2020: 0,19 %)			
ARS 12.730	Argentina Treasury Bond BONCER, Series CER, 1,000 %, fällig 05.08.2021 †b	116	0,01
ARS 24.020	Argentine Bonos del Tesoro, 18,200 %, fällig 03.10.2021 †	152	0,01
550	Argentine Republic Government International Bond, 6,875 %, fällig 22.04.2021 ƒ	268	0,02
1.590	Argentine Republic Government International Bond, 5,625 %, fällig 26.01.2022 ƒ	763	0,04
1.060	Argentine Republic Government International Bond, 7,500 %, fällig 22.04.2026 ƒ	487	0,03
370	Argentine Republic Government International Bond, 7,125 %, fällig 06.07.2036 ƒ	166	0,01
1.850	Argentine Republic Government International Bond, 3,750 %, fällig 31.12.2038	803	0,05

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Argentinien — (Fortsetzung)			
170	Argentine Republic Government International Bond, 7,625 %, fällig 22.04.2046 ع	75	–
370	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2023 ع	173	0,01
320	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144A, 7,875 %, fällig 15.06.2027 ع	152	0,01
		3.155	0,19
Brasilien — 1,03 % (29. Februar 2020: 1,18 %)			
BRL 16.800	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2021	3.146	0,19
BRL 11.136	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2023	2.289	0,13
BRL 17.005	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	3.634	0,21
350	Brazilian Government International Bond, 2,625 %, fällig 05.01.2023	362	0,02
770	Brazilian Government International Bond, 4,625 %, fällig 13.01.2028	852	0,05
760	Brazilian Government International Bond, 5,625 %, fällig 07.01.2041	859	0,05
6.120	Brazilian Government International Bond, 5,000 %, fällig 27.01.2045	6.425	0,38
		17.567	1,03
Kolumbien — 0,10 % (29. Februar 2020: 0,11 %)			
1.270	Colombia Government International Bond, 5,625 %, fällig 26.02.2044	1.619	0,10
Ägypten — 0,07 % (29. Februar 2020: 0,08 %)			
1.110	Egypt Government International Bond, 144A, 5,577 %, fällig 21.02.2023	1.150	0,07
Indonesien — 0,64 % (29. Februar 2020: 0,66 %)			
650	Indonesia Government International Bond, 3,750 %, fällig 25.04.2022	678	0,04
1.510	Indonesia Government International Bond, 144A, 5,875 %, fällig 15.01.2024	1.742	0,10
200	Indonesia Government International Bond, 144A, 3,850 %, fällig 18.07.2027	226	0,01
390	Indonesia Government International Bond, 3,500 %, fällig 11.01.2028	430	0,03
1.610	Indonesia Government International Bond, 144A, 5,125 %, fällig 15.01.2045	2.087	0,12
280	Indonesia Government International Bond, 5,125 %, fällig 15.01.2045	363	0,02
200	Indonesia Government International Bond, 144A, 5,250 %, fällig 08.01.2047	266	0,02
430	Indonesia Government International Bond, 4,350 %, fällig 11.01.2048	511	0,03
4.260	Indonesia Government International Bond, 3,700 %, fällig 30.10.2049	4.634	0,27
		10.937	0,64
Israel — 0,07 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
650	Israel Government International Bond, 2,750 %, fällig 03.07.2030	718	0,04
360	Israel Government International Bond, 3,875 %, fällig 03.07.2050	431	0,03
		1.149	0,07
Italien — 1,22 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 16.950	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,300 %, fällig 15.10.2021	20.797	1,22
Kuwait — 0,10 % (29. Februar 2020: 0,11%)			
1.530	Kuwait International Government Bond, 144A, 3,500 %, fällig 20.03.2027	1.735	0,10
Mexiko — 1,87 % (29. Februar 2020: 2,16 %)			
MXN 6.990	Mexican Bonos, Series M 20, 10,000 %, fällig 05.12.2024	380	0,02
MXN 148.560	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	8.026	0,47
MXN 142.047	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	7.104	0,42
MXN 256.970	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	13.116	0,77
2.590	Mexico Government International Bond, 4,600 %, fällig 10.02.2048	2.861	0,17
190	Mexico Government International Bond, 5,750 %, fällig 12.10.2110	232	0,02
		31.719	1,87
Nigeria — 0,02 % (29. Februar 2020: 0,02 %)			
300	Nigeria Government International Bond, 144A, 6,500 %, fällig 28.11.2027	299	0,02
Panama — 0,07 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
950	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 01.04.2056	1.238	0,07
Peru — 0,19 % (29. Februar 2020: 0,06 %)			
1.980	Peruvian Government International Bond, 2,783 %, fällig 23.01.2031	2.161	0,13
50	Peruvian Government International Bond, 6,550 %, fällig 14.03.2037	78	–
580	Peruvian Government International Bond, 5,625 %, fällig 18.11.2050	962	0,06
		3.201	0,19
Polen — 0,14 % (29. Februar 2020: 0,13 %)			
2.100	Republic of Poland Government International Bond, 4,000 %, fällig 22.01.2024	2.347	0,14
Katar — 0,33 % (29. Februar 2020: 0,24 %)			
620	Qatar Government International Bond, 144A, 4,000 %, fällig 14.03.2029	728	0,04
2.580	Qatar Government International Bond, 144A, 4,817 %, fällig 14.03.2049	3.537	0,21
1.090	Qatar Government International Bond, 144A, 4,400 %, fällig 16.04.2050	1.417	0,08
		5.682	0,33
Russland — 1,34 % (29. Februar 2020: 1,54 %)			
RUB 52.900	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6211, 7,000 %, fällig 25.01.2023	754	0,04
RUB 116.430	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6215, 7,000 %, fällig 16.08.2023	1.672	0,10
RUB 16.270	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6219, 7,750 %, fällig 16.09.2026	246	0,01
RUB 143.230	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6207, 8,150 %, fällig 03.02.2027	2.211	0,13
RUB 180.331	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028	2.629	0,15
RUB 384.660	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	5.554	0,33
RUB 232.730	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10.04.2030	3.519	0,21
RUB 22.030	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6225, 7,250 %, fällig 10.05.2034	324	0,02
RUB 382.680	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6230, 7,700 %, fällig 16.03.2039	5.962	0,35
		22.871	1,34
Vereinigte Arabische Emirate — 0,28 % (29. Februar 2020: 0,10 %)			
1.570	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 2,500 %, fällig 11.10.2022	1.628	0,09
2.610	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 3,875 %, fällig 16.04.2050	3.190	0,19
		4.818	0,28
USA — 22,50 % (29. Februar 2020: 16,07 %)			
2.760	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 04.11.2020	2.760	0,16
1.440	Federal National Mortgage Association, 6,625 %, fällig 15.11.2030	2.215	0,13
590	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri, 3,229 %, fällig 15.05.2050	693	0,04
3.290	United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 08.12.2020	3.289	0,19
3.460	United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 05.01.2021	3.459	0,20
5.900	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 15.10.2020	5.899	0,35
15.130	United States Treasury Bill – WI Post Auction, Null-Coupon, fällig 03.12.2020	15.126	0,89
3.110	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2,125 %, fällig 15.02.2040 β	5.672	0,33
1.160	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2,125 %, fällig 15.02.2041 β	2.111	0,12
3.190	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375 %, fällig 15.02.2044 β	5.003	0,29
4.500	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,750 %, fällig 15.02.2045 β	6.264	0,37
3.060	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, fällig 15.02.2046 β	4.494	0,27
3.790	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, fällig 15.02.2048 β	5.529	0,33
15.970	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, fällig 15.02.2049 β	23.061	1,36
9.400	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,250 %, fällig 15.02.2050 β	11.236	0,66
770	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30.04.2025	775	0,05
157.770	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.05.2025	157.795	9,28
230	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 30.06.2025	230	0,01
30	United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 30.04.2027	30	–
23.830	United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 30.06.2027	23.882	1,40
12.090	United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 31.08.2027	12.108	0,71
6.490	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.05.2030	6.455	0,38
16.440	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.08.2030	16.331	0,96
8.010	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2047	10.391	0,61
5.130	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2048	6.969	0,41
1.100	United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 15.05.2048	1.529	0,09
10.900	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	12.341	0,73

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
23.600	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15.05.2050	22.424	1,32
14.920	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	14.643	0,86
		382.714	22,50
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 500.963 USD)		512.998	30,16
Schuldverschreibungen — 4,66 % (29. Februar 2020: 4,63 %)			
1.924	1011778 BC ULC, 1,911 %, fällig 14.11.2026 *	1.856	0,11
2.173	Allied Universal Holdco LLC, 4,411 %, fällig 12.07.2026 *	2.160	0,13
561	Alterra Mountain Co, 2,911 %, fällig 31.07.2024 *	542	0,03
903	American Airlines Inc, 2,162 %, fällig 14.12.2023 *	719	0,04
300	American Axle & Manufacturing Inc, 3,000 %, fällig 06.04.2024 *	293	0,02
40	AmWINS Group Inc, 0,000 %, fällig 25.01.2024 *	40	–
527	APi Group Inc, 2,661 %, fällig 01.10.2026 *	520	0,03
410	Aramark Services Inc, 1,911 %, fällig 11.03.2025 *	393	0,02
504	Aramark Services Inc, 1,911 %, fällig 15.01.2027 *	482	0,03
2.050	Asplundh Tree Expert LLC, 0,000 %, fällig 19.08.2027 *	2.053	0,12
1.105	Asurion LLC, 3,161 %, fällig 03.11.2024 *	1.088	0,06
358	Asurion LLC, 3,161 %, fällig 03.11.2023 *	353	0,02
895	Asurion LLC, 3,161 %, fällig 04.08.2022 *	887	0,05
148	Atlantic Aviation Inc, 3,911 %, fällig 30.11.2025 *	145	0,01
1.040	Bausch Health Americas Inc, 0,000 %, fällig 27.11.2025 *	1.022	0,06
120	Berry Global Inc, 2,155 %, fällig 19.01.2024 *	118	0,01
1.881	Berry Global Inc, 2,155 %, fällig 01.10.2022 *	1.860	0,11
617	Beta Sub LLC, 4,661 %, fällig 06.08.2026 *	616	0,04
265	Brightview Landscapes LLC, 2,688 %, fällig 15.08.2025 *	262	0,01
546	Brookfield WEC Holdings Inc, 3,750 %, fällig 01.08.2025 *	539	0,03
890	Caesars Resort Collection LLC, 4,703 %, fällig 19.06.2025 *	865	0,05
922	Caesars Resort Collection LLC, 2,911 %, fällig 22.12.2024 *	870	0,05
2.002	Change Healthcare Holdings LLC, 3,500 %, fällig 01.03.2024 *	1.970	0,12
2.018	Charter Communications Operating LLC, 1,920 %, fällig 30.04.2025 *	1.989	0,12
438	Charter Communications Operating LLC, 1,920 %, fällig 01.02.2027 *	431	0,02
534	Citadel Securities LP, 2,911 %, fällig 27.02.2026 *	531	0,03
1.137	CityCenter Holdings LLC, 3,000 %, fällig 18.04.2024 *	1.080	0,06
100	CSC Holdings LLC, 2,658 %, fällig 15.04.2027 *	97	0,01
1.566	DCert Buyer, Inc., 4,161 %, fällig 08.08.2026 *	1.550	0,09
1.350	Deerfield Dakota Holding LLC, 4,750 %, fällig 05.03.2027 *	1.349	0,08
1.832	Dell International LLC, 2,750 %, fällig 19.09.2025 *	1.822	0,11
70	Delta 2 (Lux) S.a.r.l., 3,500 %, fällig 01.02.2024 *	68	–
1.190	Delta Air Lines Inc, 5,750 %, fällig 29.04.2023 *	1.189	0,07
39	Diamond Sports Group LLC, 3,420 %, fällig 18.07.2026 *	33	–
718	Edelman Financial Center LLC/ The, 3,172 %, fällig 19.07.2025 *	698	0,04
1.430	Elanco Animal Health Inc, 1,905 %, fällig 04.02.2027 *	1.404	0,08
333	Entercom Media Corp, 2,673 %, fällig 17.11.2024 *	316	0,02
315	Eyecare Partners LLC, 4,822 %, fällig 20.02.2027 *	275	0,02
74	Eyecare Partners LLC, 0,500 %, fällig 20.02.2027 *	69	–
200	FinCo I LLC, 0,000 %, fällig 27.12.2022 *	199	0,01
306	First Eagle Holdings Inc, 2,808 %, fällig 17.02.2027 *	299	0,02
804	Focus Financial Partners LLC, 2,161 %, fällig 03.07.2024 *	789	0,05
808	Four Seasons Hotels Ltd, 2,161 %, fällig 30.11.2023 *	787	0,05
670	Froneri U.S. Inc, 2,411 %, fällig 30.01.2027 *	647	0,04
350	Garda World Security Corp, 4,930 %, fällig 23.10.2026 *	350	0,02
1.327	Genesee & Wyoming Inc, 2,308 %, fällig 30.12.2026 *	1.309	0,08
143	GFL Environmental Inc, 4,000 %, fällig 31.05.2025 *	142	0,01
340	GoDaddy Operating Co, 0,000 %, fällig 15.02.2024 *	334	0,02
752	Golden Nugget LLC, 3,250 %, fällig 04.10.2023 *	675	0,04
1.512	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 2,122 %, fällig 15.11.2027 *	1.486	0,09
300	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 0,000 %, fällig 15.11.2027 *	295	0,02
287	HCA Inc, 1,911 %, fällig 13.03.2025 *	285	0,02
1.435	Hilton Worldwide Finance LLC, 1,925 %, fällig 21.06.2026 *	1.385	0,08
414	iHeartCommunications Inc, 3,161 %, fällig 01.05.2026 *	393	0,02
944	Jaguar Holding Co II, 3,500 %, fällig 18.08.2022 *	943	0,06
1.374	Jane Street Group LLC, 3,161 %, fällig 07.01.2025 *	1.359	0,08
2.100	Level 3 Parent LLC, 1,911 %, fällig 01.03.2027 *	2.040	0,12
1.741	McAfee LLC, 3,916 %, fällig 29.09.2024 *	1.730	0,10
274	Michaels Stores Inc, 3,500 %, fällig 28.01.2023 *	264	0,02
710	Milano Acquisition Corp, 0,000 %, fällig 17.08.2027 *	706	0,04
1.564	MPH Acquisition Holdings LLC, 3,750 %, fällig 07.06.2023 *	1.552	0,09
2.081	Nexstar Broadcasting Inc, 2,906 %, fällig 19.09.2026 *	2.049	0,12
794	Panther BF Aggregator 2 LP, 3,667 %, fällig 18.03.2026 *	781	0,05
245	Party City Holdings Inc, 4,100 %, fällig 19.08.2022 *	173	0,01
351	PCI Gaming Authority, 2,661 %, fällig 31.05.2026 *	342	0,02
638	Phoenix Guarantor Inc, 3,412 %, fällig 05.03.2026 *	628	0,04
2.065	Prime Security Services Borrower LLC, 4,250 %, fällig 23.09.2026 *	2.061	0,12
210	Realogy Group LLC, 4,739 %, fällig 08.02.2025 *	201	0,01
1.733	RegionalCare Hospital Partners Holding, 3,911 %, fällig 16.11.2025 *	1.702	0,10
2.002	Reynolds Consumer Products LLC, 1,911 %, fällig 04.02.2027 *	1.979	0,12
1.244	RPI 2019 Intermediate Finance Trust, 1,928 %, fällig 11.02.2027 *	1.241	0,07
1.141	Scientific Games International Inc, 3,612 %, fällig 14.08.2024 *	1.070	0,06
1.835	Sotera Health Holdings LLC, 5,500 %, fällig 22.11.2026 *	1.835	0,11
26	Stars Group Holdings BV, 3,808 %, fällig 10.07.2025 *	26	–
1.033	Station Casinos LLC, 2,500 %, fällig 08.02.2027 *	983	0,06
885	Terrier Media Buyer Inc, 4,411 %, fällig 17.12.2026 *	871	0,05
1.491	TKC Holdings Inc, 4,750 %, fällig 01.02.2023 *	1.405	0,08
690	T-Mobile USA, 3,161 %, fällig 15.05.2025 *	692	0,04
544	Trans Union LLC, 1,911 %, fällig 13.11.2026 *	532	0,03
1.128	UFC Holdings LLC, 4,250 %, fällig 29.04.2026 * †	1.116	0,07
707	Univision Communications Inc, 4,750 %, fällig 24.03.2026 *	693	0,04
232	Valeant Pharmaceuticals International, 3,176 %, fällig 28.05.2025 *	229	0,01
362	VFH Parent LLC, 3,164 %, fällig 01.03.2026 *	359	0,02
1.790	VICI Properties 1 LLC, 1,933 %, fällig 22.12.2024 *	1.727	0,10
1.742	Virgin Media Bristol LLC, 2,662 %, fällig 04.01.2028 *	1.701	0,10
1.504	VVC Holding Corp, 4,818 %, fällig 11.02.2026 *	1.496	0,09
527	Western Digital Corp, 1,911 %, fällig 29.04.2023 *	522	0,03
1.810	Wynn Resorts Finance LLC, 1,920 %, fällig 20.09.2024 *	1.719	0,10
590	Ziggo BV, 2,662 %, fällig 15.04.2028 *	572	0,03
Summe Darlehensschuldverschreibungen (Anschaffungskosten 80.858 USD)		79.228	4,66
Kollektive Kapitalanlagen — 1,51 % (29. Februar 2020: 0,67 %)			
1.974	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse M	25.601	1,51
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 25.384 USD)		25.601	1,51
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 1.655.620 USD)		1.721.625	101,23

Verträge (in Tsd.)		Wert (in Tsd.)	% des Nettoin-ventarw-erts
Gekaufte Optionen — 0,07 % (29. Februar 2020: 0,20 %)			
-	U.S. 10 Year November 2020 Put 139,00, fällig 10.23.2020	34	–
–	U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 139,00, fällig 09.25.2020	146	0,01
–	U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 139,25, fällig 09.25.2020	35	–
–	U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 140,50, fällig 09.25.2020	5	–
–	U.S. 10 Year Oktober 2020 Put 139,00, fällig 09.25.2020	44	–
	U.S. 10 Year Oktober 2020 Put 139,25, fällig 09.25.2020	29	–
–	U.S. 10 Year Oktober 2020 Put 140,00, fällig 09.25.2020	75	0,01
–	U.S. Bond Oktober 2020 Call 179,00, fällig 09.25.2020	18	–
17.370	USD Put/EUR Call 1,1385, fällig 09.14.2020	850	0,05
Summe gekaufte Optionen (Kosten 684 USD)		1.236	0,07
Kreditausfallversicherungen — 0,31 % (29. Februar 2020: 0,06 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		5.342	0,31
Zinsswaps —0,17 % (29. Februar 2020: 0,08 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		2.886	0,17
Devisenterminkontrakte — 0,34 % (29. Februar 2020: 0,10 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		5.776	0,34
Termingeschäfte — 0,31 % (29. Februar 2020: 0,75 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		5.338	0,31
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		1.742.203	102,43
Geschriebene Optionen — (0,03 %) (29. Februar 2020: (0,50 %))			
–	U.S. 10 Year Dezember 2020 Call 141,00, fällig 11.20.2020	(63)	(0,01)

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Geschriebene Optionen — (Fortsetzung)		
– U.S. 10 Year Dezember 2020 Call 141,50, fällig 11.20.2020	(50)	–
– U.S. 10 Year Dezember 2020 Put 135,50, fällig 11.20.2020	(31)	–
– U.S. 10 Year Dezember 2020 Put 137,50, fällig 11.20.2020	(31)	–
– U.S. 10 Year November 2020 Call 142,00, fällig 10.23.2020	(11)	–
– U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 140,00, fällig 09.25.2020	(23)	–
– U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 141,00, fällig 09.25.2020	(7)	–
– U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 142,00, fällig 09.25.2020	(1)	–
– U.S. Bond Dezember 2020 Put 172,00, fällig 11.20.2020	(127)	(0,01)
– U.S. Bond Oktober 2020 Call 181,00, fällig 09.25.2020	(14)	–
– U.S. Bond Oktober 2020 Call 181,50, fällig 09.25.2020	(3)	–
– U.S. Bond Oktober 2020 Call 184,00, fällig 09.25.2020	(1)	–
– U.S. Bond Oktober 2020 Put 173,00, fällig 09.25.2020	(30)	–
– U.S. Bond Oktober 2020 Put 175,00, fällig 09.25.2020	(34)	–
– U.S. Bond Oktober 2020 Put 177,00, fällig 09.25.2020	(52)	(0,01)
Geschriebene Optionen insgesamt (Kosten (600) USD)	(478)	(0,03)
Zinsswaps —0,00 % (29. Februar 2020: (0,66 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(31)	(-)
Devisenterminkontrakte — (0,41 %) (29. Februar 2020: (0,30 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(7.049)	(0,41)
Termingeschäfte — (0,26 %) (29. Februar 2020: (0,46 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(4.479)	(0,26)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(12.037)	(0,70)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt	1.730.166	101,73
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	(29.435)	(1,73)
Gesamtnettovermögen	$1.700.731	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 206.688.000 USD und machten 12.15% des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

† Illiquide.

∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

ƐDas Wertpapier ist zum oder seit Ende des Berichtszeitraums am 31. August 2020 in Verzug (entweder Tilgungs- und / oder Zinszahlungen).

± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (VPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihzins entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

Bei dem Kontrahenten der OTC-Optionen handelt es sich um Goldman Sachs.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit
TBA – wird noch bekannt gegeben
ARS – Argentinischer Peso
BRL – Brasilianischer Real
EUR – Euro
MXN – Mexikanischer Peso
RUB – Russischer Rubel

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt-vermö-gens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	86,42
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	4,23
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,37
Finanzderivate	1,10
Sonstige Vermögenswerte	6,88
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Protection achat/vente	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)		Wert (in Tsd.)
Barclays	CDX.NA.HY, 5,000 %	Verkauf	20.06.2025	35.242		$ 2.015
Barclays	CDX.NA.IG, 1,000 %	Verkauf	20.06.2025	201.760	1.960	3.327
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): 890 USD)						$ 5.432
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)						–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): 890 USD)						$ 5.432

Aufstellung der Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,190 %	15.06.2027	56.215	$ (31)
Barclays	Pay Floating BRL CDI CETIP, Receive Fixed 7,024 %	04.01.2027	16.899	121
Barclays	Pay Floating BRL CDI CETIP, Receive Fixed 7,024 %	04.01.2027	15.900	114
Barclays	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024 %	04.01.2027	13.400	96
Barclays	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,044 %	04.01.2027	11.000	81
Barclays	Pay Fixed 0,260 %, Receive Floating USD Fed Funds Rate	15.05.2027	36.140	2
Barclays	Pay Fixed 0,450 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.05.2027	6.293	8
Barclays	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,450 %	18.07.2029	142.060	800
Barclays	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,440 %	20.07.2029	147.960	829
Barclays	Pay Fixed 0,900 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	17.03.2050	5.517	270
Barclays	Pay Fixed 0,792 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	18.03.2050	2.778	215
Barclays	Pay Fixed 0,818 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	19.03.2050	2.783	196
Barclays	Pay Fixed 0,885 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	13.07.2050	2.887	154
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): 1.221 USD)				$ 2.886
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (10.140) USD)				(31)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (8.919) USD)				$ 2.885

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)				Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	149	Verkauf		EUR	126	$ (1)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	60	Verkauf		USD	71	1
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	370	Verkauf		AUD	507	(5)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1.727	Verkauf		EUR	1.460	(17)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf		GBP	1	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	62	Verkauf		USD	81	2
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	71.941	Verkauf		USD	84.915	964
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	10.607	Verkauf		USD	7.602	222
15.09.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	8.641	Verkauf		EUR	7.590	(419)
16.10.2020	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	1.568	Verkauf		GBP	1.200	(36)
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	USD	25.077	Verkauf		CNH	176.871	(656)
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	USD	87.918	Verkauf		EUR	77.996	(5.255)
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	CAD	29.150	Verkauf		USD	21.297	1.054
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	EUR	27.391	Verkauf		USD	31.744	977
16.10.2020	Citi	Kauf	USD	16.400	Verkauf		MXN	369.776	(402)
16.10.2020	Citi	Kauf	ZAR	29.450	Verkauf		USD	1.678	51
16.10.2020	Citi	Kauf	GBP	9.792	Verkauf		USD	12.221	872
16.10.2020	Citi	Kauf	EUR	2.000	Verkauf		USD	2.367	22
16.10.2020	Citi	Kauf	MXN	307.120	Verkauf		USD	13.606	349
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.527	Verkauf		JPY	164.039	(22)
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	RUB	301.082	Verkauf		USD	4.157	(122)
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	MXN	234.232	Verkauf		USD	10.234	410
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	BRL	29.585	Verkauf		USD	5.506	(114)
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	AUD	1.690	Verkauf		USD	1.171	75
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	INR	156.175	Verkauf		USD	2.046	74
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	CAD	17.625	Verkauf		USD	12.988	526
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	IDR	219.474.873	Verkauf		USD	14.806	177
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 1.518 USD)									5.776
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (4.601) USD)									(7.049)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (3.083) USD)									$ (1.273)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Kauf Währung (in Tsd.)	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertstei-gerung/(Wert-minderung) von Kontrakten (in Tsd.
90 Day Euro$ Dezember 2020	460	$ 114.672	$ 1.392
90 Day Euro$ Dezember 2021	(976)	(243.463)	(1.536)
90 Day Euro$ Juni 2021	(215)	(53.648)	(612)
90 Day Euro$ März 2021	(873)	(217.813)	(301)
Euro FX Currency September 2020	9	1.343	69
Euro-BTP September 2020	349	60.894	2.602
Euro-Bund September 2020	(463)	(97.001)	(521)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2020	(26)	(6.730)	(102)
Euro-OAT September 2020	91	18.186	290
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2020	(13)	(18.606)	79
Long Gilt Dezember 2020	(139)	(25.086)	107
Mexican Peso Currency September 2020	9	205	2
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	(683)	(95.108)	59
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2020	(380)	(60.586)	334
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2020	(99)	(21.873)	(4)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	2.587	326.043	404
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	163	28.642	(290)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	305	67.376	(1.113)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 11.483 USD)			$ 5.338
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(7.061) USD)			(4.479)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 4.422 USD)			$ 859

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) €	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 43,77 % (29. Februar 2020: 47,73 %)			
Australien — 0,92 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
970	Glencore Finance Europe Ltd, 1,750 %, fällig 17.03.2025	1.015	0,92
Belgien — 1,81 % (29. Februar 2020: 1,59 %)			
140	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2,125 %, fällig 02.12.2027	156	0,14
USD 90	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	87	0,08
USD 140	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01.06.2050	142	0,13
1.100	KBC Group NV, 0,059 %, fällig 24.11.2022 *	1.104	1,00
500	KBC Group NV, 1,875 %, fällig 11.03.2027 *	510	0,46
		1.999	1,81
Brasilien — 0,37 % (29. Februar 2020: 0,34 %)			
386	Petrobras Global Finance BV, 5,875 %, fällig 07.03.2022	412	0,37
Kanada — 0,10 % (29. Februar 2020: 1,52 %)			
USD 130	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2024	112	0,10
Dänemark — 0,36 % (29. Februar 2020: 1,06 %)			
390	Danske Bank A/S, 0,750 %, fällig 02.06.2023	399	0,36
Frankreich — 2,61 % (29. Februar 2020: 3,30 %)			
310	Altice France SA/France, 3,375 %, fällig 15.01.2028	308	0,28
460	BNP Paribas SA, 2,875 %, fällig 20.03.2026 *	467	0,42
600	Dassault Systemes SE, 0,125 %, fällig 16.09.2026	601	0,54
540	RCI Banque SA, 0,212 %, fällig 12.04.2021 *	539	0,49
200	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 2,125 %, fällig 27.09.2038	248	0,23
700	Thales SA, 0,750 %, fällig 23.01.2025	717	0,65
		2.880	2,61
Deutschland — 6,01 % (29. Februar 2020: 5,58 %)			
100	Allianz Finance II BV, 5,750 %, fällig 08.07.2041 *	104	0,09
100	Allianz SE, 4,750 %, Perpetual *	112	0,10
200	Bayer AG, 2,375 %, fällig 12.11.2079 *	198	0,18
350	Hannover Finance Luxembourg SA, 5,750 %, fällig 14.09.2040 *	351	0,32
1.950	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0,050 %, fällig 18.12.2029	2.000	1,81
300	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 6,250 %, fällig 26.05.2042 *	329	0,30
400	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, fällig 26.05.2049 *	464	0,42
1.020	NRW Bank, 0,375 %, fällig 16.05.2029	1.068	0,97
900	Volkswagen Leasing GmbH, 0,021 %, fällig 06.07.2021 *	899	0,82
1.100	Vonovia Finance BV, 0,061 %, fällig 22.12.2022 *	1.098	1,00
		6.623	6,01
Israel — 0,29 % (29. Februar 2020: 0,27 %)			
USD 370	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, fällig 18.12.2022	301	0,27
USD 10	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21.07.2023	8	0,01
USD 10	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	7	0,01
		316	0,29
Italien — 0,54 % (29. Februar 2020: 0,72 %)			
620	UniCredit SpA, 2,000 %, fällig 23.09.2029 *	596	0,54
Japan — 0,59 % (29. Februar 2020: 0,53 %)			
300	Asahi Group Holdings Ltd, 1,151 %, fällig 19.09.2025	309	0,28
340	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 0,680 %, fällig 26.01.2023	346	0,31
		655	0,59
Jersey — 0,26 % (29. Februar 2020: 0,24 %)			
290	LHC3 Plc, 4,125 %, fällig 15.08.2024	290	0,26
Luxemburg — 1,24 % (29. Februar 2020: 1,13 %)			
528	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,200 %, fällig 24.07.2025	554	0,50
260	Prologis International Funding II SA, 2,375 %, fällig 14.11.2030	302	0,27
500	SELP Finance Sarl, 1,500 %, fällig 20.11.2025	515	0,47
		1.371	1,24
Niederlande — 2,30 % (29. Februar 2020: 2,40 %)			
850	ABN AMRO Bank NV, 7,125 %, fällig 06.07.2022	958	0,87
200	Cooperatieve Rabobank UA, 6,625 %, Perpetual *	208	0,19
320	Enexis Holding NV, 0,750 %, fällig 02.07.2031	332	0,30
300	ING Groep NV, 3,000 %, fällig 11.04.2028 *	318	0,29
560	IPD 3 BV, 4,500 %, fällig 15.07.2022 *	518	0,47
USD 10	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144A, 2,700 %, fällig 01.05.2025	9	0,01
USD 40	Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030	37	0,03
USD 170	Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	152	0,14
		2.532	2,30
Norwegen — 1,26 % (29. Februar 2020: 1,45 %)			
1.030	DNB Bank ASA, 0,050 %, fällig 14.11.2023	1.035	0,94
350	DNB Bank ASA, 1,250 %, fällig 01.03.2027 *	355	0,32
		1.390	1,26
Polen — 0,47 % (29. Februar 2020: 0,42 %)			
520	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA, 0,750 %, fällig 25.07.2021	522	0,47
Singapur — 0,49 % (29. Februar 2020: 0,47 %)			
500	Temasek Financial I Ltd, 1,250 %, fällig 20.11.2049	537	0,49
Südafrika — 0,30 % (29. Februar 2020: 0,26 %)			
310	Anglo American Capital Plc, 1,625 %, fällig 18.09.2025	326	0,30
Spanien — 0,63 % (29. Februar 2020: 0,90 %)			
300	Banco Santander SA, 2,500 %, fällig 18.03.2025	319	0,29
440	Tendam Brands SAU, 5,250 %, fällig 15.09.2024 *	371	0,34
		690	0,63
Supranational — 4,17 % (29. Februar 2020: 8,08 %)			
780	African Development Bank, 0,500 %, fällig 21.03.2029	820	0,74
3.480	European Stability Mechanism, Series EUR, 0,750 %, fällig 05.09.2028	3.778	3,43
4.598	4,17		
Schweden — 0,85 % (29. Februar 2020: 1,76 %)			
760	Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, fällig 02.03.2028 *	775	0,70
160	Verisure Holding AB, 5,000 %, fällig 15.04.2025 *	164	0,15
		939	0,85
Schweiz — 1,63 % (29. Februar 2020: 1,93 %)			
230	Credit Suisse Group AG, 3,250 %, fällig 02.04.2026 *	258	0,23
160	Holcim Finance Luxembourg SA, 3,000 %, Perpetual *	165	0,15
450	UBS AG, 4,750 %, fällig 12.02.2026 *	459	0,42
330	UBS Group AG, 1,750 %, fällig 16.11.2022	343	0,31
550	UBS Group AG, 1,500 %, fällig 30.11.2024	575	0,52
		1.8001,63	
Großbritannien — 5,64 % (29. Februar 2020: 4,80 %)			
373	Aviva Plc, 6,125 %, fällig 05.07.2043 *	427	0,39
100	Aviva Plc, 3,375 %, fällig 04.12.2045 *	109	0,10
360	Barclays Plc, 3,375 %, fällig 02.04.2025 *	393	0,36
680	BP Capital Markets Plc, 0,900 %, fällig 03.07.2024	701	0,64
390	Informa Plc, 1,500 %, fällig 05.07.2023	389	0,35
270	Leeds Building Society, 1,375 %, fällig 05.05.2022	276	0,25
1.110	Lloyds Banking Group Plc, 0,391 %, fällig 21.06.2024 *	1.114	1,01
530	Natwest Group Plc, 2,500 %, fällig 22.03.2023	559	0,51
GBP 140	Pinewood Finance Co Ltd, 3,250 %, fällig 30.09.2025	159	0,14
420	Rentokil Initial Plc, 0,950 %, fällig 22.11.2024	431	0,39
USD 280	Standard Chartered Plc, 3,950 %, fällig 11.01.2023	246	0,22
580	Standard Chartered Plc, 3,125 %, fällig 19.11.2024	640	0,58
GBP 140	Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250 %, fällig 15.05.2029	168	0,15
100	Wellcome Trust Ltd/The, 1,125 %, fällig 21.01.2027	105	0,09
500	Yorkshire Building Society, 1,250 %, fällig 17.03.2022	508	0,46
		6.225	5,64
USA — 10,93 % (29. Februar 2020: 8,98 %)			
USD 50	3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050	51	0,05
430	AbbVie Inc, 144A, 1,250 %, fällig 01.06.2024	446	0,40
USD 40	Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057	45	0,04
USD 30	American International Group Inc, 2,500 %, fällig 30.06.2025	27	0,02
USD 90	Apple Inc, 1,125 %, fällig 11.05.2025	78	0,07
220	AT&T Inc, 3,550 %, fällig 17.12.2032	275	0,25
720	Bank of America Corp, 1,379 %, fällig 07.02.2025 *	751	0,68
250	Becton Dickinson and Co, 1,000 %, fällig 15.12.2022	253	0,23
420	Berkshire Hathaway Inc, 1,125 %, fällig 16.03.2027	446	0,40
USD 290	Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030	272	0,25
USD 60	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	58	0,05
USD 20	Bristol-Myers Squibb Co, 2,900 %, fällig 26.07.2024	18	0,02
USD 90	Broadcom Inc, 2,250 %, fällig 15.11.2023	79	0,07
USD 70	Broadcom Inc, 3,150 %, fällig 15.11.2025	64	0,06
USD 20	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	20	0,02
790	Citigroup Inc, 1,750 %, fällig 28.01.2025	844	0,77
USD 10	Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	9	0,01
USD 220	Coca-Cola Co/The, 4,200 %, fällig 25.03.2050	243	0,22
USD 10	Coca-Cola Co/The, 2,600 %, fällig 01.06.2050	8	0,01
USD 80	Costco Wholesale Corp, 1,600 %, fällig 20.04.2030	69	0,06
USD 290	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	254	0,23
USD 140	CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	135	0,12
USD 90	Delta Air Lines Inc, 3,800 %, fällig 19.04.2023	72	0,07
USD 170	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	157	0,14
430	DH Europe Finance II Sarl, 1,800 %, fällig 18.09.2049	436	0,40
USD 60	Exxon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15.04.2051	56	0,05
USD 20	Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig 01.08.2030	18	0,02
USD 200	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	189	0,17

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) €	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
520	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, fällig 27.07.2023	548	0,50
540	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,125 %, fällig 30.09.2024	578	0,52
USD 50	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01.04.2025	46	0,04
680	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, fällig 01.11.2028	754	0,68
USD 70	Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	65	0,06
USD 20	Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	19	0,02
USD 210	Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	201	0,18
580	John Deere Bank SA, 0,000 %, fällig 03.10.2022 *	578	0,52
USD 60	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	54	0,05
USD 110	JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	99	0,09
USD 50	Lowe's Cos Inc, 5,125 %, fällig 15.04.2050	57	0,05
USD 20	McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	19	0,02
USD 70	McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	71	0,06
USD 230	Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	223	0,20
USD 120	Netflix Inc, 5,375 %, fällig 01.02.2021	103	0,09
USD 120	Netflix Inc, 5,500 %, fällig 15.02.2022	106	0,10
USD 40	Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01.05.2050	48	0,04
USD 90	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	85	0,08
USD 50	PayPal Holdings Inc, 1,350 %, fällig 01.06.2023	43	0,04
USD 50	PayPal Holdings Inc, 1,650 %, fällig 01.06.2025	44	0,04
USD 50	Procter & Gamble Co/The, 3,600 %, fällig 25.03.2050	53	0,05
450	Prologis Euro Finance LLC, 1,875 %, fällig 05.01.2029	500	0,45
USD 40	Raytheon Technologies Corp, 2,250 %, fällig 01.07.2030	36	0,03
USD 40	State Street Corp, 144A, 3,152 %, fällig 30.03.2031 *	38	0,04
USD 30	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01.02.2031	25	0,02
USD 60	Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig 04.05.2030	52	0,05
USD 50	T-Mobile USA Inc, 4,000 %, fällig 15.04.2022	44	0,04
USD 110	T-Mobile USA Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.04.2030	106	0,10
USD 20	UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, fällig 15.07.2025	19	0,02
USD 90	US Bancorp, 1,450 %, fällig 12.05.2025	78	0,07
USD 50	Visa Inc, 2,050 %, fällig 15.04.2030	44	0,04
USD 60	Visa Inc, 2,700 %, fällig 15.04.2040	54	0,05
930	Wells Fargo & Co, 0,167 %, fällig 26.04.2021 *	933	0,85
390	Wells Fargo & Co, 2,250 %, fällig 02.05.2023	412	0,37
450	Wells Fargo & Co, 1,625 %, fällig 02.06.2025	475	0,43
USD 70	WPX Energy Inc, 8,250 %, fällig 01.08.2023	66	0,06
		12.049	10,93
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 46.594 EUR)		48.276	43,77
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 47,30 % (29. Februar 2020: 50,18 %)			
Belgien — 3,23 % (29. Februar 2020: 3,38 %)			
2.020	Kingdom of Belgium Government Bond, Series 71, 3,750 %, fällig 22.06.2045	3.565	3,23
China — 1,13 % (29. Februar 2020: 1,12 %)			
680	China Government International Bond, 1,000 %, fällig 12.11.2039	661	0,60
590	Export-Import Bank of China/The, 0,300 %, fällig 06.03.2022	590	0,53
		1.251	1,13
Frankreich — 10,80 % (29. Februar 2020: 9,82 %)			
1.900	French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,850 %, fällig 25.07.2027 β	2.592	2,35
860	French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 144A, 1,800 %, fällig 25.07.2040 β	1.639	1,49
1.995	French Republic Government Bond OAT, 3,250 %, fällig 25.05.2045	3.307	3,00
130	French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 144A, 0,100 %, fällig 25.07.2047 β	174	0,16
880	French Republic Government Bond OAT, 144A, 1,500 %, fällig 25.05.2050	1.108	1,00
590	French Republic Government Bond OAT, 4,000 %, fällig 25.04.2060	1.282	1,16
1.600	UNEDIC ASSEO, 1,250 %, fällig 25.05.2033	1.811	1,64
		11.913	10,80
Deutschland — 4,34 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
4.080	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2027	4.314	3,91
330	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 98, 4,750 %, fällig 04.07.2028	471	0,43
		4.785	4,34
Indonesien — 2,45 % (29. Februar 2020: 0,87 %)			
240	Indonesia Government International Bond, 1,450 %, fällig 18.09.2026	244	0,22
530	Indonesia Government International Bond, 0,900 %, fällig 14.02.2027	521	0,47
USD 1.950	Indonesia Government International Bond, 4,200 %, fällig 15.10.2050	1.934	1,76
		2.699	2,45
Italien — 11,53 % (29. Februar 2020: 13,91 %)			
2.650	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4,500 %, fällig 01.03.2024	3.047	2,76
940	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,000 %, fällig 01.12.2025	1.013	0,92
1.900	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 0,400 %, fällig 15.05.2030 β	1.919	1,74
480	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 2,550 %, fällig 15.09.2041 β	729	0,66
4.725	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,250 %, fällig 01.09.2046	6.008	5,45
		12.716	11,53
Kuwait — 0,45 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
USD 520	Kuwait International Government Bond, 3,500 %, fällig 20.03.2027	495	0,45
Mexiko — 0,81 % (29. Februar 2020: 0,98 %)			
580	Mexico Government International Bond, 1,375 %, fällig 15.01.2025	585	0,53
310	Mexico Government International Bond, 1,750 %, fällig 17.04.2028	309	0,28
894	0,81		
Katar — 0,49 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
USD 480	Qatar Government International Bond, 4,625 %, fällig 02.06.2046	540	0,49
Rumänien — 0,67 % (29. Februar 2020: 0,64 %)			
780	Romanian Government International Bond, 2,000 %, fällig 28.01.2032	737	0,67
Saudi Arabien — 0,60 % (29. Februar 2020: 0,55 %)			
640	Saudi Government International Bond, 2,000 %, fällig 09.07.2039	663	0,60
Südkorea — 1,05 % (29. Februar 2020: 0,95 %)			
1.150	Export-Import Bank of Korea, 0,375 %, fällig 26.03.2024	1.161	1,05
Spanien — 7,93 % (29. Februar 2020: 8,57 %)			
1.350	Spain Government Bond, 0,450 %, fällig 31.10.2022	1.377	1,25
1.600	Spain Government Bond, 144A, 1,300 %, fällig 31.10.2026	1.737	1,57
790	Spain Government Bond, 144A, 1,400 %, fällig 30.04.2028	868	0,79
1.330	Spain Government Bond, 144A, 2,900 %, fällig 31.10.2046	1.871	1,70
2.110	Spain Government Bond, Series 30Y, 144A, 2,700 %, fällig 31.10.2048	2.890	2,62
		8.743	7,93
Vereinigte Arabische Emirate — 0,50 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
USD 540	Abu Dhabi Government International Bond, 3,875 %, fällig 16.04.2050	557	0,50
USA — 1,32 % (29. Februar 2020: 3,45 %)			
USD 550	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, fällig 15.02.2049 b	654	0,60
USD 810	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,250 %, fällig 15.02.2050 b	796	0,72
		1.450	1,32
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 48.558 EUR)		52.169	47,30
Kollektive Kapitalanlagen — 2,83 % (29. Februar 2020: 0,58 %)			
USD 3.721	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	3.127	2,83
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Kosten 3.225 EUR)		3.127	2,83
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 98.377 EUR)		103.572	93,90
Devisenterminkontrakte — 0,19 % (29. Februar 2020: 0,09 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		209	0,19
Termingeschäfte — 0,17 % (29. Februar 2020: 0,71 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		183	0,17
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		103.964	94,26
Geschriebene Optionen — 0,05 % (29. Februar 2020: (0,12 %))			
-	Euro-Bund Oktober 2020 Put 172,00, fällig 25.09.2020	(11)	(0,01)
USD –	U.S. Bond Oktober 2020 Put 175,00, fällig 25.09.2020	(14)	
USD (1.240)	USD Put/NOK Call 9,00, fällig 25.09.2020	(28)	(0,01)
Geschriebene Optionen insgesamt (Kosten (36) EUR)		1.236	0,07
Kreditausfallversicherungen — (0,09 %) (29. Februar 2020: (0,06 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(98)	(0,09)
Devisenterminkontrakte — (0,02 %) (29. Februar 2020: (0,04 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(24)	(0,02)
Termingeschäfte — (0,08 %) (29. Februar 2020: (0,91 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(86)	(0,08)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		(261)	(0,24)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		103.703	94,02

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto-inventar-werts
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	6.594	5,98
Gesamtnettovermögen	€110.297	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1,000 EUR, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 20.090.000 USD und machten 18.22% des Nettovermögens aus.

* Variabler Sicherheitstarif. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (VPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihzins entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

GBP – Britisches Pfund Sterling

USD – US-Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	90,75
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,83
Finanzderivate	0,35
Sonstige Vermögenswerte	6,88
Gesamtvermögen	100,00

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/ Verkaufssi-cherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 %	Kauf	20.06.2025	4.450	€ (98)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Kreditausfallversicherungen (29. Februar 2020 (in Tsd.):– EUR)					€ (98)
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (77) EUR)					–
Apreciación neta de swaps de tipos de interés (29. Februar 2020 (miles): (77) EUR)					€ (98)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	SEK	18.300	Verkauf	EUR	1.778	€ (7)
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	NOK	22.577	Verkauf	EUR	2.131	31
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	EUR	6.967	Verkauf	USD	8.239	75
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	EUR	153	Verkauf	AUD	252	(3)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	EUR	1.996	Verkauf	GBP	1.795	12
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	EUR	5.668	Verkauf	USD	6.682	79
19.11.2020	UBS	Kauf	SEK	3.981	Verkauf	EUR	388	(2)
19.11.2020	UBS	Kauf	EUR	1.572	Verkauf	USD	1.851	24
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 116 EUR)								€ 209
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (56) EUR)								(24)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 60 EUR)								€ 185

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertstei-gerung/(Wert-minderung) von Kontrakten (in Tsd.
Australie 10 Year Bond September 2020	22	€ 1.999	€ 1
Canadian 10 Year Bond Dezember 2020	3	291	(2)
Euro-BTP September 2020	(17)	(2.495)	12
Euro-Bund September 2020	26	4.568	(3)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2020	(25)	(5.416)	(25)
Euro-OAT September 2020	8	1.341	12
Long Gilt Dezember 2020	(21)	(3.181)	30
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	(256)	(29.926)	62
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2020	(13)	(1.736)	15
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	221	23.401	22
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	(12)	(1.763)	29
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	10	1.835	(56)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 881 EUR)			€ 183
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(1.133) EUR)			(86)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (252) EUR)			€ 97

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 0,55 % (29. Februar 2020: 0,50 %)			
54	New Century Home Equity Loan Trust 2003-6, Series 2003 6, Klasse M1, 1,255 %, fällig 25.01.2034 *	52	0,19
94	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Series 2007 FXD1, Klasse 3A4, 5,860 %, fällig 25.01.2037	96	0,36
Asset-Backed Securities insgesamt (Kosten 143 USD)		148	0,55
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 2,74 % (29. Februar 2020: 6,08 %)			
88	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Series 2004 AR1, Klasse 6M2, 1,775 %, fällig 25.02.2034 *	88	0,33
260	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2017 DNA3, Klasse B1, 4,625 %, fällig 25.03.2030 *	263	0,99
47	Impac CMB Trust Series 2004-6, Series 2004 6, Klasse 2A, 6,060 %, fällig 25.10.2034	50	0,18
139	Lehman XS Trust Series 2006-12N, Series 2006 12N, Klasse A31A, 0,375 %, fällig 25.08.2046 *	130	0,49
67	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2003-A1, Series 2003 A1, Klasse M, 6,558 %, fällig 25.05.2033 *	59	0,22
70	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Series 2005 8XS, Klasse M1, 0,820 %, fällig 25.04.2035 *	67	0,25
119	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR15 Trust, Series 2005 AR15, Klasse A1C4, 0,575 %, fällig 25.11.2045 *	74	0,28
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 721 USD)		731	2,74
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 82,01 % (29. Februar 2020: 75,47 %)			
Brasilien — 0,21 % (29. Februar 2020: 0,26 %)			
31	Petrobras Global Finance BV, 6,125 %, fällig 17.01.2022	33	0,12
20	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17.03.2024	22	0,09
		55	0,21
Kanada — 2,26 % (29. Februar 2020: 3,46 %)			
80	Cascades Inc/Cascades USA Inc, 5,125 %, fällig 15.01.2026	85	0,32
60	Cenovus Energy Inc, 3,000 %, fällig 15.08.2022	61	0,23
50	Cott Holdings Inc, 5,500 %, fällig 01.04.2025	52	0,19
40	Cott Holdings Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.04.2025	41	0,15
20	GFL Environmental Inc, 144A, 3,750 %, fällig 01.08.2025	20	0,07
90	GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2026	95	0,36
80	GFL Environmental Inc, 144A, 8,500 %, fällig 01.05.2027	87	0,33
66	MEG Energy Corp, 6,500 %, fällig 15.01.2025	67	0,25
100	MEG Energy Corp, 7,125 %, fällig 01.02.2027	96	0,36
		604	2,26
Kaimaninseln — 0,71 % (29. Februar 2020: 0,80 %)			
1	Ambac LSNI LLC, 144A, 6,000 %, fällig 12.02.2023 *	1	0,01
170	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 6,500 %, fällig 15.09.2024	99	0,37
150	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15.09.2024	88	0,33
		188	0,71
Frankreich — 2,35 % (29. Februar 2020: 0,95 %)			
400	Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, fällig 01.05.2026	425	1,59
200	Banijay Entertainment SASU, 5,375 %, fällig 01.03.2025	203	0,76
		628	2,35
Deutschland — 1,09 % (29. Februar 2020: 0,43 %)			
80	Mercer International Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2025	82	0,31
200	Vertical US Newco Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.07.2027	209	0,78
		291	1,09
Israel — 0,42 % (29. Februar 2020: 1,33 %)			
70	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,200 %, fällig 21.07.2021	70	0,26
40	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 144A, 7,125 %, fällig 31.01.2025	43	0,16
		113	0,42
Italien — 1,64 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, fällig 26.06.2024	216	0,81
200	Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303 %, fällig 30.05.2024	221	0,83
		437	1,64
Luxemburg — 1,54 % (29. Februar 2020: 1,94 %)			
200	ARD Finance SA, 6,500 %, fällig 30.06.2027	206	0,77
200	Intelsat Jackson Holdings SA, 8,000 %, fällig 15.02.2024 ξ	204	0,77
		410	1,54
Macau — 1,55 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1	Sands China Ltd, 144A, 3,800 %, fällig 08.01.2026	212	0,79
200	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2026	203	0,76
		415	1,55
Peru — 0,65 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
170	Hudbay Minerals Inc, 7,250 %, fällig 15.01.2023	173	0,65
Südkorea — 0,32 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
80	Clark Equipment Co, 144A, 5,875 %, fällig 01.06.2025	85	0,32
Schweiz — 1,62 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, Perpetual *	216	0,81
200	UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	217	0,81
		433	1,62
Vereinigte Arabische Emirate — 0,63 % (29. Februar 2020: 1,06 %)			
130	DAE Funding LLC, 4,500 %, fällig 01.08.2022	129	0,48
110	Shelf Drilling Holdings Ltd, 8,250 %, fällig 15.02.2025	39	0,15
		168	0,63
Großbritannien — 2,58 % (29. Februar 2020: 4,43 %)			
200	Barclays Bank Plc, 7,625 %, fällig 21.11.2022	223	0,84
EUR 200	Barclays Plc, 8,000 %, Perpetual *	244	0,91
210	Natwest Group Plc, 8,625 %, Perpetual *	221	0,83
		688	2,58
USA — 63,68 % (29. Februar 2020: 58,91 %)			
70	AdaptHealth LLC, 144A, 6,125 %, fällig 01.08.2028	74	0,28
180	ADT Security Corp/The, 4,125 %, fällig 15.06.2023	188	0,71
50	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2026	54	0,20
100	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 6,625 %, fällig 15.07.2026	107	0,40
50	Allison Transmission Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.10.2027	52	0,20
10	Alteryx Inc, 1,000 %, fällig 01.08.2026	10	0,04
–	Ambac Assurance Corp, 144A, 5,100 %, Perpetual	–	–
40	American Axle & Manufacturing Inc, 6,250 %, fällig 01.04.2025	41	0,16
100	American Axle & Manufacturing Inc, 6,250 %, fällig 15.03.2026	102	0,38
140	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp, 5,375 %, fällig 15.09.2024	130	0,49
20	Apache Corp, 4,875 %, fällig 15.11.2027	21	0,08
50	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 4,750 %, fällig 23.08.2022	46	0,17
200	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 6,000 %, fällig 15.02.2025	209	0,78
150	Axalta Coating Systems LLC, 4,875 %, fällig 15.08.2024	154	0,58
50	Bank of America Corp, Series FF, 5,875 %, Perpetual *	55	0,21
170	Bausch Health Cos Inc, 7,000 %, fällig 15.03.2024	177	0,66
140	Bausch Health Cos Inc, 6,125 %, fällig 15.04.2025	144	0,54
40	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2027	43	0,16
90	Berry Petroleum Co LLC, 7,000 %, fällig 15.02.2026	74	0,28
90	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	74	0,28
30	Blackstone Mortgage Trust Inc, 4,375 %, fällig 05.05.2022	29	0,11
180	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 6,125 %, fällig 15.11.2022	180	0,67
140	Boyne USA Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.05.2025	149	0,56
40	Builders FirstSource Inc, 144A, 6,750 %, fällig 01.06.2027	44	0,16
40	BY Crown Parent LLC / BY Bond Finance Inc, 144A, 4,250 %, fällig 31.01.2026	41	0,15
190	Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.07.2025	202	0,76
70	Carriage Services Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.06.2026	74	0,28
320	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 5,375 %, fällig 01.05.2025	330	1,24
70	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,125 %, fällig 01.05.2027	75	0,28
30	CD&R Smokey Buyer Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.07.2025	32	0,12
80	CDW LLC / CDW Finance Corp, 4,125 %, fällig 01.05.2025	84	0,31
40	Centene Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01.06.2026	42	0,16
100	Centene Corp, 144A, 5,375 %, fällig 15.08.2026	106	0,40
130	Centene Corp, 4,250 %, fällig 15.12.2027	136	0,51
280	Century Communities Inc, 5,875 %, fällig 15.07.2025	292	1,10
90	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	105	0,39
40	Cheniere Energy Inc, 4,250 %, fällig 15.03.2045	27	0,10
170	CHS/Community Health Systems Inc, 8,000 %, fällig 15.03.2026	177	0,66
70	CIT Group Inc, 4,125 %, fällig 09.03.2021	71	0,27
40	Citigroup Inc, Series M, 6,300 %, Perpetual *	43	0,16
200	Clear Channel International BV, 144A, 6,625 %, fällig 01.08.2025	208	0,78
120	Cogent Communications Group Inc, 5,375 %, fällig 01.03.2022	124	0,46
150	CommScope Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.03.2027	162	0,61
100	Comstock Resources Inc, 9,750 %, fällig 15.08.2026	107	0,40
30	Continental Resources Inc/OK, 5,000 %, fällig 15.09.2022	30	0,11
70	Continental Resources Inc/OK, 3,800 %, fällig 01.06.2024	69	0,26

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
40	CoreCivic Inc, 5,000 %, fällig 15.10.2022	40	0,15
50	CoreCivic Inc, 4,625 %, fällig 01.05.2023	48	0,18
50	Covanta Holding Corp, 5,875 %, fällig 01.07.2025	52	0,20
60	CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 5,250 %, fällig 01.06.2025	61	0,23
130	DCP Midstream Operating LP, 4,950 %, fällig 01.04.2022	133	0,50
6	Delta Air Lines 2007-1 Klasse B Pass Through Trust, Series 071B, 8,021 %, fällig 10.08.2022	6	0,02
50	Delta Air Lines Inc, 3,625 %, fällig 15.03.2022	50	0,19
300	Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig 28.10.2024	276	1,03
40	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	44	0,16
190	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	198	0,74
220	DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	233	0,87
180	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	206	0,77
70	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig 15.06.2025	78	0,29
70	Donnelley Financial Solutions Inc, 8,250 %, fällig 15.10.2024	73	0,27
40	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2025	42	0,16
70	Entegris Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2028	73	0,27
210	EQM Midstream Partners LP, 4,000 %, fällig 01.08.2024	211	0,79
30	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000 %, fällig 01.07.2025	32	0,12
80	EQM Midstream Partners LP, 4,125 %, fällig 01.12.2026	78	0,29
30	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, fällig 01.07.2027	33	0,12
10	EQM Midstream Partners LP, 5,500 %, fällig 15.07.2028	10	0,04
70	EQT Corp, 7,875 %, fällig 01.02.2025	80	0,30
50	ESH Hospitality Inc, 144A, 5,250 %, fällig 01.05.2025	51	0,19
80	ESH Hospitality Inc, 5,250 %, fällig 01.05.2025	81	0,30
50	Exterran Energy Solutions LP / EES Finance Corp, 8,125 %, fällig 01.05.2025	43	0,16
110	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 7,875 %, fällig 15.11.2025	111	0,42
80	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21.04.2023	89	0,33
80	Ford Motor Co, 9,000 %, fällig 22.04.2025	94	0,35
200	Ford Motor Credit Co LLC, 3,087 %, fällig 09.01.2023	199	0,75
200	Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, fällig 16.06.2025	210	0,79
110	Forestar Group Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.04.2024	117	0,44
420	Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, fällig 14.11.2024	454	1,70
50	GEO Group Inc/The, 5,125 %, fällig 01.04.2023	41	0,16
110	GEO Group Inc/The, 5,875 %, fällig 15.10.2024	87	0,33
20	GEO Group Inc/The, 6,000 %, fällig 15.04.2026	15	0,06
100	Golden Nugget Inc, 6,750 %, fällig 15.10.2024	85	0,32
50	Golden Nugget Inc, 8,750 %, fällig 01.10.2025	37	0,14
150	Greif Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.03.2027	160	0,60
150	Hanesbrands Inc, 4,625 %, fällig 15.05.2024	158	0,59
60	Hanesbrands Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.05.2025	64	0,24
50	Hanesbrands Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15.05.2026	55	0,20
240	HCA Inc, 5,375 %, fällig 01.02.2025	271	1,01
80	Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.05.2025	84	0,31
50	Howard Hughes Corp/The, 144A, 5,375 %, fällig 01.08.2028	51	0,19
40	IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2025	43	0,16
100	Iron Mountain Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.07.2028	104	0,39
50	iStar Inc, 4,250 %, fällig 01.08.2025	49	0,18
70	j2 Cloud Services LLC / j2 Cloud Co-Obligor Inc, 6,000 %, fällig 15.07.2025	73	0,27
210	L Brands Inc, 5,625 %, fällig 15.10.2023	219	0,82
90	L Brands Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.07.2025	98	0,37
50	L Brands Inc, 144A, 9,375 %, fällig 01.07.2025	58	0,22
50	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 5,250 %, fällig 15.03.2022	50	0,19
70	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2027	64	0,24
120	Lamb Weston Holdings Inc, 4,625 %, fällig 01.11.2024	126	0,47
43	Lehman Escrow Receipt, Null-Coupon, Perpetual †∞	1	–
100	Lennar Corp, 4,875 %, fällig 15.12.2023	108	0,40
60	Lennar Corp, 4,500 %, fällig 30.04.2024	65	0,24
50	Lennar Corp, 4,750 %, fällig 29.11.2027	57	0,21
90	Levi Strauss & Co, 5,000 %, fällig 01.05.2025	92	0,35
40	LifePoint Health Inc, 4,375 %, fällig 15.02.2027	40	0,15
100	Lions Gate Capital Holdings LLC, 6,375 %, fällig 01.02.2024	103	0,38
40	MGIC Investment Corp, 5,250 %, fällig 15.08.2028	42	0,16
50	Michaels Stores Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.07.2027	51	0,19
50	Microchip Technology Inc, 144A, 4,250 %, fällig 01.09.2025	52	0,20
70	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	73	0,27
100	Mohegan Gaming & Entertainment, 7,875 %, fällig 15.10.2024 †	95	0,36
130	Montage Resources Corp, 8,875 %, fällig 15.07.2023	133	0,50
70	Murphy Oil USA Inc, 5,625 %, fällig 01.05.2027	74	0,28
40	Navient Corp, 6,750 %, fällig 15.06.2026	42	0,16
60	Navient Corp, 5,000 %, fällig 15.03.2027	58	0,22
100	NCL Corp Ltd, 144A, 12,250 %, fällig 15.05.2024	112	0,42
50	NCL Corp Ltd, 3,625 %, fällig 15.12.2024	34	0,13
90	NCL Corp Ltd, 144A, 10,250 %, fällig 01.02.2026	91	0,34
90	NMI Holdings Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2025	97	0,36
170	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, fällig 15.01.2023 † ε	33	0,12
20	Occidental Petroleum Corp, 1,730 %, fällig 15.08.2022 *	19	0,07
50	Occidental Petroleum Corp, 2,700 %, fällig 15.02.2023	48	0,18
80	Occidental Petroleum Corp, 2,900 %, fällig 15.08.2024	74	0,28
70	Occidental Petroleum Corp, 5,875 %, fällig 01.09.2025	71	0,26
40	Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, fällig 15.03.2026	39	0,15
70	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.04.2026	77	0,29
150	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 5,750 %, fällig 15.04.2026	166	0,62
70	QEP Resources Inc, 6,875 %, fällig 01.03.2021	72	0,27
150	Quicken Loans LLC, 5,750 %, fällig 01.05.2025	155	0,58
90	Range Resources Corp, 4,875 %, fällig 15.05.2025	84	0,32
30	Range Resources Corp, 144A, 9,250 %, fällig 01.02.2026	32	0,12
80	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15.06.2025	84	0,32
120	Resolute Forest Products Inc, 5,875 %, fällig 15.05.2023	119	0,44
99	RR Donnelley & Sons Co, 8,250 %, fällig 01.07.2027	99	0,37
80	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 5,625 %, fällig 01.12.2025	81	0,31
150	Seagate HDD Cayman, 4,875 %, fällig 01.03.2024	165	0,62
130	ServiceMaster Co LLC/The, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2024	133	0,50
70	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2025	72	0,27
70	Signature Aviation US Holdings Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.05.2026	72	0,27
120	Silversea Cruise Finance Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 01.02.2025	121	0,45
40	Silversea Cruise Finance Ltd, 7,250 %, fällig 01.02.2025	40	0,15
200	Sprint Communications Inc, 11,500 %, fällig 15.11.2021	223	0,84
50	Sprint Communications Inc, 6,000 %, fällig 15.11.2022	54	0,20
125	Sprint Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2023	146	0,55
160	Sprint Corp, 7,125 %, fällig 15.06.2024	186	0,70
70	Starwood Property Trust Inc, 5,000 %, fällig 15.12.2021	71	0,27
30	StoneX Group Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.06.2025	33	0,12
120	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp, 144A, 5,250 %, fällig 15.01.2029	126	0,47
120	SunOpta Foods Inc, 144A, 9,500 %, fällig 09.10.2022	123	0,46
40	Surgery Center Holdings Inc, 144A, 10,000 %, fällig 15.04.2027	43	0,16
18	Taylor Morrison Communities Inc, 6,000 %, fällig 01.09.2023	19	0,07
10	Taylor Morrison Communities Inc, 5,875 %, fällig 31.01.2025	10	0,04
50	Taylor Morrison Communities Inc / Taylor Morrison Holdings II Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.04.2023	53	0,20
270	Tenet Healthcare Corp, 6,750 %, fällig 15.06.2023	288	1,08
80	Tenet Healthcare Corp, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2025	88	0,33
110	T-Mobile USA Inc, 6,000 %, fällig 15.04.2024	112	0,42
40	TopBuild Corp, 144A, 5,625 %, fällig 01.05.2026	42	0,16
30	TransDigm Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.12.2025	33	0,12
70	TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	74	0,28
50	United Airlines Holdings Inc, 4,250 %, fällig 01.10.2022	46	0,17
100	United Rentals North America Inc, 4,625 %, fällig 15.10.2025	102	0,38
100	United Rentals North America Inc, 5,500 %, fällig 15.05.2027	107	0,40
60	Univision Communications Inc, 144A, 9,500 %, fällig 01.05.2025	66	0,25
10	US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig 15.07.2027	11	0,04
220	Viking Cruises Ltd, 6,250 %, fällig 15.05.2025	159	0,60
110	Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15.05.2025	122	0,46

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
50	Western Digital Corp, 4,750 %, fällig 15.02.2026	54	0,20
60	Western Midstream Operating LP, 4,000 %, fällig 01.07.2022	61	0,23
220	Western Midstream Operating LP, 4,100 %, fällig 01.02.2025	220	0,82
10	Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig 01.06.2025	10	0,04
20	William Carter Co/The, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2025	21	0,08
120	William Carter Co/The, 144A, 5,625 %, fällig 15.03.2027	126	0,47
20	Williams Cos Inc/The, Series A, 7,500 %, fällig 15.01.2031	26	0,10
10	WPX Energy Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2022	10	0,04
160	WPX Energy Inc, 8,250 %, fällig 01.08.2023	180	0,68
120	WW International Inc, 144A, 8,625 %, fällig 01.12.2025	127	0,47
70	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,750 %, fällig 15.04.2025	74	0,28
50	XHR LP, 144A, 6,375 %, fällig 15.08.2025	51	0,19
100	XPO Logistics Inc, 6,750 %, fällig 15.08.2024	107	0,40
110	XPO Logistics Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.05.2025	118	0,44
		16.990	63,68
Sambia — 0,76 % (29. Februar 2020: 0,91 %)			
200	First Quantum Minerals Ltd, 7,250 %, fällig 01.04.2023	204	0,76
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 21.393 USD)		21.882	82,01
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 0,38 % (29. Februar 2020: 0,47 %)			
Argentinien — 0,38 % (29. Februar 2020: 0,47 %)			
210	Argentine Republic Government International Bond, 5,625 %, fällig 26.01.2022 ƹ	101	0,38
Total des obligations et bons d'État (Coût198 USD)		101	0,38
Schuldverschreibungen — 9,32 % (29. Februar 2020: 9,59 %)			
70	8Th Avenue Food & Provisions Inc, 7,912 %, fällig 01.10.2026 *	69	0,26
50	Academy Ltd, 5,000 %, fällig 02.07.2022 * †	47	0,18
40	ACProducts Inc, 7,500 %, fällig 02.09.2025 *	40	0,15
40	Acrisure LLC, 3,661 %, fällig 15.02.2027 *	38	0,14
38	Advantage Sales & Marketing Inc, 4,250 %, fällig 25.07.2021 * †	37	0,14
107	Air Medical Group Holdings Inc, 4,250 %, fällig 28.04.2022 *	106	0,40
80	Allen Media LLC, 5,801 %, fällig 10.02.2027 *	77	0,29
86	AppLovin Corporation, 4,161 %, fällig 15.08.2025 *	85	0,32
70	Beta Sub LLC, 4,661 %, fällig 06.08.2026 *	70	0,26
25	Boyd Gaming Corp, 2,372 %, fällig 15.09.2023 *	24	0,09
70	Caesars Resort Collection LLC, 4,703 %, fällig 19.06.2025 *	68	0,25
50	Chesapeake Energy Corp, – %, fällig 23.06.2024 *	33	0,12
59	Corrections Corporation of America, 5,500 %, fällig 12.12.2024 *	58	0,22
99	CWGS Group LLC, 3,500 %, fällig 08.11.2023 *	96	0,36
50	DCert Buyer, Inc., 4,161 %, fällig 08.08.2026 *	49	0,18
60	Delta Air Lines Inc, 5,750 %, fällig 29.04.2023 *	60	0,22
40	Douglas Dynamics LLC, 4,750 %, fällig 08.06.2026 *	40	0,15
50	Equinox Holdings Inc, 10,000 %, fällig 08.03.2024 *	50	0,19
81	Eyecare Partners LLC, 4,822 %, fällig 05.02.2027 *	76	0,28
19	Eyecare Partners LLC, 0,500 %, fällig 05.02.2027 *	18	0,07
60	Eyecare Partners LLC, 8,558 %, fällig 21.01.2027 *	56	0,21
16	GlobalTranz Enterprises Inc, 5,158 %, fällig 02.05.2026 *	13	0,05
6	iHeartCommunications Inc, 3,161 %, fällig 01.05.2026 *	6	0,02
40	JetBlue Airways Corp, 6,250 %, fällig 17.06.2024 *	40	0,15
133	Leslie's Poolmart Inc, 3,661 %, fällig 16.08.2023 *	131	0,49
79	Medical Solutions Holdings Inc, 5,500 %, fällig 14.06.2024 *	77	0,29
50	Michaels Stores Inc, 3,500 %, fällig 28.01.2023 *	48	0,18
60	Mohegan Tribal Gaming Authority, 5,375 %, fällig 13.10.2023 * †	54	0,20
50	Panther BF Aggregator 2 LP, 3,667 %, fällig 18.03.2026 *	49	0,18
60	Particle Investments S.a.r.l., 5,750 %, fällig 11.05.2027 *	60	0,22
78	Pisces Midco Inc, 3,918 %, fällig 29.03.2025 *	77	0,29
40	Radiology Partners Inc, 5,985 %, fällig 09.07.2025 *	38	0,14
39	Radnet Management Inc, 4,750 %, fällig 01.07.2023 *	39	0,15
35	RegionalCare Hospital Partners Holding, 3,911 %, fällig 16.11.2025 *	35	0,13
–	Reynolds Consumer Products LLC, 1,911 %, fällig 04.02.2027 *	–	–
31	Sally Holdings LLC, 2,420 %, fällig 05.07.2024 *	30	0,11
59	Scientific Games International Inc, 3,612 %, fällig 14.08.2024 *	55	0,21
50	Sotera Health Holdings LLC, 5,500 %, fällig 22.11.2026 *	50	0,19
20	Spencer Spirit IH LLC, 6,244 %, fällig 14.06.2026 * †	17	0,07
80	TransDigm Group Inc, 2,411 %, fällig 09.12.2025 *	76	0,28
70	U.S. Renal Care Inc, 5,187 %, fällig 14.06.2026 *	68	0,26
60	United Airlines, 6,250 %, fällig 25.06.2027 *	61	0,23
41	Univision Communications Inc, 4,750 %, fällig 24.03.2026 *	41	0,15
40	Verscend Holding Corp, 4,661 %, fällig 27.08.2025 *	40	0,15
40	Vertex Aerospace Services Corp, 4,661 %, fällig 29.06.2025 *	39	0,15
40	Vertical U.S. Newco Inc, 0,000 %, fällig 30.06.2027 *	40	0,15
110	Windstream Services LLC, 0,000 %, fällig 11.08.2027 *	107	0,40
Summe Darlehensschuldverschreibungen (Anschaffungskosten 2.518 USD)		2.488	9,32
Stammaktien — 0,05 % (29. Februar 2020: 0,04 %)			
USA — 0,05 % (29. Februar 2020: 0,04 %)			
–	Berry Corp	1	0,01
2	Montage Resources Corp	12	0,04
		13	0,05
Stammaktien insgesamt (Kosten 71 USD)		13	0,05
Vorzugsaktien — 0,83 % (29. Februar 2020: 1,18 %)			
USA — 0,83 % (29. Februar 2020: 1,18 %)			
1	B Riley Financial Inc	25	0,09
8	GMAC Capital Trust I, Series 2	196	0,74
		221	0,83
Vorzugsaktien insgesamt (Kosten 221 USD)		221	0,83
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 25.265 USD)		25.584	95,88
Contratos de divisas a término — 0,06 % (29. Februar 2020 :0,03 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		17	0,06
Termingeschäfte — 0,04 % (29. Februar 2020: 0,06 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		11	0,04
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		25.612	95,98
Devisenterminkontrakte — (0,04 %) (29. Februar 2020 :(0,03 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(12)	(0,04)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(12)	(0,04)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		25.600	95,94
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		1.083	4,06
Gesamtnettovermögen		$26.683	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 7.432.000 USD, soit 27,84 % de l'actif net.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

† Illiquide.

∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

ƹ Das Wertpapier ist zum oder seit Ende des Berichtszeitraums am 31. August 2020 in Verzug (entweder Tilgungs- und / oder Zinszahlungen).

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

EUR – Euro

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	84,84
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	9,14
Finanzderivate	0,10
Sonstige Vermögenswerte	5,92
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	AUD	–	$ –
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.087	Verkauf	USD	1.283	14
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	42	Verkauf	USD	30	1
16.10.2020	Citi	Kauf	USD	206	Verkauf	CAD	280	(9)
16.10.2020	Citi	Kauf	CAD	279	Verkauf	USD	212	2
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	224	Verkauf	EUR	190	(3)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 6 USD)								$ 17
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (6) USD)								(12)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								$ 5

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	(28)	$ (3.899)	$ 4
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	44	5.545	7
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 13 USD)			$ 11
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(30) USD))			-
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (17) USD))			$ 11

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 0,57 % (29. Februar 2020: 0,56 %)			
1.750	Hertz Vehicle Financing II LP, Series 2017 2A, Klasse B, 144A, 4,200 %, fällig 25.10.2023	1.748	0,26
2.479	HSI Asset Securitization Corp Trust 2007-OPT1, Series 2007 OPT1, Klasse 1A, 0,315 %, fällig 25.12.2036 *	2.076	0,31
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 3.757 USD)		3.824	0,57
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 3,28 % (29. Februar 2020: 4,93 %)			
513	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series 2006-C5, Series 2006 C5, Klasse AJ, 5,373 %, fällig 15.12.2039	229	0,03
2.862	CSMC Series 2015-2R, Series 2015 2R, Klasse 7A2, 144A, 3,374 %, fällig 27.08.2036 *	2.196	0,33
893	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2015 C03, Klasse 2M2, 5,175 %, fällig 25.07.2025 *	918	0,14
2.483	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C01, Klasse 1M2, 3,725 %, fällig 25.07.2029 *	2.553	0,38
789	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Klasse 1M2, 2,325 %, fällig 25.10.2030 *	779	0,12
3.770	Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, Series 2020 DNA1, Klasse B1, 144A, 2,475 %, fällig 25.01.2050 *	3.353	0,50
594	Ginnie Mae II Pool 'MA5399', 4,500 %, fällig 20.08.2048	641	0,10
414	Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5,000 %, fällig 20.01.2049	449	0,07
837	GMACM Mortgage Loan Trust 2005-AF2, Series 2005 AF2, Klasse A1, 6,000 %, fällig 25.12.2035	796	0,12
2.722	Impac Secured Assets Trust 2006-2, Series 2006 2, Klasse 2M3, 1,275 %, fällig 25.08.2036 *	2.536	0,38
5.300	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Series 2018 PHMZ, Klasse M, 144A, 8,370 %, fällig 15.06.2035 *†	4.083	0,61
223	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-CIBC19, Series 2007 CB19, Klasse AJ, 6,068 %, fällig 12.02.2049 *	94	0,01
15	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12, Series 2007 LD12, Klasse AJ, 6,710 %, fällig 15.02.2051 *	14	–
1.850	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-1, Series 2017 1, Klasse M1, 144A, 4,000 %, fällig 25.01.2056 *	1.846	0,27
2.225	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR17 Trust, Series 2005 AR17, Klasse A1C3, 0,655 %, fällig 25.12.2045 *	1.511	0,22
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 24.399 USD)		21.998	3,28
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 50,96 % (29. Februar 2020: 39,39 %)			
Argentinien — 0,29 % (29. Februar 2020: 0,45 %)			
2.270	Pampa Energia SA, 7,500 %, fällig 24.01.2027	1.941	0,29
ARS 400	YPF SA, 16,500 %, fällig 09.05.2022 †	2	–
		1.943	0,29
Belgien — 0,62 % (29. Februar 2020: 0,36 %)			
2.090	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, fällig 01.02.2046	2.589	0,39
480	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	560	0,08
40	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439 %, fällig 06.10.2048	47	0,01
790	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01.06.2050	958	0,14
		4.154	0,62
Brasilien — 3,72 % (29. Februar 2020: 3,45 %)			
2.250	Braskem America Finance Co, 7,125 %, fällig 22.07.2041	2.419	0,36
1.710	Braskem Finance Ltd, 5,375 %, fällig 02.05.2022	1.766	0,26
3.820	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 6,125 %, Perpetual *	3.722	0,56
6.494	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17.03.2024	7.191	1,07
1.310	Suzano Austria GmbH, 5,750 %, fällig 14.07.2026	1.501	0,22
1.790	Suzano Austria GmbH, 5,000 %, fällig 15.01.2030	1.914	0,29
3.550	Ultrapar International SA, 144A, 5,250 %, fällig 06.10.2026	3.811	0,57
2.210	Vale Overseas Ltd, 6,250 %, fällig 10.08.2026	2.629	0,39
		24.953	3,72
Kanada — 0,89 % (29. Februar 2020: 0,88 %)			
2.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.01.2028	2.053	0,31
2.790	MEG Energy Corp, 7,125 %, fällig 01.02.2027	2.676	0,40
460	Open Text Corp, 144A, 3,875 %, fällig 15.02.2028	474	0,07
740	Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2030	769	0,11
		5.972	0,89
China — 0,45 % (29. Februar 2020: 0,39 %)			
2.580	Prosus NV, 4,850 %, fällig 06.07.2027	2.988	0,45
Kolumbien — 0,58 % (29. Februar 2020: 0,52 %)			
3.680	Millicom International Cellular SA, 5,125 %, fällig 15.01.2028	3.868	0,58
Frankreich — 1,39 % (29. Februar 2020: 0,05 %)			
3.290	BNP Paribas SA, 7,375 %, Perpetual *	3.751	0,56
EUR 340	Credit Agricole SA, 6,500 %, Perpetual *	419	0,06
EUR 2.000	Mercialys SA, 4,625 %, fällig 07.07.2027	2.436	0,37
EUR 3.040	Novafives SAS, 5,000 %, fällig 15.06.2025	2.687	0,40
		9.293	1,39
Deutschland — 1,03 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 1.200	alstria office REIT-AG, 1,500 %, fällig 23.06.2026	1.440	0,21
EUR 2.200	Bertelsmann SE & Co KGaA, 3,000 %, fällig 23.04.2075 *	2.662	0,40
EUR 820	HT Troplast GmbH, 9,250 %, fällig 15.07.2025	1.061	0,16
EUR 620	Vertical Holdco GmbH, 6,625 %, fällig 15.07.2028	775	0,12
EUR 780	Vertical Midco GmbH, 4,375 %, fällig 15.07.2027	956	0,14
		6.894	1,03
Irland — 0,83 % (29. Februar 2020: 0,76 %)			
490	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,500 %, fällig 15.09.2023	503	0,08
1.420	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2022	1.410	0,21
1.140	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2023	1.089	0,16
2.590	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 15.02.2024	2.556	0,38
		5.558	0,83
Israel — 0,56 % (29. Februar 2020: 0,48 %)			
EUR 1.460	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 6,000 %, fällig 31.01.2025	1.862	0,28
2.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21.07.2023	1.924	0,28
		3.786	0,56
Italien — 1,54 % (29. Februar 2020: 1,24 %)			
EUR 492	International Design Group SPA, 6,500 %, fällig 15.11.2025	565	0,08
EUR 1.750	Intesa Sanpaolo SpA, 7,000 %, Perpetual *	2.127	0,32
EUR 1.400	Intesa Sanpaolo SpA, 5,500 %, Perpetual *	1.658	0,25
1.630	UniCredit SpA, 5,459 %, fällig 30.06.2035 *	1.691	0,25
EUR 3.480	UniCredit SpA, 6,625 %, Perpetual *	4.277	0,64
		10.318	1,54
Jersey — 0,04 % (29. Februar 2020: 0,03 %)			
EUR 220	LHC3 Plc, 4,125 %, fällig 15.08.2024	263	0,04
Kasachstan — 0,66 % (29. Februar 2020: 0,58 %)			
790	KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig 24.04.2030	950	0,14
3.150	KazTransGas JSC, 4,375 %, fällig 26.09.2027	3.493	0,52
		4.443	0,66
Macau — 0,15 % (29. Februar 2020: 0,19 %)			
940	Sands China Ltd, 4,600 %, fällig 08.08.2023	1.008	0,15
Mexiko — 1,49 % (29. Februar 2020: 1,40 %)			
3.130	Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman, 6,875 %, Perpetual *	3.167	0,47
2.470	BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125 %, fällig 18.01.2033 *	2.382	0,36
3.790	Orbia Advance Corp SAB de CV, 5,875 %, fällig 17.09.2044	4.439	0,66
		9.988	1,49
Marokko — 0,56 % (29. Februar 2020: 0,52 %)			
3.530	OCP SA, 4,500 %, fällig 22.10.2025	3.742	0,56
Niederlande — 2,24 % (29. Februar 2020: 1,81 %)			
EUR 1.600	Cooperatieve Rabobank UA, 6,625 %, Perpetual *	1.988	0,30
8.120	ING Groep NV, 6,875 %, Perpetual *	8.579	1,28
EUR 1.300	Maxeda DIY Holding BV, 6,125 %, fällig 15.07.2022	1.498	0,22
270	Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030	298	0,05
950	Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	1.028	0,15
1.510	Trivium Packaging Finance BV, 5,500 %, fällig 15.08.2026	1.596	0,24
		14.987	2,24
Peru — 1,81 % (29. Februar 2020: 1,34 %)			
1.630	Hudbay Minerals Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15.01.2025	1.694	0,25
4.050	Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	5.188	0,77
4.720	Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, fällig 30.04.2028	5.273	0,79
		12.155	1,81
Südafrika — 0,03 % (29. Februar 2020: 0,03 %)			
200	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10.04.2027	230	0,03
Spanien — 0,37 % (29. Februar 2020: 0,22 %)			
EUR 800	Cellnex Telecom SA, 1,875 %, fällig 26.06.2029	971	0,14
EUR 370	Tendam Brands SAU, 5,000 %, fällig 15.09.2024	375	0,06
EUR 1.130	Tendam Brands SAU, 5,250 %, fällig 15.09.2024 *	1.164	0,17
		2.510	0,37
Schweden — 0,57 % (29. Februar 2020: 0,51 %)			
EUR 3.400	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,624 %, Perpetual *	3.834	0,57
Schweiz — 1,47 % (29. Februar 2020: 0,84 %)			
720	Credit Suisse Group AG, 7,500 %, Perpetual *	777	0,12
EUR 770	ELM BV for Firmenich International SA, 3,750 %, Perpetual *	958	0,14
1.438	Glencore Finance Canada Ltd, 6,000 %, fällig 15.11.2041	1.714	0,25
EUR 630	Holcim Finance Luxembourg SA, 3,000 %, Perpetual *	773	0,11
1.770	Syngenta Finance NV, 4,441 %, fällig 24.04.2023	1.865	0,28

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Schweiz— (Fortsetzung)			
3.500	UBS Group AG, 7,000 %, Perpetual *	3.795	0,57
		9.882	1,47
Türkei — 0,33 % (29. Februar 2020: 0,62 %)			
2.280	Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 4,875 %, fällig 19.06.2024	2.245	0,33
Vereinigte Arabische Emirate — 0,58 % (29. Februar 2020: 0,50 %)			
20	DAE Funding LLC, 144A, 4,500 %, fällig 01.08.2022	20	0,01
3.240	DP World Plc, 5,625 %, fällig 25.09.2048	3.839	0,57
		3.859	0,58
Großbritannien — 3,85 % (29. Februar 2020: 2,49 %)			
3.640	Barclays Bank Plc, 7,625 %, fällig 21.11.2022	4.049	0,60
GBP 620	Barclays Plc, 7,125 %, Perpetual *	892	0,13
EUR 1.990	EC Finance Plc, 2,375 %, fällig 15.11.2022	2.107	0,31
EUR 1.800	Fiat Chrysler Automobiles NV, 3,875 %, fällig 05.01.2026	2.325	0,35
GBP 750	Grainger Plc, 3,000 %, fällig 03.07.2030	1.033	0,15
GBP 1.459	Greene King Finance Plc, Series B2, 2,273 %, fällig 15.03.2036 *	1.504	0,23
GBP 1.050	HSBC Holdings Plc, 7,000 %, fällig 07.04.2038	2.042	0,31
2.550	HSBC Holdings Plc, 6,375 %, Perpetual *	2.712	0,41
EUR 1.600	Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, Perpetual *	1.936	0,29
GBP 2.545	Marston's Issuer Plc, Series B1, 2,632 %, fällig 15.07.2035 *	2.690	0,40
GBP 1.150	Saga Plc, 3,375 %, fällig 12.05.2024	1.252	0,19
EUR 740	Synlab Bondco Plc, 4,750 %, fällig 01.07.2025 *	894	0,13
GBP 1.077	Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, fällig 13.07.2044	1.893	0,28
450	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.08.2026	475	0,07
		25.804	3,85
USA — 24,46 % (29. Februar 2020: 19,11 %)			
1.610	3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050	1.962	0,29
3.250	AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	3.614	0,54
1.550	AbbVie Inc, 144A, 4,850 %, fällig 15.06.2044	1.957	0,29
260	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp, 5,375 %, fällig 15.09.2024	240	0,04
3.300	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.02.2025	3.445	0,51
1.790	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	1.864	0,28
600	Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	754	0,11
110	Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.04.2026	122	0,02
540	Bausch Health Cos Inc, 144A, 9,000 %, fällig 15.12.2025	592	0,09
1.580	Boeing Co/The, 4,875 %, fällig 01.05.2025	1.721	0,26
400	Boeing Co/The, 3,750 %, fällig 01.02.2050	360	0,05
320	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	369	0,05
1.710	Bristol-Myers Squibb Co, 5,000 %, fällig 15.08.2045	2.442	0,36
EUR 1.070	Carnival Corp, 10,125 %, fällig 01.02.2026	1.293	0,19
280	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01.05.2025	289	0,04
850	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,750 %, fällig 15.02.2026	892	0,13
2.380	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,125 %, fällig 01.05.2027	2.538	0,38
3.030	Centene Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2022	3.057	0,46
860	Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	945	0,14
880	CenturyLink Inc, Series W, 6,750 %, fällig 01.12.2023	977	0,15
770	Cigna Corp, 2,400 %, fällig 15.03.2030	810	0,12
640	Cigna Corp, 4,800 %, fällig 15.08.2038	810	0,12
3.000	Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	3.490	0,52
1.730	Coca-Cola Co/The, 4,200 %, fällig 25.03.2050	2.294	0,34
320	Comcast Corp, 3,600 %, fällig 01.03.2024	355	0,05
300	Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	347	0,05
2.090	Comcast Corp, 4,700 %, fällig 15.10.2048	2.816	0,42
600	Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	868	0,13
3.548	Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, fällig 01.06.2044	3.150	0,47
1.000	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	1.127	0,17
743	CVS Health Corp, 4,100 %, fällig 25.03.2025	848	0,13
1.240	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03.11.2036	1.245	0,19
550	Deere & Co, 3,750 %, fällig 15.04.2050	677	0,10
1.720	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 5,875 %, fällig 15.06.2021	1.722	0,26
1.500	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.06.2024	1.558	0,23
297	Delta Air Lines 2007-1 Klasse B Pass Through Trust, Series 071B, 8,021 %, fällig 10.08.2022	279	0,04
1.680	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	1.842	0,27
1.020	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	1.063	0,16
2.275	DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.07.2022	2.391	0,36
1.620	DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	1.715	0,26
2.250	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	2.579	0,38
2.210	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig 15.06.2025	2.467	0,37
200	El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, fällig 15.06.2032	276	0,04
970	Energy Transfer Partners LP / Regency Energy Finance Corp, 5,875 %, fällig 01.03.2022	1.022	0,15
580	Energy Transfer Partners LP / Regency Energy Finance Corp, 5,000 %, fällig 01.10.2022	614	0,09
1.850	Energy Transfer Partners LP / Regency Energy Finance Corp, 4,500 %, fällig 01.11.2023	1.981	0,30
1.600	Enterprise Products Operating LLC, 4,800 %, fällig 01.02.2049	1.895	0,28
200	EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	240	0,04
50	EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	64	0,01
880	Exxon Mobil Corp, 4,327 %, fällig 19.03.2050	1.132	0,17
310	Exxon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15.04.2051	349	0,05
3.370	FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, fällig 15.11.2031	4.777	0,71
3.160	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21.04.2023	3.498	0,52
3.080	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	3.464	0,52
3.719	GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418 %, fällig 15.11.2035	3.846	0,57
90	General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2040	114	0,02
1.070	General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2050	1.401	0,21
50	General Electric Co, 6,750 %, fällig 15.03.2032	63	0,01
1.046	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10.01.2039	1.335	0,20
390	General Electric Co, 4,250 %, fällig 01.05.2040	394	0,06
350	General Electric Co, 4,350 %, fällig 01.05.2050	356	0,05
840	General Motors Co, 5,400 %, fällig 02.10.2023	932	0,14
405	Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, Perpetual *	373	0,06
1.840	HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	2.081	0,31
1.290	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.04.2027	1.325	0,20
240	Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	275	0,04
1.160	Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	1.331	0,20
910	Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	1.265	0,19
150	Intel Corp, 4,950 %, fällig 25.03.2060	217	0,03
330	JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	361	0,05
47	JPMorgan Chase & Co, Series I, 3,738 %, Perpetual *	46	0,01
3.510	JPMorgan Chase & Co, Series U, 6,125 %, Perpetual *	3.755	0,56
40	Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,950 %, fällig 01.09.2022	42	0,01
550	Kinder Morgan Inc, 8,050 %, fällig 15.10.2030	740	0,11
1.735	Kinder Morgan Inc, 7,800 %, fällig 01.08.2031	2.431	0,36
565	Kinder Morgan Inc, 7,750 %, fällig 15.01.2032	812	0,12
500	Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, fällig 15.07.2045	570	0,08
2.026	L3Harris Technologies Inc, 5,054 %, fällig 27.04.2045	2.718	0,41
40	Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,625 %, fällig 01.11.2024	42	0,01
1.530	Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,875 %, fällig 01.11.2026	1.604	0,24
318	Lehman Escrow Receipt, Null-Coupon, Perpetual †∞	4	–
590	LifePoint Health Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.02.2027	590	0,09
180	Lowe's Cos Inc, 5,000 %, fällig 15.04.2040	239	0,04
230	Lowe's Cos Inc, 5,125 %, fällig 15.04.2050	320	0,05
1.080	Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	1.364	0,20
1.443	Match Group Holdings II LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.12.2027	1.544	0,23
110	McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	125	0,02
1.150	McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	1.408	0,21
280	Morgan Stanley, 5,597 %, fällig 24.03.2051 *	433	0,06
GBP 820	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 2,550 %, fällig 05.12.2023	1.097	0,16
1.750	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 4,625 %, fällig 01.08.2029	1.871	0,28
450	Navient Corp, 5,875 %, fällig 25.10.2024	464	0,07
1.390	NCL Corp Ltd, 144A, 10,250 %, fällig 01.02.2026	1.402	0,21
2.000	Netflix Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15.06.2030	2.314	0,35
501	Newell Brands Inc, 4,350 %, fällig 01.04.2023	531	0,08
1.010	NGPL PipeCo LLC, 144A, 7,768 %, fällig 15.12.2037	1.233	0,18
310	NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	358	0,05

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
1.650	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	1.877	0,28
210	NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	247	0,04
690	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig 15.08.2029	594	0,09
40	Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2031	43	0,01
1.290	Pfizer Inc, 2,625 %, fällig 01.04.2030	1.442	0,22
2.000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2028	2.103	0,31
180	Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, fällig 25.03.2030	208	0,03
420	Procter & Gamble Co/The, 3,550 %, fällig 25.03.2040	516	0,08
390	Procter & Gamble Co/The, 3,600 %, fällig 25.03.2050	496	0,07
1.080	Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.02.2028	1.153	0,17
355	Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01.03.2032	508	0,08
3.000	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	4.534	0,68
110	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,125 %, fällig 01.02.2025	113	0,02
120	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,375 %, fällig 01.02.2027	124	0,02
1.280	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2030	1.351	0,20
280	Time Warner Cable LLC, 4,125 %, fällig 15.02.2021	282	0,04
990	T-Mobile USA Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.04.2030	1.136	0,17
380	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,250 %, fällig 15.05.2030	414	0,06
650	United Rentals North America Inc, 4,625 %, fällig 15.10.2025	666	0,10
780	United Rentals North America Inc, 5,500 %, fällig 15.05.2027	837	0,12
1.200	United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2027	1.252	0,19
180	UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.06.2048	232	0,03
50	UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	67	0,01
1.190	Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22.03.2050	1.498	0,22
1.760	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 4,625 %, fällig 01.12.2029	1.833	0,27
460	Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.09.2027	327	0,05
330	Visa Inc, 2,050 %, fällig 15.04.2030	352	0,05
540	Visa Inc, 2,700 %, fällig 15.04.2040	585	0,09
1.370	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	1.140	0,17
1.360	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	1.863	0,28
1.910	Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Perpetual *	2.109	0,31
452	Williams Cos Inc/The, Series A, 7,500 %, fällig 15.01.2031	596	0,09
2.155	Williams Cos Inc/The, 5,750 %, fällig 24.06.2044	2.599	0,39
960	WPX Energy Inc, 5,250 %, fällig 15.10.2027	957	0,14
380	WPX Energy Inc, 4,500 %, fällig 15.01.2030	364	0,05
182	XPO Logistics Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.06.2022	183	0,03
2.420	XPO Logistics Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.09.2023	2.470	0,37
		163.995	24,46

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Sambia — 0,45 % (29. Februar 2020: 0,39 %)			
290	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 01.04.2023	295	0,04
570	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 01.03.2024	569	0,09
1.050	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2025	1.072	0,16
1.090	First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 01.03.2026	1.093	0,16
		3.029	0,45
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 314.167 USD)		341.701	50,96
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 19,38 % (29. Februar 2020: 33,29 %)			
Argentinien — 0,49 % (29. Februar 2020: 0,60 %)			
ARS 10.214	Argentina Treasury Bond BONCER, Series CER, 1,000 %, fällig 05.08.2021 †β	93	0,01
ARS 21.478	Argentine Bonos del Tesoro, 18,200 %, fällig 03.10.2021 † ε	136	0,02
1.020	Argentine Republic Government International Bond, 5,875 %, fällig 11.01.2028	457	0,07
ARS 182.520	Bonos del Tesoro Nacional en Pesos Badlar, 31,579 %, fällig 03.04.2022 *†	1.392	0,21
2.510	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 7,875 %, fällig 15.06.2027 ε	1.192	0,18
		3.270	0,49
Brasilien — 1,13 % (29. Februar 2020: 1,26 %)			
BRL 24.604	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2023	5.057	0,76
BRL 11.694	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	2.499	0,37
		7.556	1,13
Kolumbien — 0,60 % (29. Februar 2020: 1,48 %)			
3.140	Colombia Government International Bond, 5,625 %, fällig 26.02.2044	4.002	0,59
COP 171.800	Colombian TES, Series B, 10,000 %, fällig 24.07.2024	56	0,01
		4.058	0,60
Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) — 0,25 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 1.500	Ivory Coast Government International Bond, 5,250 %, fällig 22.03.2030	1.705	0,25
Ägypten — 0,52 % (29. Februar 2020: 0,15 %)			
2.330	Egypt Government International Bond, 5,750 %, fällig 29.05.2024	2.406	0,36
EUR 960	Egypt Government International Bond, 6,375 %, fällig 11.04.2031	1.107	0,16
		3.513	0,52
Deutschland — 0,21 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 1.110	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2030	1.380	0,21
Ghana — 0,25 % (29. Februar 2020: 0,24 %)			
1.730	Ghana Government International Bond, 7,625 %, fällig 16.05.2029	1.662	0,25
Indonesien — 3,13 % (29. Februar 2020: 2,84 %)			
2.390	Indonesia Government International Bond, 5,250 %, fällig 17.01.2042	3.104	0,46
IDR 133.339.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	9.499	1,42
IDR 111.280.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR78, 8,250 %, fällig 15.05.2029	8.380	1,25
		20.983	3,13
Israel — 0,20 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1.140	Israel Government International Bond, 3,875 %, fällig 03.07.2050	1.365	0,20

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Mexiko — 3,00 % (29. Februar 2020: 4,89 %)			
MXN 45.164	Mexican Bonos, Series M 20, 7,500 %, fällig 03.06.2027	2.291	0,34
MXN 357.157	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	17.862	2,66
		20.153	3,00
Nigeria — 0,13 % (29. Februar 2020: 0,11 %)			
900	Nigeria Government International Bond, 7,625 %, fällig 28.11.2047	859	0,13
Panama — 0,23 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1.180	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 01.04.2056	1.538	0,23
Peru — 0,22 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1.400	Peruvian Government International Bond, 2,392 %, fällig 23.01.2026	1.476	0,22
Katar — 0,25 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1.540	Qatar Government International Bond, 3,400 %, fällig 16.04.2025	1.691	0,25
Russland — 2,36 % (29. Februar 2020: 3,67 %)			
RUB 503.925	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028	7.345	1,10
RUB 575.235	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6225, 7,250 %, fällig 10.05.2034	8.470	1,26
		15.815	2,36
Südafrika — 1,58 % (29. Februar 2020: 1,04 %)			
ZAR 7.261	Republic of South Africa Government Bond, Series R209, 6,250 %, fällig 31.03.2036	284	0,04
ZAR 31.243	Republic of South Africa Government Bond, Series 2037, 8,500 %, fällig 31.01.2037	1.476	0,22
ZAR 145.556	Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	5.455	0,82
3.750	Republic of South Africa Government International Bond, 5,750 %, fällig 30.09.2049	3.366	0,50
		10.581	1,58
Vereinigte Arabische Emirate — 0,48 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
3.030	Abu Dhabi Government International Bond, 2,500 %, fällig 16.04.2025	3.227	0,48
USA — 4,35 % (29. Februar 2020: 17,01 %)			
540	United States Treasury Note/ Bond, 0,125 %, fällig 30.06.2022	540	0,08
13.972	United States Treasury Note/ Bond, 2,875 %, fällig 31.10.2023	15.171	2,26
4.920	United States Treasury Note/ Bond, 2,250 %, fällig 15.11.2024 ≠	5.340	0,80
440	United States Treasury Note/ Bond, 1,500 %, fällig 15.08.2026	469	0,07
1.460	United States Treasury Note/ Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2026	1.603	0,24
770	United States Treasury Note/ Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2027	860	0,13
1.650	United States Treasury Note/ Bond, 3,000 %, fällig 15.05.2045	2.204	0,33
15	United States Treasury Note/ Bond, 3,000 %, fällig 15.11.2045	20	–
500	United States Treasury Note/ Bond, 2,250 %, fällig 15.08.2046	589	0,09
360	United States Treasury Note/ Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2047	486	0,07
120	United States Treasury Note/ Bond, 3,125 %, fällig 15.05.2048	167	0,02
820	United States Treasury Note/ Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2049	1.122	0,17

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
430	United States Treasury Note/ Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	576	0,09
		29.147	4,35
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 148.690 USD)		129.979	19,38
Schuldverschreibungen — 6,39 % (29. Februar 2020: 6,69 %)			
1.294	1011778 BC ULC, 1,911 %, fällig 14.11.2026 *	1.247	0,18
1.630	Air Medical Group Holdings Inc, 4,250 %, fällig 28.04.2022 *	1.618	0,24
595	Alterra Mountain Co, 2,911 %, fällig 31.07.2024 *	575	0,09
1.015	APi Group Inc, 2,661 %, fällig 01.10.2026 *	1.001	0,15
1.061	Aramark Services Inc, 1,911 %, fällig 11.03.2025 *	1.017	0,15
1.201	Asurion LLC, 3,161 %, fällig 03.11.2024 *	1.183	0,18
953	Berry Global Inc, 2,155 %, fällig 01.10.2022 *	943	0,14
715	Brightview Landscapes LLC, 2,688 %, fällig 15.08.2025 *	708	0,11
844	Caesars Resort Collection LLC, 2,911 %, fällig 22.12.2024 *	796	0,12
1.199	Change Healthcare Holdings LLC, 3,500 %, fällig 01.03.2024 *	1.180	0,18
659	Charter Communications Operating LLC, 1,920 %, fällig 30.04.2025 *	649	0,10
182	Entercom Media Corp, 2,673 %, fällig 17.11.2024 *	173	0,03
1.011	Equinox Holdings Inc, 4,072 %, fällig 08.03.2024 *	764	0,11
1.015	First Eagle Holdings Inc, 2,808 %, fällig 17.02.2027 *	994	0,15
645	Focus Financial Partners LLC, 2,161 %, fällig 03.07.2024 *	633	0,09
536	Four Seasons Hotels Ltd, 2,161 %, fällig 30.11.2023 *	522	0,08
EUR 940	Froneri Lux FinCo SARL, 2,625 %, fällig 30.01.2027 *	1.092	0,16
660	Garda World Security Corp, 4,930 %, fällig 23.10.2026 *	660	0,10
1.017	Genesee & Wyoming Inc, 2,308 %, fällig 05.11.2026 *	1.004	0,15
216	Golden Nugget LLC, 3,250 %, fällig 04.10.2023 *	194	0,03
498	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 2,122 %, fällig 15.11.2027 *	489	0,08
500	HCA Inc, 1,911 %, fällig 13.03.2025 *	498	0,07
1.246	Hilton Worldwide Finance LLC, 1,925 %, fällig 21.06.2026 *	1.203	0,18
678	Jaguar Holding Co II, 3,500 %, fällig 18.08.2022 *	677	0,10
513	Level 3 Parent LLC, 1,911 %, fällig 01.03.2027 *	498	0,07
744	McAfee LLC, 3,916 %, fällig 29.09.2024 *	739	0,11
1.657	Michaels Stores Inc, 3,500 %, fällig 28.01.2023 *	1.595	0,24
404	MPH Acquisition Holdings LLC, 3,750 %, fällig 07.06.2023 *	401	0,06
259	Nexstar Broadcasting Inc, 2,906 %, fällig 19.09.2026 *	255	0,04
955	Option Care Health Inc, 4,661 %, fällig 06.08.2026 *	953	0,14
EUR 718	Ortho Clinical Diagnostics S.A., 3,500 %, fällig 17.01.2027 *	823	0,12
953	Panther BF Aggregator 2 LP, 3,667 %, fällig 18.03.2026 *	937	0,14
466	Party City Holdings Inc, 4,100 %, fällig 19.08.2022 *	330	0,05
1.850	Petco Animal Supplies Inc, 4,250 %, fällig 26.01.2023 *	1.591	0,24
664	Prime Security Services Borrower LLC, 3,405 %, fällig 23.09.2026 *	663	0,10
884	RegionalCare Hospital Partners Holding, 3,911 %, fällig 16.11.2025 *	868	0,13
124	Reynolds Consumer Products LLC, 1,911 %, fällig 04.02.2027 *	122	0,02
18	Reynolds Group Holdings Inc, 2,911 %, fällig 05.02.2023 *	18	–
1.429	Scientific Games International Inc, 3,612 %, fällig 14.08.2024 *	1.340	0,20
953	Sedgwick Claims Management Services Inc, 3,411 %, fällig 31.12.2025 *	922	0,14
1.297	Sotera Health Holdings LLC, 5,500 %, fällig 22.11.2026 *	1.297	0,19
EUR 2.090	TDC A/S, 3,000 %, fällig 11.06.2025 *	2.449	0,37
915	Terrier Media Buyer Inc, 4,411 %, fällig 17.12.2026 *	901	0,13
332	Trans Union LLC, 1,911 %, fällig 13.11.2026 *	324	0,05
278	UFC Holdings LLC, 4,250 %, fällig 29.04.2026 * †	275	0,04
1.196	Univision Communications Inc, 4,750 %, fällig 24.03.2026 *	1.172	0,17
1.729	Valeant Pharmaceuticals International, 3,176 %, fällig 28.05.2025 *	1.703	0,25
186	VICI Properties 1 LLC, 1,933 %, fällig 22.12.2024 *	180	0,03
830	Virgin Media Bristol LLC, 2,662 %, fällig 04.01.2028 *	810	0,12
622	Western Digital Corp, 1,911 %, fällig 29.04.2023 *	616	0,09
1.271	Wynn Resorts Finance LLC, 1,920 %, fällig 20.09.2024 *	1.207	0,18
Summe Darlehensschuldverschreibungen (Anschaffungskosten 44.170 USD)		42.809	6,39
Kollektive Kapitalanlagen — 9,58 % (29. Februar 2020: 8,53 %)			
1.001	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse M	12.982	1,94
83	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US$ Distributing (M)	8.455	1,26
EUR 74	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Euro High Yield Fund – LM Class Euro (Accumulating)	15.536	2,32
145	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset US High Yield Fund – LM Class US$ Distributing (M)	12.531	1,87
59	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Legg Mason Western Asset India Bond – LM Class US$ Accumulating	7.872	1,17
EUR 57	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	6.867	1,02
Gesamt Kollektive Kapitalanlagen (Kosten 56.368 USD)		64.243	9,58
Stammaktien — 0,04 % (29. Februar 2020: 0,05 %)			
USA — 0,04 % (29. Februar 2020: 0,05 %)			
44	Berry Corp	173	0,02
57	Hercules Offshore Inc †∞	47	0,01
9	Montage Resources Corp	45	0,01
		265	0,04
Stammaktien insgesamt (Kosten 1.380 USD)		265	0,04
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 592.930 USD)		604.819	90,20
Gekaufte Optionen — 0,00 % (29. Februar 2020: 0,10 %)			
5.720	USD Call/ZAR Put 18,10, fällig 102.10.2020	31	–
Summe gekaufte Optionen (Kosten 68 USD)		31	–
Devisenterminkontrakte — 1,70 % (29. Februar 2020: 0,37 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		11.403	1,70
Termingeschäfte — 0,03 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		184	0,03
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		616.437	91,93
Devisenterminkontrakte — (0,33 %) (29. Februar 2020: (1,05 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(2.188)	(0,33)
Termingeschäfte — (0,02 %) (29. Februar 2020: (0,29 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(132)	(0,02)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(2.320)	(0,35)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		614.117	91,58
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		56.443	8,42
Gesamtnettovermögen		$ 670.560	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 71,606,000 USD und machten 10,67% des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

† Illiquide.

∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

ε Das Wertpapier ist zum oder seit Ende des Berichtszeitraums am 31. August 2020 in Verzug (entweder Tilgungs- und / oder Zinszahlungen).

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (VPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihzins entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual	–	Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
REMIC	–	Real Estate Mortgage Investment Conduit
ARS	–	Argentinischer Peso
BRL	–	Brasilianischer Real
COP	–	Kolumbianischer Peso
EUR	–	Euro
GBP	–	Britisches Pfund Sterling
IDR	–	Indonesische Rupiah
MXN	–	Mexikanischer Peso
RUB	–	Russischer Rubel
ZAR	–	Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	73,68
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	6,34
Organismen für gemeinsame Anlagen	9,51
Finanzderivate	1,72
Sonstige Vermögenswerte	8,75
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	AUD	1	$ –
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	99	Verkauf	EUR	84	(1)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	8	Verkauf	USD	10	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	ZAR	2	–
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	62	Verkauf	GBP	47	(1)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf	AUD	6	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	EUR	1	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	114	Verkauf	EUR	95	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	229	Verkauf	GBP	176	(4)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	26	Verkauf	SGD	35	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	ZAR	24.865	Verkauf	USD	1.410	53
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.398	Verkauf	USD	1.019	9
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CHF	1.798	Verkauf	USD	1.971	18
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	18.068	Verkauf	USD	21.324	243
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	281.250	Verkauf	USD	367.673	8.332
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	PLN	28.128	Verkauf	USD	7.519	119
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	ZAR	263	Verkauf	USD	15	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	100.825	Verkauf	USD	72.260	2.108
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	11	Verkauf	ZAR	190	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	78	Verkauf	ZAR	1.381	(3)
24.09.2020	Citi	Kauf	USD	1.848	Verkauf	INR	142.245	(86)
24.09.2020	Citi	Kauf	IDR	34.311.880	Verkauf	USD	2.352	(3)
24.09.2020	Morgan Stanley	Kauf	BRL	18.237	Verkauf	USD	3.521	(195)
19.11.2020	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	17.795	Verkauf	SGD	24.444	(173)
19.11.2020	BNP Paribas	Kauf	USD	14.710	Verkauf	EUR	12.480	(209)
19.11.2020	BNP Paribas	Kauf	USD	4.571	Verkauf	GBP	3.497	(106)
19.11.2020	Citi	Kauf	MXN	36.560	Verkauf	USD	1.619	35
19.11.2020	HSBC	Kauf	USD	56.595	Verkauf	EUR	48.028	(818)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	6.127	Verkauf	EUR	5.197	(86)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	2.267	Verkauf	GBP	1.730	(46)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	5.942	Verkauf	MXN	134.180	(130)
19.11.2020	Morgan Stanley	Kauf	USD	6.360	Verkauf	EUR	5.400	(95)
19.11.2020	Morgan Stanley	Kauf	JPY	3.185.010	Verkauf	USD	30.050	51
19.11.2020	Morgan Stanley	Kauf	CAD	1.230	Verkauf	USD	919	24
19.11.2020	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.474	Verkauf	ZAR	26.450	(73)
19.11.2020	UBS	Kauf	USD	1.670	Verkauf	EUR	1.400	(4)
19.11.2020	UBS	Kauf	USD	6.408	Verkauf	GBP	4.908	(155)
19.11.2020	UBS	Kauf	EUR	22.955	Verkauf	USD	27.030	411
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 2.729 USD)								$ 11.403
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (7.723) USD)								(2.188)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (4.994) USD)								$ 9.215

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bund Dezember 2020	(91)	$ (18.758)	$ 75
Euro-Bund September 2020	(102)	(21.369)	(52)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2020	(1)	(259)	(1)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	(396)	(55.143)	51
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	(592)	(74.611)	(75)
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	4	703	(4)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	23	5.081	58
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 23 USD)			$ 184
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(2.161) USD)			(132)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (2.138) USD)			$ 52

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 3,12 % (29. Februar 2020: 4,31 %)			
400	Apex Credit CLO 2019-II Ltd, Series 2019 2A, Klasse D, 144A, 4,295 %, fällig 25.10.2032 *	393	0,22
710	Ares XLII Clo Ltd, Series 2017 42A, Klasse D, 144A, 3,708 %, fällig 22.01.2028 *	683	0,37
460	Avery Point VI CLO Ltd, Series 2015 6A, Klasse DR, 144A, 3,199 %, fällig 05.08.2027 *	433	0,24
440	Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Klasse C, 144A, 3,422 %, fällig 20.04.2031 *	423	0,23
300	BLUEMOUNTAIN CLO 2012-2 Ltd, Series 2012 2A, Klasse ER2, 144A, 6,003 %, fällig 20.11.2028 *	244	0,13
500	BlueMountain CLO 2015-2 Ltd, Series 2015 2A, Klasse ER, 144A, 5,472 %, fällig 18.07.2027 *	380	0,21
400	Catskill Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Klasse D, 144A, 6,272 %, fällig 20.04.2029 *	356	0,20
300	Cent CLO 24 Ltd, Series 2015 24A, Klasse CR, 144A, 3,425 %, fällig 15.10.2026 *	277	0,15
250	Cumberland Park CLO Ltd, Series 2015 2A, Klasse ER, 144A, 5,922 %, fällig 20.07.2028 *	224	0,12
300	GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd, Series 2014 9A, Klasse DR2, 144A, 3,270 %, fällig 29.10.2029 *	282	0,15
250	Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Klasse E, 144A, 5,225 %, fällig 15.04.2031 *	208	0,11
567	Jackson Mill CLO Ltd, Series 2015 1A, Klasse DR, 144A, 3,075 %, fällig 15.04.2027 *	532	0,29
300	LCM XXII Ltd 22A, Klasse DR, 144A, 5,772 %, fällig 20.10.2028 *	236	0,13
587	Saranac CLO III Ltd, Series 2014 3A, Klasse DR, 144A, 3,556 %, fällig 22.06.2030 *	519	0,28
250	Sound Point Clo XV Ltd, Series 2017 1A, Klasse E, 144A, 6,216 %, fällig 23.01.2029 *	188	0,10
320	Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Klasse DRR, 144A, 3,095 %, fällig 15.04.2027 *	276	0,15
100	Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Klasse ERR, 144A, 6,015 %, fällig 15.04.2027 *	71	0,04
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 6.391 USD)		5.725	3,12
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 85,32 % (29. Februar 2020: 82,38 %)			
Argentinien — 0,71 (29. Februar 2020: 0,77 %)			
200	Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750 %, fällig 02.05.2025	173	0,09
1.170	YPF SA, 144A, 8,500 %, fällig 23.03.2021	1.133	0,62
		1.306	0,71
Brasilien — 0,32 % (29. Februar 2020: 0,36 %)			
200	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 144A, 6,125 %, Perpetual *	195	0,11
330	Petrobras Global Finance BV, 7,375 %, fällig 17.01.2027	392	0,21
		587	0,32
Kanada — 2,81 % (29. Februar 2020: 3,85 %)			
10	Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.01.2026	11	0,01
500	Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.01.2028	534	0,29
420	Cenovus Energy Inc, 3,000 %, fällig 15.08.2022	427	0,23
290	Cenovus Energy Inc, 5,375 %, fällig 15.07.2025	295	0,16
110	Cenovus Energy Inc, 6,750 %, fällig 15.11.2039	115	0,06
50	Cenovus Energy Inc, 5,400 %, fällig 15.06.2047	45	0,02
420	Cott Holdings Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.04.2025	435	0,24
500	GFL Environmental Inc, 144A, 3,750 %, fällig 01.08.2025	504	0,28
120	GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2026	127	0,07
558	GFL Environmental Inc, 144A, 8,500 %, fällig 01.05.2027	608	0,33
392	MEG Energy Corp, 144A, 7,000 %, fällig 31.03.2024	390	0,21
900	MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2027	863	0,47
200	Open Text Corp, 144A, 3,875 %, fällig 15.02.2028	206	0,11
220	Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2030	229	0,13
530	Precision Drilling Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.01.2026	362	0,20
		5.151	2,81
Kaimaninseln — 0,76 % (29. Februar 2020: 0,67 %)			
2.370	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15.09.2024	1.386	0,76
Kolumbien — 0,11 % (29. Februar 2020: 0,12 %)			
200	Millicom International Cellular SA, 144A, 5,125 %, fällig 15.01.2028	210	0,11
Dänemark — 0,13 % (29. Februar 2020: 0,14 %)			
210	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig 12.01.2024	238	0,13
Frankreich — 2,11 % (29. Februar 2020: 1,89 %)			
1.280	Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, fällig 01.05.2026	1.360	0,74
1.200	Altice France SA/France, 144A, 8,125 %, fällig 01.02.2027	1.339	0,73
980	Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetual *	1.166	0,64
		3.865	2,11
Deutschland — 0,60 % (29. Februar 2020: 0,49 %)			
190	Mercer International Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2025	196	0,11
870	Vertical US Newco Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.07.2027	908	0,49
		1.104	0,60
Hongkong — 0,25 % (29. Februar 2020: 0,14 %)			
450	Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 04.12.2029	463	0,25
Irland — 0,24 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
420	Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC, 144A, 5,000 %, fällig 15.07.2028	436	0,24
Israel — 0,47 % (29. Februar 2020: 0,92 %)			
410	Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig 01.02.2036	428	0,23
200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,000 %, fällig 15.04.2024	210	0,12
200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 144A, 7,125 %, fällig 31.01.2025	217	0,12
		855	0,47
Italien — 1,00 % (29. Februar 2020: 1,05 %)			
480	Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303 %, fällig 30.05.2024	530	0,29
530	UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, fällig 02.04.2034 *	620	0,34
660	UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, fällig 30.06.2035 *	685	0,37
		1.835	1,00
Luxemburg — 0,72 % (29. Februar 2020: 0,80 %)			
200	Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2027	230	0,13
290	ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	298	0,16
780	Intelsat Jackson Holdings SA, 144A, 8,000 %, fällig 15.02.2024 †ξ	797	0,43
		1.325	0,72
Macau — 1,02 % (29. Februar 2020: 0,26 %)			
200	Sands China Ltd, 144A, 3,800 %, fällig 08.01.2026	212	0,11
200	Sands China Ltd, 5,400 %, fällig 08.08.2028	227	0,12
250	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2026	254	0,14
720	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26.08.2028	725	0,40
460	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2029	453	0,25
		1.871	1,02
Niederlande — 0,33 % (29. Februar 2020: 0,36 %)			
330	NatWest Markets NV, Series B, 7,750 %, fällig 15.05.2023	375	0,20
220	UPC Holding BV, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2028	230	0,13
		605	0,33
Peru — 0,18 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
320	Hudbay Minerals Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15.01.2025	333	0,18
Südkorea — 0,36 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
630	Clark Equipment Co, 144A, 5,875 %, fällig 01.06.2025	665	0,36
Schweiz — 0,64 % (29. Februar 2020: 0,68 %)			
470	Credit Suisse Group AG, 144A, 6,375 %, Perpetual *	512	0,28
200	Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, Perpetual *	220	0,12
400	UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	434	0,24
		1.166	0,64
Vereinigte Arabische Emirate — 0,79 % (29. Februar 2020: 1,07 %)			
1.260	DAE Funding LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.11.2023	1.258	0,69
540	Shelf Drilling Holdings Ltd, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2025	195	0,10
		1.453	0,79
Großbritannien — 2,51 % (29. Februar 2020: 2,84 %)			
1.030	Barclays Bank Plc, 7,625 %, fällig 21.11.2022	1.146	0,62
550	Barclays Plc, 5,088 %, fällig 20.06.2030 *	640	0,35
480	Barclays Plc, 8,000 %, Perpetual *	525	0,29
200	HSBC Holdings Plc, 6,500 %, Perpetual *	216	0,12
134	Natwest Group Plc, 5,125 %, fällig 28.05.2024	148	0,08
480	Natwest Group Plc,3 8,625 %, Perpetual *	506	0,28
1.310	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	1.418	0,77
		4.599	2,51
USA — 68,71 % (29. Februar 2020: 65,02 %)			
410	AdaptHealth LLC, 144A, 6,125 %, fällig 01.08.2028	431	0,23
130	Ahern Rentals Inc, 144A, 7,375 %, fällig 15.05.2023	54	0,03
220	Air Methods Corp, 144A, 8,000 %, fällig 15.05.2025	186	0,10
360	Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,125 %, fällig 15.05.2028	390	0,21
670	Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15.02.2028	665	0,36
430	Alliance Data Systems Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.12.2024	412	0,22
950	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2026	1.020	0,56
310	Ally Financial Inc, 8,000 %, fällig 01.11.2031	423	0,23
90	Alteryx Inc, 1,000 %, fällig 01.08.2026	92	0,05
260	Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14.02.2049	354	0,19
380	American Axle & Manufacturing Inc, 6,250 %, fällig 15.03.2026	389	0,21
470	American Axle & Manufacturing Inc, 6,500 %, fällig 01.04.2027	484	0,26
711	American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig 01.09.2026	781	0,43
350	Amkor Technology Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.09.2027	384	0,21
170	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp, 5,375 %, fällig 15.09.2024	157	0,09
380	Apache Corp, 4,875 %, fällig 15.11.2027	389	0,21

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
380	Apache Corp, 5,100 %, fällig 01.09.2040	369	0,20
390	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 4,750 %, fällig 23.08.2022	361	0,20
450	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.02.2025	470	0,26
300	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	312	0,17
920	Ball Corp, 2,875 %, fällig 15.08.2030	920	0,50
400	Bank of America Corp, Series FF, 5,875 %, Perpetual *	440	0,24
390	Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.04.2026	432	0,24
1.150	Bausch Health Cos Inc, 144A, 9,000 %, fällig 15.12.2025	1.261	0,69
1.630	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029	1.706	0,93
390	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	321	0,18
480	Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01.09.2028	487	0,27
860	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2026	760	0,41
360	Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030	404	0,22
760	Boyne USA Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.05.2025	808	0,44
271	Brinker International Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2024	271	0,15
120	Builders FirstSource Inc, 144A, 6,750 %, fällig 01.06.2027	131	0,07
160	Builders FirstSource Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.03.2030	171	0,09
346	BWX Technologies Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.07.2026	364	0,20
450	BWX Technologies Inc, 144A, 4,125 %, fällig 30.06.2028	471	0,26
200	BY Crown Parent LLC / BY Bond Finance Inc, 144A, 4,250 %, fällig 31.01.2026	205	0,11
340	Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.07.2025	361	0,20
600	Calpine Corp, 144A, 5,000 %, fällig 01.02.2031	628	0,34
389	Carriage Services Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.06.2026	413	0,23
740	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,125 %, fällig 01.05.2027	789	0,43
910	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 15.08.2030	967	0,53
500	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2031	524	0,29
210	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.05.2032	223	0,12
180	CD&R Smokey Buyer Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.07.2025	193	0,11
200	CDK Global Inc, 5,875 %, fällig 15.06.2026	211	0,11
490	CDW LLC / CDW Finance Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2028	513	0,28
450	CDW LLC / CDW Finance Corp, 3,250 %, fällig 15.02.2029	461	0,25
250	Centene Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01.06.2026	264	0,14
580	Centene Corp, 144A, 5,375 %, fällig 15.08.2026	616	0,34
180	Centene Corp, 3,375 %, fällig 15.02.2030	188	0,10
790	Century Communities Inc, 5,875 %, fällig 15.07.2025	824	0,45
430	CenturyLink Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.02.2027	437	0,24
530	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, fällig 23.10.2045	726	0,40
303	Cheniere Energy Inc, 4,250 %, fällig 15.03.2045	205	0,11
400	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.02.2025	410	0,22
400	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.03.2026	415	0,23
670	CIT Group Inc, 4,750 %, fällig 16.02.2024	706	0,39
520	Citigroup Inc, Series M, 6,300 %, Perpetual *	557	0,30
520	Clear Channel International BV, 144A, 6,625 %, fällig 01.08.2025	540	0,29
280	CNX Midstream Partners LP / CNX Midstream Finance Corp, 144A, 6,500 %, fällig 15.03.2026	281	0,15
590	Cogent Communications Group Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.03.2022	610	0,33
1.260	CommScope Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.03.2027	1.364	0,74
170	CommScope Technologies LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.03.2027	169	0,09
340	Comstock Resources Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.05.2025	341	0,19
470	Comstock Resources Inc, 9,750 %, fällig 15.08.2026	504	0,28
–	-- Continental Airlines 2000-1 Klasse B Pass Through Trust, Series 001B, Klasse B, 8,388 %, fällig 01.11.2020	–	–
190	Continental Resources Inc/OK, 3,800 %, fällig 01.06.2024	188	0,10
230	Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15.01.2028	219	0,12
190	CoreCivic Inc, 5,000 %, fällig 15.10.2022	188	0,10
110	CoreCivic Inc, 4,625 %, fällig 01.05.2023	105	0,06
740	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	834	0,46
650	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	675	0,37
250	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03.11.2036	251	0,14
600	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2037	603	0,33
950	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	990	0,54
2.563	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	2.938	1,60
560	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig 15.06.2025	625	0,34
250	Donnelley Financial Solutions Inc, 8,250 %, fällig 15.10.2024	261	0,14
290	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2025	302	0,17
160	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,500 %, fällig 30.01.2026	160	0,09
80	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig 30.01.2028	82	0,04
550	Entegris Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2028	576	0,31
350	EQM Midstream Partners LP, 4,000 %, fällig 01.08.2024	352	0,19
210	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000 %, fällig 01.07.2025	223	0,12
200	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, fällig 01.07.2027	219	0,12
490	EQM Midstream Partners LP, 5,500 %, fällig 15.07.2028	509	0,28
200	EQM Midstream Partners LP, 6,500 %, fällig 15.07.2048	202	0,11
560	EQT Corp, 7,875 %, fällig 01.02.2025	643	0,35
290	ESH Hospitality Inc, 144A, 5,250 %, fällig 01.05.2025	295	0,16
170	ESH Hospitality Inc, 144A, 4,625 %, fällig 01.10.2027	170	0,09
440	FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, fällig 01.09.2028	453	0,25
1.280	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, fällig 15.11.2025	1.290	0,70
300	Flex Acquisition Co Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.07.2026	316	0,17
20	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21.04.2023	22	0,01
830	Ford Motor Co, 9,000 %, fällig 22.04.2025	972	0,53
720	Ford Motor Credit Co LLC, 3,087 %, fällig 09.01.2023	717	0,39
600	Ford Motor Credit Co LLC, 3,096 %, fällig 04.05.2023	598	0,33
610	Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, fällig 16.06.2025	642	0,35
730	Forestar Group Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.04.2024	777	0,42
360	Forestar Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.03.2028	365	0,20
230	Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig 01.08.2030	246	0,13
650	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	731	0,40
462	FXI Holdings Inc, 144A, 7,875 %, fällig 01.11.2024	450	0,25
1.390	GEO Group Inc/The, 6,000 %, fällig 15.04.2026	1.070	0,58
650	Golden Nugget Inc, 144A, 8,750 %, fällig 01.10.2025	484	0,26
550	Greif Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.03.2027	587	0,32
150	Hanesbrands Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.05.2025	160	0,09
1.050	Hanesbrands Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15.05.2026	1.145	0,62
240	HCA Inc, 5,625 %, fällig 01.09.2028	286	0,16
127	HCA Inc, 7,500 %, fällig 15.11.2095	164	0,09
230	Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.05.2025	241	0,13
470	Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,750 %, fällig 01.05.2028	497	0,27
150	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.04.2027	154	0,08
352	HLF Financing Sarl LLC / Herbalife International Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2026	368	0,20
350	Howard Hughes Corp/The, 144A, 5,375 %, fällig 01.08.2028	356	0,19
660	iHeartCommunications Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	658	0,36
240	iHeartCommunications Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.01.2028	230	0,13
420	Installed Building Products Inc, 144A, 5,750 %, fällig 01.02.2028	445	0,24
880	International Game Technology Plc, 144A, 5,250 %, fällig 15.01.2029	903	0,49
300	IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2025	321	0,18
630	Iron Mountain Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.07.2028	654	0,36
478	j2 Cloud Services LLC / j2 Cloud Co-Obligor Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.07.2025	498	0,27
30	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 3,875 %, fällig 15.05.2027	32	0,02
140	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 4,250 %, fällig 01.03.2031	155	0,08
210	Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig 04.06.2042	233	0,13
570	Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, fällig 15.07.2045	650	0,35
750	Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, fällig 01.06.2046	771	0,42
1.150	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 5,500 %, fällig 01.06.2050	1.365	0,75
230	L Brands Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.07.2025	249	0,14
310	L Brands Inc, 144A, 9,375 %, fällig 01.07.2025	361	0,20
792	L Brands Inc, 5,250 %, fällig 01.02.2028	762	0,42
250	L Brands Inc, 7,500 %, fällig 15.06.2029	267	0,15

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
540	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2027	497	0,27
280	Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,875 %, fällig 01.11.2026	294	0,16
300	Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15.05.2028	331	0,18
100	Lennar Corp, 4,750 %, fällig 30.05.2025	110	0,06
80	Lennar Corp, 5,250 %, fällig 01.06.2026	91	0,05
1.010	Lennar Corp, 4,750 %, fällig 29.11.2027	1.153	0,63
430	Level 3 Financing Inc, 5,250 %, fällig 15.03.2026	449	0,25
570	Levi Strauss & Co, 5,000 %, fällig 01.05.2025	585	0,32
500	LifePoint Health Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.02.2027	500	0,27
425	Lions Gate Capital Holdings LLC, 5,875 %, fällig 01.11.2024	430	0,23
555	Lions Gate Capital Holdings LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.11.2024	561	0,31
130	Live Nation Entertainment Inc, 144A, 2,000 %, fällig 15.02.2025	118	0,06
530	Match Group Holdings II LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.12.2027	567	0,31
530	Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.06.2028	559	0,31
270	MGIC Investment Corp, 5,250 %, fällig 15.08.2028	284	0,16
200	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc, 4,500 %, fällig 01.09.2026	211	0,11
200	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc, 4,500 %, fällig 15.01.2028	206	0,11
610	Michaels Stores Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.07.2027	617	0,34
360	Microchip Technology Inc, 144A, 4,250 %, fällig 01.09.2025	375	0,20
860	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	897	0,49
760	Mohegan Gaming & Entertainment, 144A, 7,875 %, fällig 15.10.2024 †	722	0,39
570	Montage Resources Corp, 8,875 %, fällig 15.07.2023	585	0,32
480	MPH Acquisition Holdings LLC, 144A, 7,125 %, fällig 01.06.2024	488	0,27
500	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, fällig 15.10.2027	530	0,29
300	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 4,625 %, fällig 01.08.2029	321	0,18
240	Navient Corp, 6,750 %, fällig 15.06.2026	250	0,14
180	Navient Corp, 5,000 %, fällig 15.03.2027	173	0,09
640	NCL Corp Ltd, 144A, 12,250 %, fällig 15.05.2024	714	0,39
540	NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 15.12.2024	371	0,20
590	NCL Corp Ltd, 144A, 10,250 %, fällig 01.02.2026	595	0,32
210	NCR Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.10.2030	213	0,12
860	Netflix Inc, 6,375 %, fällig 15.05.2029	1.087	0,59
330	Netflix Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.11.2029	397	0,22
140	Netflix Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15.06.2030	162	0,09
270	NGPL PipeCo LLC, 144A, 4,875 %, fällig 15.08.2027	296	0,16
210	NGPL PipeCo LLC, 144A, 7,768 %, fällig 15.12.2037	256	0,14
590	NMI Holdings Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2025	638	0,35
760	Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.11.2022 ƐƐ	13	0,01
280	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, fällig 15.03.2022 † ƐƐ	55	0,03
700	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, fällig 15.01.2023 † ƐƐ	137	0,07
30	Occidental Petroleum Corp, 1,730 %, fällig 15.08.2022 *	28	0,02
390	Occidental Petroleum Corp, 2,700 %, fällig 15.02.2023	376	0,21
660	Occidental Petroleum Corp, 2,900 %, fällig 15.08.2024	608	0,33
550	Occidental Petroleum Corp, 8,875 %, fällig 15.07.2030	623	0,34
500	Olin Corp, 5,000 %, fällig 01.02.2030	484	0,26
440	ON Semiconductor Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.09.2028	461	0,25
600	Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2027	641	0,35
100	Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, fällig 15.04.2027	91	0,05
630	Party City Holdings Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.08.2026	161	0,09
70	Pattern Energy Operations LP / Pattern Energy Operations Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.08.2028	74	0,04
450	PetSmart Inc, 144A, 8,875 %, fällig 01.06.2025	468	0,26
940	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.04.2026	1.041	0,57
230	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 3,375 %, fällig 31.08.2027	230	0,13
490	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2028	515	0,28
730	Quicken Loans LLC, 144A, 5,250 %, fällig 15.01.2028	780	0,43
430	Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.02.2028	459	0,25
308	Range Resources Corp, 5,000 %, fällig 15.03.2023	307	0,17
440	Range Resources Corp, 144A, 9,250 %, fällig 01.02.2026	464	0,25
570	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15.06.2025	600	0,33
290	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc, 144A, 9,750 %, fällig 01.12.2026	314	0,17
400	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 5,625 %, fällig 01.12.2025	407	0,22
750	Scientific Games International Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.10.2025	742	0,41
260	Sensata Technologies Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.02.2030	275	0,15
372	Service Corp International/US, 7,500 %, fällig 01.04.2027	440	0,24
120	Service Corp International/US, 3,375 %, fällig 15.08.2030	123	0,07
580	ServiceMaster Co LLC/The, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2024	593	0,32
355	ServiceMaster Co LLC/The, 7,450 %, fällig 15.08.2027	387	0,21
600	Signature Aviation US Holdings Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.05.2026	620	0,34
730	Simmons Foods Inc, 144A, 5,750 %, fällig 01.11.2024	747	0,41
280	Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144A, 4,875 %, fällig 01.11.2027	267	0,15
1.180	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	1.783	0,97
1.073	Sprint Communications Inc, 11,500 %, fällig 15.11.2021	1.195	0,65
950	Sprint Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2023	1.106	0,60
920	Sprint Corp, 7,625 %, fällig 15.02.2025	1.103	0,60
440	Standard Industries Inc/NJ, 144A, 4,750 %, fällig 15.01.2028	464	0,25
240	StoneX Group Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.06.2025	260	0,14
230	Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP / Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp, 144A, 5,875 %, fällig 15.05.2025	224	0,12
260	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp, 144A, 5,125 %, fällig 01.06.2025	264	0,14
610	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp, 144A, 5,250 %, fällig 15.01.2029	641	0,35
820	SunOpta Foods Inc, 144A, 9,500 %, fällig 09.10.2022	842	0,46
100	Surgery Center Holdings Inc, 144A, 10,000 %, fällig 15.04.2027	109	0,06
350	Talen Energy Supply LLC, 144A, 10,500 %, fällig 15.01.2026	282	0,15
300	Talen Energy Supply LLC, 144A, 6,625 %, fällig 15.01.2028	302	0,16
540	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01.02.2031	547	0,30
38	Taylor Morrison Communities Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.09.2023	39	0,02
420	TEGNA Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.09.2029	423	0,23
150	Tenet Healthcare Corp, 6,750 %, fällig 15.06.2023	160	0,09
250	Tenet Healthcare Corp, 4,625 %, fällig 15.07.2024	256	0,14
480	Tenet Healthcare Corp, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2025	527	0,29
1.220	Tenet Healthcare Corp, 144A, 4,625 %, fällig 15.06.2028	1.269	0,69
270	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	387	0,21
370	T-Mobile USA Inc, 6,375 %, fällig 01.03.2025	378	0,21
440	TopBuild Corp, 144A, 5,625 %, fällig 01.05.2026	460	0,25
340	TransDigm Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.12.2025	370	0,20
750	TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	793	0,43
420	TreeHouse Foods Inc, 4,000 %, fällig 01.09.2028	428	0,23
380	Twitter Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2027	402	0,22
200	United Rentals North America Inc, 4,625 %, fällig 15.10.2025	205	0,11
230	United Rentals North America Inc, 5,500 %, fällig 15.05.2027	247	0,13
1.010	United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15.01.2030	1.124	0,61
420	Univision Communications Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.02.2025	424	0,23
500	Univision Communications Inc, 144A, 9,500 %, fällig 01.05.2025	550	0,30
420	US Concrete Inc, 6,375 %, fällig 01.06.2024	435	0,24
560	US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig 15.07.2027	605	0,33
880	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2030	881	0,48
800	Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15.05.2025	890	0,49
400	Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.09.2027	285	0,16
270	Viper Energy Partners LP, 144A, 5,375 %, fällig 01.11.2027	278	0,15
280	Vishay Intertechnology Inc, 2,250 %, fällig 15.06.2025	274	0,15
1.780	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	1.482	0,81
250	Waste Pro USA Inc, 144A, 5,500 %, fällig 15.02.2026	258	0,14
190	Western Midstream Operating LP, 4,000 %, fällig 01.07.2022	194	0,11
910	Western Midstream Operating LP, 4,100 %, fällig 01.02.2025	909	0,50
160	Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig 01.06.2025	160	0,09
610	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15.08.2048	549	0,30
675	William Carter Co/The, 144A, 5,625 %, fällig 15.03.2027	711	0,39

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
400	WPX Energy Inc, 8,250 %, fällig 01.08.2023	451	0,25
400	WPX Energy Inc, 5,750 %, fällig 01.06.2026	409	0,22
420	WPX Energy Inc, 5,250 %, fällig 15.10.2027	418	0,23
510	WPX Energy Inc, 5,875 %, fällig 15.06.2028	518	0,28
740	WW International Inc, 144A, 8,625 %, fällig 01.12.2025	781	0,43
290	Wyndham Hotels & Resorts Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.08.2028	293	0,16
490	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,750 %, fällig 15.04.2025	515	0,28
330	XHR LP, 144A, 6,375 %, fällig 15.08.2025	339	0,19
520	XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig 01.05.2034	555	0,30
540	XPO Logistics Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2024	576	0,31
430	XPO Logistics Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.05.2025	460	0,25
		125.924	68,71
Sambia — 0,55 % (29. Februar 2020: 0,95 %)			
630	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 01.04.2023	641	0,35
350	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2025	358	0,20
		999	0,55
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 151.053 USD)		156.376	85,32
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 0,47 % (29. Februar 2020: 0,55 %)			
Argentinien — 0,47 % (29. Februar 2020: 0,46 %)			
490	Argentine Republic Government International Bond, 5,625 %, fällig 26.01.2022 ƹ	235	0,13
210	Argentine Republic Government International Bond, 7,500 %, fällig 22.04.2026 ƹ	97	0,05
300	Argentine Republic Government International Bond, 6,875 %, fällig 26.01.2027 ƹ	135	0,07
200	Argentine Republic Government International Bond, 7,625 %, fällig 22.04.2046 ƹ	88	0,05
640	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 7,875 %, fällig 15.06.2027 ƹ	304	0,17
		859	0,47
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 1.886 USD)		859	0,47
Schuldverschreibungen — 6,62 % (29. Februar 2020: 7,82 %)			
369	Acrisure LLC, 3,661 %, fällig 15.02.2027 *	355	0,19
509	Allen Media LLC, 5,801 %, fällig 10.02.2027 *	492	0,27
106	Amerilife Holdings LLC, 4,156 %, fällig 06.02.2027 *	105	0,06
14	Amerilife Holdings LLC, 0,000 %, fällig 18.03.2027 *	13	0,01
448	Beta Sub LLC, 4,661 %, fällig 06.08.2026 *	447	0,24
485	Caesars Resort Collection LLC, 2,911 %, fällig 22.12.2024 *	457	0,25
440	Chesapeake Energy Corp, – %, fällig 23.06.2024 *	292	0,16
361	Corrections Corporation of America, 5,500 %, fällig 12.12.2024 *	357	0,19
480	Deerfield Dakota Holding LLC, 9,000 %, fällig 20.02.2028 *	479	0,26
1.020	Delta Air Lines Inc, 5,750 %, fällig 29.04.2023 *	1.020	0,56
350	Equinox Holdings Inc, 10,000 %, fällig 08.03.2024 *	348	0,19
330	Eyecare Partners LLC, 8,558 %, fällig 21.01.2027 *	309	0,17
76	Eyecare Partners LLC, 0,500 %, fällig 05.02.2027 *	71	0,04
324	Eyecare Partners LLC, 4,822 %, fällig 05.02.2027 *	303	0,17
514	Global Tel'Link Corp, 4,411 %, fällig 29.11.2025 *	449	0,24
280	iHeartCommunications Inc, 3,161 %, fällig 01.05.2026 *	266	0,14
257	Jane Street Group LLC, 3,161 %, fällig 07.01.2025 *	255	0,14
440	JetBlue Airways Corp, 6,250 %, fällig 17.06.2024 *	440	0,24
475	McAfee LLC, 3,916 %, fällig 29.09.2024 *	472	0,26
10	Michaels Stores Inc, 3,500 %, fällig 28.01.2023 *	10	–
477	Mohegan Tribal Gaming Authority, 5,375 %, fällig 13.10.2023 *†	435	0,24
337	Panther BF Aggregator 2 LP, 3,667 %, fällig 18.03.2026 *	332	0,18
475	Phoenix Guarantor Inc, 3,412 %, fällig 05.03.2026 *	468	0,26
470	Pisces Midco Inc, 3,918 %, fällig 29.03.2025 *	463	0,25
397	Prime Security Services Borrower LLC, 3,405 %, fällig 23.09.2026 *	396	0,22
509	Radnet Management Inc, 4,750 %, fällig 01.07.2023 *	507	0,28
493	RegionalCare Hospital Partners Holding, 3,911 %, fällig 16.11.2025 *	484	0,26
474	Science Applications International Corp, 2,411 %, fällig 05.03.2027 *	471	0,26
458	Spe.ncer Spirit IH LLC, 6,244 %, fällig 14.06.2026 *†	409	0,22
69	Terrier Media Buyer Inc, 4,411 %, fällig 17.12.2026 *	68	0,04
245	U.S. Renal Care Inc, 5,187 %, fällig 14.06.2026 *	240	0,13
400	United Airlines, 6,250 %, fällig 25.06.2027 *	404	0,22
514	VVC Holding Corp, 4,818 %, fällig 11.02.2026 *	512	0,28
Summe Darlehensschuldverschreibungen (Anschaffungskosten 12.478 USD)		12.129	6,62
Kollektive Kapitalanlagen — 1,62 % (29. Februar 2020: 4,29 %)			
2.975	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	2.975	1,62
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Kosten 2.975 USD)		2.975	1,62
Stammaktien — 0,41 % (29. Februar 2020: 0,59 %)			
USA — 0,41 % (29. Februar 2020: 0,59 %)			
116	Berry Corp	459	0,25
96	Hercules Offshore Inc †∞	79	0,04
30	Montage Resources Corp	154	0,09
1	MWO Holdings Ltd †∞	55	0,03
		747	0,41
Stammaktien insgesamt (Kosten 3.998 USD)		747	0,41
Vorzugsaktien — 0,56 % (29. Februar 2020: 0,70 %)			
USA — 0,56 % (29. Februar 2020: 0,70 %)			
7	B Riley Financial Inc	167	0,09
35	GMAC Capital Trust I, Series 2	859	0,47
		1.026	0,56
Vorzugsaktien insgesamt (Kosten 1.091 USD)		1.026	0,56
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 179.872 USD)		179.837	98,12
Kreditausfallversicherungen — 0,02 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		33	0,02
Devisenterminkontrakte — 0,04 % (29. Februar 2020: 0,01 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		60	0,04
Termingeschäfte — 0,01 % (29. Februar 2020: 0,03 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		12	0,01
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		179.942	98,19
Devisenterminkontrakte — (0,05 %) (29. Februar 2020: (0,01 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(86)	(0,05)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(86)	(0,05)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		179.856	98,14
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		3.425	1,86
Gesamtnettovermögen		$183.281	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 107.253.000 USD und machten 58.55% des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

† Illiquide.

∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

ƹ Das Wertpapier ist zum oder seit Ende des Berichtszeitraums am 31. August 2020 in Verzug (entweder Tilgungs- und / oder Zinszahlungen).

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	73,68
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	6,34
Organismen für gemeinsame Anlagen	9,51
Finanzderivate	1,72
Sonstige Vermögenswerte	8,75
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Ford Motor Credit Co LLC, 5,000 %	Verkauf	20.06.2023	480	$ 33
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (29. Februar 2020 (in Tsd.) :4 USD)					$ 33
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)					–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): 4 USD)					$ 33

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf	EUR	4	$ –
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	SGD	3	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	659	Verkauf	USD	480	4
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	742	Verkauf	USD	970	22
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1 491	Verkauf	USD	1 760	20
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	USD	1 746	Verkauf	CAD	2 390	(86)
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	CAD	2 382	Verkauf	USD	1 812	14
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 13 USD)								$ 60
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (15) USD)								(86)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (2) USD)								$ 26

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	76	$ 9 578	$ 12
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 51 USD)			$ 12
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(97) USD)			-
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (46) USD)			$ 12

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 60,31 % (29. Februar 2020: 59,25 %)			
Brasilien — 4,12 % (29. Februar 2020: 4,72 %)			
200	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 6,125 %, Perpetual *	195	1,07
150	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17.03.2024	166	0,91
160	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05.06.2115	176	0,96
200	Ultrapar International SA, 5,250 %, fällig 06.10.2026	215	1,18
		752	4,12
Chile — 3,51 % (29. Februar 2020: 3,71 %)			
200	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA, 4,700 %, fällig 07.05.2050	250	1,37
150	Enel Chile SA, 4,875 %, fällig 12.06.2028	181	0,99
200	VTR Comunicaciones SpA, 5,125 %, fällig 15.01.2028	209	1,15
		640	3,51
China — 8,20 % (29. Februar 2020: 8,08 %)			
200	China Aoyuan Group Ltd, 7,950 %, fällig 19.02.2023	212	1,16
200	China SCE Group Holdings Ltd, 8,750 %, fällig 15.01.2021	203	1,11
200	Chinalco Capital Holdings Ltd, 4,000 %, fällig 25.08.2021	203	1,11
200	Coastal Emerald Ltd, 3,950 %, fällig 01.08.2022	204	1,12
200	Country Garden Holdings Co Ltd, 4,750 %, fällig 28.09.2023	205	1,13
230	Prosus NV, 5,500 %, fällig 21.07.2025	266	1,46
200	Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6,000 %, fällig 25.01.2022	203	1,11
		1.496	8,20
Kolumbien — 6,12 % (29. Februar 2020: 5,54 %)			
220	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA, 4,875 %, fällig 21.04.2025	231	1,27
200	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	227	1,25
200	Grupo Energia Bogota SA ESP, 4,875 %, fällig 15.05.2030	227	1,24
200	Millicom International Cellular SA, 6,250 %, fällig 25.03.2029	222	1,22
200	Oleoducto Central SA, 4,000 %, fällig 14.07.2027	208	1,14
		1.115	6,12
Hongkong — 2,21 % (29. Februar 2020: 1,06 %)			
200	Elect Global Investments Ltd, 4,850 %, Perpetual	203	1,11
200	Radiant Access Ltd, 4,600 %, Perpetual	200	1,10
		403	2,21
Indien — 1,16 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	REC Ltd, 4,750 %, fällig 19.05.2023	211	1,16
Indonesien — 5,16 % (29. Februar 2020: 4,43 %)			
300	Hutama Karya Persero PT, 3,750 %, fällig 11.05.2030	329	1,80
IDR 2.000.000	Jasa Marga Persero Tbk PT, 7,500 %, fällig 11.12.2020	135	0,74
200	Minejesa Capital BV, 5,625 %, fällig 10.08.2037	212	1,16
200	Pertamina Persero PT, 6,450 %, fällig 30.05.2044	266	1,46
		942	5,16
Israel — 1,11 % (29. Februar 2020: 1,07 %)			
200	Bank Leumi Le-Israel BM, 144A, 3,275 %, fällig 29.01.2031 *	202	1,11
Kasachstan — 2,70 % (29. Februar 2020: 3,68 %)			
200	KazMunayGas National Co JSC, 6,375 %, fällig 24.10.2048	271	1,48
200	KazTransGas JSC, 4,375 %, fällig 26.09.2027	222	1,22
		493	2,70
Kuwait — 1,32 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	MEGlobal Canada ULC, 5,875 %, fällig 18.05.2030	242	1,32
Malaysia — 2,92 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
250	Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig 19.08.2050	245	1,35
200	Petronas Capital Ltd, 4,800 %, fällig 21.04.2060	287	1,57
		532	2,92
Mexiko — 3,28 % (29. Februar 2020: 2,31 %)			
200	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 7,625 %, Perpetual *	204	1,12
200	BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125 %, fällig 18.01.2033 *	193	1,06
200	Petroleos Mexicanos, 4,625 %, fällig 21.09.2023	200	1,10
		597	3,28
Marokko — 1,16 % (29. Februar 2020: 1,15 %)			
200	OCP SA, 4,500 %, fällig 22.10.2025	212	1,16
Oman — 1,06 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	OmGrid Funding Ltd, 5,196 %, fällig 16.05.2027	193	1,06
Panama — 1,11 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Banco Nacional de Panama, 2,500 %, fällig 11.08.2030	202	1,11
Peru — 1,42 % (29. Februar 2020: 2,05 %)			
50	Banco de Credito del Peru, 3,125 %, fällig 01.07.2030 *	50	0,28
200	Kallpa Generacion SA, 4,125 %, fällig 16.08.2027	208	1,14
		258	1,42
Katar — 1,13 % (29. Februar 2020: 1,09 %)			
200	ABQ Finance Ltd, 3,500 %, fällig 22.02.2022	206	1,13
Russland — 3,77 % (29. Februar 2020: 3,68 %)			
320	Lukoil International Finance BV, 6,656 %, fällig 07.06.2022	349	1,91
300	Russian Agricultural Bank OJSC Via RSHB Capital SA, 8,500 %, fällig 16.10.2023	340	1,86
		689	3,77
Singapur — 3,51 % (29. Februar 2020: 3,38 %)			
200	BOC Aviation Ltd, 2,625 %, fällig 17.01.2025	205	1,13
200	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, fällig 19.06.2024	221	1,21
200	United Overseas Bank Ltd, 3,750 %, fällig 15.04.2029 *	214	1,17
		640	3,51
Südafrika — 1,13 % (29. Februar 2020: 1,13 %)			
200	Eskom Holdings SOC Ltd, 6,350 %, fällig 10.08.2028	206	1,13
Supranational — 0,13 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
IDR 328.500	European Bank for Reconstruction & Development, 6,450 %, fällig 13.12.2022	23	0,13
Türkei — 1,19 % (29. Februar 2020: 3,27 %)			
220	Turk Telekomunikasyon AS, 4,875 %, fällig 19.06.2024	217	1,19
Vereinigte Arabische Emirate — 2,26 % (29. Februar 2020: 6,46 %)			
35	DAE Funding LLC, 144A, 5,000 %, fällig 01.08.2024	34	0,19
90	DAE Funding LLC, 5,000 %, fällig 01.08.2024	89	0,49
250	MDGH – GMTN BV, 3,950 %, fällig 21.05.2050	289	1,58
		412	2,26
USA — 0,63 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
20	General Electric Co, 3,450 %, fällig 01.05.2027	21	0,11
20	Mastercard Inc, 3,300 %, fällig 26.03.2027	23	0,13
20	Mastercard Inc, 3,350 %, fällig 26.03.2030	24	0,13
10	Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	13	0,07
30	New York Life Insurance Co, 3,750 %, fällig 15.05.2050	34	0,19
		115	0,63
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 10.244 USD)		10.998	60,31
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 29,66 % (29. Februar 2020: 25,29 %)			
Armenien — 1,12 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Republic of Armenia International Bond, 3,950 %, fällig 26.09.2029	203	1,12
Bahrain — 1,24 % (29. Februar 2020: 1,21 %)			
200	Bahrain Government International Bond, 6,750 %, fällig 20.09.2029	226	1,24
Brasilien — 1,97 % (29. Februar 2020: 2,28 %)			
BRL 1.245	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2021	233	1,28
BRL 530	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2025	112	0,61
BRL 70	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	15	0,08
		360	1,97
Costa Rica — 1,02 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Costa Rica Government International Bond, 6,125 %, fällig 19.02.2031	186	1,02
Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) — 1,43 % (29. Februar 2020: 0,48 %)			
266	Ivory Coast Government International Bond, 5,750 %, fällig 31.12.2032	261	1,43
Dominikanische Republik —1,20 % (29. Februar 2020: 0,80 %)			
220	Dominican Republic International Bond, 4,500 %, fällig 30.01.2030	219	1,20
Ägypten — 1,12 % (29. Februar 2020: 1,56 %)			
200	Egypt Government International Bond, 7,625 %, fällig 29.05.2032	204	1,12
Äthiopien — 1,12 % (29. Februar 2020: 1,13 %)			
200	Ethiopia International Bond, 6,625 %, fällig 11.12.2024	203	1,12
Guatemala — 1,29 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Guatemala Government Bond, 5,375 %, fällig 24.04.2032	236	1,29
Indonesien — 2,53 % (29. Februar 2020: 4,28 %)			
IDR 6.160.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR68, 8,375 %, fällig 15.03.2034	461	2,53
Mexiko — 1,00 % (29. Februar 2020: 1,01 %)			
MXN 3.910	Mexican Bonos, Series M, 5,750 %, fällig 05.03.2026	183	1,00

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Nigeria — 1,09 % (29. Februar 2020: 1,06 %)			
200	Nigeria Government International Bond, 6,500 %, fällig 28.11.2027	199	1,09
Panama — 1,86 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
260	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 01.04.2056	339	1,86
Katar — 1,43 % (29. Februar 2020: 2,51 %)			
200	Qatar Government International Bond, 4,400 %, fällig 16.04.2050	260	1,43
Russland — 2,36 % (29. Februar 2020: 1,72 %)			
RUB 2.650	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6209, 7,600 %, fällig 20.07.2022	38	0,21
RUB 12.619	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028	184	1,01
RUB 13.360	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6230, 7,700 %, fällig 16.03.2039	208	1,14
		430	2,36
Senegal — 1,13 % (29. Februar 2020: 1,12 %)			
200	Senegal Government International Bond, 6,250 %, fällig 23.05.2033	207	1,13
Sri Lanka — 0,91 % (29. Februar 2020: 1,07 %)			
200	Sri Lanka Government International Bond, 144A, 7,550 %, fällig 28.03.2030	166	0,91
Ukraine — 2,35 % (29. Februar 2020: 0,56 %)			
200	Ukraine Government International Bond, 8,994 %, fällig 01.02.2024	219	1,20
100	Ukraine Government International Bond, 7,750 %, fällig 01.09.2025	106	0,58
EUR 100	Ukraine Government International Bond, 4,375 %, fällig 27.01.2030	103	0,57
		428	2,35
Vereinigte Arabische Emirate — 2,26 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Abu Dhabi Government International Bond, 2,700 %, fällig 02.09.2070	199	1,09
200	Finance Department Government of Sharjah, 4,000 %, fällig 28.07.2050	214	1,17
		413	2,26
Vietnam — 1,23 % (29. Februar 2020: 1,17 %)			
200	Vietnam Government International Bond, 144A, 4,800 %, fällig 19.11.2024	225	1,23
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 5.428 USD)		5.409	29,66
Kollektive Kapitalanlagen — 9,75 % (29. Februar 2020: 9,48 %)			
17	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US$ Distributing (M)	1.778	9,75
Gesamt Kollektive Kapitalanlagen (Kosten 1.612 USD)		1.778	9,75
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 17.284 USD)		18.185	99,72
Devisenterminkontrakte — 0,24 % (29. Februar 2020: 0,60 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		43	0,24
Termingeschäfte — 0,01 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		2	0,01
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		18.230	99,97
Kreditausfallversicherungen — (0,06 %) (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(12)	(0,06)
Devisenterminkontrakte — (0,10 %) (29. Februar 2020: (0,13 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(17)	(0,10)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(29)	(0,16)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		18.201	99,81
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		35	0,19
Gesamtnettovermögen		$18.236	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 627,000 USD und machten 3.44% des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
BRL – Brasilianischer Real
EUR – Euro
IDR – Indonesische Rupiah
MXN – Mexikanischer Peso
RUB – Russischer Rubel

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	87,42
Organismen für gemeinsame Anlagen	9,47
Finanzderivate	0,24
Sonstige Vermögenswerte	2,87
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)		Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Chile Government Bond, 1,000 %	Kauf	20.12.2024	250	$	(5)
Goldman Sachs	State of Qatar, 1,000 %	Kauf	20.12.2024	250		(7)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)					$	–
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)						(12)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)					$	(12)

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)				Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	3	Verkauf	EUR	2		$ –
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–		–
09.15.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	10	Verkauf	SGD	13		–
09.15.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	SGD	6		–
09.15.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	34	Verkauf	USD	24		–
09.15.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.940	Verkauf	USD	2.291		26
09.15.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	67	Verkauf	USD	88		2
09.15.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	268	Verkauf	SAR	1.009		(1)
15.10.2020	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	262	Verkauf	RUB	19.047		7
15.10.2020	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	RUB	736	Verkauf	USD	10		–
15.10.2020	Barclays	Kauf	USD	443	Verkauf	IDR	6.521.086		(2)
15.10.2020	Barclays	Kauf	INR	500	Verkauf	USD	7		–
15.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	371	Verkauf	BRL	1.992		8
15.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	164	Verkauf	MXN	3.783		(8)
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	USD	97	Verkauf	EUR	86		(6)
15.03.2021	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	540	Verkauf	SAR	2.028		–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 114 USD)									$ 43
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (25) USD)									(17)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 89 USD)									$ 26

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	(13)	$ (1.810)	$ 2
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)			$ 2
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(64) USD)			-
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (64) USD)			$ 2

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 91.11 % (29. Februar 2020: 88.07 %)			
Brasilien — 10,78 % (29. Februar 2020: 13,10 %)			
200	Braskem Finance Ltd, 6,450 %, fällig 03.02.2024	219	0,59
280	BRF SA, 4,875 %, fällig 24.01.2030	291	0,78
400	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 5,650 %, fällig 19.03.2022	420	1,12
300	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 6,125 %, Perpetual *	292	0,78
760	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17.03.2024	841	2,25
100	Petrobras Global Finance BV, 5,999 %, fällig 27.01.2028	111	0,30
760	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05.06.2115	837	2,24
400	Suzano Austria GmbH, 5,000 %, fällig 15.01.2030	428	1,14
200	Ultrapar International SA, 5,250 %, fällig 06.10.2026	215	0,57
280	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 10.11.2039	379	1,01
		4.033	10,78
Chile — 5,15 % (29. Februar 2020: 3,47 %)			
200	Enel Chile SA, 4,875 %, fällig 12.06.2028	241	0,64
200	GNL Quintero SA, 4,634 %, fällig 31.07.2029	218	0,58
200	Inversiones CMPC SA, 4,750 %, fällig 15.09.2024	221	0,59
200	Inversiones CMPC SA, 3,850 %, fällig 13.01.2030	216	0,58
350	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 4,250 %, fällig 07.05.2029	397	1,06
200	Transelec SA, 4,625 %, fällig 26.07.2023	215	0,58
400	VTR Comunicaciones SpA, 5,125 %, fällig 15.01.2028	419	1,12
		1.927	5,15
China — 11,00 % (29. Februar 2020: 13,49 %)			
200	Alibaba Group Holding Ltd, 3,600 %, fällig 28.11.2024	221	0,59
200	Alibaba Group Holding Ltd, 4,000 %, fällig 06.12.2037	241	0,64
200	China Aoyuan Group Ltd, 7,950 %, fällig 07.09.2021	205	0,55
250	China Overseas Finance Cayman III Ltd, 5,375 %, fällig 29.10.2023	279	0,75
200	China SCE Group Holdings Ltd, 8,750 %, fällig 15.01.2021	203	0,54
200	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 4,625 %, fällig 14.03.2023	215	0,57
200	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 3,375 %, fällig 19.06.2024	212	0,57
370	CNOOC Finance 2012 Ltd, 3,875 %, fällig 02.05.2022	388	1,04
200	CNOOC Finance 2015 USA LLC, 3,500 %, fällig 05.05.2025	221	0,59
400	Country Garden Holdings Co Ltd, 4,750 %, fällig 28.09.2023	411	1,10
200	Logan Group Co Ltd, 6,500 %, fällig 16.07.2023	206	0,55
200	Longfor Group Holdings Ltd, 3,900 %, fällig 16.04.2023	210	0,56
190	Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, fällig 12.11.2023	206	0,55
200	Prosus NV, 5,500 %, fällig 21.07.2025	231	0,62
200	Prosus NV, 4,850 %, fällig 06.07.2027	232	0,62
200	Tencent Holdings Ltd, 3,925 %, fällig 19.01.2038	230	0,61
200	Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 7,900 %, fällig 11.05.2021	205	0,55
		4.116	11,00
Kolumbien — 6,92 % (29. Februar 2020: 4,57 %)			
200	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA, 4,875 %, fällig 21.04.2025	210	0,56
200	Ecopetrol SA, 6,875 %, fällig 29.04.2030	241	0,65
400	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	455	1,22
200	Grupo de Inversiones Suramericana SA, 5,500 %, fällig 29.04.2026	226	0,60
200	Grupo Energia Bogota SA ESP, 4,875 %, fällig 15.05.2030	227	0,61
200	Millicom International Cellular SA, 6,250 %, fällig 25.03.2029	222	0,59
400	Oleoducto Central SA, 4,000 %, fällig 14.07.2027	417	1,11
200	Promigas SA ESP / Gases del Pacifico SAC, 3,750 %, fällig 16.10.2029	198	0,53
150	SURA Asset Management SA, 4,375 %, fällig 11.04.2027	165	0,44
200	Transportadora de Gas Internacional SA ESP, 5,550 %, fällig 01.11.2028	226	0,61
		2.587	6,92
Hongkong — 3,27 % (29. Februar 2020: 3,31 %)			
500	Goodman HK Finance, 4,375 %, fällig 19.06.2024	544	1,46
400	Melco Resorts Finance Ltd, 4,875 %, fällig 06.06.2025	415	1,11
250	Swire Properties MTN Financing Ltd, 4,375 %, fällig 18.06.2022	263	0,70
		1.222	3,27
Indien — 3,06 % (29. Februar 2020: 2,69 %)			
400	Bharti Airtel Ltd, 4,375 %, fällig 10.06.2025	426	1,14
200	Oil India Ltd, 5,375 %, fällig 17.04.2024	219	0,59
204	ONGC Videsh Ltd, 4,625 %, fällig 15.07.2024	221	0,59
250	Reliance Industries Ltd, 3,667 %, fällig 30.11.2027	277	0,74
		1.143	3,06
Indonesien — 1,76 % (29. Februar 2020: 1,61 %)			
200	Listrindo Capital BV, 4,950 %, fällig 14.09.2026	208	0,55
200	Minejesa Capital BV, 4,625 %, fällig 10.08.2030	208	0,56
230	Minejesa Capital BV, 5,625 %, fällig 10.08.2037	244	0,65
		660	1,76
Irland — 0,51 % (29. Februar 2020: 0,49 %)			
200	Park Aerospace Holdings Ltd, 4,500 %, fällig 15.03.2023	191	0,51
Israel — 2,13 % (29. Februar 2020: 2,98 %)			
200	Bank Leumi Le-Israel BM, 144A, 3,275 %, fällig 29.01.2031 *	203	0,54
550	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig 31.01.2025	596	1,59
		799	2,13
Kasachstan — 1,83 % (29. Februar 2020: 1,55 %)			
200	KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig 24.04.2030	241	0,64
400	KazTransGas JSC, 4,375 %, fällig 26.09.2027	443	1,19
		684	1,83
Kuwait — 1,77 % (29. Februar 2020: 0,98 %)			
200	Equate Petrochemical BV, 4,250 %, fällig 03.11.2026	214	0,57
200	MEGlobal Canada ULC, 5,875 %, fällig 18.05.2030	242	0,65
200	NBK SPC Ltd, 2,750 %, fällig 30.05.2022	206	0,55
		662	1,77
Macau — 2,03 % (29. Februar 2020: 1,77 %)			
200	MGM China Holdings Ltd, 5,375 %, fällig 15.05.2024	208	0,55
200	Sands China Ltd, 5,400 %, fällig 08.08.2028	227	0,61
330	Wynn Macau Ltd, 5,125 %, fällig 15.12.2029	325	0,87
		760	2,03
Malaysia — 2,40 % (29. Februar 2020: 0,98 %)			
500	Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig 19.08.2050	490	1,31
200	CIMB Bank Bhd, 3,263 %, fällig 15.03.2022	207	0,55
200	Gohl Capital Ltd, 4,250 %, fällig 24.01.2027	202	0,54
		899	2,40
Mexiko — 5,74 % (29. Februar 2020: 5,09 %)			
200	Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman, 7,500 %, Perpetual *	202	0,54
200	Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman, 6,875 %, Perpetual *	202	0,54
200	BBVA Bancomer SA/Texas, 6,750 %, fällig 30.09.2022	217	0,58
250	BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125 %, fällig 18.01.2033 *	241	0,64
200	Cemex SAB de CV, 6,125 %, fällig 05.05.2025	206	0,55
200	Fomento Economico Mexicano SAB de CV, 3,500 %, fällig 16.01.2050	215	0,58
200	Grupo Bimbo SAB de CV, 4,700 %, fällig 10.11.2047	238	0,64
400	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV, 2,431 %, fällig 01.07.2031	410	1,10
200	Orbia Advance Corp SAB de CV, 4,000 %, fällig 04.10.2027	215	0,57
		2.146	5,74
Marokko — 1,30 % (29. Februar 2020: 1,16 %)			
250	OCP SA, 5,625 %, fällig 25.04.2024	272	0,73
200	OCP SA, 4,500 %, fällig 22.10.2025	212	0,57
		484	1,30
Niederlande — 0,56 % (29. Februar 2020: 0,48 %)			
200	VEON Holdings BV, 4,000 %, fällig 09.04.2025	208	0,56
Panama — 2,26 % (29. Februar 2020: 1,00 %)			
400	Banco Nacional de Panama, 2,500 %, fällig 11.08.2030	405	1,08
200	Banistmo SA, 3,650 %, fällig 19.09.2022	204	0,55
220	Cable Onda SA, 4,500 %, fällig 30.01.2030	236	0,63
		845	2,26
Peru — 4,04 % (29. Februar 2020: 3,33 %)			
200	Banco BBVA Peru SA, 5,250 %, fällig 22.09.2029 *	219	0,59
190	Banco de Credito del Peru, 3,125 %, fällig 01.07.2030 *	191	0,51
200	Consorcio Transmantaro SA, 4,700 %, fällig 16.04.2034	233	0,62
200	Kallpa Generacion SA, 4,125 %, fällig 16.08.2027	208	0,56
150	Southern Copper Corp, 3,875 %, fällig 23.04.2025	166	0,44
105	Southern Copper Corp, 7,500 %, fällig 27.07.2035	157	0,42
300	Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, fällig 30.04.2028	335	0,90
		1.509	4,04
Katar — 1,92 % (29. Februar 2020: 1,66 %)			
200	ABQ Finance Ltd, 3,500 %, fällig 22.02.2022	206	0,55
200	CBQ Finance Ltd, 5,000 %, fällig 24.05.2023	217	0,58
250	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3, 5,838 %, fällig 30.09.2027	295	0,79
		718	1,92
Russland — 4,57 % (29. Februar 2020: 4,47 %)			
200	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA, 4,950 %, fällig 23.03.2027	225	0,60
200	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA, 4,950 %, fällig 06.02.2028	227	0,61

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Russland — (Fortsetzung)			
200	Gazprom PJSC via Gaz Finance Plc, 3,250 %, fällig 25.02.2030	204	0,55
370	Lukoil International Finance BV, 6,656 %, fällig 07.06.2022	403	1,08
200	Lukoil International Finance BV, 4,563 %, fällig 24.04.2023	214	0,57
200	Lukoil International Finance BV, 4,750 %, fällig 02.11.2026	225	0,60
200	MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC, 4,100 %, fällig 11.04.2023	210	0,56
		1.708	4,57
Singapur — 4,10 % (29. Februar 2020: 3,59 %)			
400	BOC Aviation Ltd, 2,750 %, fällig 18.09.2022	409	1,10
200	DBS Group Holdings Ltd, 4,520 %, fällig 11.12.2028 *	218	0,58
530	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, fällig 19.06.2024	584	1,56
300	United Overseas Bank Ltd, 3,750 %, fällig 15.04.2029 *	322	0,86
		1.533	4,10
Südafrika — 0,52 % (29. Februar 2020: 0,52 %)			
200	Sasol Financing USA LLC, 6,500 %, fällig 27.09.2028	196	0,52
Südkorea — 4,02 % (29. Februar 2020: 3,99 %)			
200	GS Caltex Corp, 3,000 %, fällig 12.06.2022	206	0,55
330	KEB Hana Bank, 4,250 %, fällig 14.10.2024	363	0,97
200	Kia Motors Corp, 3,000 %, fällig 25.04.2023	209	0,56
660	Shinhan Bank Co Ltd, 3,875 %, fällig 24.03.2026	724	1,94
		1.502	4,02
Thailand — 0,62 % (29. Februar 2020: 0,56 %)			
200	Thaioil Treasury Center Co Ltd, 4,625 %, fällig 20.11.2028	234	0,62
Türkei — 2,66 % (29. Februar 2020: 2,80 %)			
400	Mersin Uluslararasi Liman Isletmeciligi AS, 5,375 %, fällig 15.11.2024	408	1,09
200	TC Ziraat Bankasi AS, 5,125 %, fällig 03.05.2022	195	0,52
400	Turk Telekomunikasyon AS, 4,875 %, fällig 19.06.2024	394	1,05
		997	2,66
Vereinigte Arabische Emirate — 3,35 % (29. Februar 2020: 4,38 %)			
400	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC, 4,600 %, fällig 02.11.2047	490	1,31
200	Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 3,625 %, fällig 12.01.2023 *	212	0,57
200	DAE Funding LLC, 5,000 %, fällig 01.08.2024	197	0,52
300	DP World Plc, 5,625 %, fällig 25.09.2048	355	0,95
		1.254	3,35
Großbritannien — 1,64 % (29. Februar 2020: 1,93 %)			
560	Hutchison Whampoa International 14 Ltd, 3,625 %, fällig 31.10.2024	612	1,64
USA — 0,11 % (29. Februar 2020: 1,22 %)			
40	General Electric Co, 3,450 %, fällig 01.05.2027	42	0,11
Sambia — 1,09 % (29. Februar 2020: 0,90 %)			
200	First Quantum Minerals Ltd, 7,250 %, fällig 01.04.2023	204	0,54
200	First Quantum Minerals Ltd, 7,500 %, fällig 01.04.2025	204	0,55
		408	1,09
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 31.983 USD)		34.079	91,11
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 6,89 % (29. Februar 2020: 9,69 %)			
Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) — 0,54 % (29. Februar 2020: 0,48 %)			
200	Ivory Coast Government International Bond, 6,125 %, fällig 15.06.2033	202	0,54
Ägypten — 0,55 % (29. Februar 2020: 0,88 %)			
200	Egypt Government International Bond, 7,625 %, fällig 29.05.2032	204	0,55
Indien — 0,57 % (29. Februar 2020: 0,98 %)			
200	Export-Import Bank of India, 3,375 %, fällig 05.08.2026	212	0,57
Nigeria — 0,55 % (29. Februar 2020: 0,48 %)			
200	Nigeria Government International Bond, 7,875 %, fällig 16.02.2032	204	0,55
Oman — 0,52 % (29. Februar 2020: 0,95 %)			
200	Oman Government International Bond, 5,625 %, fällig 17.01.2028	196	0,52
Senegal — 0,55 % (29. Februar 2020: 0,49 %)			
200	Senegal Government International Bond, 6,250 %, fällig 23.05.2033	207	0,55
Südafrika — 0,60 % (29. Februar 2020: 0,56 %)			
250	Republic of South Africa Government International Bond, 5,750 %, fällig 30.09.2049	225	0,60
Türkei — 0,51 % (29. Februar 2020: 0,47 %)			
200	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS, 6,125 %, fällig 03.05.2024	192	0,51
Ukraine — 1,37 % (29. Februar 2020: 1,03 %)			
200	Ukraine Government International Bond, 7,750 %, fällig 01.09.2025	212	0,57
300	Ukraine Government International Bond, 7,253 %, fällig 15.03.2033	301	0,80
		513	1,37
Vereinigte Arabische Emirate — 1,13 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 3,125 %, fällig 16.04.2030	225	0,60
200	Abu Dhabi Government International Bond, 2,700 %, fällig 02.09.2070	198	0,53
		423	1,13
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 2.600 USD)		2.578	6,89
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 34.583 USD)		36.657	98,00
Devisenterminkontrakte — 0,01 % (29. Februar 2020: 0,01 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		6	0,01
Termingeschäfte — 0,01 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		4	0,01
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		36.667	98,02
Devisenterminkontrakte — (0,01 %) (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(4)	(0,01)
Termingeschäfte — (0,00 %) (29. Februar 2020: 0,17 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(1)	-
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(5)	(0,01)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		36.662	98,01
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		741	1,99
Gesamtnettovermögen		$37.403	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 428,000 USD und machten 1.14 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,39
Finanzderivate	0,02
Sonstige Vermögenswerte	2,59
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	409	Verkauf	USD	483	$ 6
15.09.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.179	Verkauf	SAR	4.435	(3)
15.03.2021	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	721	Verkauf	SAR	2.708	(1)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 3 USD)								$ 6
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (-) USD)								(4)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 3 USD								$ 2

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	(16)	$ (2.228)	$ (1)
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	(2)	(351)	
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)			$ 4
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(71) USD)			(1)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (71) USD)			$ 3

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 65,88 % (29. Februar 2020: 54,16 %)			
Argentinien — 2,22 % (29. Februar 2020: 1,81 %)			
410	Pampa Energia SA, 144A, 7,500 %, fällig 24.01.2027	351	0,37
810	Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750 %, fällig 02.05.2025	700	0,74
500	YPF SA, 144A, 8,500 %, fällig 23.03.2021	484	0,52
680	YPF SA, 144A, 8,500 %, fällig 28.07.2025	550	0,59
		2.085	2,22
Brasilien — 3,55 % (29. Februar 2020: 4,19 %)			
400	Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 4,500 %, fällig 10.01.2028	391	0,42
700	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 5,650 %, fällig 19.03.2022	736	0,78
300	Petrobras Global Finance BV, 4,375 %, fällig 20.05.2023	314	0,33
860	Petrobras Global Finance BV, 7,375 %, fällig 17.01.2027	1.021	1,09
530	Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01.02.2029	583	0,62
270	Ultrapar International SA, 144A, 5,250 %, fällig 06.10.2026	290	0,31
		3.335	3,55
Kanada — 1,77 % (29. Februar 2020: 1,35 %)			
210	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2024	214	0,23
100	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.04.2025	107	0,11
210	Cascades Inc/Cascades USA Inc, 5,375 %, fällig 15.01.2028	224	0,24
380	GFL Environmental Inc, 144A, 3,750 %, fällig 01.08.2025	383	0,41
240	GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2026	254	0,27
150	MEG Energy Corp, 144A, 7,000 %, fällig 31.03.2024	149	0,16
100	Open Text Corp, 144A, 3,875 %, fällig 15.02.2028	103	0,11
220	Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2030	229	0,24
		1.663	1,77
Kaimaninseln — 0,30 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
480	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15.09.2024	281	0,30
Frankreich — 1,19 % (29. Februar 2020: 0,78 %)			
1.050	Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, fällig 01.05.2026	1.116	1,19
Deutschland — 0,41 % (29. Februar 2020: 0,57 %)			
EUR 310	Vertical Midco GmbH, 4,375 %, fällig 15.07.2027	380	0,41
Hongkong — 0,29 % (29. Februar 2020: 0,24 %)			
260	Melco Resorts Finance Ltd, 5,375 %, fällig 04.12.2029	268	0,29
Indonesien — 0,51 % (29. Februar 2020: 0,81 %)			
460	Minejesa Capital BV, 144A, 4,625 %, fällig 10.08.2030	479	0,51
Irland — 0,22 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC, 144A, 5,000 %, fällig 15.07.2028	208	0,22
Israel — 3,35 % (29. Februar 2020: 4,09 %)			
EUR 280	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,125 %, fällig 15.10.2024	302	0,32
1.840	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21.07.2023	1.770	1,89
1.170	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	1.074	1,14
		3.146	3,35
Italien — 1,36 % (29. Februar 2020: 2,46 %)			
200	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, fällig 26.06.2024	216	0,23
520	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig 15.01.2026	578	0,62
100	Telecom Italia Capital SA, 7,200 %, fällig 18.07.2036	132	0,14
300	UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, fällig 02.04.2034 *	351	0,37
		1.277	1,36
Luxemburg — 0,72 % (29. Februar 2020: 0,80 %)			
390	ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	401	0,43
EUR 230	Summer BC Holdco B SARL, 5,750 %, fällig 31.10.2026	273	0,29
		674	0,72
Macau — 0,44 % (29. Februar 2020: 0,19 %)			
200	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26.08.2028	201	0,22
210	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2029	207	0,22
		408	0,44
Mexiko — 4,72 % (29. Februar 2020: 1,73 %)			
1.580	BBVA Bancomer SA/Texas, 144A, 5,125 %, fällig 18.01.2033 *	1.524	1,62
670	Cemex SAB de CV, 144A, 7,375 %, fällig 05.06.2027	727	0,78
500	Petroleos Mexicanos, 6,875 %, fällig 04.08.2026	511	0,54
1.310	Petroleos Mexicanos, 6,625 %, fällig 15.06.2035	1.159	1,24
600	Petroleos Mexicanos, 6,625 %, fällig 15.06.2038	507	0,54
		4.428	4,72
Niederlande — 0,38 % (29. Februar 2020: 0,29 %)			
EUR 311	Maxeda DIY Holding BV, 6,125 %, fällig 15.07.2022	358	0,38
Südkorea — 0,29 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
260	Clark Equipment Co, 144A, 5,875 %, fällig 01.06.2025	274	0,29
Schweiz — 1,73 % (29. Februar 2020: 0,47 %)			
300	Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, Perpetual *	324	0,35
300	Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, Perpetual *	331	0,35
890	UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	965	1,03
		1.620	1,73
Türkei — 1,31 % (29. Februar 2020: 1,16 %)			
320	TC Ziraat Bankasi AS, 144A, 5,125 %, fällig 03.05.2022	312	0,33
300	TC Ziraat Bankasi AS, 144A, 5,125 %, fällig 29.09.2023	282	0,30
610	Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 6,875 %, fällig 28.02.2025	637	0,68
		1.231	1,31
Großbritannien — 4,44 % (29. Februar 2020: 3,77 %)			
390	Barclays Bank Plc, 7,625 %, fällig 21.11.2022	434	0,46
220	Barclays Plc, 5,088 %, fällig 20.06.2030 *	256	0,27
300	Barclays Plc, 8,000 %, Perpetual *	328	0,35
320	HSBC Holdings Plc, 6,500 %, Perpetual *	345	0,37
GBP 510	Marston's Issuer Plc, Series B1, 2,632 %, fällig 15.07.2035 *	539	0,58
670	Natwest Group Plc, 8,625 %, Perpetual *	706	0,75
GBP 210	Pinnacle Bidco Plc, 6,375 %, fällig 15.02.2025	259	0,28
GBP 320	Saga Plc, 3,375 %, fällig 12.05.2024	348	0,37
GBP 400	Santander UK Group Holdings Plc, 7,375 %, Perpetual *	568	0,61
349	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	378	0,40
		4.161	4,44
USA — 35,82 % (29. Februar 2020: 27,25 %)			
290	Adient Global Holdings Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 15.08.2026	272	0,29
560	American Axle & Manufacturing Inc, 6,500 %, fällig 01.04.2027	576	0,61
210	Apache Corp, 5,100 %, fällig 01.09.2040	204	0,22
780	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.02.2025	814	0,87
380	Ball Corp, 2,875 %, fällig 15.08.2030	380	0,41
300	Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.04.2026	333	0,35
200	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2027	215	0,23
300	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,000 %, fällig 30.01.2028	297	0,32
80	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	66	0,07
660	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2026	583	0,62
340	Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig 01.07.2030	370	0,39
330	BWX Technologies Inc, 144A, 4,125 %, fällig 30.06.2028	345	0,37
140	Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc, 144A, 5,750 %, fällig 01.07.2025	147	0,16
180	Carriage Services Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.06.2026	191	0,20
2.360	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.05.2032	2.504	2,67
290	CDW LLC / CDW Finance Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2028	304	0,32
230	CDW LLC / CDW Finance Corp, 3,250 %, fällig 15.02.2029	235	0,25
150	Citigroup Inc, Series M, 6,300 %, Perpetual *	161	0,17
360	Cogent Communications Group Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.03.2022	372	0,40
262	CommScope Technologies LLC, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2025	269	0,29
–	Continental Airlines 2000-1 Klasse B Pass Through Trust, Series 001B, Klasse B, 8,388 %, fällig 01.11.2020	–	–
110	CoreCivic Inc, 4,750 %, fällig 15.10.2027	94	0,10
490	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	552	0,59
200	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	208	0,22
140	Delta Air Lines Inc, 3,625 %, fällig 15.03.2022	139	0,15
170	Delta Air Lines Inc, 3,800 %, fällig 19.04.2023	163	0,17
300	Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig 28.10.2024	276	0,29
810	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	888	0,95
300	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	313	0,33
360	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	413	0,44
190	DISH Network Corp, 2,375 %, fällig 15.03.2024	179	0,19
610	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	603	0,64

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
110	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2025	115	0,12
80	Energizer Holdings Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.07.2026	85	0,09
100	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000 %, fällig 01.07.2025	106	0,11
90	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, fällig 01.07.2027	99	0,11
400	EQT Corp, 3,900 %, fällig 01.10.2027	388	0,41
350	Fair Isaac Corp, 144A, 4,000 %, fällig 15.06.2028	364	0,39
360	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21.04.2023	399	0,42
200	Ford Motor Credit Co LLC, 3,336 %, fällig 18.03.2021	201	0,21
200	Ford Motor Credit Co LLC, 3,087 %, fällig 09.01.2023	199	0,21
240	Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, fällig 16.06.2025	253	0,27
550	Ford Motor Credit Co LLC, 4,125 %, fällig 17.08.2027	550	0,59
370	Freeport-McMoRan Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2023	384	0,41
300	Greif Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.03.2027	320	0,34
540	Hanesbrands Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15.05.2026	589	0,63
280	HCA Inc, 5,625 %, fällig 01.09.2028	333	0,36
130	Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,750 %, fällig 01.05.2028	137	0,15
240	International Game Technology Plc, 144A, 5,250 %, fällig 15.01.2029	246	0,26
160	IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2025	171	0,18
300	JB Poindexter & Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.04.2026	320	0,34
330	Kraft Heinz Foods Co, 3,000 %, fällig 01.06.2026	344	0,37
10	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 3,875 %, fällig 15.05.2027	11	0,01
250	Kraft Heinz Foods Co, 4,625 %, fällig 30.01.2029	284	0,30
50	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 4,250 %, fällig 01.03.2031	55	0,06
320	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 7,125 %, fällig 01.08.2039	442	0,47
230	Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, fällig 01.06.2046	236	0,25
170	L Brands Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.07.2025	184	0,20
250	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2027	230	0,25
140	LifePoint Health Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.04.2025	151	0,16
420	Magellan Health Inc, 4,900 %, fällig 22.09.2024	438	0,47
150	Match Group Holdings II LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.12.2027	160	0,17
40	Michaels Stores Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.07.2027	40	0,04
390	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	407	0,43
490	Montage Resources Corp, 8,875 %, fällig 15.07.2023	503	0,54
420	NCL Corp Ltd, 144A, 12,250 %, fällig 15.05.2024	469	0,50
360	NCL Corp Ltd, 144A, 10,250 %, fällig 01.02.2026	363	0,39
160	Newell Brands Inc, 4,875 %, fällig 01.06.2025	174	0,18
420	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, fällig 15.03.2022 † ɛ	83	0,09
290	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, fällig 15.01.2023 † ɛ	57	0,06
230	Occidental Petroleum Corp, 2,900 %, fällig 15.08.2024	212	0,23
150	Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, fällig 15.03.2026	148	0,16
110	Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, fällig 01.09.2030	114	0,12
230	ON Semiconductor Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.09.2028	241	0,26
440	Party City Holdings Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.08.2026	112	0,12
300	PetSmart Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.06.2025	309	0,33
170	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.04.2026	188	0,20
EUR 320	Primo Water Corp, 5,500 %, fällig 01.07.2024	391	0,42
240	Range Resources Corp, 5,000 %, fällig 15.03.2023	240	0,26
750	Range Resources Corp, 4,875 %, fällig 15.05.2025	702	0,75
140	Range Resources Corp, 144A, 9,250 %, fällig 01.02.2026	148	0,16
100	Sensata Technologies Inc, 4,375 %, fällig 15.02.2030	106	0,11
440	Sensata Technologies Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.02.2030	465	0,50
270	ServiceMaster Co LLC/The, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2024	276	0,29
250	Sirius XM Radio Inc, 144A, 4,125 %, fällig 01.07.2030	263	0,28
140	Spectrum Brands Inc, 5,750 %, fällig 15.07.2025	145	0,15
450	Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15.11.2028	576	0,61
490	Sprint Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2023	571	0,61
200	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,875 %, fällig 15.04.2026	211	0,22
140	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,375 %, fällig 01.02.2027	145	0,15
110	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 6,500 %, fällig 15.07.2027	119	0,13
300	Tenet Healthcare Corp, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2025	330	0,35
140	Tenet Healthcare Corp, 144A, 4,625 %, fällig 15.06.2028	146	0,16
540	TransDigm Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.12.2025	588	0,63
260	Twitter Inc, 3,875 %, fällig 15.12.2027	275	0,29
260	Twitter Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2027	275	0,29
710	United Airlines Holdings Inc, 4,250 %, fällig 01.10.2022	658	0,70
140	United Airlines Holdings Inc, 5,000 %, fällig 01.02.2024	127	0,14
490	United Rentals North America Inc, 4,875 %, fällig 15.01.2028	518	0,55
280	Univision Communications Inc, 144A, 9,500 %, fällig 01.05.2025	308	0,33
805	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	670	0,71
360	Western Midstream Operating LP, 4,650 %, fällig 01.07.2026	369	0,39
250	Western Midstream Operating LP, 4,750 %, fällig 15.08.2028	252	0,27
20	Western Midstream Operating LP, 5,050 %, fällig 01.02.2030	20	0,02
875	Windstream Services LLC / Windstream Finance Corp, 10,500 %, fällig 30.06.2024 †ɛ	17	0,02
160	WW International Inc, 144A, 8,625 %, fällig 01.12.2025	169	0,18
150	Wyndham Hotels & Resorts Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.08.2028	151	0,16
400	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,750 %, fällig 15.04.2025	420	0,45
170	XHR LP, 144A, 6,375 %, fällig 15.08.2025	175	0,19
90	Yum! Brands Inc, 144A, 7,750 %, fällig 01.04.2025	101	0,11
		33.607	35,82
Sambia — 0,86 % (29. Februar 2020: 0,56 %)			
810	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 15.05.2022	810	0,86
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 60.238 USD)		61.809	65,88
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 18,38 % (29. Februar 2020: 26,73 %)			
Argentinien — 2,15 % (29. Februar 2020: 2,07 %)			
ARS 1.469	Argentina Treasury Bond BONCER, Series CER, 1,000 %, fällig 05.08.2021 †b	13	0,01
800	Argentine Republic Government International Bond, 6,875 %, fällig 22.04.2021 ɛ	389	0,42
480	Argentine Republic Government International Bond, 7,500 %, fällig 22.04.2026 ɛ	221	0,24
1.030	Argentine Republic Government International Bond, 6,875 %, fällig 26.01.2027 ɛ	462	0,49
1.090	Argentine Republic Government International Bond, 5,875 %, fällig 11.01.2028 ɛ	489	0,52
910	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144A, 9,950 %, fällig 09.06.2021 ɛ	441	0,47
		2.015	2,15
Brasilien — 1,58 % (29. Februar 2020: 4,10 %)			
BRL 1.108	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2023	228	0,24
800	Brazilian Government International Bond, 4,250 %, fällig 07.01.2025	864	0,92
350	Brazilian Government International Bond, 4,625 %, fällig 13.01.2028	387	0,42
		1.479	1,58
Costa Rica — 0,20 % (29. Februar 2020: 0,44 %)			
200	Costa Rica Government International Bond, 6,125 %, fällig 19.02.2031	186	0,20
Dominikanische Republik —0,56 % (29. Februar 2020: 0,50 %)			
500	Dominican Republic International Bond, 144A, 5,500 %, fällig 27.01.2025	526	0,56
Ecuador — 0,37 % (29. Februar 2020: 0,84 %)			
615	Ecuador Government International Bond, Series S24, 7,950 %, fällig 31.07.2040 ɛ	347	0,37
Ägypten — 1,05 % (29. Februar 2020: 0,34 %)			
950	Egypt Government International Bond, 144A, 5,577 %, fällig 21.02.2023	984	1,05
El Salvador — 0,20 % (29. Februar 2020: 0,20 %)			
200	El Salvador Government International Bond, 144A, 6,375 %, fällig 18.01.2027	187	0,20
Ghana — 0,68 % (29. Februar 2020: 0,61 %)			
360	Ghana Government International Bond, 144A, 10,750 %, fällig 14.10.2030	445	0,48
200	Ghana Government International Bond, 144A, 8,125 %, fällig 26.03.2032	191	0,20
		636	0,68

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Guatemala — 0,43 % (29. Februar 2020: 0,56 %)			
370	Guatemala Government Bond, 144A, 4,375 %, fällig 05.06.2027	403	0,43
Honduras — 0,42 % (29. Februar 2020: 0,57 %)			
350	Honduras Government International Bond, 144A, 6,250 %, fällig 19.01.2027	391	0,42
Indonesien — 0,91 % (29. Februar 2020: 2,84 %)			
IDR 1.966.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR53, 8,250 %, fällig 15.07.2021	140	0,15
IDR 10.034.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR61, 7,000 %, fällig 15.05.2022	719	0,76
		859	0,91
Jamaika - 0,25 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Jamaica Government International Bond, 6,750%, fällig 28.04.2028	234	0,25
Nigeria – 0,32 % (29. Februar 2020: 0,47 %)			
300	Nigeria Government International Bond, 144A, 7,875%, fällig 16.02.2032	305	0,32
Oman – 0,52 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
500	Oman Government International Bond, 144A, 5,625%, fällig 17.01.2028	490	0,52
Paraguay – 0,73 % (29. Februar 2020: 0,61 %)			
590	Paraguay Government International Bond, 144A, 5,000%, fällig 15.04.2026	681	0,73
Russland – 1,09 % (29. Februar 2020: 1,02 %)			
RUB 69.969	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212, 7,050%, fällig 19.01.2028	1.020	1,09
Südafrika – 0,68 % (29. Februar 2020: 0,22 %)			
400	Republic of South Africa Government International Bond, 4,875%, fällig 14.04.2026	410	0,44
250	Republic of South Africa Government International Bond, 5,650 %, fällig 27.09.2047	226	0,24
		636	0,68
Sri Lanka — 0,86 % (29. Februar 2020: 0,54 %)			
300	Sri Lanka Government International Bond, 6,250 %, fällig 04.10.2020	295	0,31
270	Sri Lanka Government International Bond, 144A, 6,850 %, fällig 14.03.2024	242	0,26
325	Sri Lanka Government International Bond, 144A, 7,850 %, fällig 14.03.2029	273	0,29
		810	0,86
Türkei — 1,90 % (29. Februar 2020: 2,35 %)			
1.960	Turkey Government International Bond, 4,250 %, fällig 14.04.2026	1.786	1,90
Ukraine — 1,32 % (29. Februar 2020: 1,49 %)			
500	Ukraine Government International Bond, 144A, 7,750 %, fällig 01.09.2020	500	0,53
700	Ukraine Government International Bond, 144A, 7,750 %, fällig 01.09.2026	741	0,79
		1.241	1,32
USA — 2,16 % (29. Februar 2020: 3,38 %)			
750	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 30.06.2025	750	0,80
1.200	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.01.2027	1.282	1,36
		2.032	2,16
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 19.037 USD)			
Schuldverschreibungen — 2,57 % (29. Februar 2020: 7,78 %)			
540	Chesapeake Energy Corp, Coupon zéro, vencido 23.06.2024 *	358	0,38
1.200	Delta Air Lines Inc, 5,750 %, fällig 29.04.2023 *	1.199	1,28
290	JetBlue Airways Corp, 6,250 %, fällig 17.06.2024 *	290	0,31
305	Party City Holdings Inc, 4,100 %, fällig 19.08.2022 *	216	0,23
340	United Airlines, 6,250 %, fällig 25.06.2027 *	343	0,37
Summe Darlehensschuldverschreibungen (Anschaffungskosten 2.627 USD)		2.406	2,57
Kollektive Kapitalanlagen — 7,70 % (29. Februar 2020: 9,60 %)			
6	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US$ Distributing (M)	649	0,69
EUR 26	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Euro High Yield Fund – LM Class Euro (Accumulating)	5.507	5,87
EUR 9	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	1.067	1,14
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 5.929 USD)		7.223	7,70
Stammaktien — 0,31 % (29. Februar 2020: 0,14 %)			
USA — 0,31 % (29. Februar 2020: 0,14 %)			
–	H&E Equipment Services Inc – New Cotai 'B' †∞	–	–
57	Hercules Offshore Inc †∞	46	0,05
1	MWO Holdings Ltd †∞	82	0,09
7	Wells Fargo & Co	164	0,17
		292	0,31
Stammaktien insgesamt (Kosten 1.959 USD)		292	0,31
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 89.790 USD)		88.978	94,84
Devisenterminkontrakte — 0,57 % (29. Februar 2020: 0,05 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		5,36	0,57
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		89.514	95,41
Devisenterminkontrakte — (0,18 %) (29. Februar 2020: (0,34 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(166)	(0,18)
Termingeschäfte — (0,35 %) (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(331)	(0,35)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(497)	(0,53)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		89.017	94,88
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		4.804	5,12
Gesamtnettovermögen		$37.403	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 40.432.000 USD, soit 43,12 % de l'actif net.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

† Illiquide.

∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

ε Das Wertpapier ist zum oder seit Ende des Berichtszeitraums am 31. August 2020 in Verzug (entweder Tilgungs- und / oder Zinszahlungen).

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (VPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihzins entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
ARS	– Argentinischer Peso
BRL	– Brasilianischer Real
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
IDR	– Indonesische Rupiah
RUB	– Russischer Rubel

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	82,34
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,50
Finanzderivate	7,50
Sonstige Vermögenswerte	7,10
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)				Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf		SGD	2	$ –
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	504	Verkauf		AUD	700	(12)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	462	Verkauf		EUR	388	(2)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	8	Verkauf		GBP	6	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	6	Verkauf		SGD	9	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	76	Verkauf		SGD	105	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	12.950	Verkauf		USD	9.281	270
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.736	Verkauf		USD	2.269	52
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.609	Verkauf		USD	3.079	36
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	24	Verkauf		USD	18	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	9.614	Verkauf		USD	7.007	59
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	26	Verkauf		USD	31	–
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	USD	351	Verkauf		EUR	310	(19)
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	EUR	1.729	Verkauf		USD	1.946	119
16.10.2020	Citi	Kauf	USD	1.430	Verkauf		GBP	1.143	(98)
19.11.2020	Citi	Kauf	USD	1.199	Verkauf		EUR	1.014	(14)
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.896	Verkauf		EUR	1.603	(21)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 59 USD)									$ 536
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (370) USD)									(166)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (311) USD)									$ 370

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro FX Currency September 2020	(47)	$ (7.014)	$ (331)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 72 USD)			$ (331)
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):– USD)			-
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 72 USD)			$ (331)

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 94,14 % (29. Februar 2020: 92,80 %)			
Australien — 0,23 % (29. Februar 2020: 0,15 %)			
AUD 90	Australie Government Bond, Series 30CI, 2,500 %, fällig 20.09.2030 β	106	0,23
Kanada — 2,13 % (29. Februar 2020: 1,85 %)			
CAD 520	Canadian Government Real Return Bond, Series CPI, 4,250 %, fällig 01.12.2026 β	831	1,79
CAD 90	Canadian Government Real Return Bond, Series CPI, 4,000 %, fällig 01.12.2031 β	160	0,34
		991	2,13
Frankreich — 6,14 % (29. Februar 2020: 3,00 %)			
EUR 1.000	French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,850 %, fällig 25.07.2027 β	1.626	3,49
EUR 340	French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 144A, 1,800 %, fällig 25.07.2040 β	770	1,66
EUR 290	French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 144A, 0,100 %, fällig 25.07.2047 β	461	0,99
		2.857	6,14
Deutschland — 1,63 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 430	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Series I/L, 0,100 %, fällig 15.04.2046 β	761	1,63
Indonesien — 1,63 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
640	Indonesia Government International Bond, 4,200 %, fällig 15.10.2050	758	1,63
Italien — 9,08 % (29. Februar 2020: 8,52 %)			
EUR 1.700	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 3,100 %, fällig 15.09.2026 β	2.650	5,69
EUR 750	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 0,400 %, fällig 15.05.2030 β	899	1,93
EUR 10	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 2,550 %, fällig 15.09.2041 β	18	0,04
EUR 440	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,250 %, fällig 01.09.2046	662	1,42
		4.229	9,08
Japan — 10,13 % (29. Februar 2020: 12,05 %)			
JPY 14.400	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 21, 0,100 %, fällig 10.03.2026 β	138	0,30
JPY 342.000	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 22, 0,100 %, fällig 10.03.2027 β	3.293	7,07
JPY 133.900	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 23, 0,100 %, fällig 10.03.2028 β	1.282	2,76
		4.713	10,13
Mexiko — 3,55 % (29. Februar 2020: 2,81 %)			
MXN 17.002	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	868	1,86
EUR 650	Mexico Government International Bond, 2,875 %, fällig 08.04.2039	785	1,69
		1.653	3,55
Nueva zelanda — 1,70 % (29. Februar 2020: 1,09 %)			
NZD 790	New Zealand Government Inflation Linked Bond, Series 0930, 3,000 %, fällig 20.09.2030 β	793	1,70
Südafrika — 1,51 % (29. Februar 2020: 1,29 %)			
ZAR 18.820	Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	705	1,51
Spanien — 3,91 % (29. Februar 2020: 2,62 %)			
EUR 1.290	Spain Government Inflation Linked Bond, 144A, 0,700 %, fällig 30.11.2033 β	1.818	3,91
Großbritannien — 0,65 % (29. Februar 2020: 0,42 %)			
GBP 70	United Kingdom Gilt Inflation Linked, Series 3MO, 0,125 %, fällig 22.03.2068 β	301	0,65
USA — 51,85 % (29. Februar 2020: 57,94 %)			
3.790	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15.07.2025 β	4.516	9,70
1.670	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15.01.2026 β	2.017	4,34
5.050	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15.01.2027 β	5.996	12,88
1.340	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500 %, fällig 15.01.2028 β	1.588	3,41
1.760	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 3,875 %, fällig 15.04.2029 β	4.017	8,63
3.740	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15.01.2030 β	4.195	9,01
970	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,750 %, fällig 15.02.2045 β	1.350	2,90
380	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,250 %, fällig 15.02.2050 β	454	0,98
		24.133	51,85
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 40.580 USD)		43.818	94,14
Kollektive Kapitalanlagen — 3,64 % (29. Februar 2020: 0,79 %)			
1.693	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	1.693	3,64
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.693 USD)		7.223	7,70
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 42.273 USD)		45.511	97,78

Kontrakte (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Nettoinventarwerts
Gekaufte Optionen — 0,00 % (29. Februar 2020: 0,04 %)			
250	USD Call/ZAR Put 18,10, fällig 102.10.2020	2	–
Summe gekaufte Optionen (Kosten 3 USD)		2	–
Devisenterminkontrakte — 0,13 % (29. Februar 2020: 0,07 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		60	0,13
Termingeschäfte — 0,20 % (29. Februar 2020: 0,12 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		92	0,20
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		45.665	98,11
Geschriebene Optionen — (0,05 %) (29. Februar 2020: (0,10 %))			
EUR	– Euro-Bund Oktober 2020 Put 172,00, fällig 25.09.2020	(4)	(0,01)
	– U.S. Bond Oktober 2020 Put 175,00, fällig 25.09.2020	(4)	-
(520)	USD Put/NOK Call 9,00, fällig 25.09.2020	(18)	(0,4)
Geschriebene Optionen insgesamt (Kosten (15) USD)		(26)	(0,05)
Devisenterminkontrakte — (0,72 %) (29. Februar 2020: (0,51 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(334)	(0,72)
Termingeschäfte — (0,14 %) (29. Februar 2020: 0,84 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(63)	(0,14)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(423)	(0,91)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		45.242	97,20
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		1.302	2,80
Gesamtnettovermögen		$ 46.544	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 7,278,000 USD und machten 15.64 % des Nettovermögens aus.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (VPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihzins entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

Die Gegenparteien für OTC-Optionen sind Goldman Sachs und JP Morgan.

ABKÜRZUNGEN:

IPC	– Verbraucherpreisindex
AUD	– Australischer Dollar
CAD	– Kanadischer Dollar
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
JPY	– Japanischer Yen
MXN	– Mexikanischer Peso
NZD	– Neuseeländischer Dollar
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,04
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,59
Finanzderivate	0,32
Sonstige Vermögenswerte	3,05
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
24.09.2020	Morgan Stanley	Kauf	BRL	2.140	Verkauf	USD	413	$ (23)
19.11.2020	BNP Paribas	Kauf	USD	348	Verkauf	EUR	295	(5)
19.11.2020	BNP Paribas	Kauf	USD	92	Verkauf	GBP	70	(2)
19.11.2020	Citi	Kauf	USD	679	Verkauf	EUR	575	(8)
19.11.2020	Citi	Kauf	USD	940	Verkauf	JPY	99.571	(1)
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	941	Verkauf	CAD	1.250	(18)
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.413	Verkauf	EUR	2.040	(26)
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.639	Verkauf	JPY	279.700	(4)
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	659	Verkauf	NZD	997	(12)
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	NOK	9.330	Verkauf	USD	1.041	27
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	AUD	1.070	Verkauf	USD	769	21
19.11.2020	HSBC	Kauf	USD	1.591	Verkauf	EUR	1.350	(23)
19.11.2020	HSBC	Kauf	EUR	615	Verkauf	USD	727	8
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	1.451	Verkauf	AUD	2.024	(42)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	1.414	Verkauf	CAD	1.882	(28)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	1.180	Verkauf	EUR	1.001	(16)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	1.311	Verkauf	GBP	1.000	(27)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	MXN	1.341	Verkauf	USD	59	1
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	JPY	63.006	Verkauf	USD	593	3
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	439	Verkauf	ZAR	7.767	(16)
19.11.2020	UBS	Kauf	USD	5.425	Verkauf	EUR	4.607	(83)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 31 USD)								$ 60
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (241) USD)								(334)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (210) USD)								$ (274)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Australie 10 Year Bond September 2020	9	$ 979	$ 3
Euro-Bobl September 2020	9	1.446	3
Euro-BTP September 2020	(3)	(524)	5
Euro-Bund Dezember 2020	(10)	(2.061)	8
Euro-Bund September 2020	(11)	(2.304)	(6)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2020	(7)	(1.812)	(9)
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2020	(2)	(2.863)	11
Long Gilt Dezember 2020	(3)	(541)	5
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	(29)	(4.038)	4
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2020	(56)	(8.929)	49
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	22	2.773	4
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	13	2.284	(24)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	6	1.325	(24)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 59 USD)			$ 92
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(400) USD)			(63)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (341) USD)			$ 29

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 25,16 % (29. Februar 2020: 29,63 %)			
Australien — 1,80 % (29. Februar 2020: 1,71 %)			
CNY 60.000	Commonwealth Bank of Australie, 4,200 %, fällig 26.10.2020	8.777	1,59
SGD 1.500	National Australie Bank Ltd, 4,150 %, fällig 19.05.2028 *	1.137	0,21
		9.914	1,80
China — 8,73 % (29. Februar 2020: 11,71 %)			
HKD 17.000	Bank of China Ltd/Hong Kong, 3,300 %, fällig 20.11.2020	2.206	0,40
CNY 9.000	Bank of China Ltd/Macau, 3,300 %, fällig 17.04.2022	1.323	0,24
3.150	China Minmetals Corp, 3,750 %, Perpetual *	3.221	0,58
850	China SCE Group Holdings Ltd, 8,750 %, fällig 15.01.2021	863	0,16
1.600	China SCE Group Holdings Ltd, 5,875 %, fällig 10.03.2022	1.612	0,29
5.000	Chinalco Capital Holdings Ltd, 4,250 %, fällig 21.04.2022	5.083	0,92
1.000	Chinalco Capital Holdings Ltd, 4,100 %, Perpetual *	1.033	0,19
CNY 30.000	CNI Capital Ltd, 3,970 %, fällig 01.11.2022	4.390	0,79
5.000	Coastal Emerald Ltd, 4,300 %, Perpetual *	5.163	0,93
CNY 11.000	Country Garden Holdings Co Ltd, 5,800 %, fällig 12.03.2021	1.614	0,29
5.000	Huaneng Hong Kong Capital Ltd, 3,600 %, Perpetual *	5.056	0,92
SGD 7.500	Huarong Finance 2017 Co Ltd, 3,200 %, fällig 27.04.2021	5.551	1,01
1.100	Longfor Group Holdings Ltd, 4,500 %, fällig 16.01.2028	1.214	0,22
CNY 23.000	Shimao Group Holdings Ltd, 5,750 %, fällig 15.03.2021	3.389	0,61
1.000	Spic 2018 Usd Senior Perpetual Bond Co Ltd, 5,800 %, Perpetual *	1.051	0,19
2.100	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd, 5,350 %, fällig 11.03.2024	2.350	0,43
3.000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 7,900 %, fällig 11.05.2021	3.075	0,56
		48.194	8,73
Frankreich — 1,34 % (29. Februar 2020: 1,30 %)			
SGD 10.000	Credit Agricole SA, 3,800 %, fällig 30.04.2031 *	7.369	1,34
Hongkong — 2,34 % (29. Februar 2020: 2,77 %)			
3.700	Bank of East Asia Ltd/The, 4,000 %, fällig 03.11.2026 *	3.759	0,68
1.200	Dah Sing Bank Ltd, 4,250 %, fällig 30.11.2026 *	1.224	0,22
HKD 28.000	Guotai Junan International Holdings Ltd, 2,900 %, fällig 12.05.2021	3.628	0,66
4.300	Radiant Access Ltd, 4,600 %, Perpetual	4.296	0,78
		12.907	2,34
Indien — 0,15 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
800	REC Ltd, 4,750 %, fällig 19.05.2023	843	0,15
Indonesien — 3,61 % (29. Februar 2020: 5,54 %)			
IDR 91.000.000	Jasa Marga Persero Tbk PT, 7,500 %, fällig 11.12.2020	6.116	1,11
3.000	Minejesa Capital BV, 5,625 %, fällig 10.08.2037	3.178	0,57
1.000	Pelabuhan Indonesia II PT, 4,250 %, fällig 05.05.2025	1.092	0,20
4.150	Pelabuhan Indonesia II PT, 5,375 %, fällig 05.05.2045	4.804	0,87
4.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4,125 %, fällig 15.05.2027	4.399	0,80
IDR 5.000.000	Sarana Multigriya Finansial Persero PT, Series OB, 6,850 %, fällig 20.02.2021	346	0,06
		19.935	3,61
Katar — 1,39 % (29. Februar 2020: 1,33 %)			
CNY 35.000	QNB Finance Ltd, 5,100 %, fällig 14.05.2021	5.181	0,94
CNY 16.700	QNB Finance Ltd, 4,350 %, fällig 29.01.2022	2.466	0,45
		7.647	1,39
Singapur — 2,21 % (29. Februar 2020: 1,81 %)			
SGD 2.750	AIMS APAC REIT, 3,600 %, fällig 12.11.2024	1.985	0,36
SGD 4.000	AIMS APAC REIT, 5,650 %, Perpetual *	2.926	0,53
SGD 5.000	DBS Group Holdings Ltd, 2,780 %, fällig 11.01.2021	3.699	0,67
SGD 2.750	Mapletree Commercial Trust Treasury Co Pte Ltd, 3,110 %, fällig 24.08.2026	2.104	0,38
SGD 2.000	SingTel Group Treasury Pte Ltd, 2,580 %, fällig 24.09.2020	1.471	0,27
		12.185	2,21
Supranational — 3,59 % (29. Februar 2020: 3,46 %)			
IDR 200.000.000	European Investment Bank, 7,400 %, fällig 24.01.2022	14.104	2,56
IDR 77.000.000	International Finance Corp, 8,000 %, fällig 09.10.2023	5.709	1,03
		19.813	3,59
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 137.061 USD)		138.807	25,16
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 67,71 % (29. Februar 2020: 61,80 %)			
China — 11,33 % (29. Februar 2020: 7,91 %)			
CNY 110.000	Agricultural Development Bank of China, Series 1806, 4,650 %, fällig 11.05.2028	17.147	3,11
CNY 10.000	China Development Bank, Series 1803, 4,620 %, fällig 09.03.2021	1.472	0,27
HKD 7.500	China Development Bank Corp/Hong Kong, 1,026 %, fällig 24.01.2024 *	963	0,17
CNY 33.000	China Government Bond, 3,380 %, fällig 21.11.2024	4.957	0,90
CNY 96.500	China Government Bond, 3,600 %, fällig 21.05.2030	14.937	2,71
CNY 130.000	China Government Bond, Series INBK, 3,390 %, fällig 16.03.2050	17.832	3,23
CNY 5.000	Export-Import Bank of China/The, 4,400 %, fällig 14.05.2024	770	0,14
CNY 30.000	Export-Import Bank of China/The, Series 1910, 3,860 %, fällig 20.05.2029	4.418	0,80
		62.496	11,33
Indien — 6,88 % (29. Februar 2020: 10,35 %)			
INR 280.000	India Government Bond, 8,150 %, fällig 24.11.2026	4.221	0,76
INR 980.000	India Government Bond, Series SPB, 8,240 %, fällig 15.02.2027	14.788	2,68
INR 450.000	India Government Bond, 7,170 %, fällig 08.01.2028	6.455	1,17
INR 700.000	India Government Bond, 7,610 %, fällig 09.05.2030	10.333	1,87
INR 160.000	India Government Bond, 6,570 %, fällig 05.12.2033	2.190	0,40
		37.987	6,88
Indonesien — 7,43 % (29. Februar 2020: 8,41 %)			
IDR 51.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR77, 8,125 %, fällig 15.05.2024	3.826	0,69
IDR 96.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR56, 8,375 %, fällig 15.09.2026	7.372	1,34
IDR 108.875.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	7.757	1,41
IDR 20.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR47, 10,000 %, fällig 15.02.2028	1.653	0,30
IDR 27.500.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR64, 6,125 %, fällig 15.05.2028	1.830	0,33
IDR 114.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR54, 9,500 %, fällig 15.07.2031	9.222	1,67
IDR 25.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR58, 8,250 %, fällig 15.06.2032	1.856	0,34
IDR 5.000.000	Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Series OB, 8,350 %, fällig 25.08.2021	353	0,06
IDR 100.000.000	Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Series OB, 8,250 %, fällig 15.08.2024	7.123	1,29
		40.992	7,43
Malaysia — 10,63 % (29. Februar 2020: 10,94 %)			
MYR 20.490	Malaysia Government Bond, Series 0118, 3,882 %, fällig 14.03.2025	5.294	0,96
MYR 52.380	Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	13.675	2,48
MYR 1.200	Malaysia Government Bond, Series 0308, 5,248 %, fällig 15.09.2028	344	0,06
MYR 26.850	Malaysia Government Bond, Series 0219, 3,885 %, fällig 15.08.2029	7.093	1,28
MYR 78.000	Malaysia Government Bond, Series 0411, 4,232 %, fällig 30.06.2031	21.120	3,83

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Malaysia — (Fortsetzung)			
MYR 22.510	Malaysia Government Bond, Series 0413, 3,844 %, fällig 15.04.2033	5.853	1,06
MYR 20.360	Malaysia Government Bond, Series 0419, 3,828 %, fällig 05.07.2034	5.280	0,96
		58.659	10,63
Philippinen — 10,46 % (29. Februar 2020: 9,38 %)			
CNY 20.000	Philippine Government International Bond, 5,000 %, fällig 23.03.2021	2.939	0,53
PHP 1.016.000	Philippine Government International Bond, 3,900 %, fällig 26.11.2022	21.401	3,88
PHP 1.256.000	Philippine Government International Bond, 6,250 %, fällig 14.01.2036	33.352	6,05
		57.692	10,46
Singapur — 1,64 % (29. Februar 2020: 5,40 %)			
SGD 10.600	Singapore Government Bond, 1,875 %, fällig 01.03.2050	9.052	1,64
Südkorea — 12,79 % (29. Februar 2020: 2,99 %)			
IDR 80.000.000	Export-Import Bank of Korea, 8,400 %, fällig 30.11.2021	5.655	1,02
1.300	Industrial Bank of Korea, 3,900 %, Perpetual *	1.325	0,24
CNY 69.000	Korea Development Bank/The, 4,650 %, fällig 12.03.2021	10.160	1,84
KRW 52.200.000	Korea Treasury Bond, Series 2912, 1,375 %, fällig 10.12.2029	43.454	7,88
KRW 13.000.000	Korea Treasury Bond, Series 3909, 1,125 %, fällig 10.09.2039	9.970	1,81
		70.564	12,79
Sri Lanka — 0,90 % (29. Februar 2020: 0,96 %)			
2.000	Sri Lanka Government International Bond, 5,875 %, fällig 25.07.2022	1.840	0,33
3.800	Sri Lanka Government International Bond, 6,200 %, fällig 11.05.2027	3.144	0,57
		4.984	0,90
Thailand — 5,56 % (29. Februar 2020: 5,46 %)			
THB 801.030	Thailand Government Bond, 3,300 %, fällig 17.06.2038	30.653	5,56
USA - 0,09 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
500	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15.05.2050	475	0,09
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 371.137 USD)		373.554	67,71
Total Return Swaps — 1,38 % (29. Februar 2020: 1,34 %)			
Indonesien — 1,38 % (29. Februar 2020: 1,34 %)			
IDR 10.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR46, 9,500 %, fällig 15.07.2023 ∞	769	0,14
IDR 45.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR52, 10,500 %, fällig 15.08.2030 ∞	3.833	0,70
IDR 37.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR54, 9,500 %, fällig 15.07.2031 ∞	2.993	0,54
		7.595	1,38
Summe Total Return Swaps (Kosten 10.363 USD)		7.595	1,38
Kollektive Kapitalanlagen — 2,94 % (29. Februar 2020: 5,82 %)			
SGD 4.112	Legg Mason Western Asset Asian Bond Trust – Class A (SGD) Accumulating ∞	5.198	0,94
11.023	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	11.023	2,00
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 15.155 USD)		16.221	2,94
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 533.716 USD)		536.177	97,19
Devisenterminkontrakte — 0,35 % (29. Februar 2020: 0,19 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1.948	0,35
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		538.125	97,54
Devisenterminkontrakte — (0,01 %) (29. Februar 2020: (0,25 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(59)	(0,01)
Termingeschäfte — (0,17 %) (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(939)	(0,17)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(998)	(0,18)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		537.127	97,36
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		14.577	2,64
Gesamtnettovermögen		$ 551.704	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0.01 %.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
CNY	– Chinesischer Renminbi
HKD	– Hongkong-Dollar
IDR	– Indonesische Rupiah
INR	– Indische Rupie
KRW	– Südkoreanischer Won
MYR	– Malaysischer Ringgit
PHP	– Philippinischer Peso
SGD	– Singapur-Dollar
THB	– Thailändischer Baht

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,80
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,93
Finanzderivate	0,35
Sonstige Vermögenswerte	2,92
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	HKD	–	$ –
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	SGD	3	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	HKD	488	Verkauf	USD	63	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	41	Verkauf	USD	30	1
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	72	Verkauf	USD	53	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CNH	97	Verkauf	USD	14	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1.087	Verkauf	AUD	1.511	(28)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	2.179	Verkauf	CNH	15.167	(31)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	184	Verkauf	SGD	250	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	12	Verkauf	SGD	16	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	45.847	Verkauf	USD	32.860	957
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CHF	340	Verkauf	USD	373	3
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CNH	84.702	Verkauf	USD	12.122	227
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	6.510	Verkauf	USD	7.684	88
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	7.001	Verkauf	USD	5.101	43
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	2	Verkauf	USD	1	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	410	Verkauf	USD	490	–
21.09.2020	Citi	Kauf	SGD	36.910	Verkauf	USD	26.500	629
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 1.095 USD)								$ 1.948
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (1.462) USD)								(59)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (367) USD)								$ 1.889

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Korea 10 Year Bond September 2020	646	$ 71.895	$ (846)
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	40	7.029	(93)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 2.657 USD)			$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):– USD)			(939)
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 2.657 USD)			$ (939)

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 77,29 % (29. Februar 2020: 79,27 %)			
Australien — 2,71 % (29. Februar 2020: 1,81 %)			
GBP 1.770	BHP Billiton Finance Ltd, Series 11, 3,250 %, fällig 25.09.2024	2.641	0,65
300	BHP Billiton Finance USA Ltd, 2,875 %, fällig 24.02.2022	311	0,08
EUR 720	Optus Finance Pty Ltd, 1,000 %, fällig 20.06.2029	882	0,22
EUR 287	Telstra Corp Ltd, 3,750 %, fällig 16.05.2022	365	0,09
EUR 1.670	Toyota Finance Australie Ltd, 1,584 %, fällig 21.04.2022	2.049	0,50
GBP 550	Toyota Finance Australie Ltd, 1,625 %, fällig 11.07.2022	749	0,18
GBP 230	Westpac Banking Corp, 2,625 %, fällig 14.12.2022	321	0,08
EUR 3.000	Westpac Banking Corp, 0,625 %, fällig 22.11.2024	3.682	0,91
		11.000	2,71
Belgien — 0,44 % (29. Februar 2020: 1,49 %)			
EUR 650	Euroclear Bank SA, 0,500 %, fällig 10.07.2023	791	0,19
EUR 400	Euroclear Investments SA, 1,125 %, fällig 07.12.2026	508	0,13
EUR 400	KBC Group NV, 0,750 %, fällig 01.03.2022	484	0,12
		1.783	0,44
Kanada — 3,18 % (29. Februar 2020: 4,39 %)			
500	Bank of Montreal, Series D, 3,100 %, fällig 13.04.2021	509	0,12
GBP 2.970	Bank of Nova Scotia/The, 1,375 %, fällig 05.12.2023	4.069	1,00
EUR 2.200	Bank of Nova Scotia/The, 0,500 %, fällig 30.04.2024	2.666	0,66
1.300	Royal Bank of Canada, 3,700 %, fällig 05.10.2023	1.427	0,35
GBP 1.230	Royal Bank of Canada, 1,375 %, fällig 09.12.2024	1.695	0,42
EUR 2.110	Toronto-Dominion Bank/The, 0,375 %, fällig 25.04.2024	2.548	0,63
		12.914	3,18
Dänemark — 0,61 % (29. Februar 2020: 0,86 %)			
EUR 550	Danske Bank A/S, 0,875 %, fällig 22.05.2023	663	0,17
1.580	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig 12.01.2024	1.791	0,44
Finnland — 0,29 % (29. Februar 2020: 0,39 %)			
EUR 950	Nordea Bank Abp, 0,875 %, fällig 26.06.2023	1.163	0,29
Frankreich — 9,06 % (29. Februar 2020: 12,23 %)			
EUR 300	Air Liquide Finance SA, 1,000 %, fällig 02.04.2025	374	0,09
EUR 1.000	APRR SA, 0,000 %, fällig 20.01.2023	1.197	0,30
EUR 800	APRR SA, 1,500 %, fällig 25.01.2030	1.057	0,26
GBP 2.600	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1,500 %, fällig 07.10.2026	3.616	0,89
670	BNP Paribas SA, 3,250 %, fällig 03.03.2023	719	0,18
230	BNP Paribas SA, 4,705 %, fällig 10.01.2025 *	257	0,06
EUR 1.100	BNP Paribas SA, 1,375 %, fällig 28.05.2029	1.396	0,34
EUR 1.000	BPCE SA, 1,000 %, fällig 01.04.2025	1.229	0,30
GBP 2.600	BPCE SA, 1,375 %, fällig 23.12.2026	3.561	0,88
EUR 300	Credit Agricole SA/London, 1,250 %, fällig 14.04.2026	383	0,09
1.650	Credit Agricole SA/London, 1,907 %, fällig 16.06.2026 *	1.705	0,42
EUR 300	Credit Agricole SA/London, 1,750 %, fällig 05.03.2029	393	0,10
EUR 1.000	Engie SA, 1,375 %, fällig 27.03.2025	1.267	0,31
EUR 400	Engie SA, 1,000 %, fällig 13.03.2026	502	0,12
EUR 400	Engie SA, 2,375 %, fällig 19.05.2026	542	0,13
EUR 1.100	Engie SA, 0,500 %, fällig 24.10.2030	1.320	0,33
EUR 2.200	EssilorLuxottica SA, 0,000 %, fällig 27.05.2023	2.631	0,65
GBP 3.200	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 1,000 %, fällig 11.02.2023	4.326	1,07
EUR 600	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 1,000 %, fällig 19.10.2026	756	0,19
EUR 300	Sanofi, Series 5FXD, 0,500 %, fällig 21.03.2023	364	0,09
EUR 400	Sanofi, 1,000 %, fällig 01.04.2025	501	0,12
1.040	Sanofi, 3,625 %, fällig 19.06.2028	1.225	0,30
EUR 1.000	Schneider Electric SE, 0,000 %, fällig 12.06.2023	1.197	0,30
EUR 400	Thales SA, 0,875 %, fällig 19.04.2024	491	0,12
EUR 1.100	Total Capital International SA, 1,023 %, fällig 04.03.2027	1.389	0,34
EUR 1.600	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 1,125 %, fällig 15.09.2025	1.934	0,48
GBP 1.700	Vinci SA, 2,250 %, fällig 15.03.2027	2.432	0,60
		36.764	9,06
Deutschland — 4,30 % (29. Februar 2020: 5,68 %)			
EUR 900	Allianz Finance II BV, 0,000 %, fällig 14.01.2025	1.082	0,27
EUR 700	Allianz Finance II BV, 1,500 %, fällig 15.01.2030	944	0,23
GBP 200	BASF SE, 1,375 %, fällig 21.06.2022	272	0,07
EUR 300	BASF SE, 0,875 %, fällig 15.11.2027	379	0,09
EUR 500	Deutsche Boerse AG, 1,125 %, fällig 26.03.2028	643	0,16
GBP 6.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,875 %, fällig 18.07.2024	8.234	2,03
EUR 500	SAP SE, 0,250 %, fällig 10.03.2022	600	0,15
EUR 300	SAP SE, 1,750 %, fällig 22.02.2027	397	0,10
GBP 1.200	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0,875 %, fällig 05.06.2023	1.624	0,40
EUR 200	Vier Gas Transport GmbH, 1,500 %, fällig 25.09.2028	263	0,06
EUR 200	Volkswagen Bank GmbH, 0,625 %, fällig 08.09.2021	240	0,06
EUR 360	Volkswagen Bank GmbH, 0,750 %, fällig 15.06.2023	432	0,10
EUR 920	Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, fällig 01.10.2024	1.125	0,28
GBP 900	Volkswagen Financial Services NV, 1,625 %, fällig 30.11.2022	1.218	0,30
		17.453	4,30
Italien — 0,58 % (29. Februar 2020: 0,78 %)			
EUR 1.960	Enel Finance International NV, 0,000 %, fällig 17.06.2024	2.332	0,58
Japan — 1,49 % (29. Februar 2020: 2,06 %)			
1.450	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,218 %, fällig 07.03.2022	1.511	0,37
EUR 120	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 0,680 %, fällig 26.01.2023	146	0,03
EUR 750	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 0,980 %, fällig 09.10.2023	922	0,23
EUR 550	Mizuho Financial Group Inc, 1,598 %, fällig 10.04.2028	717	0,18
EUR 270	Sumitomo Mitsui Banking Corp, 2,750 %, fällig 24.07.2023	349	0,09
EUR 2.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0,632 %, fällig 23.10.2029	2.396	0,59
		6.041	1,49
Luxemburg — 0,74 % (29. Februar 2020: 0,16 %)			
EUR 2.275	Prologis International Funding II SA, 1,750 %, fällig 15.03.2028	2.985	0,74
Niederlande — 4,09 % (29. Februar 2020: 3,77 %)			
EUR 3.000	ABN AMRO Bank NV, 0,875 %, fällig 15.01.2024	3.693	0,91
EUR 220	ABN AMRO Bank NV, 1,000 %, fällig 16.04.2025	276	0,07
150	Cooperatieve Rabobank UA, 3,875 %, fällig 08.02.2022	158	0,04
EUR 200	Cooperatieve Rabobank UA, 0,750 %, fällig 29.08.2023	244	0,06
GBP 2.500	Cooperatieve Rabobank UA, 1,250 %, fällig 14.01.2025	3.419	0,84
250	Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,125 %, fällig 26.04.2021	255	0,06
270	Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,375 %, fällig 21.05.2025	304	0,08
EUR 2.010	Enexis Holding NV, 0,750 %, fällig 02.07.2031	2.490	0,61
EUR 400	Euronext NV, 1,000 %, fällig 18.04.2025	493	0,12
EUR 400	ING Groep NV, 0,750 %, fällig 09.03.2022	483	0,12
EUR 200	ING Groep NV, 1,000 %, fällig 20.09.2023	246	0,06
EUR 300	ING Groep NV, 2,125 %, fällig 10.01.2026	395	0,10
1.780	Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 11.05.2025	1.990	0,49
1.700	Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030	1.874	0,46
EUR 220	TenneT Holding BV, 1,375 %, fällig 05.06.2028	286	0,07
		16.606	4,09
Norwegen — 0,69 % (29. Februar 2020: 0,53 %)			
EUR 1.000	Equinor ASA, 0,750 %, fällig 22.05.2026	1.236	0,30
EUR 540	Equinor ASA, 1,250 %, fällig 17.02.2027	690	0,17
EUR 390	Sparebank 1 Oestlandet, 0,875 %, fällig 13.03.2023	475	0,12
EUR 330	Sparebanken Vest, 0,500 %, fällig 29.11.2022	396	0,10
		2.797	0,69
Singapur — 0,21 % (29. Februar 2020: 0,30 %)			
810	Temasek Financial I Ltd, 2,375 %, fällig 23.01.2023	847	0,21
Spanien — 0,39 % (29. Februar 2020: 0,55 %)			
800	Banco Santander SA, 3,848 %, fällig 12.04.2023	862	0,21
GBP 500	Banco Santander SA, 2,750 %, fällig 12.09.2023	701	0,18
		1.563	0,39
Supranational — 3,10 % (29. Februar 2020: 1,40 %)			
GBP 3.000	European Investment Bank, 0,750 %, fällig 14.07.2023	4.085	1,01
GBP 6.300	Inter-American Development Bank, 0,500 %, fällig 15.09.2026	8.481	2,09
		12.566	3,10
Schweden — 1,70 % (29. Februar 2020: 2,32 %)			
EUR 1.240	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,050 %, fällig 01.07.2024	1.487	0,37
540	Svenska Handelsbanken AB, 1,875 %, fällig 07.09.2021	549	0,13
GBP 500	Svenska Handelsbanken AB, 1,625 %, fällig 18.06.2022	683	0,17
EUR 450	Swedbank AB, 0,300 %, fällig 06.09.2022	541	0,13
EUR 3.050	Swedbank AB, 0,250 %, fällig 09.10.2024	3.646	0,90
		6.906	1,70
Schweiz — 3,18 % (29. Februar 2020: 1,82 %)			
EUR 800	Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, fällig 15.12.2028	1.041	0,26
2.130	Credit Suisse AG/New York NY, 2,800 %, fällig 08.04.2022	2.214	0,54
500	Credit Suisse AG/New York NY, 3,625 %, fällig 09.09.2024	558	0,14
GBP 1.050	Credit Suisse Group AG, 2,125 %, fällig 12.09.2025 *	1.452	0,36
GBP 320	Nestle Finance International Ltd, 2,250 %, fällig 30.11.2023	456	0,11
EUR 680	Nestle Finance International Ltd, 1,500 %, fällig 01.04.2030	910	0,22
EUR 180	Novartis Finance SA, 0,500 %, fällig 14.08.2023	219	0,05
EUR 380	Richemont International Holding SA, 1,000 %, fällig 26.03.2026	479	0,12

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Schweiz — (Fortsetzung)			
EUR 1.500	Richemont International Holding SA, 0,750 %, fällig 26.05.2028	1.858	0,46
400	UBS Group AG, 3,000 %, fällig 15.04.2021	407	0,10
EUR 200	UBS Group AG, 1,750 %, fällig 16.11.2022	248	0,06
EUR 2.400	UBS Group AG, 2,125 %, fällig 04.03.2024	3.069	0,76
		12.911	3,18
Großbritannien — 5,98 % (29. Februar 2020: 7,01 %)			
EUR 800	Aviva Plc, 1,875 %, fällig 13.11.2027	1.060	0,26
EUR 350	BP Capital Markets Plc, 0,900 %, fällig 03.07.2024	430	0,11
2.055	BP Capital Markets Plc, 3,506 %, fällig 17.03.2025	2.300	0,57
GBP 1.700	British Land Co Plc/The, 2,375 %, fällig 14.09.2029	2.304	0,57
EUR 400	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 1,250 %, fällig 13.04.2025	492	0,12
GBP 180	Close Brothers Finance Plc, 3,875 %, fällig 27.06.2021	247	0,06
GBP 150	Close Brothers Group Plc, 2,750 %, fällig 26.04.2023	209	0,05
190	GlaxoSmithKline Capital Plc, 2,850 %, fällig 08.05.2022	198	0,05
EUR 270	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,250 %, fällig 21.05.2026	345	0,09
EUR 550	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,000 %, fällig 12.09.2026	694	0,17
EUR 520	HSBC Holdings Plc, 0,875 %, fällig 06.09.2024	636	0,16
1.660	HSBC Holdings Plc, 3,803 %, fällig 11.03.2025 *	1.800	0,44
390	HSBC Holdings Plc, 1,645 %, fällig 18.04.2026 *	393	0,10
1.220	HSBC Holdings Plc, 2,099 %, fällig 04.06.2026 *	1.254	0,31
GBP 300	HSBC Holdings Plc, 3,000 %, fällig 22.07.2028 *	433	0,11
EUR 280	Leeds Building Society, 2,625 %, fällig 01.04.2021	339	0,08
GBP 1.500	Lloyds Bank Corporate Markets Plc, 1,500 %, fällig 23.06.2023	2.040	0,50
GBP 270	Lloyds Bank Plc, 2,500 %, fällig 01.06.2022	373	0,09
EUR 1.000	Lloyds Banking Group Plc, 0,500 %, fällig 12.11.2025 *	1.193	0,29
EUR 890	Lloyds Banking Group Plc, 3,500 %, fällig 01.04.2026 *	1.200	0,30
EUR 200	London Stock Exchange Group Plc, 0,875 %, fällig 19.09.2024	246	0,06
EUR 690	London Stock Exchange Group Plc, 1,750 %, fällig 06.12.2027	893	0,22
650	Nationwide Building Society, 144A, 3,622 %, fällig 26.04.2023 *	680	0,17
680	Reckitt Benckiser Treasury Services Plc, 2,375 %, fällig 24.06.2022	703	0,17
GBP 400	Santander UK Plc, 1,625 %, fällig 10.05.2021	540	0,13
850	Unilever Capital Corp, 3,250 %, fällig 07.03.2024	928	0,23
EUR 480	Unilever NV, 1,250 %, fällig 25.03.2025	607	0,15
EUR 550	Unilever NV, 1,125 %, fällig 12.02.2027	705	0,17
EUR 810	Wellcome Trust Ltd/The, 1,125 %, fällig 21.01.2027	1.019	0,25
		24.261	5,98
USA — 34,55 % (29. Februar 2020: 31,72 %)			
EUR 2.260	Abbott Ireland Financing DAC, 0,100 %, fällig 19.11.2024	2.704	0,67
1.240	Adobe Inc, 1,900 %, fällig 01.02.2025	1.314	0,32
1.700	Adobe Inc, 2,150 %, fällig 01.02.2027	1.830	0,45
350	Altria Group Inc, 2,850 %, fällig 09.08.2022	365	0,09
1.980	Amazon.com Inc, 3,800 %, fällig 05.12.2024	2.246	0,55
340	Apple Inc, 3,200 %, fällig 13.05.2025	381	0,09
EUR 1.520	Apple Inc, 0,000 %, fällig 15.11.2025	1.825	0,45
GBP 1.500	Apple Inc, 3,050 %, fällig 31.07.2029	2.405	0,59
200	Bank of America Corp, 3,300 %, fällig 11.01.2023	213	0,05
646	Bank of America Corp, 3,004 %, fällig 20.12.2023 *	681	0,17
3.180	Bank of America Corp, 3,550 %, fällig 05.03.2024 *	3.406	0,84
EUR 800	Bank of America Corp, 3,648 %, fällig 31.03.2029 *	1.165	0,29
EUR 500	Berkshire Hathaway Inc, 1,125 %, fällig 16.03.2027	634	0,16
EUR 530	BlackRock Inc, 1,250 %, fällig 06.05.2025	670	0,17
EUR 550	Blackstone Holdings Finance Co LLC, 1,000 %, fällig 05.10.2026	676	0,17
2.000	Bristol-Myers Squibb Co, 2,900 %, fällig 26.07.2024	2.182	0,54
200	Caterpillar Financial Services Corp, 1,931 %, fällig 01.10.2021	204	0,05
1.700	Caterpillar Inc, 2,600 %, fällig 09.04.2030	1.869	0,46
800	Chevron Corp, 2,355 %, fällig 05.12.2022	833	0,21
2.400	Chevron Corp, 1,554 %, fällig 11.05.2025	2.501	0,62
310	Chubb INA Holdings Inc, 3,350 %, fällig 03.05.2026	355	0,09
EUR 1.300	Chubb INA Holdings Inc, 0,875 %, fällig 15.06.2027	1.595	0,39
EUR 800	Chubb INA Holdings Inc, 1,550 %, fällig 15.03.2028	1.027	0,25
150	Citigroup Inc, 1,205 %, fällig 25.04.2022 *	152	0,04
GBP 230	Citigroup Inc, 2,750 %, fällig 24.01.2024	326	0,08
3.540	Citigroup Inc, 3,300 %, fällig 27.04.2025	3.934	0,97
250	Coca-Cola Co/The, 3,150 %, fällig 15.11.2020	251	0,06
EUR 500	Coca-Cola Co/The, 0,125 %, fällig 22.09.2022	600	0,15
EUR 860	Colgate-Palmolive Co, 0,000 %, fällig 12.11.2021	1.029	0,25
390	Colgate-Palmolive Co, 2,450 %, fällig 15.11.2021	400	0,10
EUR 1.300	Colgate-Palmolive Co, 0,500 %, fällig 06.03.2026	1.602	0,39
1.000	Comcast Corp, 3,700 %, fällig 15.04.2024	1.111	0,27
2.640	Comcast Corp, 3,100 %, fällig 01.04.2025	2.924	0,72
390	Comcast Corp, 3,150 %, fällig 01.03.2026	438	0,11
1.800	Costco Wholesale Corp, 1,375 %, fällig 20.06.2027	1.843	0,45
1.600	Deere & Co, 3,100 %, fällig 15.04.2030	1.834	0,45
EUR 5.860	Exxon Mobil Corp, 0,142 %, fällig 26.06.2024	7.019	1,73
2.200	Exxon Mobil Corp, 2,992 %, fällig 19.03.2025	2.426	0,60
780	Exxon Mobil Corp, 3,043 %, fällig 01.03.2026	870	0,21
150	Gilead Sciences Inc, 2,550 %, fällig 01.09.2020	150	0,04
1.830	Gilead Sciences Inc, 3,650 %, fällig 01.03.2026	2.101	0,52
2.100	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,625 %, fällig 22.01.2023	2.255	0,56
EUR 1.750	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,125 %, fällig 19.08.2024	2.071	0,51
2.800	Home Depot Inc/The, 2,500 %, fällig 15.04.2027	3.071	0,76
180	Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	200	0,05
EUR 1.260	Honeywell International Inc, 0,000 %, fällig 10.03.2024	1.503	0,37
2.060	Honeywell International Inc, 2,500 %, fällig 01.11.2026	2.271	0,56
EUR 1.020	Illinois Tool Works Inc, 0,250 %, fällig 05.12.2024	1.232	0,30
1.880	Intel Corp, 3,400 %, fällig 25.03.2025	2.111	0,52
EUR 350	Johnson & Johnson, 0,250 %, fällig 20.01.2022	421	0,10
110	Johnson & Johnson, 3,375 %, fällig 05.12.2023	122	0,03
310	JPMorgan Chase & Co, 3,200 %, fällig 25.01.2023	331	0,08
3.090	JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, fällig 05.12.2024 *	3.420	0,84
EUR 320	JPMorgan Chase & Co, 1,500 %, fällig 29.10.2026	412	0,10
910	Kimberly-Clark Corp, 3,950 %, fällig 01.11.2028	1.096	0,27
250	Komatsu Finance America Inc, 2,118 %, fällig 11.09.2020	250	0,06
1.150	März Inc, 2,700 %, fällig 01.04.2025	1.249	0,31
1.700	März Inc, 144A, 2,700 %, fällig 01.04.2025	1.846	0,46
280	Mastercard Inc, 3,375 %, fällig 01.04.2024	309	0,08
EUR 500	Medtronic Global Holdings SCA, Series 0000, 0,375 %, fällig 07.03.2023	602	0,15
EUR 1.400	Medtronic Global Holdings SCA, 0,250 %, fällig 02.07.2025	1.688	0,42
570	Microsoft Corp, 2,700 %, fällig 12.02.2025	623	0,15
2.400	Microsoft Corp, 2,400 %, fällig 08.08.2026	2.626	0,65
120	Morgan Stanley, 2,500 %, fällig 21.04.2021	122	0,03
EUR 330	Morgan Stanley, 1,375 %, fällig 27.10.2026	419	0,10
5.410	NIKE Inc, 2,400 %, fällig 27.03.2025	5.842	1,44
2.080	Nuveen LLC, 4,000 %, fällig 01.11.2028	2.490	0,61
1.600	NVIDIA Corp, 2,850 %, fällig 01.04.2030	1.787	0,44
220	Oracle Corp, 2,500 %, fällig 15.10.2022	230	0,06
GBP 300	PepsiCo Inc, 2,500 %, fällig 01.11.2022	421	0,10
EUR 1.510	PepsiCo Inc, 0,250 %, fällig 06.05.2024	1.828	0,45
EUR 310	PepsiCo Inc, 0,750 %, fällig 18.03.2027	388	0,10
100	Philip Morris International Inc, 1,875 %, fällig 25.02.2021	101	0,02
340	Philip Morris International Inc, 2,900 %, fällig 15.11.2021	351	0,09
EUR 1.250	Procter & Gamble Co/The, 0,625 %, fällig 30.10.2024	1.543	0,38
1.990	Procter & Gamble Co/The, 2,450 %, fällig 25.03.2025	2.160	0,53
EUR 350	Prologis Euro Finance LLC, 1,875 %, fällig 05.01.2029	464	0,11
2.120	Prudential Financial Inc, 1,500 %, fällig 10.03.2026	2.216	0,55
EUR 2.500	Public Storage, 0,875 %, fällig 24.01.2032	2.960	0,73
570	salesforce.com Inc, 3,250 %, fällig 11.04.2023	612	0,15
430	Schlumberger Holdings Corp, 4,000 %, fällig 21.12.2025	477	0,12
270	Target Corp, 2,650 %, fällig 15.09.2030	301	0,07
560	Texas Instruments Inc, 1,375 %, fällig 12.03.2025	581	0,14
1.150	Texas Instruments Inc, 2,900 %, fällig 03.11.2027	1.294	0,32
538	Toyota Motor Credit Corp, 3,400 %, fällig 15.09.2021	555	0,14
EUR 2.000	United Parcel Service Inc, 1,625 %, fällig 15.11.2025	2.589	0,64
2.150	UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, fällig 15.07.2025	2.466	0,61
2.243	Verizon Communications Inc, 4,329 %, fällig 21.09.2028	2.718	0,67
540	Visa Inc, 3,150 %, fällig 14.12.2025	608	0,15
4.000	Visa Inc, 1,900 %, fällig 15.04.2027	4.243	1,05
1.900	Walmart Inc, 3,250 %, fällig 08.07.2029	2.223	0,55
2.130	Walmart Inc, 2,375 %, fällig 24.09.2029	2.346	0,58
1.660	Waste Management Inc, 3,500 %, fällig 15.05.2024	1.819	0,45
230	Wells Fargo & Co, 3,500 %, fällig 08.03.2022	241	0,06
700	Wells Fargo & Co, 3,069 %, fällig 24.01.2023	724	0,18

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
2.940	Wells Fargo & Co, 3,196 %, fällig 17.06.2027 *	3.218	0,79
		140.137	34,55
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 292.613 USD)		313.483	77,29
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 15,61 %(29. Februar 2020: 18,04 %)			
Kanada — 0,40 % (29. Februar 2020: 0,56 %)			
GBP 1.200	CPPIB Capital Inc, 0,875 %, fällig 17.12.2024	1.638	0,40
Deutschland — 0,33 % (29. Februar 2020: 0,45 %)			
EUR 1.060	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2029	1.319	0,33
Südkorea — 0,49 % (29. Februar 2020: 0,68 %)			
EUR 1.000	Export-Import Bank of Korea, 0,625 %, fällig 11.07.2023	1.214	0,30
EUR 660	Korea Development Bank/The, 0,000 %, fällig 10.07.2024	782	0,19
		1.996	0,49
USA — 14,39 % (29. Februar 2020: 16,35 %)			
31.940	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 31.03.2022	32.750	8,07
170	United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig 31.07.2022	170	0,04
11.690	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.02.2023	12.046	2,97
590	United States Treasury Note/ Bond, 0,250 %, fällig 31.07.2025	590	0,15
910	United States Treasury Note/ Bond, 2,250 %, fällig 15.11.2027	1.023	0,25
9.510	United States Treasury Note/ Bond, 1,500 %, fällig 15.02.2030	10.248	2,53
1.550	United States Treasury Note/ Bond, 0,625 %, fällig 15.05.2030	1.542	0,38
		58.369	14,39
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 62.501 USD)		63.322	15,61
Kollektive Kapitalanlagen — 4,19 % (29. Februar 2020: 2,88 %)			
16.999	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	16.999	4,19
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 16.999 USD)		16.999	4,19
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 372.113 USD)		393.804	97,09
Devisenterminkontrakte — 1,81 % (29. Februar 2020: 0,28 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		7.327	1,81
Termingeschäfte — 0,10 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		399	0,10
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		401.530	99,00
Kreditausfallversicherungen — (0,10 %) (29. Februar 2020: (0,20 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(414)	(0,10)
Devisenterminkontrakte — (0,82 %) (29. Februar 2020: (1,04 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(3.330)	(0,82)
Termingeschäfte — (0,02 %) (29. Februar 2020: (0,42 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(91)	(0,02)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(3.835)	(0,94)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		397.695	98,06
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		7.891	1,94
Gesamtnettovermögen		$ 405.586	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 4,317,00 USD und machten 1.07 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

EUR – Euro
GBP – Britisches Pfund Sterling

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	91,89
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,15
Finanzderivate	1,88
Sonstige Vermögenswerte	2,08
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch i	Traxx Europe, 1,000 %	Kauf	20.06.2025	15.740	$ (414)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Kreditausfallversicherungen (29. Februar 2020 (in Tsd.):– USD)					$ -
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (564) USD)					(414)
Apreciación neta de swaps de tipos de interés (29. Februar 2020 (miles): (564) USD)					$ (414)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	472	Verkauf	GBP	357	$ (6)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	170	Verkauf	USD	225	3
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	310	Verkauf	GBP	235	(4)
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	43	Verkauf	USD	57	1
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	178	Verkauf	GBP	133	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	24	Verkauf	USD	32	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	40	Verkauf	EUR	33	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	2.444	Verkauf	GBP	1.867	(48)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	20	Verkauf	USD	2	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	2.699	Verkauf	USD	1.934	56
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	16	Verkauf	USD	2	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	25.490	Verkauf	USD	30.086	344
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	51	Verkauf	USD	61	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	234.925	Verkauf	USD	307.148	6.923
19.11.2020	Citi	Kauf	USD	20.639	Verkauf	EUR	17.462	(235)
19.11.2020	Citi	Kauf	USD	12.010	Verkauf	GBP	9.148	(224)
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	13.650	VentTa	EUR	11.542	(148)
19.11.2020	HSBC	Kauf	USD	21.352	Verkauf	EUR	18.119	(309)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	37.964	Verkauf	EUR	32.205	(536)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	524	Verkauf	GBP	400	(11)
19.11.2020	Royal Bank of Canada	Kauf	USD	2.361	Verkauf	GBP	1.806	(55)
19.11.2020	UBS	Kauf	USD	34.509	Verkauf	EUR	29.306	(524)
19.11.2020	UBS	Kauf	USD	50.803	Verkauf	GBP	38.908	(1.230)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 766 USD)								$ 7.327
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (2.868) USD)								(3.330)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (2.102) USD)								$ 3.997

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl September 2020	(236)	$ (37.916)	$ (49)
Euro-Bund Dezember 2020	(61)	(12.574)	51
Euro-Bund September 2020	(68)	(14.246)	(35)
Long Gilt Dezember 2020	(209)	(37.719)	348
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	(131)	(16.510)	(7)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)$			$ 399
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(1.174) USD)			(91)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (2.102) USD)			$ 308

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 9,61 % (29. Februar 2020: 13,62 %)			
300	Fannie Mae or Freddie Mac, TBA, 2,500 % ±	316	0,12
400	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 1,500 % ±	409	0,16
1.500	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 2,000 % ±	1.561	0,62
3.000	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 % ±	3.094	1,22
12	Fannie Mae Pool ‘255984’, 4,500 %, fällig 01.11.2025	13	0,01
20	Fannie Mae Pool ‘975097’, 5,000 %, fällig 01.06.2038	23	0,01
122	Fannie Mae Pool ‘AL3024’, 3,500 %, fällig 01.01.2043	132	0,05
20	Fannie Mae Pool ‘AL3572’, 5,000 %, fällig 01.07.2041	23	0,01
133	Fannie Mae Pool ‘AL7093’, 4,000 %, fällig 01.05.2045	152	0,06
43	Fannie Mae Pool ‘AS4271’, 4,500 %, fällig 01.01.2045	50	0,02
536	Fannie Mae Pool ‘AS8359’, 3,000 %, fällig 01.11.2046	568	0,22
465	Fannie Mae Pool ‘AX0756’, 3,500 %, fällig 01.07.2044	496	0,20
702	Fannie Mae Pool ‘BH7558’, 4,500 %, fällig 01.08.2047	764	0,30
250	Fannie Mae Pool ‘BJ2544’, 3,000 %, fällig 01.12.2037	265	0,10
282	Fannie Mae Pool ‘BK7700’, 4,500 %, fällig 01.10.2048	309	0,12
75	Fannie Mae Pool ‘BM4897’, 3,500 %, fällig 01.12.2046	81	0,03
129	Fannie Mae Pool ‘BN0341’, 5,000 %, fällig 01.12.2048	141	0,06
72	Fannie Mae Pool ‘BN1623’, 4,500 %, fällig 01.11.2048	79	0,03
75	Fannie Mae Pool ‘BO0968’, 4,000 %, fällig 01.06.2049	80	0,03
88	Fannie Mae Pool ‘BO6985’, 3,500 %, fällig 01.11.2049	95	0,04
92	Fannie Mae Pool ‘BP1585’, 3,500 %, fällig 01.01.2050	99	0,04
100	Fannie Mae Pool ‘BP7009’, 3,000 %, fällig 01.08.2050	107	0,04
86	Fannie Mae Pool ‘CA0148’, 4,500 %, fällig 01.08.2047	93	0,04
97	Fannie Mae Pool ‘CA0717’, 4,500 %, fällig 01.11.2047	105	0,04
217	Fannie Mae Pool ‘CA1565’, 4,500 %, fällig 01.04.2048	234	0,09
129	Fannie Mae Pool ‘CA2047’, 4,500 %, fällig 01.07.2048	141	0,06
258	Fannie Mae Pool ‘CA2199’, 4,500 %, fällig 01.08.2048	283	0,11
44	Fannie Mae Pool ‘CA2251’, 5,000 %, fällig 01.08.2048	48	0,02
124	Fannie Mae Pool ‘CA2471’, 4,000 %, fällig 01.10.2048	133	0,05
132	Fannie Mae Pool ‘CA2482’, 4,500 %, fällig 01.10.2048	145	0,06
52	Fannie Mae Pool ‘CA2652’, 5,000 %, fällig 01.11.2048	57	0,02
266	Fannie Mae Pool ‘CA4110’, 3,000 %, fällig 01.09.2049	282	0,11
81	Fannie Mae Pool ‘CA4122’, 3,500 %, fällig 01.09.2049	87	0,03
181	Fannie Mae Pool ‘CA4133’, 3,000 %, fällig 01.09.2049	195	0,08
94	Fannie Mae Pool ‘CA5164’, 3,500 %, fällig 01.02.2050	99	0,04
95	Fannie Mae Pool ‘CA5561’, 3,500 %, fällig 01.04.2050	102	0,04
320	Fannie Mae Pool ‘FM1578’, 3,500 %, fällig 01.09.2034	343	0,14
231	Fannie Mae Pool ‘FM1579’, 3,500 %, fällig 01.10.2034	246	0,10
198	Fannie Mae Pool ‘FM2793’, 3,000 %, fällig 01.03.2050	214	0,08
1.032	Fannie Mae Pool ‘FM3347’, 3,500 %, fällig 01.05.2047	1.103	0,43
1.429	Fannie Mae Pool ‘FM3773’, 3,500 %, fällig 01.11.2048	1.529	0,60
100	Fannie Mae Pool ‘FM3957’, 5,000 %, fällig 01.03.2050	110	0,04
1.361	Fannie Mae Pool ‘MA2806’, 3,000 %, fällig 01.11.2046	1.437	0,57
229	Fannie Mae Pool ‘MA3527’, 5,000 %, fällig 01.11.2048	251	0,10
384	Flagstar Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Klasse A4, 144A, 3,500 %, fällig 25.04.2048 *	390	0,15
251	Freddie Mac Gold Pool ‘C91981’, 3,000 %, fällig 01.02.2038	265	0,10
187	Freddie Mac Gold Pool ‘C91987’, 3,000 %, fällig 01.04.2038	197	0,08
119	Freddie Mac Gold Pool ‘G61374’, 4,500 %, fällig 01.04.2048	130	0,05
79	Freddie Mac Gold Pool ‘G61739’, 3,000 %, fällig 01.09.2048	86	0,03
63	Freddie Mac Gold Pool ‘G67721’, 4,500 %, fällig 01.04.2049	69	0,03
52	Freddie Mac Non Gold Pool ‘840698’, 2,503 %, fällig 01.03.2047 *	54	0,02
95	Freddie Mac Pool ‘QA7238’, 3,500 %, fällig 01.02.2050	103	0,04
83	Freddie Mac Pool ‘RA1103’, 3,000 %, fällig 01.07.2049	88	0,04
91	Freddie Mac Pool ‘RA1493’, 3,000 %, fällig 01.10.2049	96	0,04
186	Freddie Mac Pool ‘RA2140’, 3,500 %, fällig 01.02.2050	199	0,08
89	Freddie Mac Pool ‘RA2358’, 4,000 %, fällig 01.03.2050	95	0,04
190	Freddie Mac Pool ‘RA2362’, 3,500 %, fällig 01.03.2050	202	0,08
228	Freddie Mac Pool ‘SD0291’, 5,000 %, fällig 01.03.2050	250	0,10
54	Freddie Mac Pool ‘ZA5454’, 4,000 %, fällig 01.06.2048	58	0,02
213	Freddie Mac Pool ‘ZA6680’, 4,000 %, fällig 01.04.2049	231	0,09
118	Freddie Mac Pool ‘ZM5146’, 4,000 %, fällig 01.12.2047	126	0,05
163	Freddie Mac Pool ‘ZS3204’, 5,000 %, fällig 01.06.2041	184	0,07
242	Freddie Mac Pool ‘ZS3940’, 4,500 %, fällig 01.06.2038	265	0,11
252	Freddie Mac Pool ‘ZS4699’, 4,000 %, fällig 01.01.2047	272	0,11
758	Ginnie Mae I Pool ‘784571’, 3,500 %, fällig 15.06.2048	806	0,32
34	Ginnie Mae I Pool ‘AA5649’, 3,000 %, fällig 15.09.2042	36	0,01
24	Ginnie Mae I Pool ‘AB2892’, 3,000 %, fällig 15.09.2042	26	0,01
86	Ginnie Mae I Pool ‘AB9108’, 3,000 %, fällig 15.10.2042	91	0,04
59	Ginnie Mae I Pool ‘AB9109’, 3,000 %, fällig 15.10.2042	62	0,02
51	Ginnie Mae I Pool ‘AB9207’, 3,000 %, fällig 15.11.2042	54	0,02
199	Ginnie Mae II Pool ‘784825’, 3,500 %, fällig 20.10.2049	205	0,08
330	Ginnie Mae II Pool ‘MA1995’, 3,500 %, fällig 20.06.2044	353	0,14
100	Ginnie Mae II Pool ‘MA2677’, 3,000 %, fällig 20.03.2045	106	0,04
53	Ginnie Mae II Pool ‘MA4068’, 3,000 %, fällig 20.11.2046	56	0,02
43	Ginnie Mae II Pool ‘MA4511’, 4,000 %, fällig 20.06.2047	46	0,02
12	Ginnie Mae II Pool ‘MA4836’, 3,000 %, fällig 20.11.2047	13	0,01
50	Ginnie Mae II Pool ‘MA4838’, 4,000 %, fällig 20.11.2047	53	0,02
172	Ginnie Mae II Pool ‘MA5019’, 3,500 %, fällig 20.02.2048	183	0,07
337	Ginnie Mae II Pool ‘MA5135’, 3,000 %, fällig 20.04.2048	355	0,14
44	Ginnie Mae II Pool ‘MA5137’, 4,000 %, fällig 20.04.2048	48	0,02
243	Ginnie Mae II Pool ‘MA5193’, 4,500 %, fällig 20.05.2048	263	0,10
88	Ginnie Mae II Pool ‘MA5265’, 4,500 %, fällig 20.06.2048	95	0,04
122	Ginnie Mae II Pool ‘MA5331’, 4,500 %, fällig 20.07.2048	132	0,05
41	Ginnie Mae II Pool ‘MA5467’, 4,500 %, fällig 20.09.2048	44	0,02
169	Ginnie Mae II Pool ‘MA5529’, 4,500 %, fällig 20.10.2048	183	0,07
275	Ginnie Mae II Pool ‘MA5530’, 5,000 %, fällig 20.10.2048	300	0,12
114	Ginnie Mae II Pool ‘MA5711’, 4,500 %, fällig 20.01.2049	123	0,05
151	Ginnie Mae II Pool ‘MA5712’, 5,000 %, fällig 20.01.2049	163	0,06
200	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000 % ±	207	0,08
600	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500 % ±	632	0,25
79	Government National Mortgage Association, Series 2019 123, Klasse A, 3,000 %, fällig 20.10.2049	83	0,03
223	JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Series 2018 4, Klasse A1, 144A, 3,500 %, fällig 25.10.2048 *	229	0,09
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 23.864 USD)		24.401	9,61
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 27,38 % (29. Februar 2020: 24,27 %)			
Australien — 0,46 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 871	Glencore Finance Europe Ltd, 1,875 %, fällig 13.09.2023	1.079	0,42
90	Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, fällig 27.03.2027	99	0,04
		1.178	0,46
Belgien — 0,59 % (29. Februar 2020: 0,20 %)			
260	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, fällig 01.02.2046	322	0,13
EUR 230	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2,125 %, fällig 02.12.2027	305	0,12
150	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,150 %, fällig 23.01.2025	171	0,07
150	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	175	0,07
430	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01.06.2050	522	0,20
		1.495	0,59
Brasilien — 0,25 % (29. Februar 2020: 0,25 %)			
580	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17.03.2024	642	0,25
Kanada — 0,11 % (29. Februar 2020: 0,10 %)			
270	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2024	275	0,11
Dänemark — 0,08 % (29. Februar 2020: 0,08 %)			
200	Danske Bank A/S, 144A, 5,000 %, fällig 12.01.2022	211	0,08
Frankreich — 0,74 % (29. Februar 2020: 1,27 %)			
210	Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, fällig 01.05.2026	223	0,09
EUR 680	BNP Paribas SA, 2,875 %, fällig 20.03.2026 *	824	0,33
200	BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *	209	0,08
GBP 300	BNP Paribas SA, 1,875 %, fällig 14.12.2027	413	0,16
200	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, fällig 17.09.2044	204	0,08
		1.873	0,74
Deutschland — 1,21 % (29. Februar 2020: 1,10 %)			
EUR 100	Allianz Finance II BV, 5,750 %, fällig 08.07.2041 *	125	0,05
GBP 250	innogy Finance BV, 5,625 %, fällig 06.12.2023	387	0,15
GBP 100	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 6,625 %, fällig 26.05.2042 *	146	0,06
EUR 500	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, fällig 26.05.2049 *	690	0,27
EUR 1.420	Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, fällig 01.10.2024	1.736	0,68
		3.084	1,21
Israel — 0,28 % (29. Februar 2020: 0,27 %)			
700	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, fällig 18.12.2022	681	0,27

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Israel — (Fortsetzung)			
10	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21.07.2023	10	–
30	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	27	0,01
		718	0,28
Italien — 0,65 % (29. Februar 2020: 0,37 %)			
350	UniCredit SpA, 144A, 6,572 %, fällig 14.01.2022	372	0,15
EUR 1.100	UniCredit SpA, 1,200 %, fällig 20.01.2026 *	1.284	0,50
		1.656	0,65
Luxemburg — 0,30 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 620	Logicor Financing Sarl, 1,625 %, fällig 15.07.2027	754	0,30
Mexiko — 1,11 % (29. Februar 2020: 1,07 %)			
2.670	Orbia Advance Corp SAB de CV, 4,875 %, fällig 19.09.2022	2.829	1,11
Niederlande — 1,81 % (29. Februar 2020: 1,45 %)			
EUR 800	ABN AMRO Bank NV, 7,125 %, fällig 06.07.2022	1.075	0,42
500	Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, fällig 01.12.2023	558	0,22
EUR 200	ING Groep NV, 3,000 %, fällig 11.04.2028 *	253	0,10
EUR 1.500	ING Groep NV, 2,500 %, fällig 15.02.2029 *	1.893	0,75
EUR 100	Koninklijke Philips NV, 2,000 %, fällig 30.03.2030	134	0,05
20	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144A, 2,700 %, fällig 01.05.2025	21	0,01
80	Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030	88	0,04
200	Shell International Finance BV, 4,375 %, fällig 11.05.2045	249	0,10
290	Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	314	0,12
		4.585	1,81
Norwegen — 0,38 % (29. Februar 2020: 0,34 %)			
EUR 790	DNB Bank ASA, 1,125 %, fällig 20.03.2028 *	959	0,38
Peru — 0,13 % (29. Februar 2020: 0,11 %)			
250	Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	320	0,13
Südafrika — 0,32 % (29. Februar 2020: 0,28 %)			
EUR 640	Anglo American Capital Plc, 1,625 %, fällig 18.09.2025	803	0,32
Spanien — 0,31 (29. Februar 2020: 0,48 %)			
EUR 600	Banco Santander SA, 3,250 %, fällig 04.04.2026	792	0,31
Schweden — 0,32 % (29. Februar 2020: 0,28 %)			
EUR 660	Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, fällig 02.03.2028 *	803	0,32
Schweiz — 0,89 % (29. Februar 2020: 1,02 %)			
EUR 390	Credit Suisse Group AG, 3,250 %, fällig 02.04.2026 *	521	0,21
EUR 550	Holcim Finance Luxembourg SA, 1,750 %, fällig 29.08.2029	714	0,28
EUR 800	UBS Group AG, 1,500 %, fällig 30.11.2024	997	0,39
GBP 20	Zurich Finance UK Plc, 6,625 %, Perpetual *	30	0,01
		2.262	0,89
Großbritannien — 3,80 % (29. Februar 2020: 3,65 %)			
GBP 670	Aviva Plc, 6,125 %, fällig 14.11.2036 *	1.092	0,43
GBP 100	Aviva Plc, 5,125 %, fällig 04.06.2050 *	157	0,06
GBP 280	BAE Systems Plc, 4,125 %, fällig 08.06.2022	395	0,16
EUR 460	Barclays Bank Plc, 6,000 %, fällig 14.01.2021	561	0,22
EUR 2.020	Barclays Plc, 2,625 %, fällig 11.11.2025 *	2.420	0,95
100	BP Capital Markets Plc, 3,506 %, fällig 17.03.2025	112	0,04
GBP 470	BUPA Finance Plc, 5,000 %, fällig 25.04.2023	677	0,27
200	HSBC Holdings Plc, 3,803 %, fällig 11.03.2025 *	217	0,09
565	HSBC Holdings Plc, 4,250 %, fällig 18.08.2025	628	0,25
GBP 100	HSBC Holdings Plc, 7,000 %, fällig 07.04.2038	194	0,08
GBP 1.000	Lloyds Bank Plc, 7,625 %, fällig 22.04.2025	1.709	0,67
EUR 210	Lloyds Banking Group Plc, 3,500 %, fällig 01.04.2026 *	283	0,11
GBP 260	Scottish Widows Ltd, 5,500 %, fällig 16.06.2023	383	0,15
EUR 420	Sky Ltd, 2,250 %, fällig 17.11.2025	558	0,22
230	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	249	0,10
		9.635	3,80
USA — 13,64 % (29. Februar 2020: 11,95 %)			
100	3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050	122	0,05
30	AbbVie Inc, 2,900 %, fällig 06.11.2022	32	0,01
EUR 120	AbbVie Inc, 144A, 1,500 %, fällig 15.11.2023	149	0,06
310	AbbVie Inc, 144A, 3,800 %, fällig 15.03.2025	347	0,14
100	AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	129	0,05
470	AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21.11.2049	569	0,22
80	Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057	109	0,04
40	American International Group Inc, 2,500 %, fällig 30.06.2025	43	0,02
40	American International Group Inc, 4,500 %, fällig 16.07.2044	47	0,02
10	Apache Corp, 4,750 %, fällig 15.04.2043	9	–
150	Apple Inc, 1,125 %, fällig 11.05.2025	154	0,06
214	AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	253	0,10
20	Bank of America Corp, 3,300 %, fällig 11.01.2023	21	0,01
70	Bank of America Corp, 4,100 %, fällig 24.07.2023	77	0,03
32	Bank of America Corp, 3,004 %, fällig 20.12.2023 *	34	0,01
150	Bank of America Corp, 4,200 %, fällig 26.08.2024	168	0,07
330	Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22.10.2026	383	0,15
725	Bank of America Corp, 2,592 %, fällig 29.04.2031 *	774	0,30
97	Becton Dickinson and Co, 3,734 %, fällig 15.12.2024	108	0,04
480	Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030	539	0,21
100	Boeing Co/The, 3,300 %, fällig 01.03.2035	93	0,04
160	BP Capital Markets America Inc, 3,245 %, fällig 06.05.2022	168	0,07
200	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	231	0,09
40	Bristol-Myers Squibb Co, 2,900 %, fällig 26.07.2024	44	0,02
130	Broadcom Inc, 2,250 %, fällig 15.11.2023	135	0,05
140	Broadcom Inc, 3,150 %, fällig 15.11.2025	152	0,06
130	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	151	0,06
100	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	115	0,05
300	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	363	0,14
400	Cigna Corp, 4,375 %, fällig 15.10.2028	479	0,19
310	Cigna Corp, 3,200 %, fällig 15.03.2040	331	0,13
30	Citigroup Inc, 3,500 %, fällig 15.05.2023	32	0,01
EUR 290	Citigroup Inc, 1,750 %, fällig 28.01.2025	370	0,15
250	Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13.09.2025	298	0,12
510	Citigroup Inc, 4,600 %, fällig 09.03.2026	593	0,23
560	Citigroup Inc, 4,300 %, fällig 20.11.2026	647	0,25
360	Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	419	0,16
120	Citigroup Inc, 4,412 %, fällig 31.03.2031 *	146	0,06
93	Citigroup Inc, 5,300 %, fällig 06.05.2044	125	0,05
85	Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 30.07.2045	110	0,04
20	Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	21	0,01
320	Coca-Cola Co/The, 4,200 %, fällig 25.03.2050	424	0,17
20	Coca-Cola Co/The, 2,600 %, fällig 01.06.2050	20	0,01
66	Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01.11.2049	80	0,03
97	Comcast Corp, 4,049 %, fällig 01.11.2052	119	0,05
140	Costco Wholesale Corp, 1,600 %, fällig 20.04.2030	143	0,06
550	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	571	0,22
125	CVS Health Corp, 4,100 %, fällig 25.03.2025	143	0,06
440	CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	509	0,20
120	Delta Air Lines Inc, 3,800 %, fällig 19.04.2023	115	0,05
550	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	603	0,24
390	Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	448	0,18
170	DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	180	0,07
60	Duke Energy Progress LLC, 4,375 %, fällig 30.03.2044	76	0,03
1.010	Energy Transfer Operating LP, 3,750 %, fällig 15.05.2030	1.004	0,40
20	Enterprise Products Operating LLC, 3,350 %, fällig 15.03.2023	21	0,01
200	Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig 31.01.2030	214	0,08
20	Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, fällig 15.02.2045	24	0,01
10	Exelon Corp, 5,625 %, fällig 15.06.2035	13	0,01
100	Exxon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15.04.2051	113	0,04
215	FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, fällig 15.11.2031	305	0,12
310	Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, fällig 14.11.2024	335	0,13
40	Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig 01.08.2030	43	0,02
70	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	79	0,03
325	GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418 %, fällig 15.11.2035	336	0,13
522	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10.01.2039	666	0,26
110	General Electric Co, 4,250 %, fällig 01.05.2040	111	0,04
50	General Motors Co, 6,600 %, fällig 01.04.2036	60	0,02
10	General Motors Co, 5,200 %, fällig 01.04.2045	11	–
20	General Motors Co, 6,750 %, fällig 01.04.2046	24	0,01
120	General Motors Financial Co Inc, 4,375 %, fällig 25.09.2021	124	0,05
150	Gilead Sciences Inc, 4,800 %, fällig 01.04.2044	200	0,08
30	Gilead Sciences Inc, 4,750 %, fällig 01.03.2046	40	0,02

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
GBP 201	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,500 %, fällig 12.10.2021	283	0,11
280	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,850 %, fällig 08.07.2024	310	0,12
450	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01.04.2025	499	0,20
800	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, fällig 01.10.2037	1.169	0,46
640	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01.02.2041	969	0,38
380	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	507	0,20
570	HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	645	0,25
380	HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.06.2026	449	0,18
200	HCA Inc, 4,500 %, fällig 15.02.2027	229	0,09
110	HCA Inc, 5,625 %, fällig 01.09.2028	131	0,05
130	Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	145	0,06
40	Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	46	0,02
470	Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	540	0,21
150	ILFC E-Capital Trust I, 144A, 3,020 %, fällig 21.12.2065 *	77	0,03
80	JPMorgan Chase & Co, 3,625 %, fällig 13.05.2024	89	0,03
200	JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, fällig 15.12.2026	234	0,09
300	JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05.12.2029 *	363	0,14
670	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	719	0,28
180	JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	197	0,08
960	Lehman Brothers Holdings Capital Trust Escrow, Null-Coupon, Perpetual †∞ξ	–	–
177	Lehman Escrow Receipt, Null-Coupon, Perpetual †∞	2	–
70	Lowe's Cos Inc, 5,125 %, fällig 15.04.2050	97	0,04
30	McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	34	0,01
110	McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	135	0,05
29	Medtronic Inc, 4,625 %, fällig 15.03.2045	40	0,02
40	MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	51	0,02
10	Morgan Stanley, 4,431 %, fällig 23.01.2030 *	12	–
390	Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	454	0,18
170	NGPL PipeCo LLC, 144A, 4,875 %, fällig 15.08.2027	186	0,07
80	Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01.05.2050	115	0,05
250	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	284	0,11
320	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig 15.08.2029	276	0,11
80	Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig 15.03.2046	80	0,03
320	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.04.2046	256	0,10
600	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.08.2049	464	0,18
80	PayPal Holdings Inc, 1,350 %, fällig 01.06.2023	82	0,03
80	PayPal Holdings Inc, 1,650 %, fällig 01.06.2025	83	0,03
80	Procter & Gamble Co/The, 3,600 %, fällig 25.03.2050	102	0,04
70	Range Resources Corp, 5,000 %, fällig 15.03.2023	70	0,03
10	Range Resources Corp, 4,875 %, fällig 15.05.2025	9	–
70	Raytheon Technologies Corp, 2,250 %, fällig 01.07.2030	74	0,03
10	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	15	0,01
70	State Street Corp, 144A, 3,152 %, fällig 30.03.2031 *	80	0,03
210	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,875 %, fällig 15.04.2026	221	0,09
70	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 6,875 %, fällig 15.01.2029	78	0,03
50	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01.02.2031	51	0,02
4	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig 16.12.2039	6	–
90	Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig 04.05.2030	93	0,04
170	Time Warner Cable LLC, 4,125 %, fällig 15.02.2021	171	0,07
40	Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig 15.06.2039	56	0,02
190	T-Mobile USA Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.04.2030	218	0,09
30	UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, fällig 15.07.2025	34	0,01
160	US Bancorp, 1,450 %, fällig 12.05.2025	166	0,07
50	Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	68	0,03
10	Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21.08.2046	14	0,01
10	Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig 16.03.2047	15	0,01
90	Visa Inc, 2,050 %, fällig 15.04.2030	96	0,04
90	Visa Inc, 2,700 %, fällig 15.04.2040	98	0,04
340	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	283	0,11
2.110	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual *	2.124	0,84
43	Wells Fargo & Co, 4,480 %, fällig 16.01.2024	48	0,02
740	Wells Fargo & Co, 3,900 %, fällig 01.05.2045	873	0,34
1.140	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	1.562	0,61
790	Western Midstream Operating LP, 5,050 %, fällig 01.02.2030	810	0,32
550	Western Midstream Operating LP, 6,250 %, fällig 01.02.2050	552	0,22
140	WPX Energy Inc, 8,250 %, fällig 01.08.2023	158	0,06
		34.641	13,64
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 64.421 USD)		69.515	27,38
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 49,26 % (29. Februar 2020: 53,84 %)			
Belgien — 0,61 % (29. Februar 2020: 1,01 %)			
EUR 540	Kingdom of Belgium Government Bond, Series 71, 3,750 %, fällig 22.06.2045	1.134	0,45
EUR 260	Kingdom of Belgium Government Bond, Series 88, 144A, 1,700 %, fällig 22.06.2050	406	0,16
		1.540	0,61
Kanada — 3,08 % (29. Februar 2020: 2,48 %)			
CAD 9.370	Canadian Government Bond, 2,250 %, fällig 01.06.2025	7.822	3,08
Frankreich — 4,61 % (29. Februar 2020: 3,58 %)			
EUR 2.170	French Republic Government Bond OAT, 1,000 %, fällig 25.05.2027	2.832	1,11
EUR 3.700	French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,850 %, fällig 25.07.2027 β	6.015	2,37
EUR 220	French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 144A, 0,100 %, fällig 25.07.2047 β	350	0,14
EUR 770	French Republic Government Bond OAT, 144A, 1,500 %, fällig 25.05.2050	1.153	0,45
EUR 530	French Republic Government Bond OAT, 4,000 %, fällig 25.04.2060	1.369	0,54
		11.719	4,61
Deutschland — 4,58 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 400	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 98, 4,750 %, fällig 04.07.2028	680	0,27
EUR 8.620	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2029	10.957	4,31
		11.637	4,58
Indonesien — 4,04 % (29. Februar 2020: 2,39 %)			
3.380	Indonesia Government International Bond, 4,200 %, fällig 15.10.2050	4.001	1,58
IDR 84.339.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR79, 8,375 %, fällig 15.04.2039	6.255	2,46
		10.256	4,04
Italien — 3,66 % (29. Februar 2020: 4,66 %)			
EUR 970	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 2,550 %, fällig 15.09.2041 β	1.740	0,69
EUR 5.020	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,250 %, fällig 01.09.2046	7.548	2,97
		9.288	3,66
Japan — 6.01 % (29. Februar 2020: 5.51 %)			
JPY 121.700	Japan Government Ten Year Bond, Series 341, 0,300 %, fällig 20.12.2025	1.172	0,46
JPY 86.500	Japan Government Thirty Year Bond, Series 59, 0,700 %, fällig 20.06.2048	844	0,34
JPY 572.000	Japan Government Thirty Year Bond, Series 66, 0,400 %, fällig 20.03.2050	5.104	2,01
JPY 63.350	Japan Government Twenty Year Bond, Series 128, 1,900 %, fällig 20.06.2031	714	0,28
JPY 24.400	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 19, 0,100 %, fällig 10.09.2024 β	234	0,09
JPY 747.900	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 21, 0,100 %, fällig 10.03.2026 β	7.187	2,83
		15.255	6,01
Kuwait — 0,39 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
870	Kuwait International Government Bond, 3,500 %, fällig 20.03.2027	986	0,39
Mexiko — 3,32 % (29. Februar 2020: 4,18 %)			
MXN 92.829	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	4.642	1,83
EUR 1.100	Mexico Government International Bond, 2,875 %, fällig 08.04.2039	1.328	0,52
2.220	Mexico Government International Bond, 4,600 %, fällig 23.01.2046	2.469	0,97
		8.439	3,32
Katar — 0,42 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
800	Qatar Government International Bond, 4,625 %, fällig 02.06.2046	1.069	0,42
Südafrika — 0,89 % (29. Februar 2020: 1,95 %)			
ZAR 10.240	Republic of South Africa Government Bond, Series 2037, 8,500 %, fällig 31.01.2037	483	0,19

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Südafrika — (Fortsetzung)			
ZAR 47.272	Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	1.772	0,70
		2.255	0,89
Südkorea — 0,87 % (29. Februar 2020: 0,82 %)			
KRW 2.533.840	Korea Treasury Bond, Series 2606, 1,875 %, fällig 10.06.2026	2.202	0,87
Spanien — 2,24 % (29. Februar 2020: 3,46 %)			
EUR 640	Spain Government Bond, 144A, 5,150 %, fällig 31.10.2044	1.427	0,56
EUR 2.630	Spain Government Bond, Series 30Y, 144A, 2,700 %, fällig 31.10.2048	4.276	1,68
		5.703	2,24
Vereinigte Arabische Emirate — 0,43 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
890	Abu Dhabi Government International Bond, 3,875 %, fällig 16.04.2050	1.088	0,43
Großbritannien — 1,86 % (29. Februar 2020: 1,98 %)			
GBP 2.150	United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07.12.2040	4.723	1,86
USA — 12,25 % (29. Februar 2020: 16,98 %)			
1.210	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, fällig 15.02.2049 β	1.747	0,69
2.830	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,250 %, fällig 15.02.2050 β	3.383	1,33
1.070	United States Treasury Note/ Bond, 2,500 %, fällig 31.01.2021	1.080	0,43
480	United States Treasury Note/ Bond, 1,875 %, fällig 31.03.2022	493	0,19
2.450	United States Treasury Note/ Bond, 1,625 %, fällig 15.08.2022	2.522	0,99
2.110	United States Treasury Note/ Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2022	2.179	0,86
444	United States Treasury Note/ Bond, 2,875 %, fällig 31.10.2023	482	0,19
3.410	United States Treasury Note/ Bond, 2,375 %, fällig 15.08.2024	3.702	1,46
4.510	United States Treasury Note/ Bond, 1,500 %, fällig 30.11.2024	4.755	1,87
1.870	United States Treasury Note/ Bond, 0,375 %, fällig 30.04.2025	1.881	0,74
30	United States Treasury Note/ Bond, 0,250 %, fällig 30.06.2025	30	0,01
1.340	United States Treasury Note/ Bond, 2,750 %, fällig 15.11.2047	1.741	0,69
5.310	United States Treasury Note/ Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049 ≠	7.113	2,80
31.108	12,25		
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 118.139 USD)		125.090	49,26
Kollektive Kapitalanlagen — 6,92 % (29. Februar 2020: 9,06 %)			
1.355	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse M	17.579	6,92
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 17.234 USD)		17.579	6,92
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 223.658 USD)		236.585	93,17

Kontrakte (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Nettoinventarwerts
Gekaufte Optionen — 0,00 % (29. Februar 2020: 0,05 %)			
–	U.S. 10 Year Dezember 2020 Call 160,00, fällig 20.11.2020	–	–
–	U.S. 10 Year Dezember 2020 Call 160,50, fällig 20.11.2020	–	–
–	U.S. 10 Year Dezember 2020 Call 161,00, fällig 20.11.2020	–	–
–	U.S. 10 Year Dezember 2020 Call 162,00, fällig 20.11.2020	–	–
1.340	USD Call/ZAR Put 18,10, fällig 102.10.2020	7	–
Summe gekaufte Optionen (Kosten 22 USD)		7	–
Devisenterminkontrakte — 1,38 % (29. Februar 2020: 0,40 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		3.502	1,38
Termingeschäfte — 0,11 % (29. Februar 2020: 0,73 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		273	0,11
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		240.367	94,66

Kontrakte (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Nettoinventarwerts
Geschriebene Optionen — (0,04 %) (29. Februar 2020: (0,15 %))			
EUR	– Euro-Bund Oktober 2020 Put 172,00, fällig 25.09.2020	(22)	(0,01)
–	U.S. Bond Oktober 2020 Put 175,00, fällig 25.09.2020	(22)	–
(2.170)	USD Put/NOK Call 9,00, fällig 25.09.2020	(75)	(0,03)
Geschriebene Optionen insgesamt (Kosten (75) USD)		(119)	(0,04)
Devisenterminkontrakte — (0,94 %) (29. Februar 2020 :(1,02 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(2.382)	(0,94)
Termingeschäfte — (0,08 %) (29. Februar 2020: (0,79 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(188)	(0,08)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(2.689)	(1,06)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt	237.678	93,60
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	16.245	6,40
Gesamtnettovermögen	$253.923	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 21,947,000 USD und machten 8.64 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

† Illiquide.

∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

ƪ Das Wertpapier ist seit dem 31. August 2020 in Verzug (entweder Kapital und/oder Zinsen).

≠ Die Wertpapiere (in ihrer Gesamtheit oder in Teilen) sind zum 31. August 2020 als Sicherheit für den Handel mit Derivaten verpfändet.

± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (VPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihzins entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

Die Gegenparteien für OTC-Optionen sind Goldman Sachs und JP Morgan.

ABKÜRZUNGEN:

IPC	– Verbraucherpreisindex
Perpetual	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
TBA	– wird noch bekannt gegeben
CAD	– Kanadischer Dollar
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
IDR	– Indonesische Rupiah
JPY	– Japanischer Yen
KRW	– Südkoreanischer Won
MXN	– Mexikanischer Peso
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	82,31
Organismen für gemeinsame Anlagen	6,61
Finanzderivate	1,42
Sonstige Vermögenswerte	9,66
Gesamtvermögen	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1.103	Verkauf	CAD	1.447	$ (6)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	478	Verkauf	EUR	404	(4)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	57	Verkauf	NZD	86	(1)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	137.541	Verkauf	USD	102.840	2.613
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	734	Verkauf	USD	877	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	36.140	Verkauf	USD	42.654	489
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	11.123	Verkauf	USD	7.384	107
24.09.2020	JP Morgan	Kauf	USD	11.857	Verkauf	CNH	84.250	(417)
24.09.2020	JP Morgan	Kauf	USD	1.951	Verkauf	IDR	28.507.320	–
24.09.2020	JP Morgan	Kauf	USD	2.173	Verkauf	KRW	2.635.805	(46)
24.09.2020	JP Morgan	Kauf	RUB	144.461	Verkauf	USD	2.059	(119)
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	5.013	Verkauf	CAD	6.660	(94)
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	15.954	Verkauf	EUR	13.494	(178)
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	3.098	Verkauf	JPY	329.608	(18)
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	NOK	39.651	Verkauf	USD	4.426	115
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	AUD	6.461	Verkauf	USD	4.640	126
19.11.2020	HSBC	Kauf	USD	15.180	Verkauf	EUR	12.882	(219)
19.11.2020	HSBC	Kauf	EUR	640	Verkauf	USD	756	9
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	8.676	Verkauf	AUD	12.103	(253)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	9.485	Verkauf	CAD	12.616	(190)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	19.686	Verkauf	EUR	16.700	(278)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	15.035	Verkauf	GBP	11.471	(306)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	3.958	Verkauf	JPY	420.590	(17)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	906	Verkauf	ZAR	16.038	(32)
19.11.2020	Morgan Stanley	Kauf	AUD	1.880	Verkauf	USD	1.344	43
19.11.2020	UBS	Kauf	USD	12.007	Verkauf	EUR	10.197	(182)
19.11.2020	UBS	Kauf	USD	891	Verkauf	JPY	95.000	(7)
19.11.2020	UBS	Kauf	USD	614	Verkauf	MXN	13.901	(15)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 1.064 USD)								$ 3.502
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (2.689) USD)								(2.382)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (1.625) USD)								$ 1.120

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Australie 10 Year Bond September 2020	86	$ 9.354	$ 24
Canadian 10 Year Bond Dezember 2020	23	2.661	(18)
Euro-Bobl September 2020	(6)	(964)	(3)
Euro-BTP September 2020	(17)	(2.966)	26
Euro-Bund Dezember 2020	(43)	(8.864)	36
Euro-Bund September 2020	(48)	(10.056)	18
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2020	(9)	(2.330)	(14)
Euro-OAT September 2020	(23)	(4.597)	(52)
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2020	4	5.725	(10)
Long Gilt Dezember 2020	(9)	(1.624)	15
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	(472)	(65.726)	54
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2020	(39)	(6.218)	34
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2020	30	6.628	1
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	412	51.925	65
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	19	3.339	(36)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	14	3.093	(55)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 1.911 USD)			$ 273
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(2 079) USD)			188
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (168) USD)			$ 85

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 0,73 % (29. Februar 2020: 0,70 %)			
140	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Series 2018 4, Klasse A, 4,060 %, fällig 15.11.2030	159	0,21
419	SLM Student Loan Trust 2006-10, Series 2006 10, Klasse A6, 0,395 %, fällig 25.03.2044 *	391	0,52
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 546 USD)		550	0,73
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 93,09 % (29. Februar 2020: 76,77 %)			
Australien — 0,74 % (29. Februar 2020: 0,12 %)			
EUR 370	Glencore Finance Europe Ltd, 1,875 %, fällig 13.09.2023	459	0,61
80	Westpac Banking Corp, 4,421 %, fällig 24.07.2039	99	0,13
		558	0,74
Autriche — 0,45 % (29. Februar 2020: 0,42 %)			
EUR 300	CA Immobilien Anlagen AG, 0,875 %, fällig 05.02.2027	345	0,45
Belgien — 0,93 % (29. Februar 2020: 1,10 %)			
EUR 220	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3,700 %, fällig 02.04.2040	330	0,44
10	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048	12	0,01
EUR 300	KBC Group NV, 1,875 %, fällig 11.03.2027 *	365	0,48
		707	0,93
Brasilien — 1,91 % (29. Februar 2020: 1,83 %)			
310	Braskem Finance Ltd, 6,450 %, fällig 03.02.2024	339	0,45
330	Petrobras Global Finance BV, 6,900 %, fällig 19.03.2049	378	0,50
300	Suzano Austria GmbH, 7,000 %, fällig 16.03.2047	350	0,46
EUR 300	Vale SA, 3,750 %, fällig 10.01.2023	378	0,50
		1.445	1,91
Kanada — 0,18 % (29. Februar 2020: 0,17 %)			
140	MEG Energy Corp, 7,125 %, fällig 01.02.2027	134	0,18
China — 1,89 % (29. Februar 2020: 1,77 %)			
700	China Overseas Finance Cayman VII Ltd, 4,250 %, fällig 26.04.2023	749	0,99
EUR 340	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 1,750 %, fällig 14.06.2022	413	0,54
260	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 3,500 %, fällig 19.07.2022	269	0,36
		1.431	1,89
Kolumbien — 0,51 % (29. Februar 2020: 0,51 %)			
340	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	386	0,51
Dänemark — 1,31 % (29. Februar 2020: 1,59 %)			
270	Danske Bank A/S, 5,375 %, fällig 12.01.2024	306	0,40
EUR 200	Danske Bank A/S, 2,500 %, fällig 21.06.2029 *	250	0,33
EUR 370	Danske Bank A/S, 1,375 %, fällig 12.02.2030 *	440	0,58
		996	1,31
Frankreich — 5,86 % (29. Februar 2020: 4,27 %)			
EUR 300	Aeroports de Paris, 1,500 %, fällig 02.07.2032	365	0,48
EUR 100	Air Liquide Finance SA, 1,375 %, fällig 02.04.2030	132	0,17
EUR 490	AXA SA, 3,250 %, fällig 28.05.2049 *	666	0,88
200	BNP Paribas SA, 4,705 %, fällig 10.01.2025 *	224	0,29
GBP 400	BNP Paribas SA, 1,875 %, fällig 14.12.2027	551	0,73
410	BNP Paribas SA, 144A, 3,052 %, fällig 13.01.2031 *	444	0,58
EUR 200	Eiffage SA, 1,625 %, fällig 14.01.2027	247	0,33
400	Engie SA, 2,875 %, fällig 10.10.2022	414	0,55
EUR 200	Engie SA, 0,500 %, fällig 24.10.2030	240	0,32
EUR 310	GELF Bond Issuer I SA, 1,125 %, fällig 18.07.2029	363	0,48
EUR 300	Mercialys SA, 4,625 %, fällig 07.07.2027	365	0,48
EUR 200	Terega SASU, 0,625 %, fällig 27.02.2028	228	0,30
200	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 4,750 %, fällig 17.09.2044	204	0,27
		4.443	5,86
Deutschland — 5,65 % (29. Februar 2020: 4,18 %)			
EUR 100	Allianz Finance II BV, 5,750 %, fällig 08.07.2041 *	125	0,16
EUR 400	Allianz SE, 4,750 %, Perpetual *	536	0,71
EUR 300	alstria office REIT-AG, 1,500 %, fällig 23.06.2026	360	0,47
250	Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, fällig 15.06.2030	394	0,52
EUR 200	Hannover Finance Luxembourg SA, 5,750 %, fällig 14.09.2040 *	239	0,32
EUR 400	Hannover Rueck SE, 1,125 %, fällig 09.10.2039 *	466	0,62
EUR 400	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, fällig 26.05.2049 *	552	0,73
EUR 380	Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, fällig 01.10.2024	465	0,61
GBP 400	Volkswagen Financial Services NV, 4,250 %, fällig 09.10.2025	605	0,80
EUR 400	Vonovia Finance BV, 2,250 %, fällig 07.04.2030	540	0,71
		4.282	5,65
Hongkong — 0,28 % (29. Februar 2020: 0,27 %)			
200	AIA Group Ltd, 144A, 3,200 %, fällig 11.03.2025	216	0,28
Irland — 0,63 % (29. Februar 2020: 0,48 %)			
310	CRH America Finance Inc, 4,500 %, fällig 04.04.2048	348	0,46
EUR 100	CRH Funding BV, 1,625 %, fällig 05.05.2030	128	0,17
		476	0,63
Israel — 0,56 % (29. Februar 2020: 0,48 %)			
EUR 390	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,125 %, fällig 15.10.2024	421	0,56
Italien — 3,80 % (29. Februar 2020: 3,58 %)			
270	Enel Finance International NV, 6,000 %, fällig 07.10.2039	362	0,48
EUR 290	FCA Bank SpA/Ireland, 0,500 %, fällig 13.09.2024	342	0,45
EUR 380	Intesa Sanpaolo SpA, 1,000 %, fällig 04.07.2024	459	0,60
EUR 250	Intesa Sanpaolo SpA, 5,500 %, Perpetual *	296	0,39
EUR 230	UniCredit SpA, 1,250 %, fällig 25.06.2025 *	278	0,37
EUR 420	UniCredit SpA, 1,200 %, fällig 20.01.2026 *	490	0,65
EUR 340	UniCredit SpA, 2,000 %, fällig 23.09.2029 *	390	0,51
EUR 200	UniCredit SpA, 7,500 %, Perpetual *	266	0,35
		2.883	3,80
Luxemburg — 2,00 % (29. Februar 2020: 2,17 %)			
160	ArcelorMittal SA, 4,550 %, fällig 11.03.2026	175	0,23
EUR 340	Logicor Financing Sarl, 1,625 %, fällig 15.07.2027	414	0,54
EUR 230	Logicor Financing Sarl, 3,250 %, fällig 13.11.2028	308	0,41
EUR 125	Prologis International Funding II SA, 1,750 %, fällig 15.03.2028	164	0,22
EUR 240	SELP Finance Sarl, 1,500 %, fällig 20.11.2025	295	0,39
EUR 130	SELP Finance Sarl, 1,500 %, fällig 20.12.2026	160	0,21
		1.516	2,00
Macau — 0,29 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Sands China Ltd, 144A, 4,375 %, fällig 18.06.2030	216	0,29
Mexiko — 0,34 % (29. Februar 2020: 0,33 %)			
240	BBVA Bancomer SA/Texas, 6,750 %, fällig 30.09.2022	260	0,34
Niederlande — 4,31 % (29. Februar 2020: 2,78 %)			
EUR 194	ABN AMRO Bank NV, 7,125 %, fällig 06.07.2022	261	0,34
EUR 300	ABN AMRO Bank NV, 4,750 %, Perpetual *	359	0,47
EUR 310	Cooperatieve Rabobank UA, 2,500 %, fällig 26.05.2026 *	375	0,50
EUR 200	Cooperatieve Rabobank UA, 6,625 %, Perpetual *	248	0,33
EUR 100	Enexis Holding NV, 0,750 %, fällig 02.07.2031	124	0,16
EUR 140	Euronext NV, 1,000 %, fällig 18.04.2025	172	0,23
EUR 200	ING Groep NV, 3,000 %, fällig 11.04.2028 *	253	0,33
EUR 300	ING Groep NV, 2,500 %, fällig 15.02.2029 *	379	0,50
EUR 200	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1,750 %, fällig 02.04.2027	262	0,35
EUR 110	Koninklijke Philips NV, 2,000 %, fällig 30.03.2030	148	0,20
60	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 3,400 %, fällig 01.05.2030	67	0,09
EUR 490	Vesteda Finance BV, 1,500 %, fällig 24.05.2027	615	0,81
		3.263	4,31
Norwegen — 0,78 % (29. Februar 2020: 0,42 %)			
320	DNB Bank ASA, 6,500 %, Perpetual *	337	0,44
EUR 200	Equinor ASA, 1,375 %, fällig 22.05.2032	257	0,34
		594	0,78
Russland — 0,52 % (29. Februar 2020: 0,49 %)			
350	Lukoil International Finance BV, 4,750 %, fällig 02.11.2026	393	0,52
Südafrika — 0,53 % (29. Februar 2020: 0,50 %)			
350	Anglo American Capital Plc, 4,750 %, fällig 10.04.2027	403	0,53
Spanien — 2,23 % (29. Februar 2020: 2,67 %)			
EUR 200	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 5,875 %, Perpetual *	236	0,31
GBP 400	Banco Santander SA, 1,750 %, fällig 17.02.2027	531	0,70
EUR 200	Banco Santander SA, 5,250 %, Perpetual *	232	0,31
EUR 200	Cellnex Telecom SA, 1,875 %, fällig 26.06.2029	243	0,32
EUR 200	Prosegur Cia de Seguridad SA, 1,000 %, fällig 08.02.2023	242	0,32
140	Telefonica Emisiones SA, 7,045 %, fällig 20.06.2036	204	0,27
		1.688	2,23
Schweden — 1,32 % (29. Februar 2020: 1,22 %)			
EUR 350	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,624 %, Perpetual *	395	0,52
EUR 320	Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, fällig 02.03.2028 *	389	0,51
200	Svenska Handelsbanken AB, 6,250 %, Perpetual *	219	0,29
		1.003	1,32
Schweiz — 4,43 % (29. Februar 2020: 2,60 %)			
EUR 220	Credit Suisse Group AG, 3,250 %, fällig 02.04.2026 *	294	0,39
GBP 300	Credit Suisse Group AG, 2,250 %, fällig 09.06.2028 *	415	0,55
230	Credit Suisse Group AG, 6,375 %, Perpetual *	250	0,33
200	Credit Suisse Group AG, 7,250 %, Perpetual *	220	0,29
EUR 100	ELM BV for Firmenich International SA, 3,750 %, Perpetual *	125	0,17
EUR 160	Firmenich Productions Participations SAS, 1,750 %, fällig 30.04.2030	204	0,27
280	Glencore Finance Canada Ltd, 6,000 %, fällig 15.11.2041	334	0,44
EUR 100	Swiss Re Finance UK Plc, 2,714 %, fällig 04.06.2052 *	126	0,17
230	Syngenta Finance NV, 4,441 %, fällig 24.04.2023	242	0,32
EUR 102	UBS AG, 4,750 %, fällig 12.02.2026 *	124	0,16
EUR 320	UBS Group AG, 1,750 %, fällig 16.11.2022	397	0,52

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)				
Schweiz — (Fortsetzung)				
EUR	300	UBS Group AG, 1,500 %, fällig 30.11.2024	374	0,49
	230	UBS Group AG, 7,000 %, Perpetual *	250	0,33
			3.355	4,43
Vereinigte Arabische Emirate — 0,65 % (29. Februar 2020: 0,60 %)				
EUR	410	DP World Plc, 2,375 %, fällig 25.09.2026	496	0,65
Großbritannien — 13,04 % (29. Februar 2020: 11,10 %)				
EUR	210	Annington Funding Plc, 1,650 %, fällig 12.07.2024	261	0,34
EUR	350	Barclays Plc, 3,375 %, fällig 02.04.2025 *	456	0,60
EUR	280	Barclays Plc, 2,000 %, fällig 07.02.2028 *	336	0,44
GBP	210	Barclays Plc, 6,375 %, Perpetual *	288	0,38
GBP	150	BUPA Finance Plc, 5,000 %, fällig 25.04.2023	216	0,28
EUR	170	Cadent Finance Plc, 0,750 %, fällig 11.03.2032	201	0,27
GBP	190	Close Brothers Group Plc, 2,750 %, fällig 26.04.2023	264	0,35
GBP	250	Co-Operative Bank Plc/The, 4,750 %, fällig 11.11.2021	348	0,46
GBP	220	CPUK Finance Ltd, 7,239 %, fällig 28.02.2024	334	0,44
GBP	310	Dignity Finance Plc, Series B, 4,696 %, fällig 31.12.2049	319	0,42
	360	Fiat Chrysler Automobiles NV, 5,250 %, fällig 15.04.2023	382	0,50
GBP	180	Grainger Plc, 3,000 %, fällig 03.07.2030	248	0,33
	200	HSBC Holdings Plc, 2,357 %, fällig 18.08.2031 *	203	0,27
GBP	260	HSBC Holdings Plc, 5,875 %, Perpetual *	361	0,48
EUR	250	HSBC Holdings Plc, 6,000 %, Perpetual *	318	0,42
EUR	290	Informa Plc, 1,500 %, fällig 05.07.2023	345	0,45
GBP	160	Legal & General Group Plc, 4,500 %, fällig 01.11.2050 *	235	0,31
	200	Lloyds Bank Plc, 12,000 %, Perpetual *	235	0,31
EUR	240	Lloyds Banking Group Plc, 3,500 %, fällig 01.04.2026 *	324	0,43
GBP	200	Lloyds Banking Group Plc, 5,125 %, Perpetual *	263	0,35
GBP	100	M&G Plc, 3,875 %, fällig 20.07.2049 *	140	0,18
GBP	200	Marston's Issuer Plc, Series B1, 2,632 %, fällig 15.07.2035 *	211	0,28
EUR	450	Natwest Group Plc, 2,500 %, fällig 22.03.2023	567	0,75
	200	Natwest Group Plc, 4,269 %, fällig 22.03.2025 *	220	0,29
	220	Natwest Group Plc, 3,754 %, fällig 01.11.2029 *	232	0,31
EUR	120	RELX Finance BV, 0,500 %, fällig 10.03.2028	143	0,19
EUR	100	RELX Finance BV, 0,875 %, fällig 10.03.2032	120	0,16
	500	Santander UK Group Holdings Plc, 4,750 %, fällig 15.09.2025	557	0,73
	260	Standard Chartered Plc, 3,950 %, fällig 11.01.2023	272	0,36
	270	Standard Chartered Plc, 3,516 %, fällig 12.02.2030 *	280	0,37
EUR	270	Standard Chartered Plc, 2,500 %, fällig 09.09.2030 *	334	0,44
GBP	190	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500 %, fällig 02.05.2025	270	0,36
GBP	100	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,750 %, fällig 27.04.2030	142	0,19
GBP	190	UNITE Group Plc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2028	264	0,35
EUR	140	Vodafone Group Plc, 2,500 %, fällig 24.05.2039	190	0,25
			9.879	13,04
USA — 37,95 % (29. Februar 2020: 29,52 %)				
EUR	410	Abbott Ireland Financing DAC, 0,375 %, fällig 19.11.2027	495	0,65
EUR	230	AbbVie Inc, 1,250 %, fällig 01.06.2024	285	0,38
	760	AbbVie Inc, 144A, 3,200 %, fällig 21.11.2029	845	1,11
	380	AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	492	0,65
	140	Aetna Inc, 2,800 %, fällig 15.06.2023	148	0,19
EUR	190	American International Group Inc, 1,500 %, fällig 08.06.2023	235	0,31
	330	Amgen Inc, 3,625 %, fällig 22.05.2024	364	0,48
	90	Anthem Inc, 3,650 %, fällig 01.12.2027	103	0,14
	160	Apple Inc, 2,650 %, fällig 11.05.2050	166	0,22
EUR	170	AT&T Inc, 2,600 %, fällig 19.05.2038	225	0,30
GBP	125	AT&T Inc, 4,250 %, fällig 01.06.2043	208	0,27
	150	AT&T Inc, 5,450 %, fällig 01.03.2047	197	0,26
EUR	400	AT&T Inc, Series B, 2,875 %, Perpetual *	469	0,62
	340	Bank of America Corp, 3,550 %, fällig 05.03.2024 *	364	0,48
EUR	160	Bank of America Corp, 3,648 %, fällig 31.03.2029 *	233	0,31
	140	Bank of America Corp, 4,443 %, fällig 20.01.2048 *	180	0,24
	310	Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,200 %, fällig 15.08.2048	400	0,53
	250	Boeing Co/The, 4,875 %, fällig 01.05.2025	272	0,36
	120	Boeing Co/The, 3,950 %, fällig 01.08.2059	111	0,15
	479	Bristol-Myers Squibb Co, 3,625 %, fällig 15.05.2024	531	0,70
	380	Broadcom Inc, 4,300 %, fällig 15.11.2032	439	0,58
	160	Carlyle Holdings II Finance LLC, 144A, 5,625 %, fällig 30.03.2043	202	0,27
	190	Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	209	0,28
	210	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.05.2047	252	0,33
	580	Cigna Corp, 2,400 %, fällig 15.03.2030	610	0,80
	400	Cigna Corp, 3,400 %, fällig 15.03.2050	432	0,57
	150	Cimarex Energy Co, 3,900 %, fällig 15.05.2027	155	0,20
	500	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	883	1,17
	170	Coca-Cola Co/The, 4,200 %, fällig 25.03.2050	225	0,30
	510	Comcast Corp, 3,100 %, fällig 01.04.2025	565	0,75
GBP	180	Comcast Corp, 1,875 %, fällig 20.02.2036	249	0,33
	70	Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	101	0,13
	380	CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	496	0,65
EUR	130	Danaher Corp, 2,500 %, fällig 30.03.2030	181	0,24
	150	DCP Midstream Operating LP, 5,625 %, fällig 15.07.2027	162	0,21
	90	Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	90	0,12
EUR	110	Digital Dutch Finco BV, 1,500 %, fällig 15.03.2030	137	0,18
	70	Energy Transfer Operating LP, 6,250 %, fällig 15.04.2049	74	0,10
	60	Energy Transfer Operating LP, 5,000 %, fällig 15.05.2050	57	0,08
	40	Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31.01.2060	41	0,05
	250	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	228	0,30
	220	Exelon Corp, 3,400 %, fällig 15.04.2026	249	0,33
	190	Fidelity & Guaranty Life Holdings Inc, 5,500 %, fällig 01.05.2025	210	0,28
	200	FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, fällig 15.11.2031	284	0,37
	370	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21.04.2023	410	0,54
	170	Fox Corp, 3,050 %, fällig 07.04.2025	186	0,25
GBP	200	GE Capital UK Funding Unlimited Co, 8,000 %, fällig 14.01.2039	385	0,51
	320	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10.01.2039	408	0,54
	80	General Motors Co, 5,400 %, fällig 02.10.2023	89	0,12
	110	General Motors Co, 6,125 %, fällig 01.10.2025	129	0,17
	50	General Motors Co, 6,600 %, fällig 01.04.2036	60	0,08
	130	General Motors Co, 6,750 %, fällig 01.04.2046	158	0,21
	16	Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, Perpetual *	15	0,02
EUR	280	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,875 %, fällig 03.06.2026	379	0,50
	110	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800 %, fällig 15.03.2030	128	0,17
	340	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	454	0,60
	70	Halliburton Co, 5,000 %, fällig 15.11.2045	77	0,10
	340	HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.06.2026	402	0,53
EUR	270	Honeywell International Inc, 0,750 %, fällig 10.03.2032	322	0,42
	150	Humana Inc, 3,125 %, fällig 15.08.2029	166	0,22
EUR	360	Illinois Tool Works Inc, 0,250 %, fällig 05.12.2024	435	0,57
	140	Intercontinental Exchange Inc, 4,250 %, fällig 21.09.2048	174	0,23
	450	International Lease Finance Corp, 5,875 %, fällig 15.08.2022	487	0,64
EUR	250	JPMorgan Chase & Co, 1,090 %, fällig 11.03.2027 *	308	0,41
	150	Lam Research Corp, 1,900 %, fällig 15.06.2030	156	0,21
	270	Las Vegas Sands Corp, 3,500 %, fällig 18.08.2026	276	0,36
	210	Lehman Brothers Holding Inc, Null-Coupon, Perpetual †∞ ξ	–	–
	320	Lehman Brothers Holdings Capital Trust Escrow, Null-Coupon, Perpetual †∞ξ	–	–
	130	März Inc, 4,200 %, fällig 01.04.2059	167	0,22
	20	Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375 %, fällig 15.04.2050	21	0,03
	370	McDonald's Corp, 3,700 %, fällig 30.01.2026	423	0,56
	230	MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	267	0,35
	500	Microsoft Corp, 3,700 %, fällig 08.08.2046	628	0,83
	200	MPLX LP, 4,800 %, fällig 15.02.2029	232	0,31
	170	MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	181	0,24
	250	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, fällig 15.10.2027	265	0,35
GBP	430	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692 %, fällig 05.06.2028	580	0,76
	112	MUFG Americas Holdings Corp, 3,000 %, fällig 10.02.2025	121	0,16
	190	Noble Energy Inc, 3,850 %, fällig 15.01.2028	216	0,28
	180	Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig 15.01.2028	204	0,27
	270	Northwest Pipeline LLC, 4,000 %, fällig 01.04.2027	301	0,40
	100	Nuveen LLC, 4,000 %, fällig 01.11.2028	120	0,16
EUR	250	Prologis Euro Finance LLC, 1,875 %, fällig 05.01.2029	332	0,44
EUR	220	Prologis Euro Finance LLC, 0,625 %, fällig 10.09.2031	260	0,34

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
240	Prudential Financial Inc, 3,000 %, fällig 10.03.2040	257	0,34
410	Schlumberger Holdings Corp, 4,000 %, fällig 21.12.2025	455	0,60
340	Southern Co/The, 2,950 %, fällig 01.07.2023	362	0,48
70	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2028	72	0,09
340	Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2039	427	0,56
310	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	444	0,59
150	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01.02.2026	196	0,26
110	UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	147	0,19
EUR 290	US Bancorp, 0,850 %, fällig 07.06.2024	356	0,47
60	Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	82	0,11
260	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 4,125 %, fällig 15.08.2030	260	0,34
410	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual *	413	0,54
100	Walmart Inc, 4,050 %, fällig 29.06.2048	130	0,17
EUR 250	Wells Fargo & Co, 2,250 %, fällig 02.05.2023	315	0,42
EUR 590	Wells Fargo & Co, 1,338 %, fällig 04.05.2025 *	723	0,95
GBP 200	Wells Fargo & Co, 4,875 %, fällig 29.11.2035	349	0,46
150	Western Midstream Operating LP, 4,650 %, fällig 01.07.2026	154	0,20
	Western Midstream Operating LP, 4,750 %, fällig 15.08.2028	111	0,15
100	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15.08.2048	90	0,12
130	Western Midstream Operating LP, 6,250 %, fällig 01.02.2050	130	0,17
330	Williams Cos Inc/The, 4,300 %, fällig 04.03.2024	363	0,48
30	WPX Energy Inc, 5,250 %, fällig 15.10.2027	30	0,04
120	WPX Energy Inc, 4,500 %, fällig 15.01.2030	115	0,15
		28.757	37,95
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 64.653 USD)		70.546	93,09
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 4,70 % (29. Februar 2020: 15,22 %)			
Deutschland — 1,20 % (29. Februar 2020: 7,96 %)			
EUR 130	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 98, 4,750 %, fällig 04.07.2028	221	0,29
EUR 220	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2029	280	0,37
EUR 70	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2030	87	0,12
EUR 200	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,250 %, fällig 15.08.2048	319	0,42
		907	1,20
Indonesien — 0,54 % (29. Februar 2020: 1,43 %)			
EUR 350	Indonesia Government International Bond, 1,400 %, fällig 30.10.2031	410	0,54
Mexiko — 0,24 % (29. Februar 2020: 0,25 %)			
MXN 3.570	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	178	0,24
Rumänien — 0,43 % (29. Februar 2020: 0,41 %)			
EUR 290	Romanian Government International Bond, 2,000 %, fällig 28.01.2032	328	0,43
Russland — 0,74 % (29. Februar 2020: 0,70 %)			
RUB 11.680	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	169	0,22
EUR 300	Russian Foreign Bond – Eurobond, 2,875 %, fällig 04.12.2025	392	0,52
		561	0,74
Großbritannien — 0,44 % (29. Februar 2020: 0,07 %)			
GBP 140	United Kingdom Gilt, 4,750 %, fällig 07.12.2030	271	0,36
GBP 26	United Kingdom Gilt, 4,500 %, fällig 07.12.2042	61	0,08
		332	0,44
USA — 1,11 % (29. Februar 2020: 3,96 %)			
160	United States Treasury Note/ Bond, 0,250 %, fällig 30.06.2025	160	0,21
60	United States Treasury Note/ Bond, 3,125 %, fällig 15.11.2028	72	0,09
10	United States Treasury Note/ Bond, 2,625 %, fällig 15.02.2029	12	0,02
40	United States Treasury Note/ Bond, 1,500 %, fällig 15.02.2030	43	0,06
80	United States Treasury Note/ Bond, 0,625 %, fällig 15.05.2030	80	0,10
420	United States Treasury Note/ Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	475	0,63
		842	1,11
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 3.462 USD)		3.558	4,70
Kollektive Kapitalanlagen — 0,37 % (29. Februar 2020: 0,70 %)			
284	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	284	0,37
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 284 USD)		284	0,37
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 68.945 USD)		74.938	98,89
Devisenterminkontrakte — 0,03 % (29. Februar 2020 :0,14 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		24	0,03
Termingeschäf4te — 0,08 % (29. Februar 2020: 0,41 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		61	0,08
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		75.023	99,00
Kreditausfallversicherungen — (0,67 %) (29. Februar 2020: (1,02 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(511)	(0,67)
Devisenterminkontrakte — (0,86 %) (29. Februar 2020: (0,53 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(651)	(0,86)
Termingeschäfte — (0,10 %) (29. Februar 2020: (0,31 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(78)	(0,10)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(1.240)	(1,63)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		73.783	97,37
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		1.999	2,63
Gesamtnettovermögen		$75.782	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144 Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1,944,000 USD und machten 2.56 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

† Illiquide.

∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

ƐDas Wertpapier ist seit dem 31. August 2020 in Verzug (entweder Kapital und/oder Zinsen).

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
EUR – Euro
GBP – Britisches Pfund Sterling
MXN – Mexikanischer Peso
RUB – Russischer Rubel

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,24
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,37
Finanzderivate	0,11
Sonstige Vermögenswerte	3,28
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/Ver-kaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 5,000 %	Kauf	20.06.2025	3.530	$ (327)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 %	Kauf	20.06.2025	6.970	(184)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Kreditausfallversicherungen (29. Februar 2020 (in Tsd.): - USD)					$ -
Apreciación neta de swaps de tipos de interés (29. Februar 2020 (miles): (805) USD)					(511)
Apreciación neta de swaps de tipos de interés (29. Februar 2020 (miles): (805) USD)					$ (511)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	13	Verkauf	EUR	11	$ –
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	566	Verkauf	USD	668	7
24.09.2020	Morgan Stanley	Kauf	BRL	1.600	Verkauf	USD	309	(17)
19.11.2020	Citi	Kauf	USD	6.239	Verkauf	EUR	5.278	(70)
19.11.2020	Citi	Kauf	USD	203	Verkauf	GBP	155	(4)
19.11.2020	Citi	Kauf	EUR	1.800	Verkauf	USD	2.135	17
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	9.085	Verkauf	EUR	7.682	(99)
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.270	Verkauf	GBP	968	(25)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	9.233	Verkauf	EUR	7.833	(130)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	5.616	Verkauf	GBP	4.285	(114)
19.11.2020	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.874	Verkauf	EUR	1.591	(28)
19.11.2020	UBS	Kauf	USD	8.173	Verkauf	EUR	6.938	(120)
19.11.2020	UBS	Kauf	USD	1.832	Verkauf	GBP	1.402	(44)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 105 USD)								$ 24
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (418) USD)								(651)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (313) USD)								$ (627)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl September 2020	(5)	$ (803)	$ –
Euro-Bund Dezember 2020	(14)	(2.886)	12
Euro-Bund September 2020	(15)	(3.142)	(4)
Long Gilt Dezember 2020	(13)	(2.346)	22
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	21	2.924	2
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	36	4.537	5
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	(10)	(1.757)	20
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	19	4.197	(74)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 327 USD)			$ 61
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(245) USD)			(78)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 82 USD)			$ (17)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) €	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 91,50 % (29. Februar 2020: 90,00 %)			
Brasilien — 1,75 % (29. Februar 2020: 1,90 %)			
GBP 770	Petrobras Global Finance BV, 6,625 %, fällig 16.01.2034	938	1,75
Frankreich — 10,22 % (29. Februar 2020: 9,34 %)			
940	3AB Optique Developpement SAS, 4,000 %, fällig 01.10.2023	917	1,71
1.000	Altice France SA/France, 3,375 %, fällig 15.01.2028	994	1,86
200	Banijay Entertainment SASU, 3,500 %, fällig 01.03.2025	198	0,37
500	Casino Guichard Perrachon SA, 4,498 %, fällig 07.03.2024	418	0,78
400	Europcar Mobility Group, 4,000 %, fällig 30.04.2026	202	0,38
500	Faurecia SE, 3,750 %, fällig 15.06.2028	510	0,95
910	Kapla Holding SAS, 3,375 %, fällig 15.12.2026	875	1,63
200	Mercialys SA, 4,625 %, fällig 07.07.2027	204	0,38
1.220	Novafives SAS, 5,000 %, fällig 15.06.2025	902	1,69
250	Parts Europe SA, 6,500 %, fällig 16.07.2025	254	0,47
		5.474	10,22
Deutschland — 9,73 % (29. Februar 2020: 7,29 %)			
200	Bayer AG, 2,375 %, fällig 12.11.2079 *	198	0,37
500	Bertelsmann SE & Co KGaA, 3,000 %, fällig 23.04.2075 *	507	0,95
680	CBR Fashion Finance BV, 5,125 %, fällig 01.10.2022	642	1,20
460	HT Troplast GmbH, 9,250 %, fällig 15.07.2025	498	0,93
1.000	IHO Verwaltungs GmbH, 3,750 %, fällig 15.09.2026	1.029	1,92
825	Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, fällig 30.09.2025	823	1,54
800	Platin 1426 GmbH, 5,375 %, fällig 15.06.2023	772	1,44
500	Rebecca Bidco GmbH, 5,750 %, fällig 15.07.2025	511	0,95
100	Vertical Holdco GmbH, 6,625 %, fällig 15.07.2028	105	0,20
120	Vertical Midco GmbH, 4,375 %, fällig 15.07.2027	123	0,23
		5.208	9,73
Grèce — 1,29 % (29. Februar 2020: 1,23 %)			
692	Crystal Almond SARL, 4,250 %, fällig 15.10.2024	689	1,29
Irland — 1,24 % (29. Februar 2020: 1,17 %)			
680	eircom Finance DAC, 2,625 %, fällig 15.02.2027	666	1,24
Israel — 3,22 % (29. Februar 2020: 2,95 %)			
1.370	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,125 %, fällig 15.10.2024	1.238	2,31
170	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 6,000 %, fällig 31.01.2025	181	0,34
300	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 4,500 %, fällig 01.03.2025	304	0,57
		1.723	3,22
Italien — 9,98 % (29. Februar 2020: 7,80 %)			
1.000	ASR Media and Sponsorship SpA, 5,125 %, fällig 01.08.2024	1.009	1,88
1.000	doValue SpA, 5,000 %, fällig 04.08.2025	995	1,86
250	Gamma Bidco SpA, 6,250 %, fällig 15.07.2025	250	0,47
470	International Design Group SPA, 6,500 %, fällig 15.11.2025	452	0,84
665	KME SE, 6,750 %, fällig 01.02.2023	442	0,83
580	Leonardo SpA, 4,875 %, fällig 24.03.2025	656	1,23
1.410	Telecom Italia SpA/Milano, 3,625 %, fällig 25.05.2026	1.538	2,87
		5.342	9,98
Jersey — 0,28 % (29. Februar 2020: 0,27 %)			
150	LHC3 Plc, 4,125 %, fällig 15.08.2024	150	0,28
Luxemburg — 4,81 % (29. Februar 2020: 6,69 %)			
940	Altice France Holding SA, 8,000 %, fällig 15.05.2027	1.024	1,91
710	Eurofins Scientific SE, 4,875 %, Perpetual *	755	1,41
140	PLT VII Finance Sarl, 4,625 %, fällig 05.01.2026	144	0,27
650	Summer BC Holdco B SARL, 5,750 %, fällig 31.10.2026	650	1,22
		2.573	4,81
Mexiko — 1,43 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
920	Petroleos Mexicanos, 2,750 %, fällig 21.04.2027	765	1,43
Niederlande — 4,78 % (29. Februar 2020: 6,49 %)			
583	Maxeda DIY Holding BV, 6,125 %, fällig 15.07.2022	563	1,05
1.000	Schoeller Packaging BV, 6,375 %, fällig 01.11.2024	965	1,80
1.000	Trivium Packaging Finance BV, 3,750 %, fällig 15.08.2026	1.031	1,93
		2.559	4,78
Rumänien — 1,82 % (29. Februar 2020: 1,70 %)			
1.000	RCS & RDS SA, 3,250 %, fällig 05.02.2028	972	1,82
Spanien — 6,47 % (29. Februar 2020: 8,08 %)			
300	Cirsa Finance International Sarl, 6,250 %, fällig 20.12.2023	274	0,51
900	Codere Finance 2 Luxembourg SA, 6,750 %, fällig 01.11.2021 †	554	1,03
250	Grupo Antolin-Irausa SA, 3,250 %, fällig 30.04.2024	224	0,42
690	Repsol International Finance BV, 4,500 %, fällig 25.03.2075 *	735	1,37
900	Telefonica Europe BV, 4,375 %, Perpetual *	955	1,79
590	Tendam Brands SAU, 5,000 %, fällig 15.09.2024	502	0,94
260	Tendam Brands SAU, 5,250 %, fällig 15.09.2024 *	219	0,41
		3.463	6,47
Schweden — 2,18 % (29. Februar 2020: 1,22 %)			
700	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,624 %, Perpetual *	662	1,24
500	Verisure Holding AB, 3,875 %, fällig 15.07.2026	506	0,94
		1.168	2,18
Schweiz — 0,56 % (29. Februar 2020: 0,27 %)			
140	ELM BV for Firmenich International SA, 3,750 %, Perpetual *	146	0,27
150	Holcim Finance Luxembourg SA, 3,000 %, Perpetual *	154	0,29
		300	0,56
Großbritannien — 20,18 % (29. Februar 2020: 17,80 %)			
GBP 300	B&M European Value Retail SA, 3,625 %, fällig 15.07.2025	342	0,64
GBP 220	Co-operative Group Holdings 2011 Ltd, 7,500 %, fällig 08.07.2026	289	0,54
1.090	FCE Bank Plc, 0,869 %, fällig 13.09.2021	1.077	2,01
330	Fiat Chrysler Automobiles NV, 3,875 %, fällig 05.01.2026	357	0,67
GBP 1.000	Galaxy Bidco Ltd, 6,500 %, fällig 31.07.2026	1.146	2,14
GBP 500	Jerrold Finco Plc, 6,125 %, fällig 15.01.2024	550	1,03
GBP 1.100	Ladbrokes Group Finance Plc, 5,125 %, fällig 08.09.2023	1.278	2,39
GBP 350	Marston's Issuer Plc, Series B1, 2,632 %, fällig 15.07.2035 *	310	0,58
GBP 580	Miller Homes Group Holdings Plc, 5,500 %, fällig 15.10.2024	661	1,23
GBP 320	Pinewood Finance Co Ltd, 3,250 %, fällig 30.09.2025	363	0,68
GBP 950	Pinnacle Bidco Plc, 6,375 %, fällig 15.02.2025	982	1,83
GBP 680	Saga Plc, 3,375 %, fällig 12.05.2024	622	1,16
GBP 260	TalkTalk Telecom Group Plc, 3,875 %, fällig 20.02.2025	293	0,55
GBP 236	Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, fällig 13.07.2044	348	0,65
GBP 1.400	Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250 %, fällig 15.05.2029	1.681	3,14
500	Viridian Group FinanceCo Plc / Viridian Power & Energy Holdings DAC, 4,000 %, fällig 15.09.2025	504	0,94
		10.803	20,18
USA — 11,56 % (29. Februar 2020: 15,80 %)			
440	Ashland Services BV, 2,000 %, fällig 30.01.2028	431	0,80
1.170	Bausch Health Cos Inc, 4,500 %, fällig 15.05.2023	1.170	2,19
620	Belden Inc, 4,125 %, fällig 15.10.2026	634	1,18
240	Carnival Corp, 10,125 %, fällig 01.02.2026	243	0,46
300	International Game Technology Plc, 3,500 %, fällig 15.07.2024	305	0,57
450	International Game Technology Plc, 2,375 %, fällig 15.04.2028	415	0,78
720	James Hardie International Finance DAC, 3,625 %, fällig 01.10.2026	739	1,38
540	Kronos International Inc, 3,750 %, fällig 15.09.2025	533	1,00
GBP 190	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 2,550 %, fällig 05.12.2023	213	0,40
520	Netflix Inc, 3,625 %, fällig 15.06.2030	574	1,07
250	OI European Group BV, 2,875 %, fällig 15.02.2025	253	0,47
660	Primo Water Corp, 5,500 %, fällig 01.07.2024	677	1,26
		6.187	11,56
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 49.630 EUR)		48.980	91,50
Schuldverschreibungen — 2,31 % (29. Februar 2020: 6,05 %)			
200	Financiere Cep SASU, 0,000 %, fällig 03.06.2027 *	200	0,37
270	Froneri Lux FinCo SARL, 2,625 %, fällig 30.01.2027 *	263	0,49
160	Ortho Clinical Diagnostics S.A., 3,500 %, fällig 17.01.2027 *	153	0,29
627	Verisure Holding AB, 3,000 %, fällig 21.10.2022 *	622	1,16
Schuldverschreibungen insgesamt (Kosten 1.248 EUR)		1.238	2,31
Kollektive Kapitalanlagen — 0,63 % (29. Februar 2020: 0,77 %)			
USD 400	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	336	0,63
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 363 EUR)		336 a	0,63
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 51.241 EUR)		50.554	94,44
Devisenterminkontrakte — 0,02 % (29. Februar 2020: 0,64 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		7	0,02
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		50.561	94,46
Devisenterminkontrakte — (0,17 %) (29. Februar 2020: (0,21 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(90)	(0,17)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(90)	(0,17)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		50.471	94,29
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		3.059	5,71
Gesamtnettovermögen		53.530 €	100,00

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1,000 EUR, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0.01 %.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

† Illiquide.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

GBP – Britisches Pfund Sterling

USD – US-Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	90,94
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	2,30
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,62
Finanzderivate	0,01
Sonstige Vermögenswerte	6,13
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	179	Verkauf	EUR	198	€	2
19.11.2020	BNP Paribas	Kauf	EUR	257	Verkauf	GBP	231		(2)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	EUR	507	Verkauf	GBP	456		(3)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	EUR	149	Verkauf	USD	176		2
19.11.2020	Royal Bank of Canada	Kauf	EUR	3.164	Verkauf	GBP	2.854		(29)
19.11.2020	Societe Generale	Kauf	EUR	137	Verkauf	GBP	124		(2)
19.11.2020	UBS	Kauf	EUR	6.208	Verkauf	GBP	5.598		(54)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 365 EUR)								€	7
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (117) EUR)									(90)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): 248 EUR)								€	(83)

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 1,59 % (29. Februar 2020: 1,67 %)			
72	Argent Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2004-W8, Series 2004 W8, Klasse A2, 1,135 %, fällig 25.05.2034 *	72	–
10.398	Community Funding CLO 2015-1A, Series 2015 1A, Klasse A, 144A, 5,750 %, fällig 01.11.2027 †	11.091	0,16
5.657	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Klasse A1, 144A, 2,750 %, fällig 25.07.2057 *	5.843	0,08
14.410	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Klasse A2, 144A, 3,065 %, fällig 25.07.2057 *	14.448	0,20
6.392	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I, Series 2006 I, Klasse 2A, 0,302 %, fällig 15.01.2037 *	6.095	0,09
8.000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Series 2018 4, Klasse A, 4,060 %, fällig 15.11.2030	9.064	0,13
10.484	Hertz Vehicle Financing II LP, Series 2016 2A, Klasse C, 144A, 4,990 %, fällig 25.03.2022	10.301	0,15
11.260	Hertz Vehicle Financing II LP, Series 2017 1A, Klasse C, 144A, 5,270 %, fällig 25.10.2021	11.114	0,16
12.579	Hertz Vehicle Financing II LP, Series 2018 1A, Klasse A, 144A, 3,290 %, fällig 25.02.2024	12.604	0,18
4.716	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-HE1, Series 2005 HE1, Klasse M1, 0,850 %, fällig 25.12.2034 *	4.548	0,06
5.561	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS, Series 2018 2GS, Klasse A, 144A, 4,200 %, fällig 22.02.2044	5.900	0,08
19.701	Sonic Capital LLC, Series 2020 1A, Klasse A2I, 144A, 3,845 %, fällig 20.01.2050	21.073	0,30
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 108.543 USD)		112.153	1,59
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 1,76 % (29. Februar 2020: 2,06 %)			
18.790	BBCCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Klasse D, 144A, 4,715 %, fällig 10.08.2033 *	17.857	0,25
15.478	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Klasse 1M1, 144A, 0,975 %, fällig 25.01.2040 *	15.451	0,22
10.270	CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C3, Klasse D, 3,494 %, fällig 15.08.2048 *	7.074	0,10
7.000	CSAIL 2016-C7 Commercial Mortgage Trust, Series 2016 C7, Klasse D, 144A, 4,533 %, fällig 15.11.2049 *	4.124	0,06
7.255	CSMC Series 2015-12R, Series 2015 12R, Klasse 2A1, 144A, 0,676 %, fällig 30.11.2037 *	7.226	0,10
42.390	CSMC Trust 2018-J1, Series 2018 J1, Klasse B2, 144A, 3,653 %, fällig 25.02.2048 *	39.082	0,55
72	Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500 %, fällig 01.12.2047	78	–
1.062	Flagstar Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Klasse A4, 144A, 3,500 %, fällig 25.04.2048 *	1.081	0,02
775	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2015 DNA1, Klasse M2, 2,025 %, fällig 25.10.2027 *	775	0,01
17.480	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Klasse C, 144A, 3,912 %, fällig 15.09.2031 *	16.846	0,24
4.700	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2014-FL6, Series 2014 FL6, Klasse D, 144A, 4,412 %, fällig 15.11.2031 *	4.126	0,06
3.097	MortgageIT Trust 2005-3, Series 2005 3, Klasse A1, 0,775 %, fällig 25.08.2035 *	3.030	0,04
6.771	New Residential Mortgage Loan Trust 2017-4, Series 2017 4A, Klasse A1, 144A, 4,000 %, fällig 25.05.2057 *	7.392	0,11
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 128.056 USD)		124.142	1,76
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 40,39 % (29. Februar 2020: 30,28 %)			
Australien — 0,25 % (29. Februar 2020: 0,14 %)			
9.520	BHP Billiton Finance USA Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 19.10.2075 *	11.392	0,16
210	Glencore Funding LLC, 144A, 4,125 %, fällig 12.03.2024	229	–
5.640	Glencore Funding LLC, 144A, 3,875 %, fällig 27.10.2027	6.171	0,09
		17.792	0,25
Belgien — 0,60 % (29. Februar 2020: 0,54 %)			
4.690	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	5.469	0,08
17.840	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, fällig 23.01.2049	24.045	0,34
7.800	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01.06.2050	9.462	0,13
2.570	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,800 %, fällig 23.01.2059	3.682	0,05
		42.658	0,60
Brasilien — 0,84 % (29. Februar 2020: 0,88 %)			
11.200	Petrobras Global Finance BV, 7,375 %, fällig 17.01.2027	13.291	0,19
27.820	Petrobras Global Finance BV, 5,999 %, fällig 27.01.2028	30.901	0,44
13.890	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05.06.2115	15.300	0,21
		59.492	0,84
Kanada — 0,15 % (29. Februar 2020: 0,15 %)			
3.060	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2024	3.121	0,04
1.770	Cott Holdings Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.04.2025	1.832	0,03
5.220	Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig 15.12.2027	5.679	0,08
		10.632	0,15
China — 0,15 % (29. Februar 2020: 0,13 %)			
8.930	Prosus NV, 144A, 4,850 %, fällig 06.07.2027	10.342	0,15
Kolumbien — 0,31 % (29. Februar 2020: 0,30 %)			
9.010	Ecopetrol SA, 5,375 %, fällig 26.06.2026	10.024	0,14
10.720	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	12.185	0,17
		22.209	0,31
Dänemark — 0,43 % (29. Februar 2020: 0,38 %)			
1.170	Danske Bank A/S, 144A, 5,000 %, fällig 12.01.2022	1.234	0,02
4.760	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig 12.01.2024	5.394	0,08
EUR 18.920	Danske Bank A/S, 5,875 %, Perpetual *	23.450	0,33
		30.078	0,43
Frankreich — 1,15 % (29. Februar 2020: 1,63 %)			
10.943	Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, fällig 01.05.2026	11.629	0,16
3.600	BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, fällig 10.01.2025 *	4.027	0,06
5.390	BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, fällig 10.01.2030 *	6.703	0,09
520	BNP Paribas SA, 144A, 7,625 %, Perpetual *	535	0,01
EUR 10.859	BNP Paribas SA, 6,125 %, Perpetual *	13.677	0,19
400	BNP Paribas SA, 144A, 7,000 %, Perpetual *	458	0,01
9.600	BNP Paribas SA, 144A, 7,375 %, Perpetual *	10.945	0,15
11.610	Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetual *	13.809	0,20
EUR 15.857	Credit Agricole SA, 6,500 %, Perpetual *	19.523	0,28
		81.306	1,15
Indien — 0,37 % (29. Februar 2020: 0,38 %)			
INR 500.000	NTPC Ltd, Series 53, 9,170 %, fällig 22.09.2024	7.682	0,11
INR 500.000	Power Finance Corp Ltd, Series 130C, 8,390 %, fällig 19.04.2025	7.294	0,11
INR 250.000	Power Grid Corp of India Ltd, Series C, 8,200 %, fällig 23.01.2025	3.704	0,05
INR 500.000	REC Ltd, Series 133, 8,300 %, fällig 10.04.2025	7.249	0,10
		25.929	0,37
Irland — 0,02 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1.360	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,500 %, fällig 15.05.2021	1.383	0,02
Israel — 1,34 % (29. Februar 2020: 0,94 %)			
710	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, Series 2, 3,650 %, fällig 10.11.2021	714	0,01
9.512	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, fällig 18.12.2022	9.248	0,13
1.185	Teva Pharmaceutical Finance IV BV, 3,650 %, fällig 10.11.2021	1.191	0,02
4.320	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,200 %, fällig 21.07.2021	4.321	0,06
5.853	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21.07.2023	5.630	0,08
22.413	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 144A, 7,125 %, fällig 31.01.2025	24.300	0,34
2.385	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	2.190	0,03
2.390	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,750 %, fällig 01.03.2028	2.609	0,04
51.712	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, fällig 01.10.2046	44.382	0,63
		94.585	1,34
Italien — 2,47 % (29. Februar 2020: 1,94 %)			
8.930	Enel Finance International NV, 144A, 6,000 %, fällig 07.10.2039	11.978	0,17
2.675	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, fällig 26.06.2024	2.886	0,04
1.690	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig 15.01.2026	1.880	0,03
EUR 25.679	Intesa Sanpaolo SpA, 7,000 %, Perpetual *	31.214	0,44
EUR 11.610	Intesa Sanpaolo SpA, 5,875 %, Perpetual *	13.892	0,20
2.210	Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303 %, fällig 30.05.2024	2.443	0,03
8.490	UniCredit SpA, 144A, 6,572 %, fällig 14.01.2022	9.028	0,13
41.520	UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, fällig 02.04.2034 *	48.571	0,69

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Italien - (Fortsetzung)			
6.910	UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, fällig 30.06.2035 *	7.169	0,10
EUR 36.550	UniCredit SpA, 6,625 %, Perpetual *	44.921	0,64
		173.982	2,47
Luxemburg — 0,21 % (29. Februar 2020: 0,19 %)			
8.580	ArcelorMittal SA, 3,600 %, fällig 16.07.2024	9.016	0,13
3.285	ArcelorMittal SA, 6,125 %, fällig 01.06.2025	3.797	0,05
1.550	ArcelorMittal SA, 7,250 %, fällig 15.10.2039	1.994	0,03
		14.807	0,21
Macau — 0,14 % (29. Februar 2020: 0,11 %)			
2.980	Sands China Ltd, 4,600 %, fällig 08.08.2023	3.196	0,05
4.380	Sands China Ltd, 5,125 %, fällig 08.08.2025	4.864	0,07
1.640	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26.08.2028	1.652	0,02
		9.712	0,14
Malaysia — 0,26 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
18.750	Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig 19.08.2050	18.403	0,26
Mexiko — 0,37 % (29. Februar 2020: 0,38 %)			
3.900	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 6,875 %, Perpetual *	3.946	0,06
8.900	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625 %, Perpetual *	9.078	0,13
15.780	Petroleos Mexicanos, 6,375 %, fällig 23.01.2045	12.989	0,18
		26.013	0,37
Niederlande — 1,05 % (29. Februar 2020: 1,13 %)			
EUR 20.400	ABN AMRO Bank NV, 5,750 %, Perpetual *	24.427	0,35
EUR 33.200	Cooperatieve Rabobank UA, 6,625 %, Perpetual *	41.248	0,58
1.300	Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030	1.433	0,02
6.580	Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	7.120	0,10
		74.228	1,05
Südafrika — 0,09 % (29. Februar 2020: 0,08 %)			
1.400	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,000 %, fällig 11.09.2027	1.544	0,02
3.950	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2028	4.492	0,07
		6.036	0,09
Spanien — 0,90 % (29. Februar 2020: 0,80 %)			
EUR 32.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 8,875 %, Perpetual *	39.819	0,56
EUR 19.800	Banco Santander SA, 6,250 %, Perpetual *	23.599	0,34
		63.418	0,90
Supranational — 0,18 % (29. Februar 2020: 0,17 %)			
IDR 175.900.000	International Bank for Reconstruction & Development, 8,400 %, fällig 12.10.2021	12.499	0,18
Schweiz — 1,28 % (29. Februar 2020: 0,89 %)			
2.970	Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	3.469	0,05
23.330	Credit Suisse Group AG, 144A, 5,250 %, Perpetual *	23.826	0,34
8.680	Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, Perpetual *	9.368	0,13
200	Credit Suisse Group AG, 144A, 6,375 %, Perpetual *	218	–
770	Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, Perpetual *	849	0,01
2.520	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd, 4,875 %, fällig 15.05.2045	3.441	0,05
15.800	UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	17.134	0,24
11.160	UBS Group AG, 6,875 %, Perpetual *	12.397	0,18
EUR 9.400	UBS Group AG, 5,750 %, Perpetual *	11.785	0,17
7.050	UBS Group AG, 7,000 %, Perpetual *	8.007	0,11
		90.494	1,28
Vereinigte Arabische Emirate — 0,40 % (29. Februar 2020: 0,01 %)			
770	DAE Funding LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.11.2023	769	0,01
24.000	MDGH – GMTN BV, 3,950 %, fällig 21.05.2050	27.719	0,39
		28.488	0,40
Großbritannien — 3,05 % (29. Februar 2020: 2,76 %)			
2.410	Barclays Bank Plc, 7,625 %, fällig 21.11.2022	2.681	0,04
9.340	Barclays Plc, 4,972 %, fällig 16.05.2029 *	11.127	0,16
340	Barclays Plc, 5,088 %, fällig 20.06.2030 *	395	0,01
14.720	Barclays Plc, 8,000 %, Perpetual *	16.110	0,23
9.260	Barclays Plc, 7,750 %, Perpetual *	9.811	0,14
EUR 19.300	Barclays Plc, 8,000 %, Perpetual *	23.525	0,33
13.360	BAT Capital Corp, 3,557 %, fällig 15.08.2027	14.642	0,21
10.340	BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig 15.08.2047	11.265	0,16
10.750	HSBC Holdings Plc, 4,583 %, fällig 19.06.2029 *	12.569	0,18
19.788	HSBC Holdings Plc, 6,500 %, Perpetual *	21.338	0,30
3.280	Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, Perpetual *	3.558	0,05
2.942	Natwest Group Plc, 6,125 %, fällig 15.12.2022	3.230	0,05
3.280	Natwest Group Plc, 6,100 %, fällig 10.06.2023	3.649	0,05
6.410	Natwest Group Plc, 6,000 %, fällig 19.12.2023	7.234	0,10
57.370	Natwest Group Plc, 5,125 %, fällig 28.05.2024	63.606	0,90
6.970	Natwest Group Plc, 8,625 %, Perpetual *	7.342	0,10
900	Reynolds American Inc, 6,150 %, fällig 15.09.2043	1.135	0,02
1.530	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	1.657	0,02
		214.874	3,05
USA — 24,29 % (29. Februar 2020: 16,27 %)			
2.150	3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050	2.620	0,04
6.550	AbbVie Inc, 144A, 2,950 %, fällig 21.11.2026	7.212	0,10
14.790	AbbVie Inc, 144A, 4,050 %, fällig 21.11.2039	17.337	0,25
2.320	Altria Group Inc, 4,400 %, fällig 14.02.2026	2.691	0,04
8.030	Altria Group Inc, 4,800 %, fällig 14.02.2029	9.607	0,14
8.244	Altria Group Inc, 6,200 %, fällig 14.02.2059	11.312	0,16
2.540	Amazon.com Inc, 4,950 %, fällig 05.12.2044	3.654	0,05
40.420	Amazon.com Inc, 4,050 %, fällig 22.08.2047	52.628	0,75
45.097	Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057	61.522	0,87
77.830	Amazon.com Inc, 2,700 %, fällig 03.06.2060	80.655	1,14
4.990	American International Group Inc, 3,400 %, fällig 30.06.2030	5.542	0,08
20.816	Apache Corp, 5,100 %, fällig 01.09.2040	20.231	0,29
5.810	Apache Corp, 4,750 %, fällig 15.04.2043	5.476	0,08
13.050	Apache Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2044	11.647	0,17
5.990	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.02.2025	6.254	0,09
3.250	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	3.384	0,05
25.580	BAC Capital Trust XIV, Series G, 4,000 %, Perpetual *	24.612	0,35
3.270	Bank of America Corp, 2,592 %, fällig 29.04.2031 *	3.491	0,05
550	Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	691	0,01
29.340	Bank of America Corp, Series FF, 5,875 %, Perpetual *	32.280	0,46
31.390	Bank of America Corp, Series AA, 6,100 %, Perpetual *	35.243	0,50
20.180	Bank of America Corp, Series X, 6,250 %, Perpetual *	22.132	0,31
1.504	Bausch Health Americas Inc, 144A, 8,500 %, fällig 31.01.2027	1.657	0,02
31.490	Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.03.2024	32.718	0,46
2.600	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.11.2025	2.686	0,04
1.416	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,250 %, fällig 30.01.2030	1.409	0,02
5.715	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15.11.2022	5.699	0,08
210	Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030	236	–
9.590	Boeing Co/The, 3,250 %, fällig 01.02.2035	9.015	0,13
780	Boeing Co/The, 3,550 %, fällig 01.03.2038	707	0,01
600	Boeing Co/The, 3,750 %, fällig 01.02.2050	540	0,01
10.000	Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01.05.2050	12.025	0,17
3.000	Boeing Co/The, 3,950 %, fällig 01.08.2059	2.785	0,04
4.000	Boeing Co/The, 5,930 %, fällig 01.05.2060	4.913	0,07
4.540	California Institute of Technology, 3,650 %, fällig 01.09.2119	5.073	0,07
8.870	Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig 15.01.2035	10.024	0,14
5.230	Cameron LNG LLC, 144A, 3,701 %, fällig 15.01.2039	5.877	0,08
1.280	Carrier Global Corp, 144A, 2,700 %, fällig 15.02.2031	1.345	0,02
2.700	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01.05.2025	2.783	0,04
1.670	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,000 %, fällig 01.02.2028	1.768	0,03
600	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 15.08.2030	638	0,01
1.500	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.05.2032	1.592	0,02
1.070	Centene Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2022	1.079	0,02
680	Centene Corp, 4,750 %, fällig 15.01.2025	700	0,01
1.490	Centene Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01.06.2026	1.574	0,02

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
13.380	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	15.341	0,22
5.740	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	7.012	0,10
1.540	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	1.766	0,03
10.730	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,834 %, fällig 23.10.2055	14.817	0,21
1.780	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 5,125 %, fällig 30.06.2027	2.006	0,03
1.000	Chevron Corp, 3,078 %, fällig 11.05.2050	1.089	0,02
2.650	Cimarex Energy Co, 3,900 %, fällig 15.05.2027	2.733	0,04
6.095	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	10.768	0,15
4.834	Citigroup Inc, 5,300 %, fällig 06.05.2044	6.519	0,09
990	Citigroup Inc, 4,750 %, fällig 18.05.2046	1.270	0,02
2.600	Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 23.07.2048	3.506	0,05
51.985	Citigroup Inc, Series P, 5,950 %, Perpetual *	56.157	0,80
650	Coca-Cola Co/The, 4,200 %, fällig 25.03.2050	862	0,01
30	Coca-Cola Co/The, 2,600 %, fällig 01.06.2050	31	–
1.660	Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	1.918	0,03
320	Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	380	0,01
370	Comcast Corp, 3,400 %, fällig 15.07.2046	412	0,01
560	Comcast Corp, 4,700 %, fällig 15.10.2048	754	0,01
1.750	Comcast Corp, 3,450 %, fällig 01.02.2050	1.977	0,03
8.789	CommonSpirit Health, 4,350 %, fällig 01.11.2042	9.724	0,14
2.890	CommonSpirit Health, 3,817 %, fällig 01.10.2049	3.259	0,05
1.530	CommScope Technologies LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.03.2027	1.523	0,02
6.107	Concho Resources Inc, 4,850 %, fällig 15.08.2048	7.080	0,10
370	Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15.01.2028	353	–
8.260	Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, fällig 01.06.2044	7.334	0,10
5.110	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	5.758	0,08
1.400	CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	1.722	0,02
3.870	CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	4.509	0,06
33.380	CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	43.599	0,62
160	CVS Health Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2050	192	–
4.342	DCP Midstream LP, Series A, 7,375 %, Perpetual *	3.195	0,05
2.405	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03.11.2036	2.415	0,03
5.990	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2037	6.016	0,09
1.120	Delta Air Lines Inc, 2,600 %, fällig 04.12.2020	1.120	0,02
6.150	Delta Air Lines Inc, 3,400 %, fällig 19.04.2021	6.165	0,09
6.530	Delta Air Lines Inc, 3,625 %, fällig 15.03.2022	6.494	0,09
2.940	Delta Air Lines Inc, 3,800 %, fällig 19.04.2023	2.826	0,04
3.486	Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig 28.10.2024	3.203	0,05
7.440	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	8.155	0,12
5.030	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	5.241	0,07
8.660	Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	9.943	0,14
180	Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	191	–
160	Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2042	155	–
2.370	Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	2.377	0,03
2.100	Diamondback Energy Inc, 3,250 %, fällig 01.12.2026	2.158	0,03
3.720	Dignity Health, 5,267 %, fällig 01.11.2064	4.669	0,07
5.650	DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	5.980	0,08
190	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	218	–
3.850	Energy Transfer Operating LP, 5,000 %, fällig 15.05.2050	3.690	0,05
6.590	Energy Transfer Operating LP, Series F, 6,750 %, Perpetual *	5.486	0,08
6.120	Energy Transfer Operating LP, Series G, 7,125 %, Perpetual *	5.350	0,08
2.568	Enterprise Products Operating LLC, 6,125 %, fällig 15.10.2039	3.347	0,05
4.131	Enterprise Products Operating LLC, 6,450 %, fällig 01.09.2040	5.548	0,08
1.566	Enterprise Products Operating LLC, 5,950 %, fällig 01.02.2041	2.007	0,03
2.330	Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, fällig 15.02.2045	2.803	0,04
2.995	Enterprise Products Operating LLC, 4,250 %, fällig 15.02.2048	3.271	0,05
4.680	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	4.274	0,06
420	EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	504	0,01
1.320	EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	1.695	0,02
5.690	Exxon Mobil Corp, 4,327 %, fällig 19.03.2050	7.322	0,10
2.920	Exxon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15.04.2051	3.287	0,05
28.515	FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, fällig 15.11.2031	40.421	0,57
2.950	FirstEnergy Corp, Series C, 4,850 %, fällig 15.07.2047	3.608	0,05
200	Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, fällig 16.06.2025	210	–
1.550	Ford Motor Credit Co LLC, 4,125 %, fällig 17.08.2027	1.549	0,02
3.700	Fox Corp, 5,476 %, fällig 25.01.2039	4.913	0,07
70	Freeport-McMoRan Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2023	73	–
250	Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, fällig 14.11.2024	270	–
1.120	Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig 01.08.2030	1.199	0,02
540	Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, fällig 14.11.2034	610	0,01
3.910	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	4.398	0,06
5.370	GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418 %, fällig 15.11.2035	5.554	0,08
180	General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2040	228	–
840	General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2050	1.100	0,02
590	General Electric Co, 3,450 %, fällig 01.05.2027	624	0,01
1.220	General Electric Co, 3,625 %, fällig 01.05.2030	1.260	0,02
5.483	General Electric Co, 5,875 %, fällig 14.01.2038	6.339	0,09
11.060	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10.01.2039	14.111	0,20
1.270	General Electric Co, 4,250 %, fällig 01.05.2040	1.285	0,02
6.630	General Electric Co, 4,350 %, fällig 01.05.2050	6.742	0,10
915	Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, Perpetual *	842	0,01
655	Goldman Sachs Capital III, Series APEX, 4,000 %, Perpetual *	597	0,01
12.340	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, fällig 01.10.2037	18.027	0,26
16.590	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	22.140	0,31
16.180	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig 21.10.2045	21.627	0,31
5.990	Hackensack Meridian Health Inc, 4,211 %, fällig 01.07.2048	7.527	0,11
610	HCA Inc, 5,375 %, fällig 01.02.2025	688	0,01
2.370	HCA Inc, 7,690 %, fällig 15.06.2025	2.853	0,04
380	HCA Inc, 5,625 %, fällig 01.09.2028	453	0,01
1.110	HCA Inc, 5,875 %, fällig 01.02.2029	1.350	0,02
1.610	HCA Inc, 3,500 %, fällig 01.09.2030	1.697	0,02
5.130	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.04.2027	5.270	0,07
280	Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	321	–
550	Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	631	0,01
6.290	ILFC E-Capital Trust I, 144A, 3,020 %, fällig 21.12.2065 *	3.219	0,05
530	Intel Corp, 4,600 %, fällig 25.03.2040	707	0,01
6.990	Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	9.716	0,14
2.480	Intel Corp, 4,950 %, fällig 25.03.2060	3.588	0,05
3.140	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	3.372	0,05
7.480	JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, fällig 13.05.2031 *	8.059	0,11
4.320	JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	4.722	0,07
1.265	Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,950 %, fällig 15.01.2038	1.687	0,02
6.189	Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,500 %, fällig 01.09.2039	7.938	0,11
5.130	Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,550 %, fällig 15.09.2040	6.393	0,09
5.250	Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,375 %, fällig 01.03.2041	6.618	0,09
6.450	Kinder Morgan Inc, 5,300 %, fällig 01.12.2034	7.746	0,11
451	Kraft Heinz Foods Co, 3,950 %, fällig 15.07.2025	490	0,01
170	Kraft Heinz Foods Co, 6,750 %, fällig 15.03.2032	226	–
480	Kraft Heinz Foods Co, 6,875 %, fällig 26.01.2039	655	0,01
120	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 7,125 %, fällig 01.08.2039	166	–
120	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 4,625 %, fällig 01.10.2039	128	–

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
60	Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig 04.06.2042	67	–
1.750	Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, fällig 01.06.2046	1.798	0,03
1.930	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 4,875 %, fällig 01.10.2049	2.132	0,03
1.550	Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,875 %, fällig 01.11.2026	1.625	0,02
8.050	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	8.158	0,12
610	Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25.06.2025	607	0,01
1.740	Levi Strauss & Co, 5,000 %, fällig 01.05.2025	1.785	0,03
1.190	Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig 15.04.2030	1.479	0,02
590	Lowe's Cos Inc, 5,000 %, fällig 15.04.2040	783	0,01
1.970	Lowe's Cos Inc, 5,125 %, fällig 15.04.2050	2.740	0,04
7.940	Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	10.026	0,14
4.050	McDonald's Corp, 4,450 %, fällig 01.03.2047	5.058	0,07
3.370	McDonald's Corp, 4,450 %, fällig 01.09.2048	4.230	0,06
340	McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	385	0,01
1.090	McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	1.335	0,02
940	MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	1.092	0,02
3.140	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	3.273	0,05
910	Morgan Stanley, 5,597 %, fällig 24.03.2051 *	1.408	0,02
3.930	MPLX LP, 4,800 %, fällig 15.02.2029	4.561	0,06
7.720	MPLX LP, 5,200 %, fällig 01.03.2047	8.795	0,12
4.580	MPLX LP, 4,700 %, fällig 15.04.2048	4.948	0,07
8.730	MPLX LP, 5,500 %, fällig 15.02.2049	10.381	0,15
710	NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	820	0,01
2.000	Noble Energy Inc, 3,850 %, fällig 15.01.2028	2.272	0,03
10.130	Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01.05.2050	14.618	0,21
1.060	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	1.226	0,02
5.070	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	5.768	0,08
1.890	NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	2.223	0,03
6.040	Occidental Petroleum Corp, 6,950 %, fällig 01.07.2024	6.267	0,09
1.940	Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, fällig 15.03.2026	1.914	0,03
13.300	Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, fällig 01.09.2030	13.796	0,20
67.423	Occidental Petroleum Corp, Null-Coupon, fällig 10.10.2036	29.666	0,42
5.320	Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, fällig 15.03.2040	5.067	0,07
4.135	Occidental Petroleum Corp, 4,500 %, fällig 15.07.2044	3.285	0,05
16.120	Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, fällig 15.06.2045	12.775	0,18
7.820	Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig 15.03.2046	7.782	0,11
6.460	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.04.2046	5.171	0,07
1.400	Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, fällig 15.02.2047	1.053	0,01
3.140	Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig 15.03.2048	2.382	0,03
2.860	Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01.02.2031	2.754	0,04
890	Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.08.2040	834	0,01
3.190	Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01.08.2050	2.985	0,04
1.980	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.04.2026	2.192	0,03
1.420	Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, fällig 25.03.2030	1.643	0,02
1.170	Procter & Gamble Co/The, 3,550 %, fällig 25.03.2040	1.436	0,02
6.030	Procter & Gamble Co/The, 3,600 %, fällig 25.03.2050	7.677	0,11
2.325	PulteGroup Inc, 6,375 %, fällig 15.05.2033	2.930	0,04
835	Range Resources Corp, 5,875 %, fällig 01.07.2022	848	0,01
2.420	Range Resources Corp, 5,000 %, fällig 15.03.2023	2.415	0,03
4.760	Range Resources Corp, 4,875 %, fällig 15.05.2025	4.453	0,06
6.910	Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2040	7.152	0,10
2.740	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	4.141	0,06
2.220	Sprint Communications Inc, 11,500 %, fällig 15.11.2021	2.473	0,04
210	Sprint Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2023	245	–
310	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,375 %, fällig 01.02.2027	321	–
3.810	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2030	4.022	0,06
1.440	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01.02.2031	1.460	0,02
670	Taylor Morrison Communities Inc, 144A, 5,875 %, fällig 31.01.2025	683	0,01
1.730	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,900 %, fällig 15.09.2044	2.190	0,03
11.910	The Vanguard Group Inc, 3,050 %, fällig 22.08.2050 †∞	11.353	0,16
1.300	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	1.863	0,03
100	T-Mobile USA Inc, 6,000 %, fällig 01.03.2023	100	–
70	T-Mobile USA Inc, 6,000 %, fällig 15.04.2024	71	–
2.940	T-Mobile USA Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.04.2030	3.374	0,05
3.630	T-Mobile USA Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2050	4.440	0,06
10.190	Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, Null-Coupon, fällig 15.02.2024	9.161	0,13
2.100	Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, Null-Coupon, fällig 15.02.2038	877	0,01
5.580	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01.02.2026	7.304	0,10
1.090	TransDigm Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.12.2025	1.186	0,02
1.710	TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	1.807	0,03
920	United Rentals North America Inc, 5,875 %, fällig 15.09.2026	980	0,01
1.750	United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2027	1.827	0,03
3.340	United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15.01.2030	3.716	0,05
320	United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.02.2031	332	–
530	Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22.03.2050	667	0,01
106.289	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual *	107.009	1,52
1.890	Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04.04.2031 *	2.308	0,03
7.400	Wells Fargo & Co, 4,650 %, fällig 04.11.2044	9.042	0,13
5.420	Wells Fargo & Co, 4,400 %, fällig 14.06.2046	6.502	0,09
2.930	Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig 07.12.2046	3.716	0,05
36.230	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	49.630	0,70
3.926	Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Perpetual *	4.335	0,06
3.490	Wesleyan University, 4,781 %, fällig 01.07.2116	4.435	0,06
1.460	Western Midstream Operating LP, 4,100 %, fällig 01.02.2025	1.458	0,02
4.630	Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig 01.06.2025	4.640	0,07
765	Western Midstream Operating LP, 4,650 %, fällig 01.07.2026	784	0,01
5.100	Western Midstream Operating LP, 4,500 %, fällig 01.03.2028	5.138	0,07
5.040	Western Midstream Operating LP, 4,750 %, fällig 15.08.2028	5.090	0,07
9.610	Western Midstream Operating LP, 5,050 %, fällig 01.02.2030	9.851	0,14
8.751	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig 01.04.2044	8.114	0,11
2.620	Western Midstream Operating LP, 5,300 %, fällig 01.03.2048	2.352	0,03
7.650	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15.08.2048	6.885	0,10
7.630	Williams Cos Inc/The, 3,750 %, fällig 15.06.2027	8.435	0,12
7.350	Williams Cos Inc/The, Series A, 7,500 %, fällig 15.01.2031	9.694	0,14
9.840	Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15.03.2032	14.216	0,20
3.600	Williams Cos Inc/The, 6,300 %, fällig 15.04.2040	4.548	0,06
8.940	Williams Cos Inc/The, 5,750 %, fällig 24.06.2044	10.780	0,15
665	Williams Cos Inc/The, 5,100 %, fällig 15.09.2045	780	0,01
3.980	Willis-Knighton Medical Center, Series 2018, 4,813 %, fällig 01.09.2048	4.984	0,07
6.980	WPX Energy Inc, 8,250 %, fällig 01.08.2023	7.870	0,11
2.670	WPX Energy Inc, 5,250 %, fällig 15.10.2027	2.660	0,04
2.570	WPX Energy Inc, 4,500 %, fällig 15.01.2030	2.459	0,03
8.433	XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig 01.05.2034	8.998	0,13
8.202	XPO Logistics Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.06.2022	8.245	0,12
		1 714 108	24,29
Sambia — 0,09 % (29. Februar 2020: 0,08 %)			
1.510	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 01.04.2023	1.537	0,02
5.000	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2025	5.106	0,07
		6.643	0,09
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 2.619.952 USD)		2 850 111	40,39
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 43,73 % (29. Februar 2020: 60,68 %)			
Australien — 1,22 % (29. Februar 2020: 0,52 %)			
AUD 93.740	Australie Government Bond, Series 150, 3,000 %, fällig 21.03.2047	86.337	1,22

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			
Brasilien — 2,08 % (29. Februar 2020: 4,29 %)			
BRL 305.118	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2023	62.710	0,89
BRL 144.130	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	30.806	0,44
8.530	Brazilian Government International Bond, 4,250 %, fällig 07.01.2025	9.213	0,13
41.800	Brazilian Government International Bond, 5,000 %, fällig 27.01.2045	43.881	0,62
		146.610	2,08
China — 1,35 % (29. Februar 2020: 0,37 %)			
CNY 54.500	China Government Bond, 3,380 %, fällig 21.11.2024	8.187	0,12
CNY 121.000	China Government Bond, 3,480 %, fällig 29.06.2027	18.497	0,26
CNY 11.000	China Government Bond, 3,600 %, fällig 27.06.2028	1.704	0,02
CNY 490.000	China Government Bond, Series INBK, 3,390 %, fällig 16.03.2050	67.214	0,95
		95.602	1,35
Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) — 0,19 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
13.040	Ivory Coast Government International Bond, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2033	13.191	0,19
Dominikanische Republik — 0,15 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
11.020	Dominican Republic International Bond, 144A, 5,875 %, fällig 30.01.2060	10.601	0,15
Ägypten — 0,27 % (29. Februar 2020: 1,25 %)			
EGP 22.000	Egypt Government Bond, Series 7YR, 18,400 %, fällig 30.05.2024	1.544	0,02
11.970	Egypt Government International Bond, 144A, 5,750 %, fällig 29.05.2024	12.361	0,18
4.900	Egypt Government International Bond, 144A, 7,625 %, fällig 29.05.2032	5.008	0,07
		18.913	0,27
Ghana — 0,15 % (29. Februar 2020: 0,03 %)			
2.180	Ghana Government International Bond, 144A, 7,875 %, fällig 26.03.2027	2.165	0,03
3.170	Ghana Government International Bond, 144A, 10,750 %, fällig 14.10.2030	3.919	0,06
4.700	Ghana Government International Bond, 144A, 8,950 %, fällig 26.03.2051	4.385	0,06
		10.469	0,15
Indien — 2,09 % (29. Februar 2020: 1,80 %)			
INR 300.000	Export-Import Bank of India, Series P-03, 9,300 %, fällig 11.05.2022	4.372	0,06
INR 1.510.000	India Government Bond, 8,120 %, fällig 10.12.2020	20.779	0,29
INR 1.100.000	India Government Bond, 7,800 %, fällig 11.04.2021	15.312	0,22
INR 1.580.000	India Government Bond, Series SPB, 8,130 %, fällig 21.09.2022	23.017	0,33
INR 500.000	India Government Bond, 7,160 %, fällig 20.05.2023	7.219	0,10
INR 1.200.000	India Government Bond, 8,830 %, fällig 25.11.2023	18.153	0,26
INR 900.000	India Government Bond, 6,180 %, fällig 04.11.2024	12.613	0,18
INR 1.480.000	India Government Bond, 8,150 %, fällig 24.11.2026	22.310	0,32
INR 300.000	India Government Bond, 7,170 %, fällig 08.01.2028	4.303	0,06
INR 1.300.000	India Government Bond, 7,590 %, fällig 20.03.2029	19.146	0,27
		147.224	2,09
Indonesien — 6,84 % (29. Februar 2020: 5,96 %)			
IDR 82.452.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR61, 7,000 %, fällig 15.05.2022	5.904	0,08
IDR 18.941.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR56, 8,375 %, fällig 15.09.2026	1.455	0,02
IDR 1.596.482.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	113.741	1,61
IDR 547.847.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029	42.842	0,61
IDR 1.579.922.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR78, 8,250 %, fällig 15.05.2029	118.973	1,69
IDR 1.057.630.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR82, 7,000 %, fällig 15.09.2030	73.426	1,04
IDR 1.311.792.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR68, 8,375 %, fällig 15.03.2034	98.106	1,39
IDR 276.928.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR72, 8,250 %, fällig 15.05.2036	20.511	0,29
IDR 39.561.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR79, 8,375 %, fällig 15.04.2039	2.934	0,04
IDR 69.231.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR76, 7,375 %, fällig 15.05.2048	4.741	0,07
		482.633	6,84
Italien — 2,08 % (29. Februar 2020: 0,75 %)			
EUR 88.120	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,850 %, fällig 01.09.2049	147.070	2,08
Japan — 0,00 % (29. Februar 2020: 3,57 %)			
JPY 1	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 21, 0,100 %, fällig 10.03.2026 β	–	–
Mexiko — 6,87 % (29. Februar 2020: 6,27 %)			
MXN 175.110	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	9.027	0,13
MXN 6.891.404	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	344.646	4,88
MXN 2.574.930	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	131.426	1,86
		485.099	6,87
Russland — 9,41 % (29. Februar 2020: 8,32 %)			
RUB 1.043.860	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6219, 7,750 %, fällig 16.09.2026	15.802	0,22
RUB 1.043.840	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6226, 7,950 %, fällig 07.10.2026	15.915	0,23
RUB 9.834.551	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6207, 8,150 %, fällig 03.02.2027	151.822	2,15
RUB 11.647.347	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028	169.775	2,41
RUB 2.639.720	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	38.115	0,54
RUB 1.357.010	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10.04.2030	20.519	0,29
RUB 514.670	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6221, 7,700 %, fällig 23.03.2033	7.849	0,11
RUB 4.862.880	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6225, 7,250 %, fällig 10.05.2034	71.599	1,02
RUB 11.060.250	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6230, 7,700 %, fällig 16.03.2039	172.311	2,44
		663.707	9,41
Südafrika — 1,27 % (29. Februar 2020: 1,30 %)			
ZAR 1.425.680	Republic of South Africa Government Bond, Series R209, 6,250 %, fällig 31.03.2036	55.727	0,79
35.340	Republic of South Africa Government International Bond, 4,300 %, fällig 12.10.2028	34.003	0,48
		89.730	1,27
Ukraine — 0,09 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
6.370	Ukraine Government International Bond, 144A, 7,375 %, fällig 25.09.2032	6.478	0,09
Vereinigte Arabische Emirate — 0,92 % (29. Februar 2020: 0,80 %)			
18.180	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 4,125 %, fällig 11.10.2047	23.059	0,33
38.620	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 3,125 %, fällig 30.09.2049	41.657	0,59
		64.716	0,92
USA — 8,75 % (29. Februar 2020: 25,03 %)			
4.240	City of Detroit MI, 4,000 %, fällig 01.04.2044	3.435	0,05
1.820	Morongo Band of Mission Indians/The, 144A, 7,000 %, fällig 01.10.2039	2.123	0,03
4.675	New Jersey Transportation Trust Fund Authority, 6,561 %, fällig 15.12.2040	6.061	0,09
1.880	New Jersey Transportation Trust Fund Authority, 4,131 %, fällig 15.06.2042	1.899	0,03
950	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 3,706 %, fällig 15.05.2120	1.098	0,02
16.530	State of Illinois, 5,100 %, fällig 01.06.2033	16.944	0,24
40.420	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, fällig 15.02.2046 ≠ β	59.368	0,84
17.898	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, fällig 15.02.2049 β	25.846	0,37
101.960	United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 31.08.2027	102.111	1,45
68.550	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.05.2030	68.181	0,97
7.650	United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, fällig 15.02.2036	11.575	0,16
29.440	United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 15.02.2043	39.789	0,56
10.710	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.11.2049	13.087	0,18
28.870	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	32.686	0,46
229.320	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15.05.2050 ≠	217.890	3,09
15.250	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	14.966	0,21
		617.059	8,75
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 3.191.515 USD)		3.085.439	43,73
Schuldverschreibungen — 1,59 % (29. Februar 2020: 1,69 %)			
5.512	1011778 BC ULC, 1,911 %, fällig 14.11.2026 *	5.317	0,08
1.461	Alterra Mountain Co, 2,911 %, fällig 31.07.2024 *	1.411	0,02
234	Aramark Services Inc, 1,911 %, fällig 11.03.2025 *	224	–
2.824	Asurion LLC, 3,161 %, fällig 03.11.2024 *	2.781	0,04
4.746	Berry Global Inc, 2,155 %, fällig 01.10.2022 *	4.693	0,07
1.562	Berry Global Inc, 2,155 %, fällig 19.01.2024 *	1.537	0,02

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
6.362	Caesars Resort Collection LLC, 2,911 %, fällig 22.12.2024 *	6.000	0,08
5.270	Change Healthcare Holdings LLC, 3,500 %, fällig 01.03.2024 *	5.187	0,07
6.225	Charter Communications Operating LLC, 1,920 %, fällig 30.04.2025 *	6.135	0,09
2.615	CityCenter Holdings LLC, 3,000 %, fällig 18.04.2024 *	2.483	0,03
4.250	Dell International LLC, 2,750 %, fällig 19.09.2025 *	4.226	0,06
1.458	Edelman Financial Center LLC/The, 3,172 %, fällig 19.07.2025 *	1.418	0,02
2.513	Entercom Media Corp, 2,673 %, fällig 17.11.2024 *	2.383	0,03
1.463	Golden Nugget LLC, 3,250 %, fällig 04.10.2023 *	1.315	0,02
2.163	Hilton Worldwide Finance LLC, 1,925 %, fällig 21.06.2026 *	2.087	0,03
7.538	Jaguar Holding Co II, 3,500 %, fällig 18.08.2022 *	7.530	0,11
1.649	Jane Street Group LLC, 3,161 %, fällig 07.01.2025 *	1.631	0,02
4.206	Level 3 Parent LLC, 1,911 %, fällig 01.03.2027 *	4.085	0,06
1.192	Michaels Stores Inc, 3,500 %, fällig 28.01.2023 *	1.147	0,02
4.829	MPH Acquisition Holdings LLC, 3,750 %, fällig 07.06.2023 *	4.790	0,07
1.356	Phoenix Guarantor Inc, 3,412 %, fällig 05.03.2026 *	1.335	0,02
6.460	Prime Security Services Borrower LLC, 3,405 %, fällig 23.09.2026 *	6.449	0,09
4.407	RegionalCare Hospital Partners Holding, 3,911 %, fällig 16.11.2025 *	4.329	0,06
1.807	Reynolds Consumer Products LLC, 1,911 %, fällig 04.02.2027 *	1.786	0,03
2.166	Reynolds Group Holdings Inc, 2,911 %, fällig 05.02.2023 *	2.142	0,03
6.785	Scientific Games International Inc, 3,612 %, fällig 14.08.2024 *	6.362	0,09
4.377	SFR Group SA, 4,438 %, fällig 06.01.2026 *	4.300	0,06
4.768	TKC Holdings Inc, 4,750 %, fällig 01.02.2023 *	4.495	0,06
2.380	Trans Union LLC, 1,911 %, fällig 13.11.2026 *	2.329	0,03
8.013	Univision Communications Inc, 4,750 %, fällig 24.03.2026 *	7.857	0,11
1.301	Valeant Pharmaceuticals International, 3,176 %, fällig 28.05.2025 *	1.281	0,02
440	VFH Parent LLC, 3,164 %, fällig 01.03.2026 *	437	0,01
1.550	Virgin Media Bristol LLC, 2,662 %, fällig 04.01.2028 *	1.513	0,02
1.175	VVC Holding Corp, 4,818 %, fällig 11.02.2026 *	1.169	0,02
Schuldverschreibungen insgesamt (Kosten 115.329 USD)		112.164	1,59
Kollektive Kapitalanlagen — 1,66 % (29. Februar 2020: 0,57 %)			
2.112	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse M	27.396	0,39
EUR 122	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Klasse Euro Acumulación	14.608	0,21
74.912	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (Distribución)	74.912	1,06
Gesamt Kollektive Kapitalanlagen (Kosten 115.947 USD)		116.916	1,66
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 6.279.342 USD)		6.400.925	90,72

Kontrakte (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Gekaufte Optionen — 0,33 % (29. Februar 2020: 0,40 %)			
–	Australien Dollar Currency Future Oktober 2020 Call 72,00, fällig 009.10.2020	289	–
1	Australien Dollar Currency Future September 2020 Call 71,50, fällig 04.09.2020	1.214	0,02
–	Australien Dollar Currency Future September 2020 Call 72,00, fällig 04.09.2020	894	0,01
–	Australien Dollar Currency Future September 2020 Call 72,50, fällig 04.09.2020	184	–
1	Canadian Dollar Currency Future September 2020 Call 75,00, fällig 04.09.2020	904	0,01
–	Euro Currency Future Oktober 2020 Call 1,18, fällig 009.10.2020	100	–
–	Euro Currency Future Oktober 2020 Put 1,18, fällig 009.10.2020	175	–
–	Euro Currency Future Oktober 2020 Put 1,19, fällig 009.10.2020	60	–
–	Euro Currency Future September 2020 Call 1,18, fällig 04.09.2020	474	0,01
–	Euro Currency Future September 2020 Call 1,18, fällig 04.09.2020	314	0,01
-	Euro Currency Future September 2020 Call 1,19, fällig 04.09.2020	165	-
–	Euro Currency Future September 2020 Put 1,18, fällig 04.09.2020	5	–
–	Euro Currency Future September 2020 Put 1,19, fällig 04.09.2020	45	–
1	U.S. 10 Year Oktober 2020 Put 140,00, fällig 25.09.2020	458	0,01
–	U.S. Bond Oktober 2020 Call 174,50, fällig 25.09.2020	149	–
–	U.S. Bond Oktober 2020 Call 175,00, fällig 25.09.2020	129	–
–	U.S. Bond Oktober 2020 Call 175,50, fällig 25.09.2020	442	0,01
–	U.S. Bond Oktober 2020 Call 177,00, fällig 25.09.2020	129	–
2	U.S. Bond Oktober 2020 Call 178,00, fällig 25.09.2020	1.016	0,01
72.300	USD Put/BRL Call 5,6515, fällig 23.11.2020	4.220	0,06
104.730	USD Put/INR Call 73,00, fällig 03.09.2020	81	–
65.740	USD Put/INR Call 74,65, fällig 27.10.2020	1.085	0,02
144.600	USD Put/INR Call 74,8450, fällig 23.11.2020	2.777	0,04
65.700	USD Put/MXN Call 21,9170, fällig 24.09.2020	815	0,01
38.140	USD Put/MXN Call 22,00, fällig 07.10.2020	661	0,01
38.140	USD Put/MXN Call 22,3670, fällig 002.10.2020	1.033	0,02
74.440	USD Put/MXN Call 22,57, fällig 11.11.2020	2.884	0,04
69.950	USD Put/RUB Call 73,00, fällig 19.11.2020	1.218	0,02
72.820	USD Put/RUB Call 73,00, fällig 13.11.2020	1.190	0,02
Summe gekaufte Optionen (Kosten 19.852 USD)		23.110	0,33
Kreditausfallversicherungen — 0,32 % (29. Februar 2020: 0,15 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		22.785	0,32

Kontrakte (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Zinsswaps —1,21 % (29. Februar 2020: 0,06 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		85.177	1,21
Devisenterminkontrakte — 1,61 % (29. Februar 2020: 1,24 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		113.230	1,61
Termingeschäfte — 1,09 % (29. Februar 2020: 3,79 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		77.088	1,09
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		6.722.315	95,28
Geschriebene Optionen — (0,88 %) (29. Februar 2020: (1,49 %))			
–	Australien Dollar Currency Future September 2020 Call 71,00, fällig 04.09.2020	(368)	(0,01)
–	Australien Dollar Currency Future September 2020 Put 70,00, fällig 04.09.2020	(1)	–
–	British Pound Currency Future September 2020 Call 131,00, fällig 04.09.2020	(275)	–
–	British Pound Currency Future September 2020 Call 132,50, fällig 04.09.2020	(139)	–
–	Canadian Dollar Currency Future Oktober 2020 Call 76,00, fällig 009.10.2020	(263)	–
–	Euro Currency Future Oktober 2020 Call 1,19, fällig 009.10.2020	(631)	(0,01)
(1)	Euro Currency Future Oktober 2020 Call 1,19, fällig 009.10.2020	(1.190)	(0,02)
–	Euro Currency Future September 2020 Call 1,19, fällig 04.09.2020	(352)	(0,01)
–	Euro Currency Future September 2020 Put 1,15, fällig 04.09.2020	(2)	-
EUR (1)	Euro-Bund Oktober 2020 Call 175,00, fällig 25.09.2020	(99)	-
–	Japanese Yen FX Currency September 2020 Call 95,50, fällig 04.09.2020	(5)	-
–	Japanese Yen FX Currency September 2020 Put 94,50, fällig 04.09.2020	(111)	-
(1)	U.S. 10 Year November 2020 Call 139,50, fällig 23.10.2020	(298)	–
(2)	U.S. 10 Year November 2020 Call 140,00, fällig 23.10.2020	(564)	(0,01)
(1)	U.S. 10 Year November 2020 Put 138,50, fällig 23.10.2020	(301)	–
(1)	U.S. 10 Year November 2020 Put 139,00, fällig 23.10.2020	(317)	(0,01)
(1)	U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 139,25, fällig 25.09.2020	(325)	(0,01)
(3)	U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 139,50, fällig 25.09.2020	(758)	(0,01)
(8)	U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 140,00, fällig 25.09.2020	(1.059)	(0,02)
(2)	U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 140,50, fällig 25.09.2020	(124)	–
(2)	U.S. 10 Year Oktober 2020 Put 139,00, fällig 25.09.2020	(760)	(0,01)
(1)	U.S. 10 Year Oktober 2020 Put 139,50, fällig 25.09.2020	(421)	(0,01)
(1)	U.S. Bond November 2020 Put 173,00, fällig 23.10.2020	(981)	(0,01)
–	U.S. Bond November 2020 Put 175,00, fällig 23.10.2020	(524)	(0,01)

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Geschriebene Optionen — (Fortsetzung)			
–	U.S. Bond Oktober 2020 Call 179,00, fällig 25.09.2020	(54)	-
(2)	U.S. Bond Oktober 2020 Call 180,00, fällig 25.09.2020	(597)	(0,01)
(1)	U.S. Bond Oktober 2020 Call 181,00, fällig 25.09.2020	(91)	–
–	U.S. Bond Oktober 2020 Call 183,00, fällig 25.09.2020	(10)	-
(1)	U.S. Bond Oktober 2020 Call 184,00, fällig 25.09.2020	(64)	–
(2)	U.S. Bond Oktober 2020 Put 175,00, fällig 25.09.2020	(3.103)	(0,04)
(1)	U.S. Bond Oktober 2020 Put 176,00, fällig 25.09.2020	(1.337)	(0,02)
–	U.S. Bond Oktober 2020 Put 177,00, fällig 25.09.2020	(883)	(0,01)
(5)	U.S. Bond Oktober 2020 Put 179,00, fällig 25.09.2020	(16.786)	(0,24)
(67.960)	USD Call/BRL Put 5,50, fällig 21.10.2020	(2.025)	(0,03)
(75.790)	USD Call/BRL Put 5,5740, fällig 21.09.2020	(931)	(0,01)
(106.790)	USD Call/BRL Put 5,58, fällig 05.10.2020	(1.956)	(0,03)
(104.730)	USD Call/INR Put 77,00, fällig 03.09.2020	-	-
(68.660)	USD Call/RUB Put 71,79, fällig 23.10.2020	(3.077)	(0,04)
(69.950)	USD Call/RUB Put 75,00, fällig 19.11.2020	(1.929)	(0,03)
(34.420)	USD Call/RUB Put 75,60, fällig 03.09.2020	(22)	-
(34.420)	USD Call/RUB Put 77,00, fällig 03.11.2020	(511)	(0,01)
(76.550)	USD Put/AUD Call 0,70, fällig 11.09.2020	(4.272)	(0,06)
(144.600)	USD Put/BRL Call 5,3240, fällig 23.11.2020	(3.658)	(0,05)
(76.280)	USD Put/MXN Call 21,13, fällig 07.10.2020	(263)	-
(131.400)	USD Put/MXN Call 21,2170, fällig 24.09.2020		(303)
(76.280)	USD Put/MXN Call 21,65, fällig 002.10.2020	(671)	(0,01)
(148.880)	USD Put/MXN Call 21,90, fällig 11.11.2020	(3.007)	(0,04)
(68.411)	USD Put/NOK Call 9,00, fällig 23.09.2020	(2.347)	(0,03)
(145.640)	USD Put/RUB Call 70,90, fällig 13.11.2020	(1.070)	(0,02)
(66.780)	USD Put/SEK Call 9,00, fällig 14.09.2020	(2.780)	(0,04)
Geschriebene Optionen insgesamt (Kosten (52.364) USD)		(61.615)	(0,88)
Zinsswaps —(0,11 %) (29. Februar 2020: (9,13 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(7.258)	(0,11)
Swaptions — (0,03 %) (29. Februar 2020: (0,01) %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(2.313)	(0,03)
Devisenterminkontrakte — (1,21 %) (29. Februar 2020: (1,44 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(85.095)	(1,21)
Termingeschäfte — (2,15 %) (29. Februar 2020: (2,12 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(151.622)	(2,15)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(307.903)	(4,38)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		6.414.412	90,90
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		641.428	9,10
Gesamtnettovermögen		$7.055.840	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 943.453.000 USD und machten 13,38 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

† Illiquide.

∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

≠ Die Wertpapiere (in ihrer Gesamtheit oder in Teilen) sind zum 31. August 2020 als Sicherheit für den Handel mit Derivaten verpfändet.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (VPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihzins entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

Die Gegenparteien für die OTC-Optionen sind BNP Paribas, Citi, Goldman Sachs, JP Morgan und Morgan Stanley.

ABKÜRZUNGEN:

CPI	–	Verbraucherpreisindex
Perpetual	–	Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
AUD	–	Australischer Dollar
BRL	–	Brasilianischer Real
CNY	–	Chinesischer Renminbi
EGP	–	Ägyptisches Pfund
EUR	–	Euro
IDR	–	Indonesische Rupiah
INR	–	Indische Rupie
JPY	–	Japanischer Yen
MXN	–	Mexikanischer Peso
RUB	–	Russischer Rubel
ZAR	–	Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	82,37
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	1,50
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,56
Finanzderivate	4,29
Sonstige Vermögenswerte	10,28
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 %	Verkauf	20.06.2025	130.009	$ 7.433
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 %	Verkauf	20.06.2025	930.920	15.352
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.):11.398 USD)					$ 22.785
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (1.987) USD)					-
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): 9.411 USD)					$ 22.785

Aufstellung der Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,190 %	15.06.2022	990.564	$ (535)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD Fed Funds Rate, Receive Fixed 0,100 %	30.11.2024	387.061	343
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,260 %, Receive Floating USD Fed Funds Rate	15.05.2027	490.643	26
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,450 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.05.2027	5.653.663	7.262
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,713 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	20.05.2030	644.729	(1.366)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,689 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	24.06.2030	681.080	540
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,680 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	08.07.2030	678.310	1.266
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,550 %, Receive Floating GBP 6M Libor BBA	07.12.2030	499.612	(5.357)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,560 %, Receive Floating USD Sofr Compound	20.07.2045	21.760	1.245
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,800 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.2045	905.572	56.855
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,000 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	209.330	4.385

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Swaptions – (Fortsetzung)

Gegenpartei	Beschreibung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,792 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	18.03.2050	12.370	$ 958
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,818 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	19.03.2050	12.593	889
Goldman Sachs	Pay Floating RUB 3M MosPrime Reuters, Receive Fixed 6,500 %	20.11.2021	9.167.700	2.474
Goldman Sachs	Pay Floating RUB 3M MosPrime Reuters, Receive Fixed 6,500 %	20.11.2021	15.279.400	4.123
Goldman Sachs	Pay Floating RUB 3M MosPrime Reuters, Receive Fixed 6,500 %	20.11.2021	17.825.900	4.811
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): 4.535 USD)				$ 85.177
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (697.710) USD)				(7.258)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (693.175) USD)				$ 77.919

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Gegenpartei	Beschreibung	Wirksamkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
BNP Paribas	Swaption Receiver Strike 1,04 %	17.09.2020	37.920	$ 454
JP Morgan	Swaption Receiver Strike 1,02 %	17.09.2020	64.014	(1.562)
Morgan Stanley	Swaption Receiver Strike 1,04 %	17.09.2020	24.825	(297)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Swaptions (29. Februar 2020 (in Tsd.): 1.098 USD)				$ –
Nicht realisierte Wertsteigerung von Swaptions (29. Februar 2020 (in Tsd.): (577) USD)				(2.313)
Nettowertminderung von Saptions (29. Februar 2020 (in Tsd.):521 USD)				$ (2.313)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	2.489	Verkauf	AUD	3.430	$ (41)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	170.927	Verkauf	BRL	947.911	(2.097)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	CHF	1	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	511	Verkauf	EUR	432	(5)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	405	Verkauf	GBP	307	(5)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	15	Verkauf	NOK	136	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	SEK	38	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	2.013	Verkauf	USD	1.461	24
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	BRL	947.911	Verkauf	USD	182.755	(9.732)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	77	Verkauf	USD	101	1
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	441	Verkauf	USD	323	1
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NOK	11	Verkauf	USD	1	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	112	Verkauf	USD	132	1
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	417	Verkauf	GBP	315	(6)
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	87	Verkauf	USD	114	1
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	253	Verkauf	GBP	191	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	52	Verkauf	USD	70	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	5.167	Verkauf	AUD	7.145	(107)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	54	Verkauf	CHF	49	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1.908	Verkauf	CHF	1.732	(5)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	150	Verkauf	CNH	1.039	(2)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	43.761	Verkauf	EUR	36.884	(263)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	16.422	Verkauf	EUR	13.754	2
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	18.409	Verkauf	GBP	14.033	(352)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1.209	Verkauf	JPY	127.759	2
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	46	Verkauf	NOK	420	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	52	Verkauf	PLN	192	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SEK	–	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	780	Verkauf	SEK	6.764	(3)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	2.149	Verkauf	SGD	2.937	(8)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	223	Verkauf	SGD	303	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CNH	50.609	Verkauf	USD	7.242	136
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	JPY	11.125.914	Verkauf	USD	105.233	(165)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	288.091	Verkauf	USD	206.511	5.987
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.756	Verkauf	USD	2.097	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	4	Verkauf	USD	3	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	632.800	Verkauf	USD	827.271	18.720
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NOK	19.089	Verkauf	USD	2.118	67
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	557.427	Verkauf	USD	63.783	672
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	150.513	Verkauf	USD	109.686	943
16.10.2020	Citi	Kauf	USD	150.417	Verkauf	MXN	3.392.703	(3.743)
16.10.2020	Citi	Kauf	JPY	2.800.000	Verkauf	USD	26.434	18
16.10.2020	Citi	Kauf	RUB	2.730.000	Verkauf	USD	36.076	517
16.10.2020	Citi	Kauf	EUR	41.000	Verkauf	USD	47.744	1.234
16.10.2020	Citi	Kauf	GBP	15.000	Verkauf	USD	19.693	364
16.10.2020	Citi	Kauf	BRL	182.507	Verkauf	USD	35.255	(1.990)
16.10.2020	Citi	Kauf	USD	47.187	Verkauf	ZAR	828.173	(1.425)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	141.193	Verkauf	BRL	739.703	$ 6.367
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	63.235	Verkauf	IDR	941.125.500	(1.017)
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	60.870	Verkauf	MXN	1.396.640	(2.591)
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	393.247	Verkauf	RUB	28.446.452	11.962
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	RUB	11.105.360	Verkauf	USD	151.030	(2.178)
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	JPY	2.776.222	Verkauf	USD	25.849	379
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	BRL	921.410	Verkauf	USD	171.479	(3.535)
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	6.932	Verkauf	AUD	9.870	(349)
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	4.637	Verkauf	CAD	6.281	(179)
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	423.704	Verkauf	IDR	6.280.699.197	(5.085)
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	220.056	Verkauf	INR	16.724.028	(6.920)
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	66.498	Verkauf	KRW	79.766.597	(674)
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	51.030	Verkauf	SEK	445.496	(501)
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	KRW	79.766.597	Verkauf	USD	67.391	(220)
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	NOK	735.221	Verkauf	USD	78.554	5.632
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	AUD	126.701	Verkauf	USD	87.826	5.636
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	SEK	1.332.987	Verkauf	USD	143.232	10.955
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	CAD	57.080	Verkauf	USD	42.063	1.704
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	IDR	1.028.451.867	Verkauf	USD	69.331	883
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	INR	6.504.730	Verkauf	USD	86.955	1.325
16.10.2020	Morgan Stanley	Kauf	MXN	993.237	Verkauf	USD	44.447	685
19.11.2020	Citi	Kauf	USD	141.966	Verkauf	EUR	120.100	(1.604)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	58.300	Verkauf	RUB	4.310.702	673
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	RUB	4.310.702	Verkauf	USD	58.284	(657)
24.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	BRL	21.889	Verkauf	USD	3.873	111
24.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	52.676	Verkauf	INR	3.990.190	(1.258)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 94.894 USD)								113.230
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (109.828) USD)								(85.095)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (14.934) USD)								$ 28.135

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro$ Dezember 2020	6.060	$ 1.510.682	$ 17.484
90 Day Euro$ Juni 2021	(19.942)	(4.976.028)	(61.152)
90 Day Euro$ März 2021	(807)	(201.347)	(306)
Australien Dollar Currency September 2020	1.719	127.017	4.980
British Pound Currency September 2020	576	48.164	1.975
Canadian Dollar Currency September 2020	842	64.640	2.238
Euro FX Currency Dezember 2020	96	14.355	142
Euro FX Currency September 2020	1.484	221.478	9.345
Euro-BTP September 2020	(736)	(128.417)	1.196
Euro-Bund Dezember 2020	(18.389)	(3.790.479)	10.251
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2020	(221)	(57.208)	(670)
Euro-OAT September 2020	2.289	457.458	6.382
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2020	20	28.625	(51)
Japanese Yen Currency September 2020	1.045	123.402	1.766
Long Gilt Dezember 2020	(4.091)	(738.322)	6.319
Mexican Peso Currency September 2020	6.500	148.265	5.451
RUB/USD September 2020	993	33.477	(387)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	(19.191)	(2.672.347)	2.094
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2020	(732)	(116.708)	644
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2020	16.908	3.735.743	788
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	38.597	4.864.428	6.033
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	22.297	3.918.001	(38.910)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	12.545	2.771.269	(50.146)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 289.066 USD)			$ 77.088
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(161.732) USD)			(151.622)
Nettowertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 127.334 USD)			$ (74.534)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 8,47 % (29. Februar 2020: 8,11 %)			
258	ABFC 2003-OPT1 Trust, Series 2003 OPT1, Klasse A3, 0,855 %, fällig 25.04.2033 *	239	0,02
4.034	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 2005-HE3, Series 2005 HE3, Klasse M4, 1,120 %, fällig 25.05.2035 *	3.692	0,37
2.230	Aegis Asset Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Ctfs Ser 2005-4, Series 2005 4, Klasse M2, 0,645 %, fällig 25.10.2035 *	2.070	0,20
400	Ammc Clo 20 Ltd, Series 2017 20A, Klasse E, 144A, 6,083 %, fällig 17.04.2029 *	347	0,03
500	AMMC CLO XI Ltd, Series 2012 11A, Klasse A1R2, 144A, 1,278 %, fällig 30.04.2031 *	491	0,05
986	Apex Credit CLO 2017 Ltd, Series 2017 1A, Klasse A1, 144A, 1,734 %, fällig 24.04.2029 *	984	0,10
1.700	Apex Credit CLO 2019-II Ltd, Series 2019 2A, Klasse D, 144A, 4,295 %, fällig 25.10.2032 *	1.670	0,17
1.250	Apidos CLO XII, Series 2013 12A, Klasse ER, 144A, 5,675 %, fällig 15.04.2031 *	1.028	0,10
350	Ares XLI Clo Ltd, Series 2016 41A, Klasse D, 144A, 4,475 %, fällig 15.01.2029 *	342	0,03
750	Ares XLIII CLO Ltd, Series 2017 43A, Klasse A, 144A, 1,495 %, fällig 15.10.2029 *	748	0,07
1.750	Ares XXXIIR CLO Ltd, Series 2014 32RA, Klasse C, 144A, 3,180 %, fällig 15.05.2030 *	1.625	0,16
1.800	Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Klasse C, 144A, 3,422 %, fällig 20.04.2031 *	1.730	0,17
750	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd, Series 2015 8A, Klasse A1AR, 144A, 1,372 %, fällig 20.01.2031 *	740	0,07
500	Black Diamond Clo 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Klasse A1A, 144A, 1,554 %, fällig 24.04.2029 *	496	0,05
594	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd, Series 2015 1A, Klasse A1R, 144A, 1,596 %, fällig 13.04.2027 *	594	0,06
500	BlueMountain CLO 2015-2 Ltd, Series 2015 2A, Klasse ER, 144A, 5,472 %, fällig 18.07.2027 *	380	0,04
1.250	BlueMountain CLO 2016-1 Ltd, Series 2016 1A, Klasse CR, 144A, 2,122 %, fällig 20.04.2027 *	1.188	0,12
1.000	BlueMountain CLO XXII Ltd, Series 2018 22A, Klasse A1, 144A, 1,355 %, fällig 15.07.2031 *	984	0,10
600	Canyon Capital CLO 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Klasse D, 144A, 3,875 %, fällig 15.07.2030 *	594	0,06
1.500	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-3 Ltd, Series 2015 3A, Klasse A1R, 144A, 1,247 %, fällig 28.07.2028 *	1.493	0,15
500	Carlyle US Clo 2017-2 Ltd, Series 2017 2A, Klasse C, 144A, 3,972 %, fällig 20.07.2031 *	482	0,05
700	Catskill Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Klasse D, 144A, 6,272 %, fällig 20.04.2029 *	624	0,06
1.000	Cedar Funding VIII Clo Ltd, Series 2017 8A, Klasse A1, 144A, 1,523 %, fällig 17.10.2030 *	996	0,10
780	Cent CLO 24 Ltd, Series 2015 24A, Klasse CR, 144A, 3,425 %, fällig 15.10.2026 *	721	0,07
1.000	Cumberland Park CLO Ltd, Series 2015 2A, Klasse DR, 144A, 2,972 %, fällig 20.07.2028 *	981	0,10
500	Cumberland Park CLO Ltd, Series 2015 2A, Klasse ER, 144A, 5,922 %, fällig 20.07.2028 *	447	0,04
500	CVP CLO 2017-2 Ltd, Series 2017 2A, Klasse D, 144A, 2,922 %, fällig 20.01.2031 *	458	0,05
1.410	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-B, Series 2004 B, Klasse 2A, 0,382 %, fällig 15.02.2029 *	1.293	0,13
135	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-D, Series 2005 D, Klasse 2A, 0,352 %, fällig 15.11.2035 *	130	0,01
650	Dewolf Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Klasse C, 144A, 2,425 %, fällig 15.10.2030 *	651	0,07
600	Dewolf Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Klasse D, 144A, 3,425 %, fällig 15.10.2030 *	580	0,06
2.901	Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Series 2018 2, Klasse B, 144A, 4,250 %, fällig 20.12.2038	2.976	0,29
12	Earnest Student Loan Program 2016-A LLC, Series 2016 A, Klasse R, 144A, 0,000 %, fällig 25.01.2039	182	0,02
2.090	Encore Credit Receivables Trust 2005-2, Series 2005 2, Klasse M4, 1,105 %, fällig 25.11.2035 *	2.004	0,20
5.050	FBR Securitization Trust 2005-2, Series 2005 2, Klasse M4, 1,105 %, fällig 25.09.2035 *	3.851	0,38
387	First Franklin Mortgage Loan Trust 2003-FF4, Series 2003 FF4, Klasse M1, 1,956 %, fällig 25.10.2033 *	386	0,04
2.350	Flatiron Clo 17 Ltd, Series 2017 1A, Klasse A, 144A, 1,530 %, fällig 15.05.2030 *	2.340	0,23
250	Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Klasse E, 144A, 5,225 %, fällig 15.04.2031 *	208	0,02
1.600	Grippen Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Klasse D, 144A, 3,572 %, fällig 20.01.2030 *	1.546	0,15
450	Halcyon Loan Advisors Funding 2015-2 Ltd, Series 2015 2A, Klasse AR, 144A, 1,325 %, fällig 25.07.2027 *	448	0,05
3.500	Hertz Vehicle Financing II LP, Series 2016 2A, Klasse D, 144A, 5,970 %, fällig 25.03.2022	3.322	0,33
3.330	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2005-C, Series 2005 C, Klasse M2, 0,675 %, fällig 25.10.2035 *	3.218	0,32
341	Jackson Mill CLO Ltd, Series 2015 1A, Klasse AR, 144A, 1,105 %, fällig 15.04.2027 *	338	0,03
1.000	Jackson Mill CLO Ltd, Series 2015 1A, Klasse DR, 144A, 3,075 %, fällig 15.04.2027 *	938	0,09
850	Jamestown CLO IV Ltd, Series 2014 4A, Klasse A2R, 144A, 1,625 %, fällig 15.07.2026 *	842	0,08
750	Jamestown CLO X Ltd, Series 2017 10A, Klasse A1, 144A, 1,523 %, fällig 17.07.2029 *	747	0,07
1.300	LCM XXII Ltd 22A, Klasse DR, 144A, 5,772 %, fällig 20.10.2028 *	1.021	0,10
1.250	Marble Point Clo X Ltd, Series 2017 1A, Klasse C, 144A, 2,625 %, fällig 15.10.2030 *	1.226	0,12
2.388	Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE2, Series 2007 HE2, Klasse A1, 1,325 %, fällig 25.08.2037 *	2.212	0,22
1.000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 35 Ltd, Series 2019 35A, Klasse E, 144A, 7,272 %, fällig 19.01.2033 *	950	0,09
250	Oaktree CLO 2015-1 Ltd, Series 2015 1A, Klasse DR, 144A, 5,472 %, fällig 20.10.2027 *	186	0,02
790	Ocean Trails CLO IX, Series 2020 9A, Klasse A1, 144A, 0,000 %, fällig 15.10.2029 *∞	790	0,08
895	Ocean Trails CLO IX, Series 2020 9A, Klasse A2, 144A, 0,000 %, fällig 15.10.2029 *∞	895	0,09
250	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, Series 2018 1A, Klasse C, 144A, 2,872 %, fällig 20.01.2031 *	230	0,02
1.121	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Series 2007 FXD1, Klasse 1A1, 5,866 %, fällig 25.01.2037	1.094	0,11
2.364	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Series 2007 FXD1, Klasse 2A1, 5,866 %, fällig 25.01.2037	2.313	0,23
1.080	OZLM VII Ltd, Series 2014 7RA, Klasse CR, 144A, 3,273 %, fällig 17.07.2029 *	948	0,09
900	OZLM XI Ltd, Series 2015 11A, Klasse BR, 144A, 2,568 %, fällig 30.10.2030 *	880	0,09
2.600	RAMP Series 2006-NC3 Trust, Series 2006 NC3, Klasse M1, 0,515 %, fällig 25.03.2036 *	2.478	0,25
579	RBSSP Resecuritization Trust 2010-4, Series 2010 4, Klasse 6A2, 144A, 5,825 %, fällig 26.02.2036	587	0,06
982	Recette Clo Ltd, Series 2015 1A, Klasse AR, 144A, 1,192 %, fällig 20.10.2027 *	978	0,10
920	Regatta VI Funding Ltd, Series 2016 1A, Klasse AR, 144A, 1,352 %, fällig 20.07.2028 *	918	0,09
1.000	Romark CLO Ltd, Series 2017 1A, Klasse D, 144A, 6,906 %, fällig 23.10.2030 *	883	0,09
1.335	Saranac CLO III Ltd, Series 2014 3A, Klasse DR, 144A, 3,556 %, fällig 22.06.2030 *	1.182	0,12
490	Shackleton 2014-VI-R CLO Ltd, Series 2014 6RA, Klasse A, 144A, 1,293 %, fällig 17.07.2028 *	488	0,05
1.000	SMB Private Education Loan Trust 2015-C, Series 2015 C, Klasse C, 144A, 4,500 %, fällig 17.09.2046	1.086	0,11
530	Symphony CLO XIX Ltd, Series 2018 19A, Klasse E, 144A, 5,471 %, fällig 16.04.2031 *	442	0,04
750	TCI-Flatiron Clo 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Klasse A, 144A, 1,480 %, fällig 18.11.2030 *	747	0,07
530	TCI-Symphony CLO 2016-1 Ltd, Series 2016 1A, Klasse DR, 144A, 3,266 %, fällig 13.10.2029 *	481	0,05
450	TCI-Symphony CLO 2016-1 Ltd, Series 2016 1A, Klasse ER, 144A, 5,766 %, fällig 13.10.2029 *	372	0,04

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
400	Thayer Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Klasse D, 144A, 6,372 %, fällig 20.04.2029 *	357	0,03
510	Tralee CLO III Ltd, Series 2014 3A, Klasse AR, 144A, 1,302 %, fällig 20.10.2027 *	507	0,05
600	Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Klasse DRR, 144A, 3,095 %, fällig 15.04.2027 *	517	0,05
500	Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Klasse ERR, 144A, 6,015 %, fällig 15.04.2027 *	357	0,04
750	Voya CLO 2016-3 Ltd, Series 2016 3A, Klasse A1R, 144A, 1,462 %, fällig 18.10.2031 *	746	0,07
1.500	Voya CLO 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Klasse C, 144A, 3,603 %, fällig 17.04.2030 *	1.374	0,14
200	VOYA CLO 2017-2, Series 2017 2A, Klasse D, 144A, 6,295 %, fällig 07.06.2030 *	172	0,02
1.000	Voya CLO 2018-3 Ltd, Series 2018 3A, Klasse A1A, 144A, 1,425 %, fällig 15.10.2031 *	996	0,10
2.586	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE4 Trust, Series 2007 HE4, Klasse 1A, 0,345 %, fällig 25.07.2047 *	2.110	0,21
1.000	Webster Park CLO Ltd, Series 2015 1A, Klasse CR, 144A, 3,172 %, fällig 20.07.2030 *	948	0,09
1.050	Wellfleet CLO 2017-2A Ltd, Series 2017 2A, Klasse C, 144A, 3,672 %, fällig 20.10.2029 *	963	0,10
890	Whitehorse XII Ltd, Series 2018 12A, Klasse D, 144A, 3,925 %, fällig 15.10.2031 *	796	0,08
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 87.842 USD)		85.374	8,47
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 11,06 % (29. Februar 2020: 13,63 %)			
1.503	Alternative Loan Trust 2007-4CB, Series 2007 4CB, Klasse 1A5, 5,750 %, fällig 25.04.2037	1.507	0,15
1.192	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Series 2016 GG10, Klasse AJA, 144A, 6,015 %, fällig 10.08.2045 *	526	0,05
1.891	Banc of America Funding Corp, Series 2015 R3, Klasse 1A2, 144A, 0,620 %, fällig 27.03.2036 *	1.560	0,16
440	BBCCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Klasse D, 144A, 4,715 %, fällig 10.08.2033 *	418	0,04
2.660	BBSG 2016-MRP Mortgage Trust, Series 2016 MRP, Klasse A, 144A, 3,275 %, fällig 05.06.2036	2.602	0,26
3.220	BXMT 2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2, Klasse A, 144A, 1,062 %, fällig 16.02.2037 *	3.152	0,31
36.430	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Series 2017 P8, Klasse XA, 1,052 %, fällig 15.09.2050 *	1.888	0,19
2.260	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1, Klasse C, 4,454 %, fällig 10.02.2048 *	2.137	0,21
10	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series 2006-C3, Series 2006 C3, Klasse AJ, 6,635 %, fällig 15.06.2038 *	5	–
391	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series 2006-C5, Series 2006 C5, Klasse AJ, 5,373 %, fällig 15.12.2039	175	0,02
4.690	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Klasse F, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037	2.647	0,26
2.000	CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Klasse F, 144A, 4,512 %, fällig 15.07.2032 *	1.478	0,15
1.400	CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Klasse H, 144A, 7,512 %, fällig 15.07.2032 *	855	0,09
2.936	CSWF 2018-TOP, Series 2018 TOP, Klasse D, 144A, 1,962 %, fällig 15.08.2035 *	2.748	0,27
2.577	DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Series 2007 AR1, Klasse 1A1B, 0,301 %, fällig 19.04.2047 *	2.165	0,21
2.220	Eagle RE 2020-1 Ltd, Series 2020 1, Klasse M1C, 144A, 1,975 %, fällig 25.01.2030 *	1.963	0,19
440	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C03, Klasse 1B1, 5,025 %, fällig 25.10.2029 *	441	0,04
2.500	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05, Klasse 1B1, 3,775 %, fällig 25.01.2030 *	2.354	0,23
2.327	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05, Klasse 1M2, 2,375 %, fällig 25.01.2030 *	2.300	0,23
3.400	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C06, Klasse 1B1, 4,325 %, fällig 25.02.2030 *	3.176	0,32
2.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C07, Klasse 1B1, 4,175 %, fällig 25.05.2030 *	1.933	0,19
3.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C01, Klasse 1B1, 3,725 %, fällig 25.07.2030 *	2.813	0,28
3.320	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05, Klasse 1B1, 4,425 %, fällig 25.01.2031 *	3.115	0,31
3.014	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA3, Klasse M3, 5,175 %, fällig 25.12.2028 *	3.162	0,31
1.000	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Klasse C, 144A, 3,912 %, fällig 15.09.2031 *	964	0,10
94	GS Mortgage Securities Trust 2006-GG8, Series 2006 GG8, Klasse AJ, 5,622 %, fällig 10.11.2039	65	0,01
252	GSMPS Mortgage Loan Trust 2006-RP1, Series 2006 RP1, Klasse 1A2, 144A, 7,500 %, fällig 25.01.2036	265	0,03
4.175	Impac Secured Assets Trust 2006-3, Series 2006 3, Klasse A7, 0,445 %, fällig 25.11.2036 *	2.472	0,25
3.190	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Series 2018 PHMZ, Klasse M, 144A, 8,370 %, fällig 15.06.2035 *†	2.458	0,24
68	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-CIBC19, Series 2007 CB19, Klasse AJ, 6,068 %, fällig 12.02.2049 *	29	–
5	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12, Series 2007 LD12, Klasse AJ, 6,710 %, fällig 15.02.2051 *	4	–
4.130	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Series 2018 WPT, Klasse FFL, 144A, 3,057 %, fällig 05.07.2033 *	3.793	0,38
5.836	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-NNN MZ, Series 2020 NNNZ, Klasse M, 144A, 8,542 %, fällig 16.01.2037	4.483	0,44
915	JP Morgan Resecuritization Trust Series 2009-10, Series 2009 10, Klasse 7A2, 144A, 6,054 %, fällig 26.02.2037 *	534	0,05
3.639	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Series 2019 BOLT, Klasse C, 144A, 3,962 %, fällig 15.07.2034 *	3.249	0,32
5.077	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Series 2019 BOLT, Klasse XCP, 144A, 2,052 %, fällig 15.07.2034 *	90	0,01
169	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Series 2007 5, Klasse AJ, 5,450 %, fällig 12.08.2048 *	100	0,01
169	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Series 2007 5, Klasse AJFL, 144A, 5,450 %, fällig 12.08.2048 *	100	0,01
594	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-2AR, Series 2005 2AR, Klasse B1, 0,675 %, fällig 25.04.2035 *	504	0,05
2.407	Motel 6 Trust 2017-MTL6, Series 2017 MTL6, Klasse F, 144A, 4,412 %, fällig 15.08.2034 *	2.327	0,23
2.800	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Klasse D, 144A, 4,544 %, fällig 15.08.2036 *	2.460	0,24
2.450	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Klasse E, 144A, 4,544 %, fällig 15.08.2036 *	1.991	0,20
659	Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Series 2015 4R, Klasse 1A14, 144A, 0,403 %, fällig 26.03.2047 *	535	0,05
2.023	Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Series 2015 4R, Klasse 2A2, 144A, 0,312 %, fällig 26.10.2036 *	1.740	0,17
3.980	Radnor Re 2018-1 Ltd, Series 2018 1, Klasse M2, 144A, 2,875 %, fällig 25.03.2028 *	3.783	0,38
4.420	Radnor RE 2020-1 Ltd, Series 2020 1, Klasse M1C, 144A, 1,925 %, fällig 25.02.2030 *	3.898	0,39
222	Rosslyn Portfolio Trust 2017-ROSS, Series 2017 ROSS, Klasse F, 144A, 4,739 %, fällig 15.06.2033 *	194	0,02
4.420	Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Series 2017 4, Klasse M, 144A, 4,750 %, fällig 25.06.2057 *	4.481	0,44
5.365	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-1, Series 2017 1, Klasse M1, 144A, 4,000 %, fällig 25.01.2056 *	5.354	0,53
4.180	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1, Series 2018 1, Klasse M, 4,750 %, fällig 25.05.2057 *	4.074	0,40
2.500	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-4, Series 2018 4, Klasse M, 144A, 4,750 %, fällig 25.03.2058	2.368	0,24
2.564	Sequoia Mortgage Trust 2007-2, Series 2007 2, Klasse 1A3, 0,478 %, fällig 20.06.2036 *	2.375	0,24

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
1.420	STACR Trust 2018-DNA2, Series 2018 DNA2, Klasse B1, 144A, 3,875 %, fällig 25.12.2030 *	1.289	0,13
3.000	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Klasse C, 144A, 2,912 %, fällig 15.11.2027 *†	185	0,02
1.300	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Klasse D, 144A, 3,662 %, fällig 15.11.2027 *†	39	–
1.160	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Klasse E, 144A, 4,562 %, fällig 15.11.2027 *†	116	0,01
2.708	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Klasse D, 144A, 2,154 %, fällig 11.11.2034 *†	2.436	0,24
2.649	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Klasse E, 144A, 3,334 %, fällig 11.11.2034 *	2.197	0,22
2.827	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Klasse F, 144A, 4,106 %, fällig 11.11.2034 *†	2.189	0,22
723	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series 2007-C33, Series 2007 C33, Klasse AJ, 5,843 %, fällig 15.02.2051 *	560	0,06
491	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR17 Trust, Series 2005 AR17, Klasse A1C3, 0,655 %, fällig 25.12.2045 *	333	0,03
1.836	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR13 Trust, Series 2006 AR13, Klasse 2A, 2,182 %, fällig 25.10.2046 *	1.658	0,16
726	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR3 Trust, Series 2006 AR3, Klasse A1B, 2,171 %, fällig 25.02.2046 *	664	0,07
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 125.584 USD)		111.476	11,06
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 55,53 % (29. Februar 2020: 51,14 %)			
Argentinien — 0,44 % (29. Februar 2020: 0,51 %)			
2.260	Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750 %, fällig 02.05.2025	1.953	0,19
1.990	YPF SA, 8,500 %, fällig 23.03.2021	1.927	0,19
580	YPF SA, 144A, 8,500 %, fällig 23.03.2021	562	0,06
		4.442	0,44
Australien — 0,25 % (29. Februar 2020: 0,03 %)			
250	BHP Billiton Finance USA Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 19.10.2075 *	299	0,03
1.730	Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, fällig 16.04.2025	1.901	0,19
290	Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, fällig 27.03.2027	319	0,03
		2.519	0,25
Belgien — 0,69 % (29. Februar 2020: 0,89 %)			
1.910	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, fällig 23.01.2049	2.575	0,25
250	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,800 %, fällig 23.01.2059	358	0,04
EUR 3.200	KBC Group NV, 4,750 %, Perpetual *	4.005	0,40
		6.938	0,69
Brasilien — 1,70 % (29. Februar 2020: 1,67 %)			
2.060	Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 4,500 %, fällig 10.01.2028	2.015	0,20
6.470	Petrobras Global Finance BV, 5,299 %, fällig 27.01.2025	7.077	0,70
1.690	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05.06.2115	1.861	0,19
650	Suzano Austria GmbH, 5,750 %, fällig 14.07.2026	745	0,07
2.160	Suzano Austria GmbH, 6,000 %, fällig 15.01.2029	2.453	0,24
1.480	Vale Overseas Ltd, 6,250 %, fällig 10.08.2026	1.761	0,18
910	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 10.11.2039	1.231	0,12
		17.413	1,70
Kanada — 1,95 % (29. Februar 2020: 2,38 %)			
1.500	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.01.2028	1.540	0,15
530	Air Canada, 144A, 7,750 %, fällig 15.04.2021	532	0,05
600	Barrick North America Finance LLC, 5,750 %, fällig 01.05.2043	879	0,09
900	Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.01.2028	961	0,10
1.250	Cenovus Energy Inc, 5,375 %, fällig 15.07.2025	1.274	0,13
1.210	GFL Environmental Inc, 144A, 4,250 %, fällig 01.06.2025	1.235	0,12
2.030	GFL Environmental Inc, 144A, 3,750 %, fällig 01.08.2025	2.048	0,20
2.325	GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2026	,	0,24
1.158	GFL Environmental Inc, 144A, 8,500 %, fällig 01.05.2027	1.263	0,13
1.230	MEG Energy Corp, 144A, 7,000 %, fällig 31.03.2024	1.224	0,12
500	MEG Energy Corp, 144A, 6,500 %, fällig 15.01.2025	510	0,05
1.500	MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2027	1.439	0,14
470	Open Text Corp, 144A, 3,875 %, fällig 15.02.2028	484	0,05
1.200	Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2030	1.246	0,12
410	Teck Resources Ltd, 6,000 %, fällig 15.08.2040	445	0,05
1.060	Teck Resources Ltd, 5,400 %, fällig 01.02.2043	1.099	0,11
970	TransAlta Corp, 6,500 %, fällig 15.03.2040	1.000	0,10
		19.637	1,95
Kaimaninseln — 0,19 % (29. Februar 2020: 0,33 %)			
3.230	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15.09.2024	1.890	0,19
China — 0,34 % (29. Februar 2020: 0,47 %)			
550	Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, fällig 12.11.2023	595	0,06
2.430	Prosus NV, 144A, 4,850 %, fällig 06.07.2027	2.814	0,28
		3.409	0,34
Kolumbien — 0,27 % (29. Februar 2020: 0,26 %)			
1.270	Millicom International Cellular SA, 144A, 6,625 %, fällig 15.10.2026	1.384	0,14
1.220	Millicom International Cellular SA, 144A, 6,250 %, fällig 25.03.2029	1.355	0,13
		2.739	0,27
Dänemark — 0,07 % (29. Februar 2020: 0,31 %)			
210	Danske Bank A/S, 144A, 5,000 %, fällig 12.01.2022	221	0,02
450	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig 12.01.2024	510	0,05
		731	0,07
Frankreich — 1,06 % (29. Februar 2020: 1,21 %)			
5.330	Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, fällig 01.05.2026	5.664	0,56
500	Altice France SA/France, 144A, 8,125 %, fällig 01.02.2027	558	0,06
400	BNP Paribas SA, 144A, 3,052 %, fällig 13.01.2031 *	433	0,04
1.500	Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetual *	1.784	0,18
EUR 1.070	Credit Agricole SA, 6,500 %, Perpetual *	1.318	0,13
930	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, fällig 17.09.2044	950	0,09
		10.707	1,06
Deutschland — 0,11 % (29. Februar 2020: 0,20 %)			
EUR 270	Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, fällig 30.09.2025	323	0,03
-21800	Vertical US Newco Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.07.2027	835	0,08
		1.158	0,11
Hongkong — 0,24 % (29. Februar 2020: 0,27 %)			
2.320	Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 04.12.2029	2.390	0,24
Indien — 0,18 % (29. Februar 2020: 0,16 %)			
1.790	ICICI Bank Ltd/Hong Kong, 5,750 %, fällig 16.11.2020	1.803	0,18
Irland — 0,56 % (29. Februar 2020: 0,49 %)			
690	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 5,000 %, fällig 01.10.2021	711	0,07
250	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,450 %, fällig 16.12.2021	255	0,02
190	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,950 %, fällig 01.02.2022	192	0,02
190	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,500 %, fällig 26.05.2022	191	0,02
1.040	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,500 %, fällig 15.09.2023	1.068	0,11
330	Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 01.10.2023	321	0,03
2.270	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2022	2.255	0,22
730	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2023	697	0,07
		5.690	0,56
Israel — 0,52 % (29. Februar 2020: 0,51 %)			
5.300	Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, Series C, 0,250 %, fällig 01.02.2026	5.219	0,52
Italien — 1,26 % (29. Februar 2020: 1,28 %)			
4.010	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, fällig 26.06.2024	4.327	0,43
2.800	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig 15.01.2026	3.115	0,31
400	Intesa Sanpaolo SpA, Series XR, 144A, 4,700 %, fällig 23.09.2049	462	0,05
2.050	UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, fällig 02.04.2034 *	2.398	0,24
2.280	UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, fällig 30.06.2035 *	2.365	0,23
		12.667	1,26
Jersey — 0,01 % (29. Februar 2020: 0,01 %)			
EUR 100	LHC3 Plc, 4,125 %, fällig 15.08.2024	120	0,01
Kasachstan — 0,58 % (29. Februar 2020: 0,54 %)			
2.570	KazMunayGas National Co JSC, 144A, 4,750 %, fällig 19.04.2027	2.907	0,29
200	KazMunayGas National Co JSC, 144A, 6,375 %, fällig 24.10.2048	271	0,02
2.440	KazTransGas JSC, 144A, 4,375 %, fällig 26.09.2027	2.706	0,27
		5.884	0,58
Luxemburg — 0,68 % (29. Februar 2020: 0,87 %)			
2.540	Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2027	2.916	0,29

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Luxemburg — (Fortsetzung)			
50	ArcelorMittal SA, 3,600 %, fällig 16.07.2024	53	–
850	ArcelorMittal SA, 6,125 %, fällig 01.06.2025	982	0,10
2.000	ArcelorMittal SA, 4,550 %, fällig 11.03.2026	2.193	0,22
660	ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	679	0,07
		6.823	0,68
Macau — 0,53 % (29. Februar 2020: 0,29 %)			
1.000	Sands China Ltd, 5,125 %, fällig 08.08.2025	1.111	0,11
400	Sands China Ltd, 144A, 3,800 %, fällig 08.01.2026	424	0,04
2.430	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26.08.2028	2.448	0,24
1.410	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2029	1.388	0,14
		5.371	0,53
Malaysia — 0,24 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
2.500	Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig 19.08.2050	2.454	0,24
Mexiko — 0,26 % (29. Februar 2020: 0,33 %)			
200	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 6,875 %, Perpetual *	202	0,02
2.330	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625 %, Perpetual *	2.377	0,24
		2.579	0,26
Niederlande — 0,42 % (29. Februar 2020: 0,51 %)			
EUR 3.200	Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, Perpetual *	4.000	0,40
230	UPC Holding BV, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2028	241	0,02
		4.241	0,42
Peru — 0,13 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1.310	Hudbay Minerals Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15.01.2025	1.362	0,13
Russland — 0,32 % (29. Februar 2020: 0,45 %)			
1.010	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA, 144A, 4,950 %, fällig 23.03.2027	1.137	0,12
1.820	Lukoil International Finance BV, 144A, 4,750 %, fällig 02.11.2026	2.043	0,20
		3.180	0,32
Singapur — 0,08 % (29. Februar 2020: 0,09 %)			
710	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, fällig 19.06.2024	783	0,08
Südafrika — 0,04 % (29. Februar 2020: 0,05 %)			
410	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,000 %, fällig 11.09.2027	452	0,04
Spanien — 0,24 % (29. Februar 2020: 0,28 %)			
EUR 1.600	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 5,875 %, Perpetual *	1.887	0,19
150	Telefonica Emisiones SA, 4,103 %, fällig 08.03.2027	172	0,02
EUR 100	Tendam Brands SAU, 5,000 %, fällig 15.09.2024	101	0,01
EUR 230	Tendam Brands SAU, 5,250 %, fällig 15.09.2024 *	237	0,02
		2.397	0,24
Schweiz — 0,58 % (29. Februar 2020: 0,75 %)			
500	Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	584	0,06
670	Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, Perpetual *	723	0,07
200	Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, Perpetual *	220	0,02
200	Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, Perpetual *	223	0,02
3.740	UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	4.056	0,41
		5.806	0,58
Vereinigte Arabische Emirate — 0,67 % (29. Februar 2020: 0,84 %)			
3.250	DAE Funding LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.11.2023	3.246	0,32
2.710	DP World Plc, 144A, 5,625 %, fällig 25.09.2048	3.211	0,32
930	Shelf Drilling Holdings Ltd, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2025	335	0,03
		6.792	0,67
Großbritannien — 2,11 % (29. Februar 2020: 2,85 %)			
900	Barclays Bank Plc, 7,625 %, fällig 21.11.2022	1.001	0,10
EUR 1.730	Barclays Plc, 2,000 %, fällig 07.02.2028 *	2.077	0,20
1.200	Barclays Plc, 5,088 %, fällig 20.06.2030 *	1.396	0,14
1.550	Barclays Plc, 8,000 %, Perpetual *	1.696	0,17
540	Barclays Plc, 7,750 %, Perpetual *	572	0,06
GBP 470	CPUK Finance Ltd, 7,239 %, fällig 28.02.2024	713	0,07
360	HSBC Holdings Plc, 4,950 %, fällig 31.03.2030	444	0,04
360	HSBC Holdings Plc, 6,250 %, Perpetual *	368	0,04
1.680	HSBC Holdings Plc, 6,500 %, Perpetual *	1.812	0,18
EUR 1.500	HSBC Holdings Plc, 5,250 %, Perpetual *	1.820	0,18
EUR 2.100	Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, Perpetual *	2.541	0,25
200	Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, Perpetual *	217	0,02
750	Natwest Group Plc, 5,125 %, fällig 28.05.2024	831	0,08
800	Natwest Group Plc, 8,625 %, Perpetual *	843	0,08
1.600	Santander UK Group Holdings Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.09.2025	1.782	0,18
GBP 340	Santander UK Group Holdings Plc, 7,375 %, Perpetual *	483	0,05
2.500	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	2.707	0,27
		21.303	2,11
USA — 38,26 % (29. Februar 2020: 31,73 %)			
800	AbbVie Inc, 144A, 2,950 %, fällig 21.11.2026	881	0,09
3.970	AbbVie Inc, 144A, 4,050 %, fällig 21.11.2039	4.654	0,46
960	AdaptHealth LLC, 144A, 6,125 %, fällig 01.08.2028	1.008	0,10
800	Advanced Micro Devices Inc, 7,500 %, fällig 15.08.2022	899	0,09
900	Air Methods Corp, 144A, 8,000 %, fällig 15.05.2025	762	0,08
490	Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,750 %, fällig 30.09.2024	508	0,05
1.380	Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,125 %, fällig 15.05.2028	1.493	0,15
1.860	Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15.02.2028	1.846	0,18
3.660	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2026	3.930	0,39
490	Alteryx Inc, 1,000 %, fällig 01.08.2026	499	0,05
1.480	Altria Group Inc, 4,800 %, fällig 14.02.2029	1.771	0,18
2.150	Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14.02.2049	2.927	0,29
2.000	American Axle & Manufacturing Inc, 6,250 %, fällig 15.03.2026	2.046	0,20
4.114	American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig 01.09.2026	4.517	0,45
2.090	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 4,750 %, fällig 23.08.2022	1.937	0,19
390	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2026	407	0,04
900	Aviation Capital Group LLC, 144A, 2,875 %, fällig 20.01.2022	895	0,09
1.150	Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.12.2024	1.184	0,12
2.740	Ball Corp, 2,875 %, fällig 15.08.2030	2.741	0,27
1.280	Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.04.2026	1.419	0,14
2.520	Bausch Health Americas Inc, 144A, 8,500 %, fällig 31.01.2027	2.776	0,28
40	Bausch Health Cos Inc, 144A, 9,000 %, fällig 15.12.2025	44	–
300	Becton Dickinson and Co, 3,363 %, fällig 06.06.2024	327	0,03
828	Becton Dickinson and Co, 3,700 %, fällig 06.06.2027	940	0,09
2.100	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	1.729	0,17
1.320	Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01.09.2028	1.340	0,13
3.550	Blackstone Mortgage Trust Inc, 4,375 %, fällig 05.05.2022	3.426	0,34
480	Blackstone Mortgage Trust Inc, 4,750 %, fällig 15.03.2023	450	0,04
380	Boeing Co/The, 2,700 %, fällig 01.02.2027	369	0,04
500	Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030	561	0,06
1.310	Boeing Co/The, 3,250 %, fällig 01.02.2035	1.231	0,12
2.380	Boeing Co/The, 5,930 %, fällig 01.05.2060	2.923	0,29
2.220	Boyne USA Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.05.2025	2.361	0,23
120	Bristol-Myers Squibb Co, 5,000 %, fällig 15.08.2045	171	0,02
2.140	Bristol-Myers Squibb Co, 4,250 %, fällig 26.10.2049	2.858	0,28
1.600	Broadcom Inc, 4,150 %, fällig 15.11.2030	1.807	0,18
290	Builders FirstSource Inc, 144A, 6,750 %, fällig 01.06.2027	317	0,03
1.460	Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.07.2025	1.549	0,15
710	Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc, 144A, 5,750 %, fällig 01.07.2025	745	0,07
10	CalAtlantic Group Inc/old, 5,250 %, fällig 01.06.2026	10	–
590	Carriage Services Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.06.2026	626	0,06
2.530	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,000 %, fällig 01.02.2028	2.678	0,27
2.500	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 15.08.2030	2.656	0,26

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
1.700	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.05.2032	1.804	0,18
430	CD&R Smokey Buyer Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.07.2025	461	0,05
800	CDK Global Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.05.2029	873	0,09
1.220	CDW LLC / CDW Finance Corp, 4,125 %, fällig 01.05.2025	1.274	0,13
1.240	CDW LLC / CDW Finance Corp, 3,250 %, fällig 15.02.2029	1.270	0,13
1.250	Centene Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01.06.2026	1.320	0,13
2.270	Centene Corp, 144A, 5,375 %, fällig 15.08.2026	2.413	0,24
360	Centene Corp, 3,375 %, fällig 15.02.2030	375	0,04
1.110	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	1.273	0,13
80	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,384 %, fällig 23.10.2035	111	0,01
310	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	379	0,04
2.800	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	3.297	0,33
2.340	Cheniere Energy Inc, 4,250 %, fällig 15.03.2045	1.587	0,16
1.000	Cheniere Energy Partners LP, 4,500 %, fällig 01.10.2029	1.044	0,10
1.000	Cigna Corp, 4,800 %, fällig 15.08.2038	1.265	0,13
1.230	Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	1.431	0,14
300	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	530	0,05
400	Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 30.07.2045	519	0,05
500	Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 23.07.2048	674	0,07
1.110	CNX Midstream Partners LP / CNX Midstream Finance Corp, 144A, 6,500 %, fällig 15.03.2026	1.116	0,11
2.530	Cogent Communications Group Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.03.2022	2.615	0,26
820	Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	1.015	0,10
600	Comcast Corp, 4,700 %, fällig 15.10.2048	808	0,08
1.400	CommScope Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.03.2027	1.515	0,15
370	CommScope Technologies LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.03.2027	368	0,04
560	Comstock Resources Inc, 9,750 %, fällig 15.08.2026	598	0,06
3.100	Comstock Resources Inc, 9,750 %, fällig 15.08.2026	3.323	0,33
946	CoreCivic Inc, 4,625 %, fällig 01.05.2023	902	0,09
250	Costco Wholesale Corp, 1,600 %, fällig 20.04.2030	255	0,03
170	Costco Wholesale Corp, 1,750 %, fällig 20.04.2032	175	0,02
5.080	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	5.725	0,57
750	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	779	0,08
3.500	CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	4.306	0,43
EUR 910	CyrusOne LP / CyrusOne Finance Corp, 1,450 %, fällig 22.01.2027	1.074	0,11
325	DCP Midstream Operating LP, 3,875 %, fällig 15.03.2023	330	0,03
120	DCP Midstream Operating LP, 5,625 %, fällig 15.07.2027	130	0,01
600	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2037	603	0,06
363	Delta Air Lines 2007-1 Klasse A Pass Through Trust, Series 071A, 6,821 %, fällig 10.08.2022	363	0,04
1.000	Delta Air Lines Inc, 2,600 %, fällig 04.12.2020	1.000	0,10
760	Delta Air Lines Inc, 3,400 %, fällig 19.04.2021	762	0,08
2.170	Delta Air Lines Inc, 3,800 %, fällig 19.04.2023	2.086	0,21
2.100	Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig 28.10.2024	1.930	0,19
1.090	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	1.195	0,12
2.410	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	2.511	0,25
1.880	Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	1.886	0,19
980	Diamondback Energy Inc, 5,375 %, fällig 31.05.2025	1.021	0,10
3.970	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	4.551	0,45
1.400	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	1.384	0,14
1.340	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig 15.06.2025	1.496	0,15
1.140	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2025	1.189	0,12
827	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,500 %, fällig 30.01.2026	829	0,08
483	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig 30.01.2028	495	0,05
330	Energizer Holdings Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.07.2026	351	0,03
1.120	Entegris Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2028	1.173	0,12
300	Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, fällig 31.01.2051	307	0,03
1.000	Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31.01.2060	1.022	0,10
550	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000 %, fällig 01.07.2025	584	0,06
490	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, fällig 01.07.2027	537	0,05
1.000	EQT Corp, 7,875 %, fällig 01.02.2025	1.149	0,11
660	Exxon Mobil Corp, 4,327 %, fällig 19.03.2050	849	0,08
750	Exxon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15.04.2051	844	0,08
1.000	FirstEnergy Corp, Series B, 3,900 %, fällig 15.07.2027	1.099	0,11
1.500	FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, fällig 15.11.2031	2.126	0,21
2.670	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, fällig 15.11.2025	2.692	0,27
1.510	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21.04.2023	1.672	0,17
2.010	Ford Motor Co, 9,000 %, fällig 22.04.2025	2.355	0,23
880	Ford Motor Credit Co LLC, 3,200 %, fällig 15.01.2021	882	0,09
600	Ford Motor Credit Co LLC, 3,219 %, fällig 09.01.2022	599	0,06
1.260	Ford Motor Credit Co LLC, 3,087 %, fällig 09.01.2023	1.255	0,12
1.060	Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, fällig 16.06.2025	1.115	0,11
1.290	Fox Corp, 4,709 %, fällig 25.01.2029	1.552	0,15
1.210	Fox Corp, 5,476 %, fällig 25.01.2039	1.607	0,16
620	Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig 01.08.2030	664	0,07
4.000	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	4.499	0,45
4.520	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10.01.2039	5.767	0,57
420	General Electric Co, 4,250 %, fällig 01.05.2040	425	0,04
180	General Electric Co, 4,350 %, fällig 01.05.2050	183	0,02
920	General Motors Co, 6,125 %, fällig 01.10.2025	1.081	0,11
520	General Motors Co, 6,250 %, fällig 02.10.2043	607	0,06
965	GEO Group Inc/The, 5,875 %, fällig 15.01.2022	942	0,09
320	GEO Group Inc/The, 5,875 %, fällig 15.10.2024	252	0,02
1.437	GEO Group Inc/The, 6,000 %, fällig 15.04.2026	1.106	0,11
680	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,750 %, fällig 01.06.2028	775	0,08
1.440	Golden Nugget Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2024	1.228	0,12
610	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16.11.2026	681	0,07
1.580	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	2.109	0,21
400	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig 21.10.2045	535	0,05
1.000	Hanesbrands Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.05.2024	1.053	0,10
1.060	Hanesbrands Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.05.2025	1.132	0,11
360	Hanesbrands Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15.05.2026	393	0,04
600	HCA Inc, 5,375 %, fällig 01.02.2025	676	0,07
2.600	HCA Inc, 5,625 %, fällig 01.09.2028	3.097	0,31
3.250	HCA Inc, 5,500 %, fällig 15.06.2047	4.136	0,41
2.020	Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.05.2025	2.120	0,21
2.160	Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,750 %, fällig 01.05.2028	2.284	0,23
2.400	iHeartCommunications Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.01.2028	2.295	0,23
950	International Game Technology Plc, 144A, 5,250 %, fällig 15.01.2029	975	0,10
750	IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2025	802	0,08
340	j2 Cloud Services LLC / j2 Cloud Co-Obligor Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.07.2025	354	0,03
401	Kraft Heinz Foods Co, 3,950 %, fällig 15.07.2025	436	0,04
60	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 3,875 %, fällig 15.05.2027	64	0,01
200	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 4,250 %, fällig 01.03.2031	222	0,02
120	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 4,875 %, fällig 01.10.2049	133	0,01
1.600	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 5,500 %, fällig 01.06.2050	1.900	0,19
890	L Brands Inc, 5,625 %, fällig 15.10.2023	930	0,09
570	L Brands Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.07.2025	618	0,06
3.130	L Brands Inc, 5,250 %, fällig 01.02.2028	3.012	0,30
2.450	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.08.2021	2.447	0,24
340	Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15.05.2028	375	0,04
850	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	861	0,09

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
70	Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25.06.2025	70	0,01
600	Las Vegas Sands Corp, 3,500 %, fällig 18.08.2026	613	0,06
1.010	Lennar Corp, 4,500 %, fällig 30.04.2024	1.086	0,11
800	Lennar Corp, 4,750 %, fällig 29.11.2027	913	0,09
1.000	LifePoint Health Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.02.2027	1.000	0,10
2.370	Lions Gate Capital Holdings LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.11.2024	2.396	0,24
560	Live Nation Entertainment Inc, 144A, 2,000 %, fällig 15.02.2025	507	0,05
220	Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375 %, fällig 15.04.2050	229	0,02
350	Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	442	0,04
2.010	Match Group Holdings II LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.12.2027	2.150	0,21
2.530	Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.06.2028	2.670	0,26
810	MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	941	0,09
1.400	MGIC Investment Corp, 5,250 %, fällig 15.08.2028	1.473	0,15
720	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc, 4,500 %, fällig 01.09.2026	758	0,07
2.500	Michaels Stores Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.07.2027	2.529	0,25
2.620	Mohegan Gaming & Entertainment, 144A, 7,875 %, fällig 15.10.2024 †	2.487	0,25
3.500	Montage Resources Corp, 8,875 %, fällig 15.07.2023	3.590	0,36
590	MPH Acquisition Holdings LLC, 144A, 7,125 %, fällig 01.06.2024	600	0,06
2.700	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, fällig 15.10.2027	2.860	0,28
GBP 1.326	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692 %, fällig 05.06.2028	1.788	0,18
1.370	NCL Corp Ltd, 144A, 12,250 %, fällig 15.05.2024	1.528	0,15
1.490	NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 15.12.2024	1.023	0,10
1.690	NCL Corp Ltd, 144A, 10,250 %, fällig 01.02.2026	1.705	0,17
10	Netflix Inc, 5,875 %, fällig 15.11.2028	12	–
2.890	Netflix Inc, 6,375 %, fällig 15.05.2029	3.652	0,36
1.000	Netflix Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15.06.2030	1.157	0,11
440	New York Life Insurance Co, 144A, 3,750 %, fällig 15.05.2050	502	0,05
730	Newell Brands Inc, 4,875 %, fällig 01.06.2025	792	0,08
3.550	Newell Brands Inc, 4,700 %, fällig 01.04.2026	3.830	0,38
3.820	NGPL PipeCo LLC, 144A, 7,768 %, fällig 15.12.2037	4.665	0,46
1.420	NMI Holdings Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2025	1.535	0,15
2.790	Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.11.2022 ƐƐ	48	–
1.190	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	1.354	0,13
2.260	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, fällig 15.03.2022 † Ɛ	446	0,04
1.390	Oasis Petroleum Inc, 6,875 %, fällig 15.01.2023 † Ɛ	271	0,03
770	Occidental Petroleum Corp, 1,730 %, fällig 15.08.2022 *	728	0,07
3.642	Occidental Petroleum Corp, 7,150 %, fällig 15.05.2028	3.624	0,36
250	Occidental Petroleum Corp, 8,875 %, fällig 15.07.2030	283	0,03
500	Olin Corp, 5,000 %, fällig 01.02.2030	484	0,05
1.210	ON Semiconductor Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.09.2028	1.267	0,13
2.500	Owl Rock Capital Corp, 4,000 %, fällig 30.03.2025	2.520	0,25
990	Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, fällig 15.04.2027	900	0,09
1.750	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 5,625 %, fällig 15.10.2027	1.815	0,18
2.400	PDC Energy Inc, 1,125 %, fällig 15.09.2021	2.328	0,23
2.630	PetSmart Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.03.2023	2.653	0,26
1.140	PetSmart Inc, 144A, 8,875 %, fällig 01.06.2025	1.185	0,12
1.940	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.04.2026	2.148	0,21
3.710	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 3,375 %, fällig 31.08.2027	3.706	0,37
780	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2028	820	0,08
1.550	Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.02.2028	1.655	0,16
810	Range Resources Corp, 5,750 %, fällig 01.06.2021	817	0,08
1.360	Range Resources Corp, 5,875 %, fällig 01.07.2022	1.382	0,14
767	Range Resources Corp, 5,000 %, fällig 15.08.2022	773	0,08
540	Range Resources Corp, 5,000 %, fällig 15.03.2023	539	0,05
3.360	Range Resources Corp, 144A, 9,250 %, fällig 01.02.2026	3.544	0,35
790	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15.06.2025	832	0,08
760	Royal Caribbean Cruises Ltd, 2,650 %, fällig 28.11.2020	760	0,08
1.415	RR Donnelley & Sons Co, 8,250 %, fällig 01.07.2027	1.408	0,14
510	Sensata Technologies Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.02.2030	539	0,05
500	ServiceMaster Co LLC/The, 7,450 %, fällig 15.08.2027	545	0,05
1.210	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2028	1.240	0,12
1.907	Silversea Cruise Finance Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 01.02.2025	1.920	0,19
570	Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15.11.2028	729	0,07
5.680	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	8.585	0,85
350	Sprint Corp, 7,250 %, fällig 15.09.2021	370	0,04
480	Standard Industries Inc/ NJ, 144A, 4,750 %, fällig 15.01.2028	506	0,05
750	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp, 144A, 5,250 %, fällig 15.01.2029	788	0,08
2.160	SunOpta Foods Inc, 144A, 9,500 %, fällig 09.10.2022	2.217	0,22
1.200	Talen Energy Supply LLC, 144A, 10,500 %, fällig 15.01.2026	966	0,10
300	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 6,500 %, fällig 15.07.2027	325	0,03
160	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 6,875 %, fällig 15.01.2029	177	0,02
1.480	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01.02.2031	1.501	0,15
452	Taylor Morrison Communities Inc, 144A, 5,875 %, fällig 31.01.2025	461	0,05
1.200	Tenet Healthcare Corp, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2025	1.319	0,13
600	Tenet Healthcare Corp, 144A, 5,125 %, fällig 01.11.2027	635	0,06
540	Tenet Healthcare Corp, 144A, 4,625 %, fällig 15.06.2028	561	0,06
1.200	Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01.03.2030	1.258	0,12
50	Time Warner Cable LLC, 6,550 %, fällig 01.05.2037	67	0,01
220	Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig 15.06.2039	307	0,03
1.690	T-Mobile USA Inc, 4,750 %, fällig 01.02.2028	1.823	0,18
400	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 144A, 3,250 %, fällig 15.05.2030	436	0,04
2.180	TransDigm Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.12.2025	2.373	0,24
2.360	TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	2.494	0,25
1.140	TreeHouse Foods Inc, 4,000 %, fällig 01.09.2028	1.163	0,12
1.760	Twitter Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2027	1.862	0,18
690	Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig 20.03.2060	809	0,08
640	United Airlines 2015-1 Klasse A Pass Through Trust, 3,700 %, fällig 01.12.2022	599	0,06
120	United Airlines Holdings Inc, 6,000 %, fällig 01.12.2020	121	0,01
910	United Rentals North America Inc, 4,625 %, fällig 15.10.2025	932	0,09
730	United Rentals North America Inc, 5,500 %, fällig 15.05.2027	783	0,08
1.480	United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2027	1.545	0,15
1.510	United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15.01.2030	1.680	0,17
2.170	Univision Communications Inc, 144A, 9,500 %, fällig 01.05.2025	2.387	0,24
1.200	US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig 15.07.2027	1.296	0,13
600	Verizon Communications Inc, 3,376 %, fällig 15.02.2025	672	0,07
780	Verizon Communications Inc, 4,522 %, fällig 15.09.2048	1.028	0,10
2.690	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2030	2.693	0,27
600	Viper Energy Partners LP, 144A, 5,375 %, fällig 01.11.2027	619	0,06
500	Visa Inc, 2,700 %, fällig 15.04.2040	542	0,05
1.420	Vishay Intertechnology Inc, 2,250 %, fällig 15.06.2025	1.388	0,14
4.500	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	3.745	0,37
680	Wells Fargo & Co, 2,879 %, fällig 30.10.2030 *	732	0,07
360	Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04.04.2031 *	440	0,04
730	Wells Fargo & Co, 4,650 %, fällig 04.11.2044	892	0,09
1.730	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	2.370	0,23
1.710	Wendy's International LLC, 7,000 %, fällig 15.12.2025	1.901	0,19

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
840	Western Midstream Operating LP, 5,375 %, fällig 01.06.2021	853	0,08
720	Western Midstream Operating LP, 4,000 %, fällig 01.07.2022	734	0,07
3.450	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig 01.04.2044	3.199	0,32
1.780	Western Midstream Operating LP, 5,300 %, fällig 01.03.2048	1.598	0,16
340	William Carter Co/The, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2025	365	0,04
1.736	Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15.03.2032	2.508	0,25
1.120	WPX Energy Inc, 8,250 %, fällig 01.08.2023	1.263	0,13
1.630	WPX Energy Inc, 5,250 %, fällig 15.10.2027	1.624	0,16
1.210	WPX Energy Inc, 4,500 %, fällig 15.01.2030	1.158	0,11
1.360	WW International Inc, 144A, 8,625 %, fällig 01.12.2025	1.436	0,14
810	Wyndham Hotels & Resorts Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.08.2028	818	0,08
2.830	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,750 %, fällig 15.04.2025	2.975	0,29
900	XHR LP, 144A, 6,375 %, fällig 15.08.2025	925	0,09
2.627	XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig 01.05.2034	2.803	0,28
		385.785	38,26
Sambia — 0,55 % (29. Februar 2020: 0,58 %)			
5.420	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 01.04.2023	5.516	0,55
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 533.159 USD)		559.930	55,53
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 10,37 % (29. Februar 2020: 14,92 %)			
Argentinien — 0,68 % (29. Februar 2020: 1,10 %)			
ARS 15.067	Argentina Treasury Bond BONCER, Series CER, 1,000 %, fällig 05.08.2021 † β	138	0,01
430	Argentine Republic Government International Bond, 7,500 %, fällig 22.04.2026 ƺ	198	0,02
637	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 10,875 %, fällig 26.01.2021	326	0,03
1.770	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144A, 9,950 %, fällig 09.06.2021 ƺ	858	0,08
1.190	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 9,950 %, fällig 09.06.2021 ƺ	577	0,06
5.190	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2023 ƺ	2.426	0,24
1.200	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144A, 9,125 %, fällig 16.03.2024 ƺ	570	0,06
580	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144A, 7,875 %, fällig 15.06.2027 ƺ	276	0,03
2.090	Provincia de Cordoba, 144A, 7,450 %, fällig 01.09.2024 ƺ	1.494	0,15
		6.863	0,68
Brasilien — 0,97 % (29. Februar 2020: 1,02 %)			
BRL 20.051	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	4.286	0,42
BRL 2.800	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2029	607	0,06
4.660	Brazilian Government International Bond, 5,000 %, fällig 27.01.2045	4.892	0,49
		9.785	0,97
Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) — 0,18 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
598	Ivory Coast Government International Bond, 5,750 %, fällig 31.12.2032	587	0,06
1.180	Ivory Coast Government International Bond, 6,125 %, fällig 15.06.2033	1.194	0,12
		1.781	0,18
Ägypten — 0,15 % (29. Februar 2020: 1,07 %)			
1.490	Egypt Government International Bond, 144A, 7,600 %, fällig 01.03.2029	1.571	0,15
Ghana — 0,24 % (29. Februar 2020: 0,44 %)			
470	Ghana Government International Bond, 8,125 %, fällig 18.01.2026	483	0,05
770	Ghana Government International Bond, 144A, 7,625 %, fällig 16.05.2029	740	0,07
1.230	Ghana Government International Bond, 144A, 8,125 %, fällig 26.03.2032	1.173	0,12
		2.396	0,24
Indonesien — 2,80 % (29. Februar 2020: 3,37 %)			
360	Indonesia Government International Bond, 5,875 %, fällig 15.01.2024	415	0,04
2.020	Indonesia Government International Bond, 3,500 %, fällig 11.01.2028	2.227	0,22
1.590	Indonesia Government International Bond, 6,625 %, fällig 17.02.2037	2.277	0,23
3.290	Indonesia Government International Bond, 5,250 %, fällig 17.01.2042	4.273	0,42
IDR 760.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR61, 7,000 %, fällig 15.05.2022	55	0,01
IDR 37.154.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR56, 8,375 %, fällig 15.09.2026	2.853	0,28
IDR 226.122.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	16.110	1,60
IDR 721.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR68, 8,375 %, fällig 15.03.2034	54	–
		28.264	2,80
Israel — 0,21 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1.140	Israel Government International Bond, 2,750 %, fällig 03.07.2030	1.259	0,13
700	Israel Government International Bond, 3,875 %, fällig 03.07.2050	838	0,08
		2.097	0,21
Japan — 0,09 % (29. Februar 2020: 0,10 %)			
JPY 92.200	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 21, 0,100 %, fällig 10.03.2026 β	886	0,09
Kasachstan — 0,29 % (29. Februar 2020: 0,32 %)			
2.460	Kazakhstan Government International Bond, 5,125 %, fällig 21.07.2025	2.888	0,29
Kuwait — 0,33 % (29. Februar 2020: 0,26 %)			
2.990	Kuwait International Government Bond, 144A, 3,500 %, fällig 20.03.2027	3.390	0,33
Mexiko — 0,86 % (29. Februar 2020: 0,71 %)			
MXN 58.000	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	3.134	0,31
470	Mexico Government International Bond, 3,600 %, fällig 30.01.2025	511	0,05
4.500	Mexico Government International Bond, 4,750 %, fällig 08.03.2044	5.066	0,50
		8.711	0,86
Panama — 0,21 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1.600	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 01.04.2056	2.086	0,21
Peru — 0,26 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
2.400	Peruvian Government International Bond, 2,783 %, fällig 23.01.2031	2.620	0,26
Katar — 0,46 % (29. Februar 2020: 0,49 %)			
1.800	Qatar Government International Bond, 144A, 5,103 %, fällig 23.04.2048	2.556	0,25
1.500	Qatar Government International Bond, 144A, 4,817 %, fällig 14.03.2049	2.056	0,21
		4.612	0,46
Russland — 1,71 % (29. Februar 2020: 1,84 %)			
RUB 1.185.489	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028	17.280	1,71
Vereinigte Arabische Emirate — 0,86 % (29. Februar 2020: 0,93 %)			
5.460	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 2,125 %, fällig 30.09.2024	5.703	0,56
2.350	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 4,125 %, fällig 11.10.2047	2.980	0,30
		8.683	0,86
USA — 0,07 % (29. Februar 2020: 2,55 %)			
300	United States Treasury Note/ Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	402	0,04
256	United States Treasury Note/ Bond, 2,250 %, fällig 15.08.2049	304	0,03
		706	0,07
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 106.442 USD)		104.619	10,37
Schuldverschreibungen — 8,57 % (29. Februar 2020: 9,70 %)			
430	8Th Avenue Food & Provisions Inc, 7,912 %, fällig 01.10.2026 *	425	0,04
452	Academy Ltd, 5,000 %, fällig 02.07.2022 *†	427	0,04
1.163	ACProducts Inc, 7,500 %, fällig 02.09.2025 *	1.167	0,12
838	Acrisure LLC, 3,661 %, fällig 15.02.2027 *	807	0,08
2.033	Advantage Sales & Marketing Inc, 4,250 %, fällig 25.07.2021 *†	1.937	0,19
530	Air Medical Group Holdings Inc, 4,250 %, fällig 28.04.2022 *	526	0,05
359	Allen Media LLC, 5,801 %, fällig 10.02.2027 *	347	0,03
739	Allied Universal Holdco LLC, 4,411 %, fällig 12.07.2026 *	735	0,07
1.367	Alterra Mountain Co, 5,500 %, fällig 01.08.2026 *	1.367	0,14
1.568	Alterra Mountain Co, 2,911 %, fällig 31.07.2024 *	1.514	0,15
1.340	Amentum Government Services Holdings LLC, 4,161 %, fällig 03.02.2027 *	1.340	0,13
876	American Axle & Manufacturing Inc, 3,000 %, fällig 06.04.2024 *	856	0,09
197	APi Group Inc, 2,661 %, fällig 01.10.2026 *	194	0,02
1.136	AppLovin Corporation, 3,661 %, fällig 15.08.2025 *	1.127	0,11
1.210	Aristocrat International Pty Ltd, 4,750 %, fällig 19.10.2024 *	1.216	0,12
1.822	Asurion LLC, 3,161 %, fällig 03.11.2024 *	1.794	0,18
1.750	Asurion LLC, 3,161 %, fällig 03.11.2023 *	1.723	0,17
613	Bass Pro Group LLC, 6,072 %, fällig 25.09.2024 *	612	0,06
1.247	Berry Global Inc, 2,155 %, fällig 01.07.2026 *	1.214	0,12

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
1.170	Boyd Gaming Corp, 2,372 %, fällig 15.09.2023 *	1.141	0,11
737	Brightview Landscapes LLC, 2,688 %, fällig 15.08.2025 *	729	0,07
2.520	Caesars Resort Collection LLC, 2,911 %, fällig 22.12.2024 *	2.377	0,24
2.290	Caesars Resort Collection LLC, 4,703 %, fällig 19.06.2025 *	2.227	0,22
338	Change Healthcare Holdings LLC, 3,500 %, fällig 01.03.2024 *	332	0,03
3.100	Chesapeake Energy Corp, – %, fällig 23.06.2024 *	2.057	0,20
897	Corrections Corporation of America, 5,500 %, fällig 12.12.2024 *	887	0,09
6.345	CWGS Group LLC, 3,500 %, fällig 08.11.2023 *	6.155	0,61
938	DCert Buyer, Inc., 4,161 %, fällig 16.10.2026 *	928	0,09
610	Deerfield Dakota Holding LLC, 4,750 %, fällig 05.03.2027 *	609	0,06
122	Dell International LLC, 2,750 %, fällig 19.09.2025 *	121	0,01
300	Douglas Dynamics LLC, 4,750 %, fällig 08.06.2026 *	299	0,03
283	Entercom Media Corp, 2,673 %, fällig 17.11.2024 *	268	0,03
660	Equinox Holdings Inc, 10,000%, fällig 08.03.2024 *	657	0,07
785	Eyecare Partners LLC, 4,822%, fällig 05.02.2027 *	735	0,07
184	Eyecare Partners LLC, 0,500%, fällig 05.02.2027 *	172	0,02
1.300	Eyecare Partners LLC, 8,558%, fällig 21.01.2027 *	1.217	0,12
EUR 790	Froneri Lux FinCo SARL, 2,625 %, fällig 30.01.2027 *	918	0,09
1.150	Froneri U.S. Inc, 2,411 %, fällig 30.01.2027 *	1.110	0,11
1.493	Garda World Security Corp, 4,930 %, fällig 23.10.2026 *	1.494	0,15
259	Genesee & Wyoming Inc, 2,308 %, fällig 05.11.2026 *	256	0,03
1.304	Global Tel'Link Corp, 4,411 %, fällig 29.11.2025 *	1.139	0,11
310	Global Tel'Link Corp, 8,411 %, fällig 29.11.2026 *	218	0,02
787	GlobalTranz Enterprises Inc, 5,158 %, fällig 02.05.2026 *	670	0,07
640	Hilton Worldwide Finance LLC, 1,925 %, fällig 21.06.2026 *	618	0,06
1.232	iHeartCommunications Inc, 3,161 %, fällig 01.05.2026 *	1.169	0,12
1.247	Jaguar Holding Co II, 3,500 %, fällig 18.08.2022 *	1.245	0,12
2.680	JetBlue Airways Corp, 6,250 %, fällig 17.06.2024 *	2.680	0,27
180	Leslie's Poolmart Inc, 3,661 %, fällig 16.08.2023 *	177	0,02
22	MA FinanceCo. LLC, 2,661 %, fällig 18.04.2024 *	21	–
1.613	McAfee LLC, 3,916 %, fällig 29.09.2024 *	1.602	0,16
2.901	Mohegan Tribal Gaming Authority, 5,375 %, fällig 13.10.2023 * †	2.643	0,26
1.466	MPH Acquisition Holdings LLC, 3,750 %, fällig 07.06.2023 *	1.454	0,14
249	Nielsen Finance LLC, 4,750 %, fällig 30.06.2025 *	251	0,03
1.194	Option Care Health Inc, 4,661 %, fällig 06.08.2026 *	1.192	0,12
1.479	Panther BF Aggregator 2 LP, 3,667 %, fällig 18.03.2026 *	1.454	0,14
990	Particle Investments S.a.r.l., 5,750 %, fällig 11.05.2027 *	985	0,10
1.418	Party City Holdings Inc, 4,100 %, fällig 19.08.2022 *	1.003	0,10
1.773	Petco Animal Supplies Inc, 4,250 %, fällig 26.01.2023 *	1.525	0,15
674	PetSmart Inc, 5,000 %, fällig 11.03.2022 *	675	0,07
535	Phoenix Guarantor Inc, 3,412 %, fällig 05.03.2026 *	526	0,05
370	Radiology Partners Inc, 5,985 %, fällig 09.07.2025 *	355	0,04
1.643	Radnet Management Inc, 4,750 %, fällig 01.07.2023 *	1.637	0,16
661	RegionalCare Hospital Partners Holding, 3,911 %, fällig 16.11.2025 *	650	0,07
351	Reynolds Consumer Products LLC, 1,911 %, fällig 04.02.2027 *	347	0,03
142	Science Applications International Corp, 0,000 %, fällig 13.03.2027 *	141	0,01
1.426	Scientific Games International Inc, 3,612 %, fällig 14.08.2024 *	1.337	0,13
150	Seattle SpinCo Inc, 2,661 %, fällig 18.04.2024 *	142	0,01
985	Sedgwick Claims Management Services Inc, 3,411 %, fällig 05.11.2025 *	953	0,10
870	Sedgwick Claims Management Services Inc, 5,250 %, fällig 03.09.2026 *	868	0,09
246	Stars Group Holdings BV, 3,808 %, fällig 10.07.2025 *	247	0,02
1.130	Surf Holdings LLC, 3,827 %, fällig 14.10.2026 *	1.107	0,11
6	Terrier Media Buyer Inc, 4,411 %, fällig 17.12.2026 *	6	–
1.145	TKC Holdings Inc, 4,750 %, fällig 01.02.2023 *	1.079	0,11
352	U.S. Renal Care Inc, 5,187 %, fällig 14.06.2026 *	345	0,03
1.775	UFC Holdings LLC, 4,250 %, fällig 29.04.2026 *†	1.756	0,17
1.737	Ultimate Software Group Inc, 3,911 %, fällig 08.04.2026 *	1.727	0,17
1.145	Univision Communications Inc, 4,750 %, fällig 24.03.2026 *	1.123	0,11
1.247	USI Inc, 0,000 %, fällig 16.05.2024 *	1.217	0,12
1.158	Valeant Pharmaceuticals International, 3,176 %, fällig 28.05.2025 *	1.141	0,11
50	VFH Parent LLC, 3,164 %, fällig 01.03.2026 *	49	0,01
800	Virgin Media Bristol LLC, 2,662 %, fällig 04.01.2028 *	781	0,08
1.304	VVC Holding Corp, 4,818 %, fällig 11.02.2026 *	1.297	0,13
1.910	WP CityMD Bidco LLC, 5,572 %, fällig 13.08.2026 *	1.904	0,19
1.000	Ziggo BV, 2,662 %, fällig 15.04.2028 *	969	0,10
Schuldverschreibungen insgesamt (Kosten 88.344 USD)		86.442	8,57
Kollektive Kapitalanlagen — 1,91 % (29. Februar 2020: 1,02 %)			
90	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Klasse US$ Distribución (M)	9.181	0,91
EUR 84	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Klasse Euro Acumulación	10.076	1,00
Gesamt Kollektive Kapitalanlagen (Kosten **18.151 USD)**		19.257	1,91
Vorzugsaktien — 0,09 % (29. Februar 2020: 0,19 %)			
USA — 0,09 % (29. Februar 2020: 0,19 %)			
30	B Riley Financial Inc	719	0,07
9	B Riley Financial Inc	233	0,02
		952	0,09
Vorzugsaktien insgesamt (Kosten 991 USD)		952	0,09
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 960.513 USD)		968.050	96,00
Gekaufte Optionen — 0,12 % (29. Februar 2020: 0,53 %)			
–	S&P 500 E-mini September 2020 Put 2.800,00, fällig 18.09.2020	5	–
–	S&P 500 E-mini W3 Oktober 2020 Put 3.000,00, fällig 16.10.2020	170	0,02
–	U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 139,50, fällig 25.09.2020	13	–
–	U.S. Bond Oktober 2020 Call 177,00, fällig 25.09.2020	20	–
–	U.S. Bond Oktober 2020 Call 179,00, fällig 25.09.2020	17	–
10.380	USD Call/GBP Put 1,2773, fällig 002.10.2020	7	–
9.540	USD Put/EUR Call 1,1385, fällig 14.09.2020	467	0,05
14.310	USD Put/EUR Call 1,1550, fällig 28.09.2020	497	0,05
4.360	USD Put/RUB Call 72,0565, fällig 20.10.2020	37	–
Summe gekaufte Optionen (Kosten 1.217 USD)		1.233	0,12
Zinsswaps — 0,48 % (29. Februar 2020: 0,19 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		4.843	0,48
Devisenterminkontrakte — 2,33 % (29. Februar 2020: 0,45 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		23.499	2,33
Termingeschäfte — 0,12 % (29. Februar 2020: 0,75 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1.228	0,12
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		998.853	99,05
Geschriebene Optionen — (0,02 %) (29. Februar 2020: (0,30 %))			
–	S&P 500 E-mini September 2020 Put 2.500,00, fällig 18.09.2020	(2)	–
–	S&P 500 E-mini W3 Oktober 2020 Put 2.750,00, fällig 16.10.2020	(60)	(0,01)
–	S&P 500 E-mini W3 Oktober 2020 Put 2.800,00, fällig 16.10.2020	(35)	–
–	U.S. 10 Year Oktober 2020 Call 140,50, fällig 25.09.2020	(3)	–
–	U.S. 10 Year Oktober 2020 Put 138,00, fällig 25.09.2020	(5)	–
–	U.S. Bond Oktober 2020 Put 173,00, fällig 25.09.2020	(13)	–
–	U.S. Bond Oktober 2020 Put 175,00, fällig 25.09.2020	(53)	–
(14.310)	USD Call/EUR Put 1,0960, fällig 28.09.2020		–
(4.360)	USD Call/RUB Put 75,2830, fällig 20.10.2020	(81)	(0,01)
Geschriebene Optionen insgesamt (Kosten (650) USD)		(252)	(0,02)
Kreditausfallversicherungen — (0,04 %) (29. Februar 2020: (0,05 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(444)	(0,04)
Zinsswaps —(0,08 %) (29. Februar 2020: (0,72 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(797)	(0,08)
Devisenterminkontrakte — (0,47 %) (29. Februar 2020: (1,15 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(4.709)	(0,47)
Termingeschäfte — (0,14 %) (29. Februar 2020: (0,53 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(1.427)	(0,14)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(7.629)	(0,75)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt	991.224	98,30
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	17.135	1,70
Gesamtnettovermögen	1.008.359$	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 430,465,000 USD und machten 42.65 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

† Illiquide.

∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

ε Das Wertpapier ist zum oder seit Ende des Berichtszeitraums am 31. August 2020 in Verzug (entweder Tilgungs- und / oder Zinszahlungen).

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (VPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihzins entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

Die Gegenparteien für die OTC-Optionen sind Citi, Goldman Sachs und Morgan Stanley.

ABKÜRZUNGEN:

CPI – Verbraucherpreisindex
Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit
ARS – Argentinischer Peso
BRL – Brasilianischer Real
EUR – Euro
GBP – Britisches Pfund Sterling
IDR – Indonesische Rupiah
JPY – Japanischer Yen
MXN – Mexikanischer Peso
RUB – Russischer Rubel

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt-vermö-gens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	83,96
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	8,42
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,87
Finanzderivate	3,00
Sonstige Vermögenswerte	2,75
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 %	Kauf	20.06.2025	7.760	$ (444)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Kreditausfallversicherungen (29. Februar 2020 (in Tsd.):– USD)					$ -
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (447) USD)					(444)
Nettowertminderung von Kreditausfallversicherungen (29. Februar 2020 (in Tsd.): (447) USD)					$ (444)

Aufstellung der Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,200 %	17.07.2024	227.766	$ 865
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,770 %	24.03.2027	25.520	523
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,450 %	18.07.2029	170.990	963
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,440 %	20.07.2029	178.050	997
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,850 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.2044	4.559	(797)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,560 %, Receive Floating USD Sofr Compound	20.07.2045	14.690	840
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,740 %, Receive Floating USD Sofr Compound	19.08.2045	2.060	32
Citi	Pay Floating BRL CDI CETIP, Receive Fixed 7,024 %	04.01.2027	9.200	66
Citi	Pay Floating BRL CDI CETIP, Receive Fixed 7,024 %	04.01.2027	9.829	71
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024 %	04.01.2027	7.800	56
JP Morgan	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,380 %	31.08.2024	44.777	195
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 6,870 %	04.01.2027	32.130	188
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,044 %	04.01.2027	6.400	47
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): 1.698 USD)				$ 4.843
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (6.314) USD)				(797)
Nettowertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (4.616) USD)				$ 4.046

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	145	Verkauf	GBP	110	$ (2)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–	–
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf	GBP	4	–
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	16	Verkauf	USD	21	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	568	Verkauf	GBP	425	(1)
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	3	Verkauf	USD	4	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	CHF	–	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	488	Verkauf	EUR	409	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	6.831	Verkauf	GBP	5.167	(73)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CHF	46	Verkauf	USD	50	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	650.057	Verkauf	USD	849.821	19.241
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	109.862	Verkauf	USD	78.736	2.297
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	44.981	Verkauf	USD	53.091	607
15.09.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	4.748	Verkauf	EUR	4.170	(231)
24.09.2020	Citi	Kauf	USD	5.513	Verkauf	SAR	20.710	(8)
24.09.2020	JP Morgan	Kauf	USD	3.012	Verkauf	SAR	11.330	(9)
29.09.2020	JP Morgan	Kauf	USD	6.412	Verkauf	EUR	5.700	(395)
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	USD	1.437	Verkauf	CAD	1.920	(35)
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	USD	51.488	Verkauf	EUR	45.679	(3.078)
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	USD	21	Verkauf	TRY	149	1
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	CAD	12.080	Verkauf	USD	8.826	437
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	EUR	390	Verkauf	USD	459	7
16.10.2020	Citi	Kauf	USD	3.976	Verkauf	GBP	3.114	(188)
16.10.2020	Citi	Kauf	USD	2.085	Verkauf	MXN	47.144	(57)
16.10.2020	Citi	Kauf	EUR	4.130	Verkauf	USD	4.885	49
16.10.2020	Citi	Kauf	RUB	80.520	Verkauf	USD	1.083	(5)
16.10.2020	Citi	Kauf	MXN	111.120	Verkauf	USD	4.850	199
16.10.2020	Citi	Kauf	USD	1	Verkauf	ZAR	12	–
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	3.982	Verkauf	BRL	21.395	82
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.774	Verkauf	MXN	62.750	(78)
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	4.997	Verkauf	RUB	364.741	108
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	RUB	160.050	Verkauf	USD	2.153	(7)
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	RUB	92.503	Verkauf	USD	1.231	9
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	JPY	597.057	Verkauf	USD	5.559	81
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	1.026	Verkauf	AUD	1.480	(66)
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	6.433	Verkauf	CAD	8.640	(193)
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	16.216	Verkauf	IDR	240.362.624	(194)
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	–	Verkauf	INR	2	–
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	1.424	Verkauf	NOK	13.220	(89)
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	CAD	7.315	Verkauf	USD	5.390	218
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	NOK	21.230	Verkauf	USD	2.268	163
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 3.957 USD)								$ 23.499
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (10.082) USD)								(4.709)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (6.125) USD)								$ 18.790

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro$ März 2021	(508)	$(126.746)	$ (168)
Australie 10 Year Bond September 2020	46	5.003	12
Euro-Bund Dezember 2020	(37)	(7.627)	31
Euro-Bund September 2020	(41)	(8.589)	(22)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2020	(2)	(518)	(3)
Long Gilt Dezember 2020	(16)	(2.888)	27
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	(819)	(114.046)	107
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2020	5	797	(3)
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2020	1.176	259.832	55
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	(482)	(60.747)	(32)
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	(507)	(89.089)	996
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	310	68.481	(1.199)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 6.584 USD)			$ (1.228)
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(4.663) USD)			(1.427)
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):1.921 USD)			$ (199)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 13,99 % (29. Februar 2020: 19,98 %)			
1.190	Accredited Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Klasse M5, 3,475 %, fällig 25.04.2035 *	1.189	0,10
4.560	Aegis Asset Backed Securities Trust 2005-3, Series 2005 3, Klasse M3, 0,665 %, fällig 25.08.2035 *	3.724	0,32
33	AFC Trust Series 2000-3, Series 2000 3, Klasse 1A, 144A, 0,925 %, fällig 25.10.2030 *	31	–
2.235	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2019 1A, Klasse A2I, 144A, 4,194 %, fällig 07.06.2049	1.945	0,17
12.000	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2019 1A, Klasse A2II, 144A, 4,723 %, fällig 07.06.2049	10.203	0,88
4.210	Asset Backed Securities Corp Home Equity Loan Trust Series OOMC 2006-HE5, Series 2006 HE5, Klasse M1, 0,455 %, fällig 25.07.2036 *	3.349	0,29
2.390	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Series 1996 1, Klasse B1, 7,875 %, fällig 10.10.2026	379	0,03
993	Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Series 2007 B, Klasse 1A2, 6,831 %, fällig 28.08.2047	991	0,09
1.244	Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Series 2007 B, Klasse 1A3, 7,219 %, fällig 28.08.2047	495	0,04
173	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Series 2005 CL1, Klasse A1, 0,500 %, fällig 25.09.2034 *	166	0,01
176	Bear Stearns Asset Backed Securities Trust 2006-1, Series 2006 1, Klasse M1, 0,675 %, fällig 25.02.2036 *	177	0,02
4.082	Citigroup Mortgage Loan Trust Inc, Series 2006 WFH2, Klasse M3, 0,485 %, fällig 25.08.2036 *	3.608	0,31
2.025	Citigroup Mortgage Loan Trust Series 2004-OPT1 Asset Backed Pass-Through Certifi, Series 2004 OPT1, Klasse M5, 1,750 %, fällig 25.10.2034 *	1.955	0,17
5.776	Conseco Finance Securitizations Corp, Series 2000 3, Klasse A, 144A, 8,260 %, fällig 01.12.2030 *	2.469	0,21
129	Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2003 BC5, Klasse 2A2, 0,875 %, fällig 25.12.2033 *	127	0,01
1.141	Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2007 SD1, Klasse A1, 144A, 0,625 %, fällig 25.03.2047 *	940	0,08
2.500	Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC, Series 2007 MX1, Klasse A4, 144A, 6,231 %, fällig 25.12.2036	2.611	0,23
4.373	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Klasse B1, 144A, 3,065 %, fällig 25.07.2057 *	3.306	0,29
5.017	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Klasse B2, 144A, 3,065 %, fällig 25.07.2057 *	3.424	0,30
4.266	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Klasse B3, 144A, 3,065 %, fällig 25.07.2057 *	2.349	0,20
4.811	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Klasse B4, 144A, 3,065 %, fällig 25.07.2057 *	814	0,07
1.888	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-9, Series 2004 9, Klasse MF2, 5,572 %, fällig 25.11.2034 *	1.968	0,17
1.410	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-B, Series 2004 B, Klasse 2A, 0,382 %, fällig 15.02.2029 *	1.293	0,11
822	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-J, Series 2004 J, Klasse 1A, 0,452 %, fällig 15.12.2033 *	795	0,07
42	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-J, Series 2004 J, Klasse 2A, 0,452 %, fällig 15.12.2033 *	41	–
2.150	Dividend Solar Loans 2018-1 LLC, Series 2018 1, Klasse D, 144A, 6,390 %, fällig 20.07.2038	1.829	0,16
4.367	Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Series 2018 2, Klasse D, 144A, 5,910 %, fällig 20.12.2038	3.663	0,32
4.869	Fieldstone Mortgage Investment Trust Series 2005-2, Series 2005 2, Klasse M3, 0,955 %, fällig 25.12.2035 *	4.454	0,38
6	First Franklin Mortgage Loan Trust 2002-FF1, Series 2002 FF1, Klasse 1A2, 1,281 %, fällig 25.04.2032 *	6	–
7.432	Fremont Home Loan Trust 2006-B, Series 2006 B, Klasse 1A, 0,322 %, fällig 25.08.2036 *	3.565	0,31
6.876	HERO Funding Trust 2016-1, Series 2016 1A, Klasse R, 144A, 0,000 %, fällig 20.09.2041	1.227	0,11
2.650	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2005-B, Series 2005 B, Klasse M6, 1,240 %, fällig 25.08.2035 *	2.443	0,21
1.935	KeyCorp Student Loan Trust 2004-A, Series 2004 A, Klasse 1B, 0,675 %, fällig 27.01.2043 *	1.775	0,15
7.910	KeyCorp Student Loan Trust 2005-A, Series 2005 A, Klasse 2C, 1,606 %, fällig 27.12.2038 *	7.315	0,63
4.950	Magnolia Finance, 0.000%, fällig 08.09.2024 ∞	4.702	0,41
52	Long Beach Mortgage Loan Trust 2002-2, Series 2002 2, Klasse M2, 1,972 %, fällig 25.07.2032 *	51	0,01
152	Mastr Specialized Loan Trust, Series 2006 2, Klasse A, 144A, 0,435 %, fällig 25.02.2036 *	146	0,01
6	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust Series 2003-SD1, Series 2003 SD1, Klasse A1, 1,175 %, fällig 25.03.2033 *	6	–
2.069	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Series 2007 FXD1, Klasse 3A4, 5,860 %, fällig 25.01.2037	2.111	0,18
1.182	Ownit Mortgage Loan Trust Series 2005-3, Series 2005 3, Klasse M1, 0,850 %, fällig 25.06.2036 *	1.132	0,10
1.845	PFCA Home Equity Investment Trust, Series 2003 IFC6, Klasse A, 144A, 4,457 %, fällig 22.04.2035 *	1.852	0,16
2.600	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-2, Series 2005 2, Klasse M2, 5,717 %, fällig 25.04.2035	1.935	0,17
2.551	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-5, Series 2005 5, Klasse MV2, 0,805 %, fällig 25.11.2035 *	2.084	0,18
4.135	RASC Series 2005-KS12 Trust, Series 2005 KS12, Klasse M4, 0,815 %, fällig 25.01.2036 *	3.702	0,32
3.900	RASC Series 2006-KS2 Trust, Series 2006 KS2, Klasse M3, 0,585 %, fällig 25.03.2036 *	3.590	0,31
3.000	Saxon Asset Securities Trust 2005-3, Series 2005 3, Klasse M4, 1,075 %, fällig 25.11.2035 *	2.667	0,23
5.435	Saxon Asset Securities Trust 2006-2, Series 2006 2, Klasse M2, 0,475 %, fällig 25.09.2036 *	4.658	0,40
8.571	SLM Student Loan Trust 2004-10, Series 2004 10, Klasse B, 0,615 %, fällig 25.01.2040 *	7.549	0,65
120	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F LLC, Series 2017 F, Klasse R1, 144A, 0,000 %, fällig 25.01.2041	4.635	0,40
1	Southern Pacific Secured Asset Corp, Series 1998 1, Klasse A7, 6,510 %, fällig 25.12.2027 *	2	–
3.231	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, Series 2005 9XS, Klasse M2, 0,825 %, fällig 25.06.2035 *	2.628	0,23
3.197	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-WF4, Series 2005 WF4, Klasse M8, 2,800 %, fällig 25.11.2035 *	3.231	0,28
2.098	Structured Asset Securities Corp Trust 2005-SC1, Series 2005 SC1, Klasse 1A1, 144A, 0,445 %, fällig 25.05.2031 *	1.551	0,13
10.000	TES 2017-1 LLC, Series 2017 1A, Klasse B, 144A, 7,740 %, fällig 20.10.2047	9.054	0,78
13.000	Towd Point Mortgage Trust 2017-1, Series 2017 1, Klasse B3, 144A, 3,906 %, fällig 25.10.2056 *	12.399	1,07
8.900	Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Klasse B2, 144A, 3,607 %, fällig 25.03.2058 *	8.033	0,69
12.118	Towd Point Mortgage Trust 2018-4, Series 2018 4, Klasse B2, 144A, 0,000 %, fällig 25.06.2058 *	9.777	0,84
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 169.384 USD)		162.121	13,99
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 75,89 % (29. Februar 2020: 68,88 %)			
5.000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Series 2017 280P, Klasse D, 144A, 1,698 %, fällig 15.09.2034 *	4.914	0,42
667	Alternative Loan Trust 2005-56, Series 2005 56, Klasse 4A1, 0,485 %, fällig 25.11.2035 *	633	0,05
683	Alternative Loan Trust 2005-59, Series 2005 59, Klasse 1A1, 0,488 %, fällig 20.11.2035 *	650	0,06
1.991	Alternative Loan Trust 2005-80CB, Series 2005 80CB, Klasse 2A1, 6,000 %, fällig 25.02.2036	2.007	0,17
3.046	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Klasse A14, 6,000 %, fällig 25.08.2036	2.557	0,22
775	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Klasse A15, 6,000 %, fällig 25.08.2036	650	0,06
793	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Klasse A16, 6,000 %, fällig 25.08.2036	666	0,06
898	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Klasse A20, 36,149 %, fällig 25.08.2036 *	1.418	0,12
868	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Klasse A24, 6,000 %, fällig 25.08.2036	729	0,06
1.104	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Klasse A3, 6,000 %, fällig 25.08.2036 *	927	0,08
117	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Klasse A7, 6,000 %, fällig 25.08.2036	99	0,01
526	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Klasse A8, 6,000 %, fällig 25.08.2036	442	0,04
6.166	Alternative Loan Trust 2006-28CB, Series 2006 28CB, Klasse A12, 5,725 %, fällig 25.10.2036 *†	1.941	0,17
7.730	Alternative Loan Trust 2007-12T1, Series 2007 12T1, Klasse A3, 6,000 %, fällig 25.06.2037	5.621	0,49
1.209	Alternative Loan Trust 2007-23CB, Series 2007 23CB, Klasse A8, 27,699 %, fällig 25.09.2037 *	1.769	0,15

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
8.740	Alternative Loan Trust 2007-5CB, Series 2007 5CB, Klasse 1A20, 5,285 %, fällig 25.04.2037 *†	2.286	0,20
4.000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF, Series 2018 ASHF, Klasse E, 144A, 3,262 %, fällig 15.04.2035 *	3.506	0,30
9.000	Ashford Hospitality Trust 2018-KEYS, Series 2018 KEYS, Klasse C, 144A, 2,012 %, fällig 15.06.2035 *	8.176	0,71
5.579	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Series 2016 GG10, Klasse AJA, 144A, 6,015 %, fällig 10.08.2045 *	2.460	0,21
8.244	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3, Series 2017 BNK3, Klasse E, 144A, 4,686 %, fällig 15.02.2050 *	4.301	0,37
4.020	Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Series 2015 R4, Klasse 4A2, 144A, 4,500 %, fällig 27.01.2030 *	4.232	0,37
3.256	Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Series 2015 R4, Klasse 4A3, 144A, 9,101 %, fällig 27.01.2030 *	1.547	0,13
9.000	Banc of America Funding 2015-R5 Trust, Series 2015 R5, Klasse 1A3, 144A, 0,302 %, fällig 26.10.2036 *	8.106	0,70
9.000	BBCCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Klasse F, 144A, 4,715 %, fällig 10.08.2033 *	7.743	0,67
6.650	BBCMS Trust 2018-BXH, Series 2018 BXH, Klasse C, 144A, 1,662 %, fällig 15.10.2037 *	6.146	0,53
13.800	BBCMS Trust 2018-RRI, Series 2018 RRI, Klasse D, 144A, 2,212 %, fällig 15.02.2033 *	13.254	1,14
1.112	BCAP LLC 2011-RR2 Trust, Series 2011 RR2, Klasse 1A4, 144A, 3,731 %, fällig 26.07.2036 *	730	0,06
6.480	BCAP LLC 2014-RR2, Series 2014 RR2, Klasse 10A2, 144A, 0,592 %, fällig 26.07.2046 *	5.068	0,44
6.545	BCAP LLC 2014-RR2, Series 2014 RR2, Klasse 11A2, 144A, 0,569 %, fällig 26.05.2037 *	5.649	0,49
1.673	BCAP LLC Trust 2007-AA3, Series 2007 AA3, Klasse 1A2, 0,445 %, fällig 25.04.2037 *	1.451	0,13
1.942	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-AC6, Series 2004 AC6, Klasse A1, 5,750 %, fällig 25.11.2034	1.780	0,15
7.649	Bellemeade Re 2017-1 Ltd, Series 2017 1, Klasse M2, 144A, 3,525 %, fällig 25.10.2027 *	7.464	0,64
11.470	Bellemeade Re 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Klasse M2, 144A, 3,075 %, fällig 25.04.2028 *	10.717	0,92
6.676	Bellemeade Re 2018-3 Ltd, Series 2018 3A, Klasse B1, 144A, 4,075 %, fällig 25.10.2028 *	4.935	0,43
13.310	Bellemeade Re 2018-3 Ltd, Series 2018 3A, Klasse M2, 144A, 2,925 %, fällig 25.10.2028 *	12.753	1,10
3.000	BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Klasse C, 144A, 2,062 %, fällig 15.07.2035 *	2.735	0,24
24.000	BHMS 2018-MZB, Series 2018 MZB, Klasse MZB, 144A, 6,798 %, fällig 15.07.2020 *	19.126	1,65
1.100	BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA, Series 2018 BIOA, Klasse E, 144A, 2,113 %, fällig 15.03.2037 *	1.066	0,09
3.613	BX Trust 2017-SLCT, Series 2017 SLCT, Klasse F, 144A, 4,412 %, fällig 15.07.2034 *	3.361	0,29
4.500	BX Trust 2018-GW MZ, Series 2018 GWMZ, Klasse MC, 144A, 5,650 %, fällig 15.05.2037 *	3.873	0,33
1.138	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2004-4, Series 2004 4A, Klasse B1, 144A, 0,657 %, fällig 25.10.2035 *	751	0,06
640	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2005-1, Series 2005 1A, Klasse A2, 144A, 0,375 %, fällig 25.01.2036 *	589	0,05
638	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2005-B, Series 2005 BA, Klasse B1, 144A, 0,572 %, fällig 25.06.2036 *	515	0,04
635	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2004-25, Series 2004 25, Klasse 2A1, 0,855 %, fällig 25.02.2035 *	584	0,05
625	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11, Series 2005 11, Klasse 3A3, 2,640 %, fällig 25.04.2035 *	501	0,04
817	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11, Series 2005 11, Klasse 6A1, 0,775 %, fällig 25.03.2035 *	672	0,06
414	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-25, Series 2005 25, Klasse A15, 27,698 %, fällig 25.11.2035 *	500	0,04
1.743	Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2007-3, Series 2007 3, Klasse 1A4, 6,000 %, fällig 25.04.2037	1.758	0,15
9.200	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Series 2006 AR6, Klasse 2A4, 0,395 %, fällig 25.09.2036 *	2.970	0,26
807	Citigroup Mortgage Loan Trust 2008-3, Series 2008 3, Klasse A3, 144A, 6,100 %, fällig 25.04.2037	391	0,03
3.529	Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-J2, Series 2014 J2, Klasse B5, 144A, 3,874 %, fällig 25.11.2044 *	2.812	0,24
5.515	Citigroup Mortgage Loan Trust 2018-C, Series 2018 C, Klasse A1, 144A, 4,125 %, fällig 25.03.2059	5.617	0,48
1.908	Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, Series 2014 UBS2, Klasse E, 144A, 5,159 %, fällig 10.03.2047 *	1.402	0,12
13.450	Connecticut Avenue Securities Trust 2018-R07, Series 2018 R07, Klasse 1B1, 144A, 4,525 %, fällig 25.04.2031 *	13.055	1,13
6.500	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Klasse 1B1, 144A, 4,275 %, fällig 25.07.2039 *	5.657	0,49
8.330	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Klasse 1B1, 144A, 3,575 %, fällig 25.10.2039 *	6.917	0,60
17.860	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Klasse 1B1, 144A, 3,425 %, fällig 25.01.2040 *	12.840	1,11
4.500	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Series 2020 SBT1, Klasse 1M2, 144A, 3,825 %, fällig 25.02.2040 *	4.297	0,37
524	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series 2006-C5, Series 2006 C5, Klasse AJ, 5,373 %, fällig 15.12.2039	234	0,02
215	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Series 2005 C2, Klasse AMFX, 4,877 %, fällig 15.04.2037	210	0,02
461	CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series 2004-AR5, Series 2004 AR5, Klasse CB2, 3,662 %, fällig 25.06.2034 *	400	0,03
12.200	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Klasse E, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037	7.515	0,65
9.200	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Klasse F, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037	5.192	0,45
2.563	CSMC 2017-RPL3 Trust, Series 2017 RPL3, Klasse B3, 144A, 4,810 %, fällig 01.08.2057 *	2.575	0,22
6.868	CSMC 2017-RPL3 Trust, Series 2017 RPL3, Klasse B4, 144A, 4,810 %, fällig 01.08.2057 *	6.778	0,59
9.231	CSMC Mortgage-Backed Trust 2006-7, Series 2006 7, Klasse 11A2, 6,325 %, fällig 25.08.2036 *†	2.850	0,25
261	CSMC Resecuritization Trust 2006-1R, Series 2006 1R, Klasse 1A2, 144A, 19,057 %, fällig 27.07.2036 *	355	0,03
4.626	CSMC Series 2015-2R, Series 2015 2R, Klasse 7A2, 144A, 3,374 %, fällig 27.08.2036 *	3.548	0,31
4.175	CSMC Trust 2013-IVR5, Series 2013 IVR5, Klasse B5, 144A, 3,632 %, fällig 25.10.2043 *	3.039	0,26
11.730	CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Klasse F, 144A, 4,512 %, fällig 15.07.2032 *	8.671	0,75
5.900	CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Klasse H, 144A, 7,512 %, fällig 15.07.2032 *	3.603	0,31
27.338	CSMC Trust 2018-J1, Series 2018 J1, Klasse B7, 144A, 9,703 %, fällig 25.02.2048	29.244	2,52
–	CSMC Trust 2018-J1, Series 2018 J1, Klasse SA, 144A, 0,000 %, fällig 25.02.2048	–	–
4.000	CSWF 2018-TOP, Series 2018 TOP, Klasse H, 144A, 3,575 %, fällig 15.08.2035 *	3.488	0,30
2.100	DBUBS 2011-LC3 Mortgage Trust, Series 2011 LC3A, Klasse G, 144A, 3,750 %, fällig 10.08.2044 †	966	0,08
1.210	DSLA Mortgage Loan Trust 2004-AR4, Series 2004 AR4, Klasse 2A2B, 0,581 %, fällig 19.01.2045 *	820	0,07
3.250	DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR3, Series 2005 AR3, Klasse 2A1B, 0,401 %, fällig 19.07.2045 *	2.932	0,25
3.237	DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR5, Series 2005 AR5, Klasse 2A1B, 0,501 %, fällig 19.09.2045 *	2.866	0,25
595	DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Series 2007 AR1, Klasse 2A1B, 0,341 %, fällig 19.04.2047 *	527	0,05
7.328	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C01, Klasse 1B, 11,925 %, fällig 25.08.2028 *	8.478	0,73
3.670	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C02, Klasse 1B, 12,425 %, fällig 25.09.2028 *	4.356	0,38
2.943	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C03, Klasse 1B, 11,925 %, fällig 25.10.2028 *	3.429	0,30
6.890	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C04, Klasse 1B, 10,425 %, fällig 25.01.2029 *	7.629	0,66
7.205	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C06, Klasse 1B, 9,425 %, fällig 25.04.2029 *	7.564	0,65
3.500	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C01, Klasse 1B1, 5,925 %, fällig 25.07.2029 *	3.660	0,32
2.550	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05, Klasse 1B1, 3,775 %, fällig 25.01.2030 *	2.401	0,21
8.696	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05, Klasse 1M2C, 2,375 %, fällig 25.01.2030 *	8.297	0,72
6.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C06, Klasse 1B1, 4,325 %, fällig 25.02.2030 *	5.605	0,48
7.560	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Klasse 1B1, 3,925 %, fällig 25.10.2030 *	7.109	0,61
3.426	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Klasse 1M2C, 2,325 %, fällig 25.10.2030 *	3.251	0,28

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
13.588	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05, Klasse 1B1, 4,425 %, fällig 25.01.2031 *	12.749	1,10
7.750	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C06, Klasse 1B1, 3,925 %, fällig 25.03.2031 *	7.278	0,63
1.145	Fannie Mae REMICS, Series 2016 60, Klasse QS, 5,925 %, fällig 25.09.2046 *	233	0,02
3.285	Fannie Mae REMICS, Series 2017 85, Klasse SC, 6,025 %, fällig 25.11.2047 *	654	0,06
6.605	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K038, Klasse X3, 2,568 %, fällig 25.06.2042 *	525	0,05
19.370	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K052, Klasse X3, 1,668 %, fällig 25.01.2044 *	1.453	0,13
9.000	Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, Series 2020 DNA1, Klasse B2, 144A, 5,425 %, fällig 25.01.2050 *	5.366	0,46
8.000	Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Series 2020 DNA2, Klasse B2, 144A, 4,975 %, fällig 25.02.2050 *	4.288	0,37
9.000	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA1, Series 2019 DNA1, Klasse B2, 144A, 10,925 %, fällig 25.01.2049 *	8.629	0,74
5.250	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA2, Series 2019 DNA2, Klasse B2, 144A, 10,675 %, fällig 25.03.2049 *	4.960	0,43
4.600	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Series 2019 DNA3, Klasse B1, 144A, 3,425 %, fällig 25.07.2049 *	4.293	0,37
6.100	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Series 2019 DNA3, Klasse B2, 144A, 8,325 %, fällig 25.07.2049 *	4.969	0,43
5.550	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Series 2019 DNA4, Klasse B2, 144A, 6,425 %, fällig 25.10.2049 *	3.918	0,34
10.000	Freddie Mac Stacr Trust 2019-FTR4, Series 2019 FTR4, Klasse B2, 144A, 5,175 %, fällig 25.11.2047 *	6.633	0,57
4.946	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA1, Klasse B, 10,175 %, fällig 25.07.2028 *	5.318	0,46
2.515	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA2, Klasse B, 10,675 %, fällig 25.10.2028 *	2.818	0,24
2.556	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA3, Klasse B, 11,425 %, fällig 25.12.2028 *	2.873	0,25
5.513	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA4, Klasse B, 8,775 %, fällig 25.03.2029 *	5.419	0,47
6.960	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2017 DNA2, Klasse B2, 11,425 %, fällig 25.10.2029 *	6.517	0,56
6.721	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2017 HRP1, Klasse B2D, 3,175 %, fällig 25.12.2042 *	3.674	0,32
5.500	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SPI1, Klasse B, 144A, 3,722 %, fällig 25.02.2048 *	3.209	0,28
14.395	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SPI3, Klasse B, 144A, 4,140 %, fällig 25.08.2048 *	10.436	0,90
31.283	FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Series 2018 SB48, Klasse B, 144A, 3,795 %, fällig 25.02.2038 *	23.523	2,03
4.063	GE Commercial Mortgage Corp Series 2007-C1 Trust, Series 2007 C1, Klasse AM, 5,606 %, fällig 10.12.2049 *	2.239	0,19
767	Government National Mortgage Association, Series 2010 102, Klasse IO, 0,010 %, fällig 16.06.2052 *		–
4.780	Government National Mortgage Association, Series 2010 13, Klasse IO, 0,000 %, fällig 16.11.2051 *		–
11.321	Government National Mortgage Association, Series 2011 127, Klasse IO, 0,307 %, fällig 16.03.2047 *	93	0,01
26.254	Government National Mortgage Association, Series 2011 95, Klasse IO, 0,067 %, fällig 16.04.2051 *	27	–
18.187	Government National Mortgage Association, Series 2012 114, Klasse IO, 0,773 %, fällig 16.01.2053 *	611	0,05
13.597	Government National Mortgage Association, Series 2013 163, Klasse IO, 1,264 %, fällig 16.02.2046 *	640	0,06
12.839	Government National Mortgage Association, Series 2014 16, Klasse IO, 0,650 %, fällig 16.06.2055 *	383	0,03
10.913	Government National Mortgage Association, Series 2014 171, Klasse IO, 0,607 %, fällig 16.11.2055 *	281	0,02
1.979	Government National Mortgage Association, Series 2014 47, Klasse IA, 0,125 %, fällig 16.02.2048 *	28	–
7.946	Government National Mortgage Association, Series 2014 50, Klasse IO, 0,694 %, fällig 16.09.2055 *	352	0,03
1.021	Government National Mortgage Association, Series 2016 135, Klasse SB, 5,938 %, fällig 16.10.2046 *	285	0,02
1.282	Government National Mortgage Association, Series 2016 51, Klasse NS, 5,892 %, fällig 20.04.2046 *	247	0,02
9.368	Government National Mortgage Association, Series 2018 125, Klasse HS, 6,092 %, fällig 20.09.2048 *	1.357	0,12
28.679	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Klasse D, 144A, 6,162 %, fällig 15.09.2031 *	25.607	2,21
7.000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, Series 2018 3PCK, Klasse B, 144A, 2,412 %, fällig 15.09.2031 *	5.001	0,43
1.250	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26, Series 2014 GC26, Klasse D, 144A, 4,662 %, fällig 10.11.2047 *	767	0,07
4.250	GSMSC Resecuritization Trust 2014-2R, Series 2014 2R, Klasse 3B, 144A, 0,782 %, fällig 26.11.2037 *	3.661	0,32
5.578	GSR Mortgage Loan Trust 2006-1F, Series 2006 1F, Klasse 6A1, 0,575 %, fällig 25.02.2036 *	484	0,04
148	HarborView Mortgage Loan Trust 2004-11, Series 2004 11, Klasse 3A3, 0,921 %, fällig 19.01.2035 *	136	0,01
98	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Klasse 2A1A, 0,701 %, fällig 19.03.2035 *	95	0,01
401	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-10, Series 2005 10, Klasse 2A1A, 0,471 %, fällig 19.11.2035 *	365	0,03
715	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-2, Series 2005 2, Klasse 2A1A, 0,601 %, fällig 19.05.2035 *	663	0,06
424	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Klasse 2A1A, 0,641 %, fällig 19.06.2035 *	413	0,04
4.201	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-8, Series 2005 8, Klasse 2A2, 2,671 %, fällig 19.09.2035 *	3.770	0,33
768	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10, Series 2006 10, Klasse 2A1A, 0,341 %, fällig 19.11.2036 *	740	0,06
3.921	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10, Series 2006 10, Klasse 2A1B, 0,401 %, fällig 19.11.2036 *	3.427	0,30
1.746	Impac CMB Trust Series 2005-1, Series 2005 1, Klasse M1, 0,865 %, fällig 25.04.2035 *	1.646	0,14
2.795	Impac CMB Trust Series 2005-3, Series 2005 3, Klasse A2, 0,775 %, fällig 25.08.2035 *	2.641	0,23
1.428	Impac CMB Trust Series 2005-4, Series 2005 4, Klasse 1M1, 0,820 %, fällig 25.05.2035 *	1.382	0,12
2.167	Impac CMB Trust Series 2005-7, Series 2005 7, Klasse A1, 0,695 %, fällig 25.11.2035 *	1.946	0,17
2.729	Impac Secured Assets Corp Series 2004-4, Series 2004 4, Klasse M5, 1,825 %, fällig 25.02.2035 *	2.182	0,19
1.268	Impac Secured Assets Trust 2006-2, Series 2006 2, Klasse 2B, 1,275 %, fällig 25.08.2036 *	1.133	0,10
1.548	Impac Secured Assets Trust 2006-2, Series 2006 2, Klasse 2M3, 1,275 %, fällig 25.08.2036 *	1.442	0,12
5.250	Independence Plaza Trust 2018-INDP, Series 2018 INDP, Klasse D, 144A, 4,356 %, fällig 10.07.2035	5.401	0,47
880	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR13, Series 2005 AR13, Klasse 1A1, 3,256 %, fällig 25.08.2035 *	665	0,06
1.153	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR2, Series 2005 AR2, Klasse 2A1B, 0,955 %, fällig 25.02.2035 *	572	0,05
2.486	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR6, Series 2005 AR6, Klasse 2A2, 0,835 %, fällig 25.04.2035 *	1.847	0,16
9.650	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Series 2017 FL11, Klasse E, 144A, 4,182 %, fällig 15.10.2032 *	8.323	0,72
2.250	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Series 2017 FL11, Klasse F, 144A, 5,482 %, fällig 15.10.2032 *	1.870	0,16
3.000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-ASH8, Series 2018 ASH8, Klasse C, 144A, 1,462 %, fällig 15.02.2035 *	2.627	0,23
28.545	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Series 2018 PHMZ, Klasse M, 144A, 8,370 %, fällig 15.06.2035 *†	21.991	1,90
309	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-CIBC19, Series 2007 CB19, Klasse AJ, 6,068 %, fällig 12.02.2049 *	131	0,01
830	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012-C8, Series 2012 C8, Klasse E, 144A, 4,826 %, fällig 15.10.2045 *	472	0,04
4.509	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-FL7, Series 2015 FL7, Klasse D, 144A, 3,912 %, fällig 15.05.2028 *	4.493	0,39
59	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-UES, Series 2015 UES, Klasse E, 144A, 3,742 %, fällig 05.09.2032 *	59	0,01

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
721	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-UES, Series 2015 UES, Klasse F, 144A, 3,742 %, fällig 05.09.2032 *	717	0,06
6.800	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Series 2018 WPT, Klasse GFL, 144A, 3,557 %, fällig 05.07.2033 *	5.805	0,50
13.865	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Klasse G, 144A, 4,412 %, fällig 15.12.2036 *	11.536	1,00
13.875	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Klasse H, 144A, 6,912 %, fällig 15.12.2036 *	10.949	0,95
7.162	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-NNN MZ, Series 2020 NNNZ, Klasse M, 144A, 8,542 %, fällig 16.01.2037	5.502	0,47
4.724	JP Morgan Mortgage Trust 2007-S3, Series 2007 S3, Klasse 1A18, 0,675 %, fällig 25.08.2037 *	1.687	0,15
5.742	JP Morgan Mortgage Trust 2013-2, Series 2013 2, Klasse B5, 144A, 3,629 %, fällig 25.05.2043 *	4.489	0,39
54.338	JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Series 2018 4, Klasse AX1, 144A, 0,255 %, fällig 25.10.2048 *†	205	0,02
54.360	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Klasse AX1, 144A, 0,302 %, fällig 25.10.2048 *†	245	0,02
7.121	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Klasse B3, 144A, 3,802 %, fällig 25.10.2048 *	6.629	0,57
4.334	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Klasse B4, 144A, 3,802 %, fällig 25.10.2048 *	3.869	0,33
1.952	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Klasse B5, 144A, 3,802 %, fällig 25.10.2048 *	1.201	0,10
3.087	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Klasse B6, 144A, 3,802 %, fällig 25.10.2048 *	1.470	0,13
5.420	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C25, Series 2014 C25, Klasse D, 144A, 4,093 %, fällig 15.11.2047 *	3.838	0,33
5.535	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Series 2019 BOLT, Klasse C, 144A, 3,962 %, fällig 15.07.2034 *	4.942	0,43
11.441	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Series 2019 BOLT, Klasse D, 144A, 6,712 %, fällig 15.07.2034 *	9.233	0,80
18.149	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Series 2019 BOLT, Klasse XCP, 144A, 2,052 %, fällig 15.07.2034 *	321	0,03
945	Magnolia Finance XI DAC, Series 2019 2, Klasse A, 144A, 2,925 %, fällig 31.07.2021 *	949	0,08
156	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-14, Series 2004 14, Klasse M2, 1,675 %, fällig 25.01.2035 *	157	0,01
21	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-15, Series 2004 15, Klasse 6A1, 0,505 %, fällig 25.12.2034 *	20	–
2.090	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-6, Series 2004 6, Klasse B1, 3,151 %, fällig 25.07.2034 *	1.971	0,17
1.365	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-8, Series 2004 8, Klasse B1, 3,096 %, fällig 25.09.2034 *	1.110	0,10
908	MASTR Reperforming Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Klasse 1A1, 144A, 6,000 %, fällig 25.08.2034	710	0,06
1.078	MASTR Reperforming Loan Trust 2005-2, Series 2005 2, Klasse 1A1F, 144A, 0,525 %, fällig 25.05.2035 *	598	0,05
651	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Series 2007 5, Klasse AJ, 5,450 %, fällig 12.08.2048 *	384	0,03
321	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Series 2007 5, Klasse AJFL, 144A, 5,450 %, fällig 12.08.2048 *	189	0,02
5.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32, Series 2016 C32, Klasse D, 144A, 3,396 %, fällig 15.12.2049 *	3.379	0,29
9	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-IQ13, Series 2007 IQ13, Klasse AJ, 5,438 %, fällig 15.03.2044	9	–
2.250	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-150E, Series 2014 150E, Klasse C, 144A, 4,438 %, fällig 09.09.2032 *	2.338	0,20
2.791	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-11AR, Series 2004 11AR, Klasse 1B1, 0,775 %, fällig 25.01.2035 *	2.334	0,20
4.044	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-8AR, Series 2006 8AR, Klasse 1A3, 0,495 %, fällig 25.06.2036 *	1.407	0,12
6.781	Motel 6 Trust 2017-MTL6, Series 2017 MTL6, Klasse F, 144A, 4,412 %, fällig 15.08.2034 *	6.555	0,57
1.248	Multifamily Trust 2016-1, Series 2016 1, Klasse B, 144A, 16,816 %, fällig 25.04.2046 *	1.416	0,12
14.560	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Klasse D, 144A, 4,544 %, fällig 15.08.2036 *	12.792	1,10
4.870	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Klasse E, 144A, 4,544 %, fällig 15.08.2036 *	3.958	0,34
4.219	Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Series 2015 4R, Klasse 4A7, 144A, 3,642 %, fällig 26.03.2037 *	3.522	0,30
3.140	One Market Plaza Trust 2017-1MKT, Series 2017 1MKT, Klasse D, 144A, 4,146 %, fällig 10.02.2032	3.231	0,28
195	Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Series 2006 1, Klasse M1, 0,545 %, fällig 25.04.2036 *	1.322	0,11
10.130	PMT Credit Risk Transfer Trust 2019-3R, Series 2019 3R, Klasse A, 144A, 2,870 %, fällig 27.10.2022 *	9.779	0,84
7.760	Radnor Re 2018-1 Ltd, Series 2018 1, Klasse M2, 144A, 2,875 %, fällig 25.03.2028 *	7.375	0,64
1.026	RALI Series 2006-QA2 Trust, Series 2006 QA2, Klasse 1A1, 0,425 %, fällig 25.02.2036 *	780	0,07
8.542	RBSGC Mortgage Loan Trust 2007-A, Series 2007 A, Klasse 3A1, 0,525 %, fällig 25.01.2037 *	1.564	0,14
17.995	Redwood Funding Trust 2019-1, Series 2019 1, Klasse PT, 144A, 4,213 %, fällig 27.09.2024	18.161	1,57
1.973	Reperforming Loan REMIC Trust 2006-R2, Series 2006 R2, Klasse AF1, 144A, 0,595 %, fällig 25.07.2036 *	1.781	0,15
4.669	Residential Asset Securitization Trust 2006-A7CB, Series 2006 A7CB, Klasse 1A3, 6,250 %, fällig 25.07.2036	4.766	0,41
13.322	Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Series 2017 4, Klasse B, 144A, 0,000 %, fällig 25.06.2057 †	2.257	0,19
20.227	Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Series 2017 4, Klasse BIO, 144A, 0,209 %, fällig 25.06.2057 *†	4.855	0,42
4.487	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Klasse B, 144A, 0,000 %, fällig 25.09.2055 †	387	0,03
10.677	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Klasse BIO, 144A, 0,350 %, fällig 25.09.2055 *†	922	0,08
9.640	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Klasse M2, 144A, 3,750 %, fällig 25.09.2055 *	8.713	0,75
73.422	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Klasse XSIO, 144A, 0,075 %, fällig 25.09.2055 *†	287	0,02
13.338	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, Series 2017 2, Klasse B, 144A, 0,000 %, fällig 25.08.2056 †	1.550	0,13
22.360	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, Series 2017 2, Klasse BIO, 144A, 0,000 %, fällig 25.08.2056 *†	2.191	0,19
5.710	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, Series 2017 2, Klasse M1, 144A, 4,000 %, fällig 25.08.2056 *	5.681	0,49
4.457	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, Series 2017 2, Klasse M2, 144A, 4,000 %, fällig 25.08.2056 *	4.073	0,35
562.302	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, Series 2017 2, Klasse XSIO, 144A, 0,075 %, fällig 25.08.2056 *†	1.634	0,14
6.500	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3, Series 2017 3, Klasse M2, 144A, 4,750 %, fällig 25.07.2056 *	6.170	0,53
2.937	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1, Series 2018 1, Klasse M, 4,750 %, fällig 25.05.2057 *	2.863	0,25
16.692	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3, Series 2018 3, Klasse BX, 144A, 1,647 %, fällig 25.08.2057 *	5.555	0,48
2.630	STACR Trust 2018-DNA3, Series 2018 DNA3, Klasse B1, 144A, 4,075 %, fällig 25.09.2048 *	2.431	0,21
6.000	STACR Trust 2018-DNA3, Series 2018 DNA3, Klasse B2, 144A, 7,925 %, fällig 25.09.2048 *	4.772	0,41
650	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Klasse D, 144A, 3,662 %, fällig 15.11.2027 *†	19	–
14.332	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Klasse E, 144A, 4,562 %, fällig 15.11.2027 *†	1.437	0,12
7.349	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust Series 2005-19XS, Series 2005 19XS, Klasse 1A2B, 0,535 %, fällig 25.10.2035 *	6.788	0,59
811	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Series 2004 2, Klasse 1A1, 4,146 %, fällig 25.03.2034 *	793	0,07
1.075	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Series 2005 8XS, Klasse M1, 0,820 %, fällig 25.04.2035 *	1.030	0,09
4.842	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR5, Series 2006 AR5, Klasse 4A1, 0,395 %, fällig 25.05.2046 *	2.504	0,22
85	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR6, Series 2006 AR6, Klasse 1A1, 0,355 %, fällig 25.07.2046 *	72	0,01
1.215	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Klasse E, 144A, 3,334 %, fällig 11.11.2034 *	1.008	0,09
8.911	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Klasse G, 144A, 6,504 %, fällig 11.11.2034 *	6.351	0,55

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
11.503	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Klasse H, 144A, 9,954 %, fällig 11.11.2034 *	8.068	0,70
5.706	UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust 2012-C2, Series 2012 C2, Klasse G, 144A, 5,000 %, fällig 10.05.2063 *†	487	0,04
990	UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust 2012-C2, Series 2012 C2, Klasse H, 144A, 5,000 %, fällig 10.05.2063 *†	48	–
3.677	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR11 Trust, Series 2005 AR11, Klasse B1, 0,785 %, fällig 25.08.2045 *	3.064	0,26
922	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR15 Trust, Series 2005 AR15, Klasse A1C4, 0,575 %, fällig 25.11.2045 *	573	0,05
7.014	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR2 Trust, Series 2005 AR2, Klasse B1, 0,705 %, fällig 25.01.2045 *	4.617	0,40
1.978	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR9 Trust, Series 2005 AR9, Klasse B1, 1,120 %, fällig 25.07.2045 *	1.653	0,14
23	Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-RA1 Trust, Series 2005 RA1, Klasse 3A, 3,631 %, fällig 25.01.2035 *	22	–
1.400	Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Series 2015 SBC5, Klasse B, 144A, 6,352 %, fällig 14.09.2022 *	1.143	0,10
1.252	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22, Series 2014 C22, Klasse D, 144A, 4,050 %, fällig 15.09.2057 *	972	0,08
Summe Mortgage-Backed Securities (Kosten 1.008.165 USD)		$879.323	75,89
Schuldverschreibungen — 4,85 % (29. Februar 2020: 3,02 %)			
30.000	American Dream, 10,750 %, fällig 29.06.2024 *∞	28.992	2,50
1.613	Freehand Hotel, 4,750 %, fällig 17.12.2024 *∞	1.549	0,14
2.935	Freehand Hotel, 4,750 %, fällig 17.12.2024 *∞	2.819	0,24
5.452	Freehand Hotel, 4,750 %, fällig 17.12.2024 *∞	5.237	0,45
8.000	Palmetto Skilled Nursing, 6,250 %, fällig 11.01.2022 *∞	7.902	0,68
10.000	Sono Retail Loan, 4,015 %, fällig 06.08.2021 *∞	9.700	0,84
Schuldverschreibungen insgesamt (Kosten 57.908 USD)		56.199	4,85
Kollektive Kapitalanlagen — 4,47 % (29. Februar 2020: 8,17 %)			
51.853	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (Distribución)	51.853	4,47
Gesamt Kollektive Kapitalanlagen (Kosten 51.853 USD)		51.853	4,47
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 1.292.260 USD)		1.149.496	99,20
Kreditausfallversicherungen — 0,02 % (29. Februar 2020: 0,05 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		241	0,02
Devisenterminkontrakte — 0,35 % (29. Februar 2020: 0,18 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		4.086	0,35
Termingeschäfte — 0,10 % (29. Februar 2020: 0,36 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1.182	0,10
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		1.155.005	99,67
Kreditausfallversicherungen — (0,08 %) (29. Februar 2020: (0,13 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(932)	(0,08)
Devisenterminkontrakte — (0,01 %) (29. Februar 2020 :(0,02 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(99)	(0,01)
Termingeschäfte — (0,10 %) (29. Februar 2020: (0,81 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(1.174)	(0,10)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(2.205)	(0,19)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		1.152.800	99,48
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		5.937	0,52
Gesamtnettovermögen		1.158.737$	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 733.128.000 USD und machten 63.23 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

† Illiquide.

∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

ABKÜRZUNGEN:

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	89,60
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	4,84
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,46
Finanzderivate	0,47
Sonstige Vermögenswerte	0,63
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	CMBX.NA.BBB, 3,000 %	Kauf	17.08.2061	1.550	$ 241
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3,000 %	Verkauf	17.10.2057	3.280	(740)
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3,000 %	Verkauf	17.10.2057	850	(192)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Kreditausfallversicherung (29. Februar 2020 (in Tsd.): 906 USD)					$ 241
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (2.507) USD)					(932)
Nettowertminderung von Kreditausfallversicherung (29. Februar 2020 (in Tsd.): (1.601) USD)					$ (691)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	33	Verkauf	GBP	25	$ (1)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	84	Verkauf	USD	111	1
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	AUD	1	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1.299	Verkauf	EUR	1.098	(13)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	155	Verkauf	GBP	118	(2)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	7.869	Verkauf	USD	10.287	232
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	284.348	Verkauf	USD	335.609	3.834
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CHF	1.671	Verkauf	USD	1.833	17
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	101	Verkauf	USD	72	2
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	JPY	5.586.825	Verkauf	USD	52.842	(83)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 3.417 USD)								$ 4.086
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (334) USD)								(99)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 3.083 USD)								$ 3.987

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2020	137	$ 21.843	$ (89)
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2020	(268)	(59.213)	(11)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	1.250	157.539	195
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	(502)	(88.211)	987
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	277	61.191	(1.074)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 6.904 USD)			$ 1.182
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(15.538) USD)			(1.174)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (8.634) USD)			$ 8

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 1,29 % (29. Februar 2020: 0,98 %)			
9.500	Nelnet Student Loan Trust 2007-1, Series 2007 1, Klasse A4, 0,360 %, fällig 27.08.2036 *	8.977	1,12
1.251	SBA Small Business Investment Cos, Series 2018 10B, Klasse 1, 3,548 %, fällig 10.09.2028	1.345	0,17
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 10.280 USD)		10.322	1,29
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 100,21 %(29. Februar 2020: 100,34 %)			
65.494	BANK 2017-BNK8, Series 2017 BNK8, Klasse XA, 0,874 %, fällig 15.11.2050 *	2.855	0,36
3.400	BANK 2018-BNK10, Series 2018 BN10, Klasse A5, 3,688 %, fällig 15.02.2061	3.917	0,49
2.210	Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Series 2018 B1, Klasse A5, 3,666 %, fällig 15.01.2051 *	2.544	0,32
4.050	BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Klasse A, 144A, 1,412 %, fällig 15.07.2035 *†	3.889	0,49
3.870	BXMT 2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2, Klasse A, 144A, 1,062 %, fällig 16.02.2037 *	3.789	0,47
37.656	CD 2017-CD6 Mortgage Trust, Series 2017 CD6, Klasse XA, 1,096 %, fällig 13.11.2050 *	1.721	0,22
2.720	Fannie Mae Interest Strip 406, Klasse 2, 4,000 %, fällig 25.02.2041	374	0,05
573	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 9, 5,000 %, fällig 25.02.2041 *	93	0,01
1.136	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse C10, 5,000 %, fällig 25.01.2038	179	0,02
974	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C13, 3,500 %, fällig 25.11.2041	87	0,01
4.793	Fannie Mae Interest Strip 417, Klasse C5, 3,500 %, fällig 25.02.2043	449	0,06
10.162	Fannie Mae Interest Strip 418, Klasse C15, 3,500 %, fällig 25.08.2043	1.326	0,17
19.187	Fannie Mae Multifamily REMIC Trust 2020-M31, Series 2020 M31, Klasse X2, 1,355 %, fällig 25.12.2032 *	2.023	0,25
15.700	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 1,500 % ±	16.071	2,01
31.000	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 2,000 % ±	32.258	4,03
35.830	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 % ±	36.952	4,61
1	Fannie Mae Pool ‘252875’, 8,000 %, fällig 01.11.2029	1	–
1	Fannie Mae Pool ‘253184’, 8,000 %, fällig 01.04.2030	1	–
–	Fannie Mae Pool ‘253399’, 8,500 %, fällig 01.08.2030		–
–	Fannie Mae Pool ‘253438’, 8,500 %, fällig 01.09.2030		–
1	Fannie Mae Pool ‘253598’, 8,500 %, fällig 01.12.2030	1	–
155	Fannie Mae Pool ‘254793’, 5,000 %, fällig 01.07.2033	178	0,02
5.310	Fannie Mae Pool ‘387771’, 3,790 %, fällig 01.08.2028	6.170	0,77
–	Fannie Mae Pool ‘535270’, 8,500 %, fällig 01.04.2030		–
17	Fannie Mae Pool ‘535299’, 7,500 %, fällig 01.05.2030	20	–
1	Fannie Mae Pool ‘535332’, 8,500 %, fällig 01.04.2030	2	–
–	Fannie Mae Pool ‘535351’, 8,000 %, fällig 01.06.2030		–
–	Fannie Mae Pool ‘535435’, 8,500 %, fällig 01.08.2030		–
1	Fannie Mae Pool ‘535608’, 9,500 %, fällig 01.04.2030	1	–
6	Fannie Mae Pool ‘535996’, 7,500 %, fällig 01.06.2031	8	–
–	Fannie Mae Pool ‘537715’, 8,500 %, fällig 01.09.2030		–
1	Fannie Mae Pool ‘541735’, 8,000 %, fällig 01.06.2030	1	–
38	Fannie Mae Pool ‘545189’, 7,500 %, fällig 01.08.2031	45	0,01
30	Fannie Mae Pool ‘545190’, 7,500 %, fällig 01.08.2031	35	–
3	Fannie Mae Pool ‘545612’, 8,000 %, fällig 01.04.2032	3	–
4	Fannie Mae Pool ‘545990’, 7,500 %, fällig 01.04.2031	4	–
–	Fannie Mae Pool ‘546591’, 8,500 %, fällig 01.06.2030		–
3	Fannie Mae Pool ‘548965’, 8,500 %, fällig 01.07.2030	3	–
17	Fannie Mae Pool ‘555676’, 7,500 %, fällig 01.12.2032	19	–
188	Fannie Mae Pool ‘555743’, 5,000 %, fällig 01.09.2033	216	0,03
48	Fannie Mae Pool ‘727181’, 5,000 %, fällig 01.08.2033	55	0,01
40	Fannie Mae Pool ‘735578’, 5,000 %, fällig 01.06.2035	46	0,01
28	Fannie Mae Pool ‘745248’, 7,500 %, fällig 01.08.2034	32	–
847	Fannie Mae Pool ‘745580’, 5,000 %, fällig 01.06.2036	975	0,12
199	Fannie Mae Pool ‘745802’, 6,000 %, fällig 01.07.2036	235	0,03
18	Fannie Mae Pool ‘745959’, 5,500 %, fällig 01.11.2036	20	–
286	Fannie Mae Pool ‘836390’, 5,000 %, fällig 01.10.2035	329	0,04
817	Fannie Mae Pool ‘836398’, 3,182 %, fällig 01.10.2035 *	842	0,11
17	Fannie Mae Pool ‘836852’, 3,179 %, fällig 01.10.2035 *	17	–
20	Fannie Mae Pool ‘843823’, 3,197 %, fällig 01.11.2035 *	20	–
282	Fannie Mae Pool ‘843997’, 3,291 %, fällig 01.11.2035 *	291	0,04
94	Fannie Mae Pool ‘865915’, 3,481 %, fällig 01.03.2036 *	95	0,01
239	Fannie Mae Pool ‘888218’, 5,000 %, fällig 01.03.2037	275	0,03
19	Fannie Mae Pool ‘889117’, 5,000 %, fällig 01.10.2035	22	–
769	Fannie Mae Pool ‘890345’, 5,000 %, fällig 01.06.2041	886	0,11
1.107	Fannie Mae Pool ‘890604’, 4,500 %, fällig 01.10.2044	1.245	0,16
4.239	Fannie Mae Pool ‘890813’, 3,500 %, fällig 01.12.2047	4.614	0,58
76	Fannie Mae Pool ‘890876’, 3,500 %, fällig 01.02.2049	83	0,01
26	Fannie Mae Pool ‘902663’, 6,000 %, fällig 01.11.2036	30	–
10	Fannie Mae Pool ‘909856’, 6,000 %, fällig 01.03.2037	12	–
394	Fannie Mae Pool ‘934231’, 5,000 %, fällig 01.01.2039	443	0,06
138	Fannie Mae Pool ‘961907’, 5,000 %, fällig 01.03.2038	158	0,02
933	Fannie Mae Pool ‘962687’, 5,000 %, fällig 01.04.2038	1.070	0,13
22	Fannie Mae Pool ‘973013’, 4,500 %, fällig 01.03.2038	24	–
1	Fannie Mae Pool ‘974763’, 4,500 %, fällig 01.04.2038	1	–
41	Fannie Mae Pool ‘981766’, 4,500 %, fällig 01.04.2038	44	0,01
8	Fannie Mae Pool ‘995072’, 5,500 %, fällig 01.08.2038	9	–
867	Fannie Mae Pool ‘995948’, 5,000 %, fällig 01.03.2039	991	0,12
105	Fannie Mae Pool ‘AA8438’, 4,500 %, fällig 01.06.2039	117	0,01
74	Fannie Mae Pool ‘AB0129’, 5,000 %, fällig 01.04.2035	83	0,01
994	Fannie Mae Pool ‘AB0131’, 5,000 %, fällig 01.12.2038	1.143	0,14
38	Fannie Mae Pool ‘AB2725’, 5,500 %, fällig 01.04.2041	43	0,01
29	Fannie Mae Pool ‘AB2817’, 5,000 %, fällig 01.04.2041	32	–
1.789	Fannie Mae Pool ‘AB3882’, 4,500 %, fällig 01.11.2041	1.998	0,25
961	Fannie Mae Pool ‘AB5692’, 4,000 %, fällig 01.06.2042	1.054	0,13
85	Fannie Mae Pool ‘AB7668’, 3,000 %, fällig 01.01.2043	91	0,01
382	Fannie Mae Pool ‘AB8144’, 5,000 %, fällig 01.04.2037	438	0,05
270	Fannie Mae Pool ‘AB9107’, 3,500 %, fällig 01.04.2033	295	0,04
52	Fannie Mae Pool ‘AC2389’, 5,000 %, fällig 01.02.2037	60	0,01
1.731	Fannie Mae Pool ‘AD1645’, 5,000 %, fällig 01.03.2040	1.995	0,25
133	Fannie Mae Pool ‘AD2963’, 5,000 %, fällig 01.04.2040	153	0,02
29	Fannie Mae Pool ‘AD3336’, 5,500 %, fällig 01.04.2040	33	–
23	Fannie Mae Pool ‘AD3796’, 5,000 %, fällig 01.04.2040	27	–
7	Fannie Mae Pool ‘AD4567’, 5,500 %, fällig 01.04.2040	8	–
5	Fannie Mae Pool ‘AD4598’, 5,500 %, fällig 01.05.2040	6	–
12	Fannie Mae Pool ‘AD4614’, 5,500 %, fällig 01.06.2040	14	–
66	Fannie Mae Pool ‘AD4898’, 5,000 %, fällig 01.05.2040	72	0,01
9	Fannie Mae Pool ‘AD8281’, 5,500 %, fällig 01.07.2040	10	–
74	Fannie Mae Pool ‘AD8326’, 5,500 %, fällig 01.07.2040	82	0,01
120	Fannie Mae Pool ‘AD8642’, 5,500 %, fällig 01.08.2040	136	0,02
84	Fannie Mae Pool ‘AD9893’, 5,500 %, fällig 01.07.2040	95	0,01
21	Fannie Mae Pool ‘AE0758’, 7,000 %, fällig 01.02.2039	24	–
177	Fannie Mae Pool ‘AH4029’, 5,000 %, fällig 01.04.2041	195	0,02
171	Fannie Mae Pool ‘AH5036’, 5,500 %, fällig 01.02.2041	191	0,02
52	Fannie Mae Pool ‘AH8309’, 5,000 %, fällig 01.04.2041	57	0,01
16	Fannie Mae Pool ‘AH9785’, 5,500 %, fällig 01.04.2041	18	–
68	Fannie Mae Pool ‘AI0199’, 5,000 %, fällig 01.04.2041	74	0,01
27	Fannie Mae Pool ‘AI9532’, 5,500 %, fällig 01.09.2041	30	–
17	Fannie Mae Pool ‘AJ2033’, 5,500 %, fällig 01.10.2041	19	–
74	Fannie Mae Pool ‘AJ4713’, 4,500 %, fällig 01.11.2041	83	0,01
82	Fannie Mae Pool ‘AL0521’, 5,000 %, fällig 01.06.2041	94	0,01
276	Fannie Mae Pool ‘AL1051’, 4,500 %, fällig 01.09.2041	309	0,04
839	Fannie Mae Pool ‘AL1469’, 7,000 %, fällig 01.02.2039	975	0,12
415	Fannie Mae Pool ‘AL1470’, 7,000 %, fällig 01.04.2037	497	0,06
8.048	Fannie Mae Pool ‘AL3024’, 3,500 %, fällig 01.01.2043	8.721	1,09
60	Fannie Mae Pool ‘AL3026’, 3,500 %, fällig 01.12.2042	65	0,01
2.400	Fannie Mae Pool ‘AL4324’, 6,500 %, fällig 01.05.2040	2.787	0,35
284	Fannie Mae Pool ‘AL4741’, 4,500 %, fällig 01.01.2044	318	0,04
461	Fannie Mae Pool ‘AL6613’, 2,500 %, fällig 01.06.2028	484	0,06
8.981	Fannie Mae Pool ‘AL7093’, 4,000 %, fällig 01.05.2045	10.246	1,28
1.624	Fannie Mae Pool ‘AL7877’, 4,000 %, fällig 01.12.2045	1.789	0,22
254	Fannie Mae Pool ‘AL9546’, 3,500 %, fällig 01.11.2046	273	0,03
4.610	Fannie Mae Pool ‘AN8048’, 3,080 %, fällig 01.01.2028	5.180	0,65
274	Fannie Mae Pool ‘AO4102’, 4,000 %, fällig 01.06.2042	300	0,04
782	Fannie Mae Pool ‘AP9766’, 4,000 %, fällig 01.10.2042	857	0,11
2.277	Fannie Mae Pool ‘AQ6295’, 3,500 %, fällig 01.12.2032	2.433	0,30
188	Fannie Mae Pool ‘AQ7130’, 3,500 %, fällig 01.12.2032	201	0,03
644	Fannie Mae Pool ‘AQ7270’, 3,500 %, fällig 01.12.2032	689	0,09
588	Fannie Mae Pool ‘AQ7306’, 3,000 %, fällig 01.01.2043	629	0,08
689	Fannie Mae Pool ‘AQ7864’, 3,500 %, fällig 01.12.2032	737	0,09
185	Fannie Mae Pool ‘AQ7869’, 3,500 %, fällig 01.11.2032	197	0,02

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
316	Fannie Mae Pool 'AQ7913', 3,500 %, fällig 01.12.2032	338	0,04
375	Fannie Mae Pool 'AQ8677', 3,500 %, fällig 01.12.2032	401	0,05
139	Fannie Mae Pool 'AR1198', 3,000 %, fällig 01.01.2043	148	0,02
456	Fannie Mae Pool 'AR1202', 3,000 %, fällig 01.01.2043	488	0,06
894	Fannie Mae Pool 'AS0462', 3,500 %, fällig 01.09.2033	972	0,12
359	Fannie Mae Pool 'AS0469', 4,000 %, fällig 01.09.2033	395	0,05
177	Fannie Mae Pool 'AS1281', 3,500 %, fällig 01.12.2033	189	0,02
7.050	Fannie Mae Pool 'AS4347', 4,000 %, fällig 01.01.2045	7.832	0,98
2.524	Fannie Mae Pool 'AS4363', 4,500 %, fällig 01.02.2045	2.926	0,37
5.151	Fannie Mae Pool 'AS6328', 3,500 %, fällig 01.12.2045	5.519	0,69
897	Fannie Mae Pool 'AS6340', 3,500 %, fällig 01.12.2045	967	0,12
2.397	Fannie Mae Pool 'AS6396', 3,500 %, fällig 01.12.2045	2.557	0,32
564	Fannie Mae Pool 'AS6541', 3,500 %, fällig 01.01.2046	619	0,08
544	Fannie Mae Pool 'AS6562', 3,500 %, fällig 01.01.2046	592	0,07
649	Fannie Mae Pool 'AS9453', 4,000 %, fällig 01.04.2047	702	0,09
439	Fannie Mae Pool 'AT2486', 3,500 %, fällig 01.06.2033	479	0,06
4.686	Fannie Mae Pool 'AT3070', 3,500 %, fällig 01.04.2043	5.151	0,64
146	Fannie Mae Pool 'AU4395', 4,000 %, fällig 01.10.2033	164	0,02
83	Fannie Mae Pool 'AU4397', 4,000 %, fällig 01.10.2033	90	0,01
143	Fannie Mae Pool 'AU7248', 4,000 %, fällig 01.10.2033	157	0,02
188	Fannie Mae Pool 'AU9562', 4,000 %, fällig 01.10.2033	206	0,03
212	Fannie Mae Pool 'AU9567', 4,000 %, fällig 01.10.2033	238	0,03
173	Fannie Mae Pool 'AU9570', 4,000 %, fällig 01.10.2033	192	0,02
10	Fannie Mae Pool 'AV3286', 5,000 %, fällig 01.11.2043	11	–
32	Fannie Mae Pool 'AV6366', 4,500 %, fällig 01.01.2044	36	–
57	Fannie Mae Pool 'AV7116', 4,500 %, fällig 01.03.2044	63	0,01
117	Fannie Mae Pool 'AV7681', 3,500 %, fällig 01.01.2034	125	0,02
288	Fannie Mae Pool 'AV7683', 3,500 %, fällig 01.01.2034	316	0,04
403	Fannie Mae Pool 'AV7694', 3,500 %, fällig 01.01.2034	446	0,06
477	Fannie Mae Pool 'AV7696', 3,500 %, fällig 01.01.2034	525	0,07
6.852	Fannie Mae Pool 'AY1321', 3,500 %, fällig 01.03.2035	7.378	0,92
4.314	Fannie Mae Pool 'AZ9645', 4,000 %, fällig 01.09.2035	4.745	0,59
12.692	Fannie Mae Pool 'BF0145', 3,500 %, fällig 01.03.2057	13.892	1,73
3.840	Fannie Mae Pool 'BF0161', 5,000 %, fällig 01.10.2046	4.362	0,54
7.620	Fannie Mae Pool 'BF0162', 5,000 %, fällig 01.11.2045	8.655	1,08
1.711	Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, fällig 01.06.2057	1.924	0,24
3.182	Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500 %, fällig 01.09.2057	3.580	0,45
3.437	Fannie Mae Pool 'BH6684', 4,000 %, fällig 01.08.2047	3.674	0,46
2.879	Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, fällig 01.12.2037	3.045	0,38
71	Fannie Mae Pool 'BJ8078', 3,500 %, fällig 01.03.2048	78	0,01
62	Fannie Mae Pool 'BK0751', 3,500 %, fällig 01.03.2048	66	0,01
261	Fannie Mae Pool 'BK7603', 4,500 %, fällig 01.10.2048	285	0,04
11.286	Fannie Mae Pool 'BM3372', 3,326 %, fällig 01.01.2028 *	11.841	1,48
2.777	Fannie Mae Pool 'BM3934', 4,500 %, fällig 01.05.2048	3.029	0,38
1.809	Fannie Mae Pool 'BM4696', 3,000 %, fällig 01.03.2047	1.949	0,24
366	Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, fällig 01.03.2043	397	0,05
5.771	Fannie Mae Pool 'BM4832', 3,000 %, fällig 01.12.2047	6.277	0,78
528	Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, fällig 01.12.2046	568	0,07
5.125	Fannie Mae Pool 'BM4951', 4,500 %, fällig 01.09.2048	5.649	0,71
1.578	Fannie Mae Pool 'BM5073', 3,000 %, fällig 01.04.2048	1.702	0,21
1.206	Fannie Mae Pool 'BM5521', 3,500 %, fällig 01.07.2048	1.278	0,16
968	Fannie Mae Pool 'BN0341', 5,000 %, fällig 01.12.2048	1.060	0,13
459	Fannie Mae Pool 'BO8932', 3,000 %, fällig 01.01.2050	494	0,06
5.141	Fannie Mae Pool 'BP0060', 3,000 %, fällig 01.01.2050	5.551	0,69
8.181	Fannie Mae Pool 'BP1660', 2,500 %, fällig 01.02.2050	8.612	1,08
2.436	Fannie Mae Pool 'BP6171', 3,500 %, fällig 01.04.2050	2.584	0,32
100	Fannie Mae Pool 'BP9421', 3,000 %, fällig 01.07.2050	107	0,01
100	Fannie Mae Pool 'BQ1402', 3,000 %, fällig 01.08.2050	107	0,01
559	Fannie Mae Pool 'CA0148', 4,500 %, fällig 01.08.2047	604	0,08
2.530	Fannie Mae Pool 'CA0717', 4,500 %, fällig 01.11.2047	2.735	0,34
287	Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500 %, fällig 01.12.2047	313	0,04
17.520	Fannie Mae Pool 'CA0917', 3,500 %, fällig 01.12.2047	18.742	2,34
1.497	Fannie Mae Pool 'CA2652', 5,000 %, fällig 01.11.2048	1.641	0,21
2.395	Fannie Mae Pool 'CA2855', 4,500 %, fällig 01.12.2048	2.587	0,32
1.869	Fannie Mae Pool 'CA6000', 3,000 %, fällig 01.06.2050	1.988	0,25
899	Fannie Mae Pool 'CA6053', 3,000 %, fällig 01.06.2050	959	0,12
3.947	Fannie Mae Pool 'FM1002', 3,500 %, fällig 01.01.2048	4.265	0,53
1.801	Fannie Mae Pool 'FM1349', 3,500 %, fällig 01.03.2047	1.960	0,24
3.506	Fannie Mae Pool 'FM1637', 4,500 %, fällig 01.05.2049	3.825	0,48
772	Fannie Mae Pool 'FM1991', 4,500 %, fällig 01.05.2049	836	0,10
776	Fannie Mae Pool 'FM2173', 4,000 %, fällig 01.09.2048	851	0,11
1.419	Fannie Mae Pool 'FM2745', 4,500 %, fällig 01.03.2050	1.538	0,19
3.717	Fannie Mae Pool 'FM2770', 3,500 %, fällig 01.04.2050	3.964	0,50
518	Fannie Mae Pool 'FM3141', 3,500 %, fällig 01.11.2048	551	0,07
635	Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000 %, fällig 01.11.2048	691	0,09
4.856	Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500 %, fällig 01.05.2047	5.189	0,65
186	Fannie Mae Pool 'FM3542', 4,000 %, fällig 01.05.2049	202	0,03
2.273	Fannie Mae Pool 'FM3589', 4,500 %, fällig 01.02.2046	2.536	0,32
1.100	Fannie Mae Pool 'FM3957', 5,000 %, fällig 01.03.2050	1.207	0,15
14	Fannie Mae Pool 'MA0440', 5,500 %, fällig 01.05.2040	16	–
40	Fannie Mae Pool 'MA0619', 5,500 %, fällig 01.11.2040	45	0,01
11	Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, fällig 01.04.2031	12	–
24	Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, fällig 01.05.2031	26	–
29	Fannie Mae Pool 'MA0766', 5,500 %, fällig 01.05.2041	33	–
12	Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, fällig 01.06.2031	13	–
211	Fannie Mae Pool 'MA0823', 5,500 %, fällig 01.07.2041	239	0,03
81	Fannie Mae Pool 'MA0867', 5,500 %, fällig 01.09.2041	92	0,01
290	Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, fällig 01.11.2031	320	0,04
363	Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, fällig 01.12.2031	400	0,05
64	Fannie Mae Pool 'MA0968', 4,500 %, fällig 01.12.2031	71	0,01
421	Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500 %, fällig 01.09.2042	456	0,06
29	Fannie Mae Pool 'MA1221', 4,500 %, fällig 01.09.2042	32	–
93	Fannie Mae Pool 'MA1363', 3,000 %, fällig 01.02.2043	100	0,01
3.257	Fannie Mae Pool 'MA1393', 4,000 %, fällig 01.03.2043	3.571	0,45
625	Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, fällig 01.09.2043	697	0,09
521	Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500 %, fällig 01.10.2043	581	0,07
357	Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500 %, fällig 01.11.2043	398	0,05
444	Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500 %, fällig 01.12.2043	495	0,06
1.011	Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, fällig 01.12.2036	1.071	0,13
372	Fannie Mae Pool 'MA3501', 5,000 %, fällig 01.10.2048	408	0,05
6.674	Fannie Mae REMICS, Series 2010 150, Klasse SK, 6,355 %, fällig 25.01.2041 *	1.740	0,22
1.731	Fannie Mae REMICS, Series 2010 2, Klasse AI, 5,500 %, fällig 25.02.2040	319	0,04
3.827	Fannie Mae REMICS, Series 2011 36, Klasse YS, 6,345 %, fällig 25.01.2041 *	922	0,12
3.075	Fannie Mae REMICS, Series 2012 22, Klasse SM, 6,325 %, fällig 25.03.2042 *	707	0,09
1.156	Fannie Mae REMICS, Series 2012 9, Klasse PT, 11,518 %, fällig 25.07.2036 *	1.589	0,20
1.409	Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Klasse BC, 6,500 %, fällig 25.07.2042	1.718	0,21
6.749	Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Klasse CB, 5,500 %, fällig 25.04.2042	7.809	0,98
11.753	Fannie Mae REMICS, Series 2016 48, Klasse IA, 4,500 %, fällig 25.06.2038	1.880	0,23
1.882	Fannie Mae REMICS, Series 2017 74, Klasse PZ, 3,500 %, fällig 25.10.2047	2.296	0,29
8.425	Fannie Mae REMICS, Series 2018 3, Klasse IO, 4,000 %, fällig 25.02.2048	1.193	0,15
8.964	Fannie Mae REMICS, Series 2018 38, Klasse SC, 6,075 %, fällig 25.06.2048 *	1.835	0,23
3.450	Fannie Mae REMICS, Series 2018 54, Klasse SA, 6,075 %, fällig 25.08.2048 *	662	0,08
1.722	Fannie Mae REMICS, Series 2019 25, Klasse PI, 5,000 %, fällig 25.05.2048	340	0,04
9.735	Fannie Mae REMICS, Series 2019 38, Klasse SH, 5,878 %, fällig 25.07.2049 *	1.849	0,23
3.343	Fannie Mae REMICS, Series 2019 42, Klasse KS, 6,975 %, fällig 25.08.2049 *	666	0,08
3.671	Fannie Mae REMICS, Series 2019 42, Klasse LS, 6,475 %, fällig 25.08.2049 *	782	0,10
4.502	Fannie Mae REMICS, Series 2019 44, Klasse SM, 5,875 %, fällig 25.08.2049 *	878	0,11
4.999	Fannie Mae REMICS, Series 2019 45, Klasse BS, 5,875 %, fällig 25.08.2049 *	870	0,11
19.504	Fannie Mae REMICS, Series 2019 45, Klasse SE, 5,875 %, fällig 25.08.2049 *	4.095	0,51
7.954	Fannie Mae REMICS, Series 2019 5, Klasse IO, 4,500 %, fällig 25.03.2049	1.341	0,17
5.088	Fannie Mae REMICS, Series 2019 54, Klasse SA, 5,875 %, fällig 25.09.2049 *	788	0,10
3.835	Fannie Mae REMICS, Series 2019 57, Klasse NS, 5,825 %, fällig 25.10.2049 *	587	0,07
4.731	Fannie Mae REMICS, Series 2019 58, Klasse HS, 5,825 %, fällig 25.10.2049 *	740	0,09
7.749	Fannie Mae REMICS, Series 2019 59, Klasse SH, 5,825 %, fällig 25.10.2049 *	1.253	0,16

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
2.237	Fannie Mae REMICS, Series 2020 26, Klasse SA, 5,775 %, fällig 25.05.2050 *	478	0,06
903	Fannie Mae REMICS, Series 2020 47, Klasse GZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	906	0,11
1.097	Fannie Mae-Aces, Series 2016 M11, Klasse AL, 2,944 %, fällig 25.07.2039	1.127	0,14
21.820	Fannie Mae-Aces, Series 2019 M11, Klasse X1, 1,168 %, fällig 25.06.2029 *	1.697	0,21
22.892	Fannie Mae-Aces, Series 2019 M13, Klasse X1, 0,945 %, fällig 25.06.2034 *	1.435	0,18
39.856	Fannie Mae-Aces, Series 2019 M14, Klasse X1, 0,705 %, fällig 25.06.2029 *	1.756	0,22
5.900	Fannie Mae-Aces, Series 2020 M11, Klasse IO, 1,895 %, fällig 25.12.2028 *	706	0,09
34.617	Fannie Mae-Aces, Series 2020 M16, Klasse X1, 0,476 %, fällig 25.04.2032 *	1.335	0,17
6.181	Fannie Mae-Aces, Series 2020 M24, Klasse X1, 1,897 %, fällig 25.01.2037 *	990	0,12
84	Freddie Mac Gold Pool 'A29586', 5,000 %, fällig 01.01.2035	96	0,01
29	Freddie Mac Gold Pool 'A30703', 5,500 %, fällig 01.12.2034	32	–
154	Freddie Mac Gold Pool 'A35950', 5,000 %, fällig 01.07.2035	177	0,02
32	Freddie Mac Gold Pool 'A36526', 5,000 %, fällig 01.08.2035	36	–
73	Freddie Mac Gold Pool 'A39036', 5,000 %, fällig 01.05.2035	84	0,01
13	Freddie Mac Gold Pool 'A39302', 5,500 %, fällig 01.11.2035	15	–
143	Freddie Mac Gold Pool 'A81215', 6,500 %, fällig 01.08.2038	159	0,02
1	Freddie Mac Gold Pool 'A84166', 6,500 %, fällig 01.01.2039	1	–
699	Freddie Mac Gold Pool 'A92179', 5,000 %, fällig 01.05.2040	806	0,10
646	Freddie Mac Gold Pool 'A97953', 5,000 %, fällig 01.04.2041	744	0,09
2	Freddie Mac Gold Pool 'C00556', 8,000 %, fällig 01.10.2027	2	–
–	Freddie Mac Gold Pool 'C01025', 8,000 %, fällig 01.07.2030	1	–
–	Freddie Mac Gold Pool 'C01051', 8,000 %, fällig 01.09.2030	1	–
2	Freddie Mac Gold Pool 'C46047', 8,000 %, fällig 01.12.2030	2	–
3	Freddie Mac Gold Pool 'C55319', 8,000 %, fällig 01.08.2031	4	–
–	Freddie Mac Gold Pool 'C57324', 8,000 %, fällig 01.09.2031	–	–
6	Freddie Mac Gold Pool 'C91046', 6,500 %, fällig 01.05.2027	7	–
2.735	Freddie Mac Gold Pool 'C91764', 3,500 %, fällig 01.05.2034	2.959	0,37
4.040	Freddie Mac Gold Pool 'C91876', 3,000 %, fällig 01.06.2036	4.280	0,53
3.395	Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000 %, fällig 01.02.2038	3.582	0,45
2	Freddie Mac Gold Pool 'G00556', 8,000 %, fällig 01.09.2026	2	–
2	Freddie Mac Gold Pool 'G00726', 8,000 %, fällig 01.06.2027	2	–
1	Freddie Mac Gold Pool 'G00931', 8,000 %, fällig 01.11.2026	1	–
20	Freddie Mac Gold Pool 'G01737', 5,000 %, fällig 01.12.2034	23	–
9	Freddie Mac Gold Pool 'G02427', 5,500 %, fällig 01.12.2036	10	–
598	Freddie Mac Gold Pool 'G02723', 6,000 %, fällig 01.03.2037	707	0,09
11	Freddie Mac Gold Pool 'G03092', 5,500 %, fällig 01.07.2037	13	–
17	Freddie Mac Gold Pool 'G03695', 5,500 %, fällig 01.11.2037	20	–
48	Freddie Mac Gold Pool 'G04581', 6,500 %, fällig 01.08.2038	55	0,01
2	Freddie Mac Gold Pool 'G04947', 6,500 %, fällig 01.04.2038	3	–
8	Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, fällig 01.09.2039	10	–
341	Freddie Mac Gold Pool 'G07025', 5,000 %, fällig 01.02.2042	393	0,05
205	Freddie Mac Gold Pool 'G07335', 7,000 %, fällig 01.03.2039	241	0,03
57	Freddie Mac Gold Pool 'G07485', 5,000 %, fällig 01.06.2041	66	0,01
424	Freddie Mac Gold Pool 'G07509', 6,500 %, fällig 01.09.2039	485	0,06
2.464	Freddie Mac Gold Pool 'G08700', 4,500 %, fällig 01.03.2046	2.698	0,34
371	Freddie Mac Gold Pool 'G16672', 3,000 %, fällig 01.03.2033	397	0,05
2.368	Freddie Mac Gold Pool 'G60329', 5,500 %, fällig 01.06.2040	2.744	0,34
7.520	Freddie Mac Gold Pool 'G60344', 4,000 %, fällig 01.12.2045	8.336	1,04
11.131	Freddie Mac Gold Pool 'G61814', 3,500 %, fällig 01.09.2048	12.032	1,50
16.071	Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000 %, fällig 01.10.2046	17.382	2,17
3	Freddie Mac Gold Pool 'H00790', 5,500 %, fällig 01.05.2037	3	–
264	Freddie Mac Gold Pool 'H02425', 5,500 %, fällig 01.02.2038	303	0,04
3	Freddie Mac Gold Pool 'H09170', 5,500 %, fällig 01.01.2038	4	–
705	Freddie Mac Gold Pool 'J39722', 3,000 %, fällig 01.10.2033	746	0,09
628	Freddie Mac Gold Pool 'J39962', 3,000 %, fällig 01.12.2033	660	0,08
288	Freddie Mac Gold Pool 'Q26702', 4,000 %, fällig 01.06.2044	329	0,04
5.804	Freddie Mac Gold Pool 'Q42046', 3,500 %, fällig 01.07.2046	6.158	0,77
3.491	Freddie Mac Gold Pool 'U69040', 4,000 %, fällig 01.05.2045	3.830	0,48
148	Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, fällig 01.10.2042	162	0,02
827	Freddie Mac Gold Pool 'U90378', 4,000 %, fällig 01.11.2042	908	0,11
499	Freddie Mac Gold Pool 'U90436', 4,000 %, fällig 01.11.2042	548	0,07
1.576	Freddie Mac Gold Pool 'U90503', 3,500 %, fällig 01.11.2042	1.707	0,21
285	Freddie Mac Gold Pool 'U90598', 3,500 %, fällig 01.12.2042	309	0,04
121	Freddie Mac Gold Pool 'U90608', 3,500 %, fällig 01.12.2042	131	0,02
136	Freddie Mac Gold Pool 'U90768', 3,500 %, fällig 01.01.2043	148	0,02
196	Freddie Mac Gold Pool 'U90778', 3,500 %, fällig 01.01.2043	213	0,03
188	Freddie Mac Gold Pool 'U90794', 3,500 %, fällig 01.01.2043	204	0,03
4.135	Freddie Mac Gold Pool 'U90809', 3,500 %, fällig 01.02.2043	4.486	0,56
169	Freddie Mac Gold Pool 'U90828', 3,500 %, fällig 01.02.2043	182	0,02
306	Freddie Mac Gold Pool 'U90841', 3,500 %, fällig 01.02.2043	332	0,04
215	Freddie Mac Gold Pool 'U90879', 3,500 %, fällig 01.02.2043	234	0,03
235	Freddie Mac Gold Pool 'U90903', 3,500 %, fällig 01.02.2043	255	0,03
321	Freddie Mac Gold Pool 'U90940', 3,500 %, fällig 01.02.2043	349	0,04
139	Freddie Mac Gold Pool 'U91027', 3,500 %, fällig 01.02.2043	149	0,02
3.717	Freddie Mac Gold Pool 'U99038', 3,000 %, fällig 01.01.2043	3.978	0,50
1.589	Freddie Mac Gold Pool 'U99045', 3,500 %, fällig 01.03.2043	1.722	0,22
291	Freddie Mac Gold Pool 'U99114', 3,500 %, fällig 01.02.2044	316	0,04
8.658	Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500 %, fällig 01.03.2045	9.374	1,17
4.766	Freddie Mac Gold Pool 'U99135', 4,000 %, fällig 01.02.2044	5.214	0,65
59.332	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K065, Klasse X1, 0,813 %, fällig 25.04.2027 *	2.384	0,30
88.101	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K069, Klasse X1, 0,491 %, fällig 25.09.2027 *	2.129	0,27
54.532	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K079, Klasse XAM, 0,222 %, fällig 25.06.2028 *	511	0,06
57.720	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K081, Klasse XAM, 0,209 %, fällig 25.08.2028 *	493	0,06
296	Freddie Mac Pool 'QA5768', 3,000 %, fällig 01.01.2050	318	0,04
197	Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000 %, fällig 01.01.2050	211	0,03
760	Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500 %, fällig 01.02.2050	821	0,10
293	Freddie Mac Pool 'QA9686', 3,000 %, fällig 01.05.2050	312	0,04
2.240	Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000 %, fällig 01.09.2049	2.406	0,30
342	Freddie Mac Pool 'RA2141', 4,000 %, fällig 01.02.2050	368	0,05
12.434	Freddie Mac Pool 'RA2194', 3,000 %, fällig 01.02.2050	13.287	1,66
2.200	Freddie Mac Pool 'RA3474', 3,000 %, fällig 01.09.2050	2.352	0,29
105	Freddie Mac Pool 'ZM8774', 5,000 %, fällig 01.10.2048	115	0,01
755	Freddie Mac Pool 'ZN0480', 3,500 %, fällig 01.10.2042	819	0,10

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
251	Freddie Mac Pool ‘ZN1436’, 5,000 %, fällig 01.11.2048	275	0,03
253	Freddie Mac Pool ‘ZS3059’, 5,500 %, fällig 01.12.2038	293	0,04
803	Freddie Mac Pool ‘ZS3399’, 5,000 %, fällig 01.11.2041	925	0,12
600	Freddie Mac Pool ‘ZS3901’, 5,000 %, fällig 01.11.2041	684	0,09
402	Freddie Mac Pool ‘ZS6518’, 4,000 %, fällig 01.10.2025	426	0,05
119	Freddie Mac Pool ‘ZT0474’, 4,500 %, fällig 01.08.2048	129	0,02
1.030	Freddie Mac Pool ‘ZT1596’, 5,000 %, fällig 01.01.2049	1.128	0,14
4.600	Freddie Mac REMICS 3810, Klasse WA, 6,196 %, fällig 15.06.2040 *	6.002	0,75
6.151	Freddie Mac REMICS 3998, Klasse DS, 6,338 %, fällig 15.02.2042 *	1.298	0,16
4.515	Freddie Mac REMICS 4134, Klasse IM, 3,500 %, fällig 15.11.2042	484	0,06
1.376	Freddie Mac REMICS 4143, Klasse AZ, 2,000 %, fällig 15.12.2042	1.309	0,16
2.719	Freddie Mac REMICS 4280, Klasse AI, 3,000 %, fällig 15.02.2028	128	0,02
1.546	Freddie Mac REMICS 4403, Klasse IG, 3,500 %, fällig 15.07.2032	75	0,01
2.668	Freddie Mac REMICS 4715, Klasse JS, 5,988 %, fällig 15.08.2047 *	506	0,06
1.650	Freddie Mac REMICS 4759, Klasse MI, 4,000 %, fällig 15.09.2045	125	0,02
2.829	Freddie Mac REMICS 4808, Klasse SB, 6,038 %, fällig 15.07.2048 *	604	0,08
816	Freddie Mac REMICS 4813, Klasse CJ, 3,000 %, fällig 15.08.2048	850	0,11
3.027	Freddie Mac REMICS 4856, Klasse IO, 5,000 %, fällig 15.01.2049	533	0,07
5.034	Freddie Mac REMICS 4882, Klasse S, 5,888 %, fällig 15.05.2049 *	765	0,10
7.273	Freddie Mac REMICS 4915, Klasse SG, 5,888 %, fällig 25.09.2049 *	1.844	0,23
4.515	Freddie Mac REMICS 4921, Klasse SN, 5,888 %, fällig 25.10.2049 *	735	0,09
1.019	Freddie Mac REMICS 4936, Klasse YZ, 2,500 %, fällig 25.12.2049	1.052	0,13
3.522	Freddie Mac REMICS 4962, Klasse SP, 5,888 %, fällig 25.03.2050 *	619	0,08
4.515	Freddie Mac REMICS 4988, Klasse AZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	4.604	0,57
14.219	Freddie Mac REMICS 4995, Klasse QI, 2,500 %, fällig 25.07.2050	1.567	0,20
6.291	Freddie Mac REMICS 5000, Klasse IB, 2,500 %, fällig 25.07.2050	808	0,10
4.881	Freddie Mac REMICS 5000, Klasse UI, 2,500 %, fällig 25.07.2050 †∞	656	0,08
2.748	Freddie Mac Strips 312, Klasse S1, 5,788 %, fällig 15.09.2043 *	561	0,07
–	Ginnie Mae I Pool ‘410304’, 7,500 %, fällig 15.12.2025	1	–
1	Ginnie Mae I Pool ‘417463’, 7,000 %, fällig 15.09.2025	1	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘430208’, 7,000 %, fällig 15.09.2027	–	–
1	Ginnie Mae I Pool ‘462669’, 7,000 %, fällig 15.04.2028	1	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘486470’, 6,500 %, fällig 15.08.2028	–	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘486516’, 6,500 %, fällig 15.09.2028	–	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘519569’, 8,000 %, fällig 15.05.2030	–	–
77	Ginnie Mae I Pool ‘646044’, 6,500 %, fällig 15.10.2037	85	0,01
2	Ginnie Mae I Pool ‘652203’, 5,000 %, fällig 15.03.2036	2	–
4	Ginnie Mae I Pool ‘658182’, 6,000 %, fällig 15.11.2036	5	–
2	Ginnie Mae I Pool ‘675375’, 5,000 %, fällig 15.05.2038	2	–
2	Ginnie Mae I Pool ‘676940’, 5,000 %, fällig 15.04.2038	3	–
9	Ginnie Mae I Pool ‘683926’, 5,000 %, fällig 15.02.2038	11	–
7	Ginnie Mae I Pool ‘684334’, 5,000 %, fällig 15.02.2038	7	–
6	Ginnie Mae I Pool ‘684754’, 5,000 %, fällig 15.04.2038	6	–
3	Ginnie Mae I Pool ‘684848’, 5,000 %, fällig 15.04.2038	3	–
3	Ginnie Mae I Pool ‘686062’, 5,000 %, fällig 15.05.2038	3	–
56	Ginnie Mae I Pool ‘698086’, 6,000 %, fällig 15.04.2039	63	0,01
22	Ginnie Mae I Pool ‘701501’, 5,000 %, fällig 15.12.2038	25	–
493	Ginnie Mae I Pool ‘701947’, 5,000 %, fällig 15.06.2039	567	0,07
246	Ginnie Mae I Pool ‘733600’, 5,000 %, fällig 15.04.2040	276	0,03
506	Ginnie Mae I Pool ‘733627’, 5,000 %, fällig 15.05.2040	573	0,07
–	Ginnie Mae I Pool ‘780141’, 10,000 %, fällig 15.12.2020	–	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘780488’, 10,000 %, fällig 15.10.2021	–	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘780574’, 10,000 %, fällig 15.12.2021	–	–
2	Ginnie Mae I Pool ‘780732’, 7,000 %, fällig 15.03.2028	3	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘780835’, 10,000 %, fällig 15.07.2022	–	–
–	Ginnie Mae I Pool ‘780991’, 9,000 %, fällig 15.11.2024	–	–
1	Ginnie Mae I Pool ‘781001’, 7,500 %, fällig 15.03.2029	2	–
84	Ginnie Mae I Pool ‘781590’, 5,500 %, fällig 15.04.2033	99	0,01
584	Ginnie Mae I Pool ‘781994’, 5,500 %, fällig 15.11.2033	684	0,09
5	Ginnie Mae I Pool ‘782198’, 6,000 %, fällig 15.10.2037	5	–
620	Ginnie Mae I Pool ‘784571’, 3,500 %, fällig 15.06.2048	659	0,08
237	Ginnie Mae I Pool ‘AA5649’, 3,000 %, fällig 15.09.2042	253	0,03
340	Ginnie Mae I Pool ‘AB2892’, 3,000 %, fällig 15.09.2042	358	0,04
86	Ginnie Mae I Pool ‘AB9108’, 3,000 %, fällig 15.10.2042	91	0,01
471	Ginnie Mae I Pool ‘AB9109’, 3,000 %, fällig 15.10.2042	496	0,06
409	Ginnie Mae I Pool ‘AB9207’, 3,000 %, fällig 15.11.2042	431	0,05
4.088	Ginnie Mae I Pool ‘BS8462’, 3,500 %, fällig 15.06.2050	4.380	0,55
12	Ginnie Mae II Pool ‘4040’, 6,500 %, fällig 20.10.2037	14	–
18	Ginnie Mae II Pool ‘4170’, 6,000 %, fällig 20.06.2038	20	–
1.292	Ginnie Mae II Pool ‘4245’, 6,000 %, fällig 20.09.2038	1.488	0,19
189	Ginnie Mae II Pool ‘4602’, 6,000 %, fällig 20.12.2039	218	0,03
235	Ginnie Mae II Pool ‘4617’, 4,500 %, fällig 20.01.2040	262	0,03
121	Ginnie Mae II Pool ‘4696’, 4,500 %, fällig 20.05.2040	135	0,02
71	Ginnie Mae II Pool ‘4747’, 5,000 %, fällig 20.07.2040	81	0,01
77	Ginnie Mae II Pool ‘4772’, 5,000 %, fällig 20.08.2040	88	0,01
6	Ginnie Mae II Pool ‘4774’, 6,000 %, fällig 20.08.2040	7	–
161	Ginnie Mae II Pool ‘4802’, 5,000 %, fällig 20.09.2040	183	0,02
59	Ginnie Mae II Pool ‘4855’, 5,000 %, fällig 20.11.2040	67	0,01
26	Ginnie Mae II Pool ‘4923’, 4,500 %, fällig 20.01.2041	29	–
19	Ginnie Mae II Pool ‘4928’, 6,000 %, fällig 20.01.2041	22	–
912	Ginnie Mae II Pool ‘4978’, 4,500 %, fällig 20.03.2041	1.015	0,13
2.021	Ginnie Mae II Pool ‘783050’, 5,000 %, fällig 20.07.2040	2.253	0,28
1.544	Ginnie Mae II Pool ‘783298’, 4,500 %, fällig 20.04.2041	1.719	0,21
4.874	Ginnie Mae II Pool ‘784577’, 4,000 %, fällig 20.07.2047	5.247	0,66
99	Ginnie Mae II Pool ‘784905’, 3,000 %, fällig 20.01.2050	104	0,01
4.136	Ginnie Mae II Pool ‘892346’, 2,851 %, fällig 20.08.2059 *	4.340	0,54
274	Ginnie Mae II Pool ‘892614’, 2,240 %, fällig 20.08.2060 *	289	0,04
1.614	Ginnie Mae II Pool ‘AV0243’, 3,500 %, fällig 20.08.2046	1.782	0,22
2.880	Ginnie Mae II Pool ‘AV8310’, 3,500 %, fällig 20.08.2046	3.155	0,39
2.532	Ginnie Mae II Pool ‘AV8311’, 3,500 %, fällig 20.08.2046	2.748	0,34
2.771	Ginnie Mae II Pool ‘AV8312’, 3,500 %, fällig 20.08.2046	2.988	0,37
1.956	Ginnie Mae II Pool ‘AZ3074’, 4,000 %, fällig 20.02.2047	2.124	0,27
3.954	Ginnie Mae II Pool ‘BC4732’, 3,500 %, fällig 20.10.2047	4.246	0,53
1.185	Ginnie Mae II Pool ‘BC5293’, 3,500 %, fällig 20.08.2047	1.272	0,16
7.817	Ginnie Mae II Pool ‘BC5429’, 3,500 %, fällig 20.10.2047	8.440	1,05
5.769	Ginnie Mae II Pool ‘BD0384’, 3,500 %, fällig 20.10.2047	6.179	0,77
1.227	Ginnie Mae II Pool ‘BD3554’, 3,500 %, fällig 20.10.2047	1.333	0,17
2.537	Ginnie Mae II Pool ‘BD3555’, 3,500 %, fällig 20.10.2047	2.740	0,34
1.535	Ginnie Mae II Pool ‘BD3636’, 3,500 %, fällig 20.10.2047	1.668	0,21
4.006	Ginnie Mae II Pool ‘BD4734’, 3,500 %, fällig 20.10.2047	4.305	0,54
4.189	Ginnie Mae II Pool ‘BD6814’, 3,500 %, fällig 20.10.2047	4.453	0,56
230	Ginnie Mae II Pool ‘BG7951’, 4,500 %, fällig 20.06.2048	248	0,03
2.476	Ginnie Mae II Pool ‘BH1521’, 4,500 %, fällig 20.07.2048	2.631	0,33
210	Ginnie Mae II Pool ‘BH1846’, 4,500 %, fällig 20.07.2048	223	0,03
3.021	Ginnie Mae II Pool ‘BH1870’, 4,500 %, fällig 20.08.2048	3.311	0,41
2.180	Ginnie Mae II Pool ‘BM7534’, 3,500 %, fällig 20.02.2050	2.313	0,29
394	Ginnie Mae II Pool ‘BM9734’, 4,000 %, fällig 20.10.2049	426	0,05
1.287	Ginnie Mae II Pool ‘BS1728’, 4,000 %, fällig 20.01.2050	1.407	0,18
1.269	Ginnie Mae II Pool ‘BS1742’, 4,000 %, fällig 20.02.2050	1.381	0,17
4.579	Ginnie Mae II Pool ‘BT9472’, 4,000 %, fällig 20.05.2050	4.989	0,62
5.877	Ginnie Mae II Pool ‘BU3196’, 4,000 %, fällig 20.05.2050	6.483	0,81
1.700	Ginnie Mae II Pool ‘BW7380’, 4,500 %, fällig 20.07.2050	1.928	0,24
1.500	Ginnie Mae II Pool ‘BW7384’, 4,000 %, fällig 20.08.2050	1.673	0,21
5.664	Ginnie Mae II Pool ‘MA2677’, 3,000 %, fällig 20.03.2045	6.004	0,75
15.703	Ginnie Mae II Pool ‘MA4003’, 3,000 %, fällig 20.10.2046	16.598	2,07
558	Ginnie Mae II Pool ‘MA4511’, 4,000 %, fällig 20.06.2047	602	0,08
493	Ginnie Mae II Pool ‘MA4781’, 5,000 %, fällig 20.10.2047	544	0,07
645	Ginnie Mae II Pool ‘MA4838’, 4,000 %, fällig 20.11.2047	693	0,09
582	Ginnie Mae II Pool ‘MA4901’, 4,000 %, fällig 20.12.2047	626	0,08
199	Ginnie Mae II Pool ‘MA5020’, 4,000 %, fällig 20.02.2048	215	0,03
331	Ginnie Mae II Pool ‘MA5078’, 4,000 %, fällig 20.03.2048	356	0,04
526	Ginnie Mae II Pool ‘MA5193’, 4,500 %, fällig 20.05.2048	570	0,07
76	Ginnie Mae II Pool ‘MA5265’, 4,500 %, fällig 20.06.2048	82	0,01
567	Ginnie Mae II Pool ‘MA5331’, 4,500 %, fällig 20.07.2048	617	0,08
7.295	Ginnie Mae II Pool ‘MA5399’, 4,500 %, fällig 20.08.2048	7.878	0,98
164	Ginnie Mae II Pool ‘MA5467’, 4,500 %, fällig 20.09.2048	178	0,02
157	Ginnie Mae II Pool ‘MA5530’, 5,000 %, fällig 20.10.2048	172	0,02

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			
265	Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, fällig 20.12.2048	287	0,04
898	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, fällig 20.01.2049	967	0,12
4.556	Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5,000 %, fällig 20.01.2049	4.937	0,62
555	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, fällig 20.03.2049	598	0,07
50	Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, fällig 20.04.2049	54	0,01
646	Ginnie Mae II Pool 'MA6412', 4,500 %, fällig 20.01.2050	693	0,09
485	Ginnie Mae II Pool 'MA6602', 4,500 %, fällig 20.04.2050	521	0,07
9.300	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000 % ±	9.636	1,20
7.300	Ginnie Mae,30 year, TBA, 2,500 % ±	7.692	0,96
1.208	Government National Mortgage Association, Series 2004 81, Klasse SK, 6,038 %, fällig 16.10.2034 *	209	0,03
2.116	Government National Mortgage Association, Series 2008 40, Klasse SC, 6,188 %, fällig 16.05.2038 *	507	0,06
2.776	Government National Mortgage Association, Series 2008 79, Klasse ID, 6,642 %, fällig 20.06.2035 *	610	0,08
705	Government National Mortgage Association, Series 2010 H02, Klasse FA, 0,853 %, fällig 20.02.2060 *	709	0,09
1.318	Government National Mortgage Association, Series 2010 H20, Klasse AF, 0,494 %, fällig 20.10.2060 *	1.315	0,16
2.494	Government National Mortgage Association, Series 2010 H22, Klasse FE, 0,514 %, fällig 20.05.2059 *	2.491	0,31
669	Government National Mortgage Association, Series 2010 H28, Klasse FE, 0,564 %, fällig 20.12.2060 *	668	0,08
1.241	Government National Mortgage Association, Series 2011 146, Klasse KS, 5,938 %, fällig 16.11.2041 *	260	0,03
1.557	Government National Mortgage Association, Series 2011 79, Klasse KS, 5,242 %, fällig 20.05.2041 *	304	0,04
4.648	Government National Mortgage Association, Series 2012 H21, Klasse FA, 0,664 %, fällig 20.07.2062 *	4.655	0,58
18.583	Government National Mortgage Association, Series 2013 93, Klasse SA, 6,038 %, fällig 16.06.2043 *	4.221	0,53
5.538	Government National Mortgage Association, Series 2014 117, Klasse SJ, 5,442 %, fällig 20.08.2044 *	1.127	0,14
1.512	Government National Mortgage Association, Series 2014 2, Klasse CI, 4,500 %, fällig 20.01.2044	293	0,04
4.461	Government National Mortgage Association, Series 2014 60, Klasse SA, 5,938 %, fällig 16.04.2044 *	941	0,12
14.913	Government National Mortgage Association, Series 2015 136, Klasse IO, 0,608 %, fällig 16.08.2055 *	542	0,07
7.631	Government National Mortgage Association, Series 2015 177, Klasse MI, 5,000 %, fällig 20.10.2044	1.447	0,18
65.637	Government National Mortgage Association, Series 2017 111, Klasse IO, 0,739 %, fällig 16.02.2059 *	3.823	0,48
3.505	Government National Mortgage Association, Series 2017 19, Klasse SE, 5,988 %, fällig 16.02.2047 *	777	0,10
7.782	Government National Mortgage Association, Series 2017 26, Klasse IQ, 5,000 %, fällig 20.02.2040	1.485	0,19
21.039	Government National Mortgage Association, Series 2017 8, Klasse IO, 0,645 %, fällig 16.08.2058 *	1.006	0,13
6	Government National Mortgage Association, Series 2017 H13, Klasse FJ, 0,364 %, fällig 20.05.2067 *	6	–
4.972	Government National Mortgage Association, Series 2018 125, Klasse HS, 6,092 %, fällig 20.09.2048 *	720	0,09
9.391	Government National Mortgage Association, Series 2018 134, Klasse SM, 6,042 %, fällig 20.10.2048 *	1.415	0,18
1.694	Government National Mortgage Association, Series 2018 37, Klasse QA, 2,750 %, fällig 20.03.2048	1.784	0,22
6.638	Government National Mortgage Association, Series 2019 1, Klasse LS, 5,892 %, fällig 20.01.2049 *	1.224	0,15
1.182	Government National Mortgage Association, Series 2019 123, Klasse A, 3,000 %, fällig 20.10.2049	1.252	0,16
500	Government National Mortgage Association, Series 2019 128, Klasse AL, 2,500 %, fällig 20.10.2049	529	0,07
2.059	Government National Mortgage Association, Series 2019 28, Klasse AB, 3,150 %, fällig 16.06.2060 *	2.160	0,27
28.206	Government National Mortgage Association, Series 2019 85, Klasse LS, 3,132 %, fällig 20.07.2049 *	2.649	0,33
7.350	Government National Mortgage Association, Series 2020 116, Klasse GI, 2,500 %, fällig 20.08.2050 †∞	997	0,12
5.100	Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Klasse EI, 2,500 %, fällig 20.08.2050 †∞	694	0,09
2.400	Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Klasse IL, 2,500 %, fällig 20.08.2050 ∞	331	0,04
7.592	Government National Mortgage Association, Series 2020 36, Klasse GS, 5,942 %, fällig 20.03.2050 *	1.471	0,18
787	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Klasse MI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	134	0,02
295	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Klasse NI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	52	0,01
2.087	Government National Mortgage Association, Series 2020 61, Klasse CI, 4,000 %, fällig 20.03.2050	243	0,03
1.593	Government National Mortgage Association, Series 2020 85, Klasse CI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	183	0,02
10.388	Government National Mortgage Association, Series 2020 H08, Klasse BI, 1,721 %, fällig 01.04.2070 *	597	0,07
2.103	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Klasse FL, 1,308 %, fällig 20.05.2070 *	2.203	0,28
300	Government National Mortgage Association, Series 2020 H12, Klasse F, 0,658 %, fällig 20.07.2070 *	300	0,04
1.700	Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Klasse FA, 0,611 %, fällig 20.07.2070 * ∞	1.690	0,21
3.740	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Klasse A, 144A, 1,462 %, fällig 15.09.2031 *	3.596	0,45
3.880	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Klasse B, 144A, 2,662 %, fällig 15.09.2031 *	3.681	0,46
2.120	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS8, Series 2017 GS8, Klasse A4, 3,469 %, fällig 10.11.2050	2.394	0,30
39.763	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Klasse AX1, 144A, 0,302 %, fällig 25.10.2048 *†	179	0,02
2.115	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Series 2018 3A, Klasse A1, 144A, 4,500 %, fällig 25.05.2058 *	2.287	0,29
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 775.442 USD)		802.714	100,21
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 0,91 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
USA — 0,91 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
7.280	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 03.12.2020	7.278	0,91
60	United States Treasury Note/ Bond, 1,125 %, fällig 28.02.2025	62	–
		7.340	0,91
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 7.339 USD)		7.340	0,91
Kollektive Kapitalanlagen — 8,73 % (29. Februar 2020: 8,90 %)			
69.893	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (Distribución)	69.893	8,73
Gesamt Kollektive Kapitalanlagen (Kosten 69.893 USD)		69.893	8,73
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 862.954 USD)		890.269	111,14
Devisenterminkontrakte — 0,00 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		33	–
Termingeschäfte — 0,03 % (29. Februar 2020: 0,25 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		279	0,03
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		890.581	111,17
Termingeschäfte — (0,06 %) (29. Februar 2020: (0,56 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(507)	(0,06)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(507)	(0,06)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		890.074	111,11
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(89.069)	(11,11)
Gesamtnettovermögen		801.005	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 17.421.000 USD und machten 2.18 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

† Illiquide.

∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.

ABKÜRZUNGEN:

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

TBA – wird noch bekannt gegeben

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	86,64
Organismen für gemeinsame Anlagen	7,38
Finanzderivate	0,03
Sonstige Vermögenswerte	5,95
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.424	Verkauf	USD	2.861	$ 33
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 15 USD)								$ 33
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								-
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 15 USD)								$ 33

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	(680)	$ (94.690)	$ 89
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2020	25	3.986	(16)
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2020	(177)	(39.107)	(7)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	663	83.559	103
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	(44)	(7.732)	87
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	125	27.613	(484)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 2.661 USD)			$ 279
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(6.039) USD)			(507)
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(3.378) USD)			$ (228)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) £	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 89,96 % (29. Februar 2020: 90,54 %)			
Australien — 1,18 % (29. Februar 2020: 0,72 %)			
500	APT Pipelines Ltd, 3,125 %, fällig 18.07.2031	552	0,48
100	BHP Billiton Finance Ltd, 6,500 %, fällig 22.10.2077 *	110	0,09
510	Glencore Finance Europe Ltd, 6,000 %, fällig 03.04.2022	547	0,47
138	National Australie Bank Ltd, 3,000 %, fällig 04.09.2026	157	0,14
		1.366	1,18
Belgien — 1,06 % (29. Februar 2020: 0,54 %)			
266	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 4,000 %, fällig 24.09.2025	306	0,26
580	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2,850 %, fällig 25.05.2037	626	0,54
USD 280	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,800 %, fällig 23.01.2059	298	0,26
		1.230	1,06
Kanada — 1,18 % (29. Februar 2020: 1,19 %)			
570	Bank of Montreal, 1,375 %, fällig 29.12.2021	577	0,50
760	Royal Bank of Canada, 1,375 %, fällig 09.12.2024	784	0,68
		1.361	1,18
China — 0,61 % (29. Februar 2020: 0,62 %)			
700	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/London, 1,500 %, fällig 31.07.2022	708	0,61
Dänemark — 1,12 % (29. Februar 2020: 1,11 %)			
500	Danske Bank A/S, 2,250 %, fällig 14.01.2028 *	511	0,44
255	Orsted A/S, 4,875 %, fällig 12.01.2032	352	0,31
380	Orsted A/S, 2,500 %, fällig 16.05.2033	432	0,37
		1.295	1,12
Finnland — 0,29 % (29. Februar 2020: 0,29 %)			
320	Nordea Bank Abp, 2,375 %, fällig 02.06.2022	332	0,29
Frankreich — 5,17 % (29. Februar 2020: 6,25 %)			
250	AXA SA, 5,625 %, fällig 16.01.2054 *	313	0,27
304	AXA SA, 6,686 %, Perpetual *	373	0,32
149	AXA SA, 5,453 %, Perpetual *	172	0,15
430	BNP Paribas SA, 3,375 %, fällig 23.01.2026	477	0,41
700	BNP Paribas SA, 1,875 %, fällig 14.12.2027	721	0,62
300	BPCE SA, 5,250 %, fällig 16.04.2029	379	0,33
200	CNP Assurances, 7,375 %, fällig 30.09.2041 *	214	0,19
350	Credit Agricole SA, 7,500 %, Perpetual *	396	0,34
500	Electricite de France SA, 5,500 %, fällig 27.03.2037	721	0,63
200	Electricite de France SA, 5,500 %, fällig 17.10.2041	297	0,26
200	Electricite de France SA, 6,000 %, fällig 23.01.2114	338	0,29
431	Orange SA, 5,750 %, Perpetual *	474	0,41
500	Total Capital International SA, 1,405 %, fällig 03.09.2031	518	0,45
350	Veolia Environnement SA, 6,125 %, fällig 29.10.2037	580	0,50
		5.973	5,17
Deutschland — 6,99 % (29. Februar 2020: 7,13 %)			
520	BMW International Investment BV, 1,000 %, fällig 17.11.2021	524	0,45
250	Deutsche Telekom AG, 3,125 %, fällig 06.02.2034	291	0,25
340	Deutsche Telekom International Finance BV, 6,500 %, fällig 08.04.2022	372	0,32
300	innogy Finance BV, 5,500 %, fällig 06.07.2022	327	0,28
131	innogy Finance BV, 5,625 %, fällig 06.12.2023	152	0,13
100	innogy Finance BV, 4,750 %, fällig 31.01.2034	134	0,12
550	innogy Finance BV, 6,125 %, fällig 06.07.2039	894	0,77
2.420	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 6,000 %, fällig 07.12.2028	3.482	3,01
400	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 6,625 %, fällig 26.05.2042 *	437	0,38
600	Volkswagen Financial Services NV, 1,625 %, fällig 30.11.2022	607	0,53
300	Volkswagen Financial Services NV, 2,125 %, fällig 27.06.2024	309	0,27
500	Volkswagen International Finance NV, 3,375 %, fällig 16.11.2026	551	0,48
		8.080	6,99
Italien — 1,76 % (29. Februar 2020: 1,77 %)			
721	Enel Finance International NV, 5,750 %, fällig 14.09.2040	1.111	0,96
397	FCA Bank SpA/Ireland, 1,625 %, fällig 29.09.2021	396	0,34
USD 600	UniCredit SpA, 7,296 %, fällig 02.04.2034 *	525	0,46
		2.032	1,76
Niederlande — 1,89 % (29. Februar 2020: 2,46 %)			
300	Cooperatieve Rabobank UA, Series 2541, 4,000 %, fällig 19.09.2022	323	0,28
600	Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, fällig 23.05.2029	741	0,64
100	ING Bank NV, 5,375 %, fällig 15.04.2021	103	0,09
500	ING Groep NV, 3,000 %, fällig 18.02.2026	547	0,47
222	Koninklijke KPN NV, 5,750 %, fällig 17.09.2029	281	0,24
162	UPP Bond 1 Issuer plc, 4,902 %, fällig 28.02.2040	196	0,17
		2.191	1,89
Südafrika — 0,41 % (29. Februar 2020: 0,43 %)			
USD 550	Anglo American Capital Plc, 4,750 %, fällig 10.04.2027	473	0,41
Spanien — 0,83 % (29. Februar 2020: 1,29 %)			
600	Banco Santander SA, 2,750 %, fällig 12.09.2023	630	0,54
250	Telefonica Emisiones SA, 5,445 %, fällig 08.10.2029	330	0,29
		960	0,83
Supranational — 5,23 % (29. Februar 2020: 6,22 %)			
1.142	European Investment Bank, 5,375 %, fällig 07.06.2021	1.189	1,03
1.250	European Investment Bank, 1,375 %, fällig 07.03.2025	1.315	1,13
2.870	European Investment Bank, 3,750 %, fällig 07.12.2027	3.548	3,07
		6.052	5,23
Schweden — 0,92 % (29. Februar 2020: 0,93 %)			
600	Svenska Handelsbanken AB, 2,375 %, fällig 18.01.2022	617	0,53
440	Swedbank AB, 1,250 %, fällig 29.12.2021	445	0,39
		1.062	0,92
Schweiz — 1,78 % (29. Februar 2020: 1,87 %)			
210	Credit Suisse Group AG, 2,125 %, fällig 12.09.2025 *	217	0,19
500	Credit Suisse Group AG, 2,250 %, fällig 09.06.2028 *	517	0,44
609	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd, 3,000 %, fällig 27.05.2022	633	0,55
USD 520	Glencore Finance Canada Ltd, 6,000 %, fällig 15.11.2041	464	0,40
210	LafargeHolcim Sterling Finance Netherlands BV, 3,000 %, fällig 12.05.2032	231	0,20
		2.062	1,78
Großbritannien — 43,41 % (29. Februar 2020: 41,53 %)			
320	Anglian Water Services Financing Plc, 1,625 %, fällig 10.08.2025	331	0,29
893	Annington Funding Plc, 2,646 %, fällig 12.07.2025	956	0,83
767	Aspire Defence Finance Plc, Series A, 4,674 %, fällig 31.03.2040	1.044	0,90
740	Assura Financing Plc, 3,000 %, fällig 19.07.2028	822	0,71
367	Aviva Plc, 5,125 %, fällig 04.06.2050 *	430	0,37
290	Aviva Plc, 6,875 %, fällig 20.05.2058 *	430	0,37
210	Aviva Plc, 6,125 %, Perpetual *	231	0,20
664	BAE Systems Plc, 4,125 %, fällig 08.06.2022	702	0,61
191	Barclays Bank UK Plc, 4,250 %, fällig 12.01.2022	201	0,17
910	Barclays Plc, 2,375 %, fällig 06.10.2023 *	934	0,81
EUR 590	Barclays Plc, 3,375 %, fällig 02.04.2025 *	574	0,50
773	Barclays Plc, 3,250 %, fällig 12.02.2027	842	0,73
181	BAT International Finance Plc, 4,000 %, fällig 04.09.2026	204	0,18
1.000	BP Capital Markets Plc, 2,030 %, fällig 14.02.2025	1.056	0,91
450	BP Capital Markets Plc, 2,274 %, fällig 03.07.2026	487	0,42
1.260	British Land Co Plc/The, 2,375 %, fällig 14.09.2029	1.278	1,11
410	Bunzl Finance Plc, 2,250 %, fällig 11.06.2025	433	0,37
333	BUPA Finance Plc, 5,000 %, fällig 25.04.2023	359	0,31
560	Cadent Finance Plc, 2,625 %, fällig 22.09.2038	618	0,53
300	Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge/The, 2,350 %, fällig 27.06.2078	450	0,39
450	Clarion Funding Plc, 1,875 %, fällig 22.01.2035	461	0,40
250	Clarion Funding Plc, 3,125 %, fällig 19.04.2048	306	0,26
329	Close Brothers Finance Plc, 2,750 %, fällig 19.10.2026	352	0,30
640	Close Brothers Group Plc, 2,750 %, fällig 26.04.2023	666	0,58
191	Clydesdale Bank Plc, 4,625 %, fällig 08.06.2026	233	0,20
184	Co-Operative Bank Plc/The, 4,750 %, fällig 11.11.2021	192	0,17
397	Coventry Building Society, 5,875 %, fällig 28.09.2022	441	0,38
120	CPUK Finance Ltd, 7,239 %, fällig 28.02.2024	136	0,12
966	CPUK Finance Ltd, 3,588 %, fällig 28.08.2025	984	0,85
195	Crh Finance UK Plc, 4,125 %, fällig 02.12.2029	236	0,20
243	Dignity Finance Plc, Series A, 3,546 %, fällig 31.12.2034	256	0,22
500	Dignity Finance Plc, Series B, 4,696 %, fällig 31.12.2049	385	0,33
212	Eastern Power Networks Plc, 5,750 %, fällig 08.03.2024	249	0,22
142	Eastern Power Networks Plc, 6,250 %, fällig 12.11.2036	233	0,20
135	Eversholt Funding Plc, 5,831 %, fällig 02.12.2020	138	0,12
294	Experian Finance Plc, 3,500 %, fällig 15.10.2021	301	0,26
170	Experian Finance Plc, 3,250 %, fällig 07.04.2032	200	0,17
319	FCE Bank Plc, 2,727 %, fällig 03.06.2022	315	0,27
468	Gatwick Funding Ltd, 6,125 %, fällig 02.03.2026	551	0,48
550	Gatwick Funding Ltd, 3,250 %, fällig 26.02.2048	536	0,46
320	GlaxoSmithKline Capital Plc, 6,375 %, fällig 09.03.2039	560	0,48
204	GlaxoSmithKline Capital Plc, 4,250 %, fällig 18.12.2045	308	0,27
350	Grainger Plc, 3,375 %, fällig 24.04.2028	373	0,32
330	Grainger Plc, 3,000 %, fällig 03.07.2030	340	0,29
248	Greene King Finance Plc, Series A2, 5,318 %, fällig 15.09.2031	272	0,24
340	Greene King Finance Plc, Series B1, 1,993 %, fällig 15.12.2034 *	297	0,26
460	Guinness Partnership Ltd/The, 2,000 %, fällig 22.04.2055	481	0,42
600	HSBC Holdings Plc, 7,000 %, fällig 07.04.2038	873	0,76

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) £	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Großbritannien — (Fortsetzung)			
597	HSBC Holdings Plc, 6,000 %, fällig 29.03.2040	797	0,69
430	HSBC Holdings Plc, 5,875 %, Perpetual *	446	0,39
150	Hutchison Whampoa Finance UK Plc, Series B, 5,625 %, fällig 24.11.2026	191	0,16
470	Informa Plc, 3,125 %, fällig 05.07.2026	479	0,41
170	Land Securities Capital Markets Plc, 2,375 %, fällig 29.03.2027	180	0,16
210	Land Securities Capital Markets Plc, 2,399 %, fällig 08.02.2029	224	0,19
100	Land Securities Capital Markets Plc, 2,625 %, fällig 22.09.2037	108	0,09
290	Leeds Building Society, 3,750 %, fällig 25.04.2029 *	302	0,26
390	Legal & General Group Plc, 3,750 %, fällig 26.11.2049 *	406	0,35
290	Legal & General Group Plc, 4,500 %, fällig 01.11.2050 *	319	0,28
173	Legal & General Group Plc, 5,500 %, fällig 27.06.2064 *	208	0,18
480	Liberty Living Finance Plc, 3,375 %, fällig 28.11.2029	489	0,42
220	LiveWest Treasury Plc, 2,250 %, fällig 10.10.2043	236	0,20
620	Lloyds Bank Plc, 5,125 %, fällig 07.03.2025	745	0,64
510	Lloyds Bank Plc, 7,625 %, fällig 22.04.2025	652	0,56
453	Lloyds Bank Plc, 6,500 %, fällig 17.09.2040	794	0,69
340	Lloyds Banking Group Plc, 5,125 %, Perpetual *	335	0,29
500	Logicor 2019-1 UK Plc, 1,875 %, fällig 17.11.2026	522	0,45
180	M&G Plc, 3,875 %, fällig 20.07.2049 *	189	0,16
294	M&G Plc, 6,340 %, fällig 19.12.2063 *	359	0,31
317	Manchester Airport Group Funding Plc, 4,125 %, fällig 02.04.2024	340	0,29
520	Manchester Airport Group Funding Plc, 4,750 %, fällig 31.03.2034	628	0,54
260	Manchester Airport Group Funding Plc, 2,875 %, fällig 30.09.2044	245	0,21
475	Marston's Issuer Plc, Series A3, 5,177 %, fällig 15.07.2032 *	484	0,42
258	Marston's Issuer Plc, Series B1, 2,632 %, fällig 15.07.2035 *	204	0,18
47	Mitchells & Butlers Finance Plc, Series B1, 5,965 %, fällig 15.12.2023	48	0,04
173	Mitchells & Butlers Finance Plc, Series B2, 6,013 %, fällig 15.12.2028	181	0,16
160	National Express Group Plc, 2,500 %, fällig 11.11.2023	162	0,14
300	National Express Group Plc, 2,375 %, fällig 20.11.2028	292	0,25
540	National Grid Electricity Transmission Plc, 2,000 %, fällig 17.04.2040	567	0,49
310	National Grid Gas Plc, 1,375 %, fällig 07.02.2031	316	0,27
100	Nationwide Building Society, 3,000 %, fällig 06.05.2026	112	0,10
336	Nationwide Building Society, 3,250 %, fällig 20.01.2028	392	0,34
370	Natwest Group Plc, 3,125 %, fällig 28.03.2027 *	399	0,35
220	Notting Hill Genesis, 2,875 %, fällig 31.01.2029	239	0,21
120	Optivo Finance Plc, 2,857 %, fällig 07.10.2035	138	0,12
219	Places For People Treasury Plc, 2,875 %, fällig 17.08.2026	233	0,20
290	RSA Insurance Group Plc, 5,125 %, fällig 10.10.2045 *	329	0,28
260	Sanctuary Capital Plc, 5,000 %, fällig 26.04.2047	438	0,38
290	Sanctuary Capital Plc, 2,375 %, fällig 14.04.2050	325	0,28
650	Santander UK Group Holdings Plc, 2,920 %, fällig 08.05.2026 *	690	0,60
170	Santander UK Plc, 5,750 %, fällig 02.03.2026	217	0,19
717	Santander UK Plc, 3,875 %, fällig 15.10.2029	868	0,75
280	Scotland Gas Networks Plc, Series A3S, 4,875 %, fällig 21.12.2034	393	0,34
308	Scottish Widows Ltd, 7,000 %, fällig 16.06.2043	436	0,38
550	Segro Plc, 2,875 %, fällig 11.10.2037	636	0,55
117	Severn Trent Utilities Finance Plc, 3,625 %, fällig 16.01.2026	134	0,12
280	Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,000 %, fällig 02.06.2040	293	0,25
100	Severn Trent Utilities Finance Plc, 4,875 %, fällig 24.01.2042	155	0,13
372	South Eastern Power Networks Plc, 5,500 %, fällig 05.06.2026	462	0,40
191	Southern Gas Networks Plc, 2,500 %, fällig 03.02.2025	205	0,18
190	SP Transmission Plc, 2,000 %, fällig 13.11.2031	202	0,18
556	Telereal Secured Finance Plc, 4,010 %, fällig 10.12.2031	607	0,53
600	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500 %, fällig 02.05.2025	637	0,55
330	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,750 %, fällig 27.04.2030	350	0,30
578	Tesco Property Finance 3 Plc, 5,744 %, fällig 13.04.2040	773	0,67
290	UNITE Group Plc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2028	301	0,26
490	UNITE USAF II Plc, 3,921 %, fällig 30.06.2025	533	0,46
370	United Utilities Water Finance Plc, 1,875 %, fällig 03.06.2042	381	0,33
170	University of Oxford, 2,544 %, fällig 08.12.2117	237	0,21
720	Vodafone Group Plc, 3,375 %, fällig 08.08.2049	833	0,72
610	Vodafone Group Plc, 3,000 %, fällig 12.08.2056	662	0,57
198	Wales & West Utilities Finance Plc, 4,625 %, fällig 13.12.2023	224	0,19
360	Wellcome Trust Ltd/The, 2,517 %, fällig 07.02.2118	516	0,45
502	Western Power Distribution East Midlands Plc, 5,250 %, fällig 17.01.2023	558	0,48
405	Western Power Distribution East Midlands Plc, 6,250 %, fällig 10.12.2040	700	0,61
113	Wm Morrison Supermarkets Plc, 4,750 %, fällig 04.07.2029	141	0,12
320	Wm Morrison Supermarkets Plc, 2,500 %, fällig 01.10.2031	342	0,30
160	Yorkshire Building Society, 3,000 %, fällig 18.04.2025 *	170	0,15
380	Yorkshire Building Society, 3,500 %, fällig 21.04.2026	428	0,37
		50.194	43,41
USA — 16,13 % (29. Februar 2020: 16,19 %)			
USD 700	AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	582	0,50
241	Amgen Inc, 4,000 %, fällig 13.09.2029	297	0,26
USD 200	Apache Corp, 4,750 %, fällig 15.04.2043	141	0,12
630	AT&T Inc, Series GBP, 2,900 %, fällig 04.12.2026	691	0,60
563	AT&T Inc, 4,250 %, fällig 01.06.2043	701	0,61
1.350	Bank of America Corp, 6,125 %, fällig 15.09.2021	1.430	1,24
244	Bank of America Corp, 5,500 %, fällig 22.11.2021	258	0,22
300	Bank of America Corp, 7,000 %, fällig 31.07.2028	427	0,37
320	Becton Dickinson and Co, 3,020 %, fällig 24.05.2025	343	0,30
380	Berkshire Hathaway Finance Corp, 2,625 %, fällig 19.06.2059	457	0,40
769	Citigroup Inc, 7,375 %, fällig 01.09.2039	1.423	1,23
340	Comcast Corp, 1,875 %, fällig 20.02.2036	351	0,30
USD 150	CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	130	0,11
330	Digital Stout Holding LLC, 3,750 %, fällig 17.10.2030	391	0,34
500	GE Capital UK Funding Unlimited Co, 5,875 %, fällig 18.01.2033	601	0,52
300	GE Capital UK Funding Unlimited Co, 8,000 %, fällig 14.01.2039	432	0,37
USD 250	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10.01.2039	238	0,21
397	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,500 %, fällig 12.10.2021	418	0,36
489	Goldman Sachs Group Inc/The, 7,125 %, fällig 07.08.2025	631	0,55
920	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,125 %, fällig 25.07.2029	1.036	0,90
160	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,875 %, fällig 18.01.2038	254	0,22
191	Kraft Heinz Foods Co, 4,125 %, fällig 01.07.2027	206	0,18
300	McDonald's Corp, 2,950 %, fällig 15.03.2034	346	0,30
152	MetLife Inc, 5,375 %, fällig 09.12.2024	180	0,16
360	Mondelez International Inc, 4,500 %, fällig 03.12.2035	422	0,36
152	Mondelez International Inc, 3,875 %, fällig 06.03.2045	164	0,14
440	Morgan Stanley, 2,625 %, fällig 09.03.2027	479	0,41
530	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692 %, fällig 05.06.2028	535	0,46
165	Pfizer Inc, 2,735 %, fällig 15.06.2043	196	0,17
350	Prologis LP, 2,250 %, fällig 30.06.2029	378	0,33
535	Time Warner Cable LLC, 5,750 %, fällig 02.06.2031	682	0,59
880	Verizon Communications Inc, 1,875 %, fällig 19.09.2030	918	0,79
210	Verizon Communications Inc, 2,500 %, fällig 08.04.2031	232	0,20
76	Walmart Inc, 5,250 %, fällig 28.09.2035	119	0,10
460	Wells Fargo & Co, 1,375 %, fällig 30.06.2022	465	0,40
1.300	Wells Fargo & Co, 4,875 %, fällig 29.11.2035	1.698	1,47
350	Wells Fargo Bank NA, 5,250 %, fällig 01.08.2023	394	0,34
		18.646	16,13
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 96.770 GBP)		104.017	89,96
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 6,29 % (29. Februar 2020: 6,87 %)			
Deutschland — 0,50 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 620	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2030	576	0,50
Großbritannien — 4,69 % (29. Februar 2020: 5,86 %)			
3.890	United Kingdom Gilt, 2,750 %, fällig 07.09.2024	4.331	3,75
210	United Kingdom Gilt, 2,000 %, fällig 07.09.2025	231	0,20
170	United Kingdom Gilt, 1,500 %, fällig 22.07.2026	185	0,16
90	United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07.12.2027	117	0,10
370	United Kingdom Gilt, 1,750 %, fällig 07.09.2037	430	0,37
80	United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07.12.2040	131	0,11
		5.425	4,69
USA — 1,10 % (29. Februar 2020: 1,01 %)			
USD 710	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.10.2024	560	0,48
USD 220	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	219	0,19

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) £	% des Netto-inventar-werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
USD 410	United States Treasury Note/ Bond, 2,250 %, fällig 15.08.2049	361	0,31
USD 160	United States Treasury Note/ Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	134	0,12
		1.274	1,10
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 7.114 GBP)		7.275	6,29
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 103.884 GBP)		111.292	96,25
Devisenterminkontrakte — 0,09 % (29. Februar 2020: 0,01 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		106	0,09
Termingeschäfte — 0,04 % (29. Februar 2020: 0,08 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		48	0,04
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		111.446	96,38
Devisenterminkontrakte — 0,00 % (29. Februar 2020: (0,06 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(6)	–
Termingeschäfte — 0,00 % (29. Februar 2020: (0,09 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(4)	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(10)	–
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		111.436	96,38
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		4.188	3,62
Gesamtnettovermögen		£115.624	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 GBP, weniger als 1,000 GBP, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

EUR – Euro

USD – US-Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,21
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,13
Finanzderivate	3,66
Sonstige Vermögenswerte	5,95
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
19.11.2020	Citi	Kauf	GBP	56	Verkauf	USD	73	£	1
19.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	GBP	1.367	Verkauf	USD	1.793		26
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	362	Verkauf	GBP	276		(6)
19.11.2020	UBS	Kauf	GBP	1.726	Verkauf	EUR	1.915		15
19.11.2020	UBS	Kauf	GBP	2.681	Verkauf	USD	3.501		64
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 10 GBP)								£	106
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (70) GBP)									(6)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (60) GBP)								£	100

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bund Dezember 2020	(1)	£ (154)	£ 1
Euro-Bund September 2020	(1)	(157)	–
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	(15)	(1.563)	3
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	37	3.492	3
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	2	262	(4)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	(10)	(1.635)	41
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 91 GBP)			£ 48
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(98) GBP)			(4)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (7) GBP)			£ 44

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 0,25 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
300	SMB Private Education Loan Trust 2020-A, Series 2020 A, Class A2A, 144A, 2,230 %, fällig 15.09.2037	311	.025
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 311 USD)		311	.025
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 90,59 % (29. Februar 2020: 95,50 %)			
Australien — 1,21 % (29. Februar 2020: 0,26 %)			
200	Commonwealth Bank of Australie, 144A, 3,743 %, fällig 12.09.2039	225	0,18
30	Glencore Funding LLC, 144A, 3,000 %, fällig 27.10.2022	31	0,02
320	Glencore Funding LLC, 144A, 4,125 %, fällig 12.03.2024	348	0,28
460	Glencore Funding LLC, 144A, 4,625 %, fällig 29.04.2024	515	0,41
120	Glencore Funding LLC, 144A, 1,625 %, fällig 01.09.2025	120	0,10
40	Glencore Funding LLC, 144A, 3,875 %, fällig 27.10.2027	44	0,04
120	Glencore Funding LLC, 144A, 2,500 %, fällig 01.09.2030	118	0,09
90	Westpac Banking Corp, 4,421 %, fällig 24.07.2039	112	0,09
		1.513	1,21
Belgien — 0,88 % (29. Februar 2020: 1,25 %)			
130	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650 %, fällig 01.02.2026	147	0,12
280	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 12.01.2024	305	0,24
90	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,150 %, fällig 23.01.2025	103	0,08
460	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048	549	0,44
		1.104	0,88
Brasilien — 0,12 % (29. Februar 2020: 0,86 %)			
130	Petrobras Global Finance BV, 6,900 %, fällig 19.03.2049	149	0,12
Kanada — 0,82 % (29. Februar 2020: 0,68 %)			
100	Air Canada, 144A, 7,750 %, fällig 15.04.2021	100	0,08
80	Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30.05.2041	113	0,09
60	Barrick PD Australie Finance Pty Ltd, 5,950 %, fällig 15.10.2039	86	0,07
140	GFL Environmental Inc, 144A, 3,750 %, fällig 01.08.2025	141	0,11
100	GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2026	106	0,09
200	MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2027	192	0,15
270	Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig 15.12.2027	294	0,23
		1.032	0,82
Kaimaninseln — 0,18 % (29. Februar 2020: 0,31 %)			
390	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15.09.2024	228	0,18
Kolumbien — 0,08 % (29. Februar 2020: 0,26 %)			
90	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	102	0,08
Dänemark — 1,89 % (29. Februar 2020: 2,34 %)			
1.610	Danske Bank A/S, 144A, 5,000 %, fällig 12.01.2022	1.698	1,36
200	Danske Bank A/S, 144A, 3,001 %, fällig 20.09.2022 *	205	0,16
220	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig 12.01.2024	249	0,20
200	Danske Bank A/S, 144A, 3,244 %, fällig 20.12.2025 *	215	0,17
		2.367	1,89
Finnland — 0,31 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
390	Nordea Bank Abp, 144A, 0,750 %, fällig 28.08.2025	389	0,31
Frankreich — 1,12 % (29. Februar 2020: 0,70 %)			
560	BNP Paribas SA, 144A, 2,819 %, fällig 19.11.2025 *	597	0,48
280	BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *	292	0,23
480	BNP Paribas SA, 144A, 3,052 %, fällig 13.01.2031 *	520	0,41
		1.409	1,12
Deutschland — 0,06 % (29. Februar 2020: 0,06 %)			
50	Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, fällig 15.06.2030	79	0,06
Irland — 1,37 % (29. Februar 2020: 0,84 %)			
300	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,450 %, fällig 16.12.2021	306	0,24
270	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,500 %, fällig 15.09.2023	277	0,22
220	Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 01.05.2022	213	0,17
180	Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 01.10.2023	175	0,14
500	Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 2,875 %, fällig 15.02.2025	445	0,35
290	SMBC Aviation Capital Finance DAC, 144A, 4,125 %, fällig 15.07.2023	308	0,25
		1.724	1,37
Israel — 0,99 % (29. Februar 2020: 1,79 %)			
40	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, fällig 18.12.2022	39	0,03
60	Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, Series C, 0,250 %, fällig 01.02.2026	59	0,05
1.140	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,200 %, fällig 21.07.2021	1.140	0,91
		1.238	0,99
Italien — 3,94 % (29. Februar 2020: 4,41 %)			
920	Intesa Sanpaolo SpA, Series 0000, 144A, 6,500 %, fällig 24.02.2021	941	0,75
730	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,125 %, fällig 14.07.2022	750	0,60
500	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,375 %, fällig 12.01.2023	520	0,41
200	Intesa Sanpaolo SpA, Series XR, 144A, 4,700 %, fällig 23.09.2049	231	0,18
EUR 400	Intesa Sanpaolo SpA, 5,875 %, Perpetual *	479	0,38
80	Telecom Italia Capital SA, 7,200 %, fällig 18.07.2036	105	0,08
60	Telecom Italia Capital SA, 7,721 %, fällig 04.06.2038	84	0,07
220	Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303 %, fällig 30.05.2024	243	0,19
940	UniCredit SpA, 144A, 6,572 %, fällig 14.01.2022	1.000	0,80
510	UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, fällig 02.04.2034 *	597	0,48
		4.950	3,94
Japan — 0,17 % (29. Februar 2020: 0,95 %)			
200	Nippon Life Insurance Co, 144A, 3,400 %, fällig 23.01.2050 *	216	0,17
Kuwait — 0,32 % (29. Februar 2020: 0,32 %)			
390	NBK SPC Ltd, 144A, 2,750 %, fällig 30.05.2022	401	0,32
Luxemburg — 0,04 % (29. Februar 2020: 0,83 %)			
40	ArcelorMittal SA, 7,250 %, fällig 15.10.2039	51	0,04
Macau — 0,49 % (29. Februar 2020: 1,04 %)			
380	Sands China Ltd, 5,125 %, fällig 08.08.2025	422	0,33
200	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2029	197	0,16
		619	0,49
Mexiko — 0,17 % (29. Februar 2020: 0,31 %)			
200	Banco Santander SA, 3,306 %, fällig 27.06.2029	219	0,17
Niederlande — 1,44 % (29. Februar 2020: 1,24 %)			
580	Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, fällig 01.12.2023	647	0,52
440	NatWest Markets NV, Series B, 7,750 %, fällig 15.05.2023	500	0,40
80	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144A, 3,400 %, fällig 01.05.2030	89	0,07
290	Shell International Finance BV, 4,375 %, fällig 11.05.2045	361	0,29
190	Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	205	0,16
		1.802	1,44
Peru — 0,08 % (29. Februar 2020: 0,07 %)			
80	Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	103	0,08
Südafrika — 0,30 % (29. Februar 2020: 0,30 %)			
360	Anglo American Capital Plc, 144A, 3,750 %, fällig 10.04.2022	373	0,30
Spanien — 0,17 % (29. Februar 2020: 0,17 %)			
200	Banco Santander SA, 3,306 %, fällig 27.06.2029	219	0,17
Schweden — 0,30 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
370	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 144A, 0,850 %, fällig 02.09.2025	370	0,30
Schweiz — 3,10 % (29. Februar 2020: 3,39 %)			
200	Alcon Finance Corp, 144A, 2,750 %, fällig 23.09.2026	218	0,17
200	Alcon Finance Corp, 144A, 3,000 %, fällig 23.09.2029	217	0,17
250	Credit Suisse AG/New York NY, 1,000 %, fällig 05.05.2023	254	0,20
250	Credit Suisse Group AG, 144A, 2,193 %, fällig 05.06.2026 *	258	0,21
250	Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	292	0,23
840	Credit Suisse Group AG, 144A, 5,250 %, Perpetual *	858	0,68
220	Credit Suisse Group AG, 144A, 6,375 %, Perpetual *	239	0,19
70	Credit Suisse USA Inc, 7,125 %, fällig 15.07.2032	108	0,09
660	Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 25.10.2022	702	0,56
200	UBS Group AG, 144A, 3,126 %, fällig 13.08.2030 *	223	0,18
480	UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	521	0,42
		3.890	3,10
Vereinigte Arabische Emirate — 0,44 % (29. Februar 2020: 0,62 %)			
250	Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 144A, 4,375 %, fällig 23.04.2025	284	0,23
250	MDGH – GMTN BV, 144A, 2,500 %, fällig 07.11.2024	263	0,21
		547	0,44
Großbritannien — 5,03 % (29. Februar 2020: 6,00 %)			
410	Barclays Bank Plc, 144A, 10,179 %, fällig 12.06.2021	438	0,35
260	Barclays Bank Plc, 7,625 %, fällig 21.11.2022	289	0,23
680	Barclays Plc, 5,088 %, fällig 20.06.2030 *	791	0,63
840	Barclays Plc, 6,125 %, Perpetual *	871	0,69
200	Barclays Plc, 7,875 %, Perpetual *	210	0,17
50	British Telecommunications Plc, 9,625 %, fällig 15.12.2030	82	0,07
200	HSBC Holdings Plc, 4,950 %, fällig 31.03.2030	247	0,20

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Großbritannien — (Fortsetzung)			
440	HSBC Holdings Plc, 3,973 %, fällig 22.05.2030 *	500	0,40
200	HSBC Holdings Plc, 2,357 %, fällig 18.08.2031 *	203	0,16
60	HSBC Holdings Plc, 7,625 %, fällig 17.05.2032	83	0,07
200	Lloyds Banking Group Plc, 3,900 %, fällig 12.03.2024	220	0,18
200	Lloyds Banking Group Plc, 4,375 %, fällig 22.03.2028	237	0,19
GBP 280	Lloyds Banking Group Plc, 5,125 %, Perpetual *	368	0,29
200	Natwest Group Plc, 2,359 %, fällig 22.05.2024 *	207	0,16
200	Natwest Group Plc, 3,073 %, fällig 22.05.2028 *	214	0,17
340	Natwest Group Plc, 3,754 %, fällig 01.11.2029 *	359	0,29
500	Natwest Group Plc, 8,625 %, Perpetual *	527	0,42
165	Reynolds American Inc, 8,125 %, fällig 01.05.2040	230	0,18
80	Vodafone Group Plc, 6,150 %, fällig 27.02.2037	113	0,09
90	Vodafone Group Plc, 5,250 %, fällig 30.05.2048	118	0,09
		6.307	5,03
USA — 65,57 % (29. Februar 2020: 65,62 %)			
160	Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30.11.2036	217	0,17
30	Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig 30.11.2046	43	0,03
1.160	AbbVie Inc, 144A, 2,600 %, fällig 21.11.2024	1.243	0,99
40	AbbVie Inc, 144A, 3,800 %, fällig 15.03.2025	45	0,04
400	AbbVie Inc, 144A, 2,950 %, fällig 21.11.2026	440	0,35
570	AbbVie Inc, 144A, 3,200 %, fällig 21.11.2029	634	0,50
20	AbbVie Inc, 144A, 4,550 %, fällig 15.03.2035	25	0,02
630	AbbVie Inc, 144A, 4,050 %, fällig 21.11.2039	738	0,59
50	Activision Blizzard Inc, 1,350 %, fällig 15.09.2030	49	0,04
110	Activision Blizzard Inc, 2,500 %, fällig 15.09.2050	103	0,08
270	Adobe Inc, 2,150 %, fällig 01.02.2027	291	0,23
200	Aetna Inc, 2,800 %, fällig 15.06.2023	211	0,17
330	Air Lease Corp, 3,875 %, fällig 01.04.2021	334	0,27
280	Air Lease Corp, 3,375 %, fällig 01.07.2025	285	0,23
500	Aircastle Ltd, 144A, 5,250 %, fällig 11.08.2025	491	0,39
120	Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15.08.2030	120	0,10
110	Alphabet Inc, 1,900 %, fällig 15.08.2040	108	0,09
120	Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15.08.2050	115	0,09
180	Alphabet Inc, 2,250 %, fällig 15.08.2060	173	0,14
80	Altria Group Inc, 3,490 %, fällig 14.02.2022	83	0,07
70	Altria Group Inc, 2,850 %, fällig 09.08.2022	73	0,06
10	Altria Group Inc, 3,800 %, fällig 14.02.2024	11	0,01
380	Altria Group Inc, 4,400 %, fällig 14.02.2026	441	0,35
710	Altria Group Inc, 4,800 %, fällig 14.02.2029	849	0,68
270	Amazon.com Inc, 1,200 %, fällig 03.06.2027	276	0,22
120	Amazon.com Inc, 3,875 %, fällig 22.08.2037	150	0,12
120	Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	122	0,10
120	American International Group Inc, 3,400 %, fällig 30.06.2030	133	0,11
90	American International Group Inc, 4,750 %, fällig 01.04.2048	110	0,09
80	Amgen Inc, 4,400 %, fällig 01.05.2045	101	0,08
70	Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15.06.2051	93	0,07
70	Anthem Inc, 4,375 %, fällig 01.12.2047	88	0,07
10	Apache Corp, 4,750 %, fällig 15.04.2043	9	0,01
150	Apache Corp, 5,350 %, fällig 01.07.2049	145	0,12
330	Apple Inc, 2,650 %, fällig 11.05.2050	342	0,27
220	AT&T Inc, 3,800 %, fällig 15.02.2027	251	0,20
60	AT&T Inc, 1,650 %, fällig 01.02.2028	61	0,05
270	AT&T Inc, 4,300 %, fällig 15.02.2030	323	0,26
280	AT&T Inc, 4,500 %, fällig 15.05.2035	336	0,27
10	AT&T Inc, 6,350 %, fällig 15.03.2040	14	0,01
130	AT&T Inc, 5,550 %, fällig 15.08.2041	169	0,13
200	AT&T Inc, 3,100 %, fällig 01.02.2043	200	0,16
180	AT&T Inc, 3,500 %, fällig 01.02.2061	179	0,14
290	Aviation Capital Group LLC, 144A, 6,750 %, fällig 06.04.2021	296	0,24
120	Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.12.2024	124	0,10
70	Bank of America Corp, 4,200 %, fällig 26.08.2024	79	0,06
120	Bank of America Corp, 1,319 %, fällig 19.06.2026 *	122	0,10
132	Bank of America Corp, 3,419 %, fällig 20.12.2028 *	148	0,12
250	Bank of America Corp, 4,271 %, fällig 23.07.2029 *	296	0,24
70	Bank of America Corp, 3,974 %, fällig 07.02.2030 *	82	0,06
420	Bank of America Corp, 2,884 %, fällig 22.10.2030 *	457	0,36
110	Bank of America Corp, 2,592 %, fällig 29.04.2031 *	117	0,09
70	Bank of America Corp, 1,898 %, fällig 23.07.2031 *	71	0,06
60	Bank of America Corp, 2,676 %, fällig 19.06.2041 *	61	0,05
20	Bank of America Corp, 4,443 %, fällig 20.01.2048 *	26	0,02
170	Bank of America Corp, 4,330 %, fällig 15.03.2050 *	220	0,18
140	Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	176	0,14
245	Becton Dickinson and Co, 1,181 %, fällig 29.12.2020 *	245	0,20
90	Becton Dickinson and Co, 3,700 %, fällig 06.06.2027	102	0,08
370	Blackstone Mortgage Trust Inc, 4,375 %, fällig 05.05.2022	357	0,28
270	Boeing Co/The, 1,650 %, fällig 30.10.2020	270	0,22
1.060	Boeing Co/The, 3,100 %, fällig 01.05.2026	1.062	0,85
100	Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030	112	0,09
110	Boeing Co/The, 3,300 %, fällig 01.03.2035	102	0,08
50	Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01.05.2040	58	0,05
220	Boeing Co/The, 3,750 %, fällig 01.02.2050	198	0,16
50	Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01.05.2050	60	0,05
390	Boeing Co/The, 3,950 %, fällig 01.08.2059	362	0,29
70	Bon Secours Mercy Health Inc, 3,464 %, fällig 01.06.2030	79	0,06
220	BP Capital Markets America Inc, 3,410 %, fällig 11.02.2026	247	0,20
160	BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, fällig 04.05.2026	178	0,14
680	BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig 24.02.2050	672	0,54
70	Bristol-Myers Squibb Co, 4,250 %, fällig 26.10.2049	93	0,07
630	Broadcom Inc, 5,000 %, fällig 15.04.2030	751	0,60
210	Broadcom Inc, 4,150 %, fällig 15.11.2030	237	0,19
300	Broadcom Inc, 4,300 %, fällig 15.11.2032	346	0,28
130	Burlington Northern Santa Fe LLC, 4,400 %, fällig 15.03.2042	166	0,13
90	California Institute of Technology, 3,650 %, fällig 01.09.2119	101	0,08
50	Cameron LNG LLC, 144A, 2,902 %, fällig 15.07.2031	55	0,04
20	Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig 15.01.2035	23	0,02
70	Cameron LNG LLC, 144A, 3,701 %, fällig 15.01.2039	79	0,06
110	Carlyle Finance LLC, 144A, 5,650 %, fällig 15.09.2048	142	0,11
60	Carlyle Finance Subsidiary LLC, 144A, 3,500 %, fällig 19.09.2029	64	0,05
80	Carlyle Holdings II Finance LLC, 144A, 5,625 %, fällig 30.03.2043	101	0,08
140	Carrier Global Corp, 144A, 2,493 %, fällig 15.02.2027	147	0,12
310	Carrier Global Corp, 144A, 2,722 %, fällig 15.02.2030	326	0,26
140	Carrier Global Corp, 144A, 3,377 %, fällig 05.04.2040	146	0,12
170	Carrier Global Corp, 144A, 3,577 %, fällig 05.04.2050	181	0,14
90	Centene Corp, 4,750 %, fällig 15.01.2025	93	0,07
90	Centene Corp, 4,250 %, fällig 15.12.2027	94	0,07
190	Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	209	0,17
310	Centene Corp, 3,375 %, fällig 15.02.2030	323	0,26
240	CenterPoint Energy Houston Electric LLC, Series AA, 3,000 %, fällig 01.02.2027	264	0,21
90	Charles Schwab Corp/The, 3,850 %, fällig 21.05.2025	103	0,08
240	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,750 %, fällig 15.02.2028	268	0,21
50	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	57	0,05
50	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.05.2047	60	0,05
130	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	163	0,13
60	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	71	0,06
40	Chevron USA Inc, 2,343 %, fällig 12.08.2050	38	0,03
220	Cigna Corp, 4,125 %, fällig 15.11.2025	255	0,20
160	Cigna Corp, 4,375 %, fällig 15.10.2028	192	0,15
390	Cigna Corp, 2,400 %, fällig 15.03.2030	410	0,33
250	Cigna Corp, 4,800 %, fällig 15.08.2038	316	0,25
350	Cigna Corp, 3,200 %, fällig 15.03.2040	374	0,30
290	Cimarex Energy Co, 4,375 %, fällig 01.06.2024	312	0,25
260	Cimarex Energy Co, 3,900 %, fällig 15.05.2027	268	0,21
70	Cintas Corp No 2, 3,700 %, fällig 01.04.2027	80	0,06

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
130	Citigroup Inc, 3,980 %, fällig 20.03.2030 *	151	0,12
130	Citigroup Inc, 2,976 %, fällig 05.11.2030 *	141	0,11
580	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	1.025	0,82
70	Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 23.07.2048	94	0,07
400	Cleveland Electric Illuminating Co/The, 144A, 3,500 %, fällig 01.04.2028	437	0,35
200	Clorox Co/The, 1,800 %, fällig 15.05.2030	205	0,16
110	Coca-Cola Co/The, 4,125 %, fällig 25.03.2040	142	0,11
50	Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	52	0,04
80	Coca-Cola Co/The, 4,200 %, fällig 25.03.2050	106	0,08
10	Coca-Cola Co/The, 2,600 %, fällig 01.06.2050	10	0,01
50	Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	58	0,05
190	Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	235	0,19
290	Comcast Corp, 6,500 %, fällig 15.11.2035	445	0,35
140	Comcast Corp, 4,600 %, fällig 15.10.2038	180	0,14
80	Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	95	0,08
50	Comcast Corp, 3,969 %, fällig 01.11.2047	60	0,05
140	Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	202	0,16
240	Commonwealth Edison Co, 6,450 %, fällig 15.01.2038	364	0,29
30	Commonwealth Edison Co, 4,000 %, fällig 01.03.2048	38	0,03
420	Concho Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.01.2025	434	0,35
50	Concho Resources Inc, 3,750 %, fällig 01.10.2027	55	0,04
40	Constellation Brands Inc, 3,700 %, fällig 06.12.2026	46	0,04
30	Constellation Brands Inc, 3,500 %, fällig 09.05.2027	34	0,03
100	Consumers Energy Co, 2,500 %, fällig 01.05.2060	97	0,08
36	Continental Airlines 2007-1 Klasse A Pass Through Trust, Series 071A, 5,983 %, fällig 19.04.2022	35	0,03
104	Continental Resources Inc/OK, 5,000 %, fällig 15.09.2022	104	0,08
50	Continental Resources Inc/OK, 4,500 %, fällig 15.04.2023	51	0,04
110	Corning Inc, 3,900 %, fällig 15.11.2049	127	0,10
80	Costco Wholesale Corp, 1,375 %, fällig 20.06.2027	82	0,07
110	Costco Wholesale Corp, 1,600 %, fällig 20.04.2030	112	0,09
30	Costco Wholesale Corp, 1,750 %, fällig 20.04.2032	31	0,02
220	CVS Health Corp, 2,625 %, fällig 15.08.2024	236	0,19
53	CVS Health Corp, 4,100 %, fällig 25.03.2025	60	0,05
40	CVS Health Corp, 3,000 %, fällig 15.08.2026	44	0,03
650	CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	766	0,61
70	CVS Health Corp, 3,250 %, fällig 15.08.2029	78	0,06
10	CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	12	0,01
320	CVS Health Corp, 2,700 %, fällig 21.08.2040	314	0,25
110	CVS Health Corp, 5,125 %, fällig 20.07.2045	143	0,11
180	CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	235	0,19
70	DCP Midstream LP, Series A, 7,375 %, Perpetual *	52	0,04
40	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03.11.2036	40	0,03
128	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 4,420 %, fällig 15.06.2021	131	0,10
90	Delta Air Lines Inc, 2,600 %, fällig 04.12.2020	90	0,07
640	Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig 28.10.2024	588	0,47
200	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	219	0,17
250	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	261	0,21
110	Delta Air Lines Inc, 3,750 %, fällig 28.10.2029	98	0,08
630	Dermira Inc, 3,000 %, fällig 15.05.2022	647	0,52
30	Devon Energy Corp, 7,950 %, fällig 15.04.2032	39	0,03
90	Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	95	0,08
270	Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	271	0,22
440	Diamondback Energy Inc, 5,375 %, fällig 31.05.2025	458	0,37
180	Dollar Tree Inc, 4,200 %, fällig 15.05.2028	213	0,17
300	DR Horton Inc, 2,500 %, fällig 15.10.2024	320	0,25
220	Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, fällig 15.02.2040	312	0,25
60	Duke Energy Corp, 3,150 %, fällig 15.08.2027	67	0,05
90	Duke Energy Indiana LLC, Series YYY, 3,250 %, fällig 01.10.2049	101	0,08
110	Duke Energy Ohio Inc, 2,125 %, fällig 01.06.2030	116	0,09
110	Eaton Corp, 4,150 %, fällig 02.11.2042	138	0,11
150	Edison International, 4,950 %, fällig 15.04.2025	165	0,13
200	Energy Transfer Operating LP, Series 5Y, 4,200 %, fällig 15.09.2023	212	0,17
250	Energy Transfer Operating LP, 5,500 %, fällig 01.06.2027	280	0,22
10	Energy Transfer Operating LP, Series 20Y, 5,800 %, fällig 15.06.2038	10	0,01
190	Energy Transfer Operating LP, Series F, 6,750 %, Perpetual *	158	0,13
320	Energy Transfer Operating LP, Series G, 7,125 %, Perpetual *	280	0,22
290	Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig 16.10.2028	342	0,27
190	Enterprise Products Operating LLC, 4,250 %, fällig 15.02.2048	208	0,17
80	Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31.01.2060	82	0,06
350	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	320	0,25
190	EOG Resources Inc, 4,150 %, fällig 15.01.2026	220	0,18
150	EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	180	0,14
30	EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	39	0,03
10	Estee Lauder Cos Inc/The, 3,125 %, fällig 01.12.2049	11	0,01
100	Exelon Corp, 4,050 %, fällig 15.04.2030	119	0,09
60	Exxon Mobil Corp, 3,482 %, fällig 19.03.2030	70	0,06
30	Exxon Mobil Corp, 2,995 %, fällig 16.08.2039	32	0,03
230	Exxon Mobil Corp, 4,227 %, fällig 19.03.2040	285	0,23
40	Exxon Mobil Corp, 4,114 %, fällig 01.03.2046	49	0,04
80	Exxon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15.04.2051	90	0,07
150	Fidelity & Guaranty Life Holdings Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.05.2025	166	0,13
220	FirstEnergy Corp, Series B, 3,900 %, fällig 15.07.2027	242	0,19
280	FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, fällig 15.11.2031	397	0,32
50	Florida Power & Light Co, 3,150 %, fällig 01.10.2049	57	0,05
560	Ford Motor Credit Co LLC, 3,350 %, fällig 01.11.2022	560	0,45
200	Ford Motor Credit Co LLC, 4,125 %, fällig 17.08.2027	200	0,16
450	Fox Corp, 5,476 %, fällig 25.01.2039	598	0,48
EUR 100	GE Capital European Funding Unlimited Co, 6,025 %, fällig 01.03.2038	160	0,13
GBP 100	GE Capital UK Funding Unlimited Co, 8,000 %, fällig 14.01.2039	193	0,15
50	General Dynamics Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2027	57	0,05
160	General Dynamics Corp, 3,625 %, fällig 01.04.2030	190	0,15
210	General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2040	266	0,21
240	General Electric Co, 6,150 %, fällig 07.08.2037	285	0,23
30	General Electric Co, 5,875 %, fällig 14.01.2038	35	0,03
1.110	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10.01.2039	1.416	1,13
120	General Motors Co, 1,210 %, fällig 10.09.2021 *	120	0,10
130	General Motors Co, 4,875 %, fällig 02.10.2023	142	0,11
100	General Motors Co, 5,400 %, fällig 02.10.2023	111	0,09
80	General Motors Co, 6,125 %, fällig 01.10.2025	94	0,07
140	General Motors Co, 6,600 %, fällig 01.04.2036	168	0,13
20	General Motors Co, 6,750 %, fällig 01.04.2046	24	0,02
70	General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	83	0,07
60	General Motors Financial Co Inc, 1,618 %, fällig 30.06.2022 *	60	0,05
120	General Motors Financial Co Inc, 3,700 %, fällig 09.05.2023	126	0,10
100	Gilead Sciences Inc, 4,000 %, fällig 01.09.2036	125	0,10
40	Gilead Sciences Inc, 4,750 %, fällig 01.03.2046	54	0,04
250	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, fällig 21.10.2025	285	0,23
620	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16.11.2026	692	0,55
170	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800 %, fällig 15.03.2030	198	0,16
90	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	120	0,10
100	Halliburton Co, 2,920 %, fällig 01.03.2030	102	0,08
120	Halliburton Co, 5,000 %, fällig 15.11.2045	132	0,11
130	HCA Inc, 4,125 %, fällig 15.06.2029	150	0,12
100	HCA Inc, 5,125 %, fällig 15.06.2039	125	0,10
180	HCA Inc, 5,500 %, fällig 15.06.2047	229	0,18
90	Health Care Service Corp A Mutual Legal Reserve Co, 144A, 2,200 %, fällig 01.06.2030	92	0,07
150	Hershey Co/The, 1,700 %, fällig 01.06.2030	155	0,12
260	Hexcel Corp, 3,950 %, fällig 15.02.2027	280	0,22
340	High Street Funding Trust I, 144A, 4,111 %, fällig 15.02.2028	386	0,31
140	Home Depot Inc/The, 2,950 %, fällig 15.06.2029	158	0,13
50	Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	57	0,05
30	Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	34	0,03

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
130	Humana Inc, 3,850 %, fällig 01.10.2024	144	0,11
80	Humana Inc, 3,950 %, fällig 15.03.2027	92	0,07
230	Humana Inc, 3,125 %, fällig 15.08.2029	255	0,20
190	Humana Inc, 4,950 %, fällig 01.10.2044	256	0,20
150	Huntington Ingalls Industries Inc, 3,483 %, fällig 01.12.2027	164	0,13
810	ILFC E-Capital Trust I, 144A, 3,020 %, fällig 21.12.2065 *	415	0,33
100	ILFC E-Capital Trust II, 144A, 3,270 %, fällig 21.12.2065 *	55	0,04
40	Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	56	0,04
150	Intel Corp, 4,950 %, fällig 25.03.2060	217	0,17
80	Intuit Inc, 0,650 %, fällig 15.07.2023	81	0,06
80	Jersey Central Power & Light Co, 144A, 4,300 %, fällig 15.01.2026	93	0,07
190	Johnson & Johnson, 2,100 %, fällig 01.09.2040	191	0,15
10	Johnson & Johnson, 2,250 %, fällig 01.09.2050	10	0,01
200	Johnson & Johnson, 2,450 %, fällig 01.09.2060	198	0,16
70	JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	83	0,07
840	JPMorgan Chase & Co, 2,739 %, fällig 15.10.2030 *	912	0,73
20	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	21	0,02
220	JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, fällig 13.05.2031 *	237	0,19
90	JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01.06.2045	124	0,10
140	JPMorgan Chase & Co, 4,260 %, fällig 22.02.2048 *	179	0,14
30	JPMorgan Chase & Co, 3,964 %, fällig 15.11.2048 *	37	0,03
100	Kaiser Foundation Hospitals, Series 2019, 3,266 %, fällig 01.11.2049	112	0,09
100	Kimberly-Clark Corp, 3,100 %, fällig 26.03.2030	114	0,09
100	Kinder Morgan Inc, 5,300 %, fällig 01.12.2034	120	0,10
20	Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01.03.2048	25	0,02
210	KKR Group Finance Co III LLC, 144A, 5,125 %, fällig 01.06.2044	261	0,21
40	KKR Group Finance Co VII LLC, 144A, 3,625 %, fällig 25.02.2050	41	0,03
220	KKR Group Finance Co VIII LLC, 144A, 3,500 %, fällig 25.08.2050	226	0,18
620	L3Harris Technologies Inc, 2,900 %, fällig 15.12.2029	687	0,55
230	L3Harris Technologies Inc, 4,854 %, fällig 27.04.2035	305	0,24
130	Lam Research Corp, 1,900 %, fällig 15.06.2030	135	0,11
50	Lam Research Corp, 2,875 %, fällig 15.06.2050	53	0,04
100	Lennox International Inc, 1,350 %, fällig 01.08.2025	101	0,08
100	Lennox International Inc, 1,700 %, fällig 01.08.2027	101	0,08
130	Lockheed Martin Corp, 1,850 %, fällig 15.06.2030	135	0,11
30	Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig 15.04.2030	37	0,03
70	Lowe's Cos Inc, 5,000 %, fällig 15.04.2040	93	0,07
50	Lowe's Cos Inc, 5,125 %, fällig 15.04.2050	70	0,06
400	Magellan Health Inc, 4,900 %, fällig 22.09.2024	417	0,33
140	Marriott International Inc/MD, 3,600 %, fällig 15.04.2024	145	0,12
30	März Inc, 144A, 3,200 %, fällig 01.04.2030	34	0,03
220	März Inc, 144A, 2,375 %, fällig 16.07.2040	217	0,17
60	Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375 %, fällig 15.04.2050	62	0,05
140	Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 4,900 %, fällig 01.04.2077	182	0,14
200	Mastercard Inc, 3,300 %, fällig 26.03.2027	230	0,18
90	Mastercard Inc, 3,350 %, fällig 26.03.2030	106	0,08
80	Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	101	0,08
120	McDonald's Corp, 2,125 %, fällig 01.03.2030	125	0,10
90	McDonald's Corp, 4,450 %, fällig 01.03.2047	112	0,09
100	McDonald's Corp, 4,450 %, fällig 01.09.2048	126	0,10
170	MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	198	0,16
80	Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	81	0,06
110	Merck & Co Inc, 2,350 %, fällig 24.06.2040	112	0,09
90	Merck & Co Inc, 2,450 %, fällig 24.06.2050	91	0,07
340	Microsoft Corp, 3,450 %, fällig 08.08.2036	410	0,33
113	Microsoft Corp, 4,100 %, fällig 06.02.2037	146	0,12
67	Microsoft Corp, 2,525 %, fällig 01.06.2050	71	0,06
90	MidAmerican Energy Co, 3,650 %, fällig 15.04.2029	107	0,09
110	MidAmerican Energy Co, 3,150 %, fällig 15.04.2050	124	0,10
240	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	250	0,20
40	Molson Coors Beverage Co, 3,000 %, fällig 15.07.2026	43	0,03
80	Molson Coors Beverage Co, 4,200 %, fällig 15.07.2046	83	0,07
130	Montage Resources Corp, 8,875 %, fällig 15.07.2023	133	0,11
270	Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28.04.2026 *	285	0,23
230	Morgan Stanley, 2,699 %, fällig 22.01.2031 *	249	0,20
90	Morgan Stanley, 4,375 %, fällig 22.01.2047	120	0,10
220	Morgan Stanley, 5,597 %, fällig 24.03.2051 *	340	0,27
20	MPLX LP, 4,800 %, fällig 15.02.2029	23	0,02
260	MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	277	0,22
GBP 330	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692 %, fällig 05.06.2028	445	0,35
130	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 4,625 %, fällig 01.08.2029	139	0,11
260	NCL Corp Ltd, 144A, 12,250 %, fällig 15.05.2024	290	0,23
170	NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 15.12.2024	117	0,09
180	New York Life Insurance Co, 144A, 3,750 %, fällig 15.05.2050	206	0,16
80	New York Life Insurance Co, 144A, 4,450 %, fällig 15.05.2069	100	0,08
40	Newmont Corp, 2,250 %, fällig 01.10.2030	42	0,03
110	Noble Energy Inc, 5,250 %, fällig 15.11.2043	147	0,12
120	Norfolk Southern Railway Co, 7,875 %, fällig 15.05.2043	204	0,16
160	Northrop Grumman Corp, 5,150 %, fällig 01.05.2040	218	0,17
250	Northrop Grumman Corp, 4,030 %, fällig 15.10.2047	306	0,24
160	Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01.05.2050	231	0,18
480	Northwest Pipeline LLC, 4,000 %, fällig 01.04.2027	535	0,43
390	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,850 %, fällig 30.09.2047	447	0,36
90	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,625 %, fällig 30.09.2059	100	0,08
130	Nuveen LLC, 144A, 4,000 %, fällig 01.11.2028	156	0,12
50	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	58	0,05
160	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	182	0,14
60	NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	71	0,06
40	Occidental Petroleum Corp, 2,600 %, fällig 15.04.2022	39	0,03
250	Occidental Petroleum Corp, 2,700 %, fällig 15.08.2022	246	0,20
100	Occidental Petroleum Corp, 2,700 %, fällig 15.02.2023	96	0,08
130	Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, fällig 15.08.2026	114	0,09
50	Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2031	54	0,04
230	Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig 15.09.2036	226	0,18
50	Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, fällig 15.06.2039	51	0,04
50	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.04.2046	40	0,03
90	Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, fällig 15.02.2047	68	0,05
20	Oncor Electric Delivery Co LLC, 3,100 %, fällig 15.09.2049	22	0,02
430	Otis Worldwide Corp, 144A, 2,565 %, fällig 15.02.2030	460	0,37
30	Otis Worldwide Corp, 144A, 3,112 %, fällig 15.02.2040	32	0,03
70	Pacific Gas and Electric Co, 1,750 %, fällig 16.06.2022	70	0,06
130	Pacific Gas and Electric Co, 4,250 %, fällig 01.08.2023	139	0,11
100	Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01.08.2027	97	0,08
70	Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01.02.2031	67	0,05
10	Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.08.2040	9	0,01
10	Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01.08.2050	9	0,01
100	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 5,625 %, fällig 15.10.2027	104	0,08
170	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2028	165	0,13
160	PayPal Holdings Inc, 2,300 %, fällig 01.06.2030	171	0,14
50	PayPal Holdings Inc, 3,250 %, fällig 01.06.2050	57	0,04
150	PepsiCo Inc, 2,625 %, fällig 29.07.2029	167	0,13
47	Pfizer Inc, 3,000 %, fällig 15.12.2026	54	0,04
60	Pfizer Inc, 2,550 %, fällig 28.05.2040	63	0,05
50	Pfizer Inc, 2,700 %, fällig 28.05.2050	52	0,04
120	Philip Morris International Inc, 2,875 %, fällig 01.05.2024	130	0,10
60	Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, fällig 25.03.2030	69	0,06
50	Procter & Gamble Co/The, 3,550 %, fällig 25.03.2040	61	0,05
80	Procter & Gamble Co/The, 3,500 %, fällig 25.10.2047	102	0,08
50	Procter & Gamble Co/The, 3,600 %, fällig 25.03.2050	64	0,05
200	Prologis LP, 1,250 %, fällig 15.10.2030	196	0,16
130	Prudential Financial Inc, 1,500 %, fällig 10.03.2026	136	0,11
80	Range Resources Corp, 5,750 %, fällig 01.06.2021	81	0,06
16	Range Resources Corp, 5,875 %, fällig 01.07.2022	16	0,01
70	Range Resources Corp, 5,000 %, fällig 15.08.2022	71	0,06
100	Range Resources Corp, 4,875 %, fällig 15.05.2025	94	0,07

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
310	Range Resources Corp, 144A, 9,250 %, fällig 01.02.2026	327	0,26
20	Raymond James Financial Inc, 4,650 %, fällig 01.04.2030	24	0,02
80	Raymond James Financial Inc, 4,950 %, fällig 15.07.2046	103	0,08
70	Raytheon Technologies Corp, 4,625 %, fällig 16.11.2048	92	0,07
100	Regeneron Pharmaceuticals Inc, 1,750 %, fällig 15.09.2030	98	0,08
20	Regeneron Pharmaceuticals Inc, 2,800 %, fällig 15.09.2050	19	0,02
280	Reliance Standard Life Global Funding II, 144A, 2,500 %, fällig 30.10.2024	291	0,23
180	Republic Services Inc, 3,375 %, fällig 15.11.2027	205	0,16
80	Royal Caribbean Cruises Ltd, 2,650 %, fällig 28.11.2020	80	0,06
50	S&P Global Inc, 1,250 %, fällig 15.08.2030	50	0,04
40	S&P Global Inc, 3,250 %, fällig 01.12.2049	47	0,04
80	S&P Global Inc, 2,300 %, fällig 15.08.2060	74	0,06
230	San Diego Gas & Electric Co, Series RRR, 3,750 %, fällig 01.06.2047	273	0,22
70	ServiceNow Inc, 1,400 %, fällig 01.09.2030	69	0,05
270	Simon Property Group LP, 3,500 %, fällig 01.09.2025	297	0,24
190	Smithfield Foods Inc, 144A, 3,350 %, fällig 01.02.2022	190	0,15
280	Southern California Edison Co, 2,250 %, fällig 01.06.2030	285	0,23
10	Southern California Edison Co, 4,000 %, fällig 01.04.2047	11	0,01
160	Southern California Edison Co, Series C, 4,125 %, fällig 01.03.2048	179	0,14
100	Southern California Edison Co, 3,650 %, fällig 01.02.2050	106	0,08
410	Southwest Airlines Co, 4,750 %, fällig 04.05.2023	437	0,35
190	Southwest Airlines Co, 5,250 %, fällig 04.05.2025	208	0,17
140	Southwest Airlines Co, 5,125 %, fällig 15.06.2027	153	0,12
388	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC, 144A, 3,360 %, fällig 20.09.2021	393	0,31
90	Sunoco Logistics Partners Operations LP, 3,900 %, fällig 15.07.2026	94	0,08
200	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.11.2023	202	0,16
50	Target Corp, 3,375 %, fällig 15.04.2029	58	0,05
110	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,900 %, fällig 15.09.2044	139	0,11
160	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,270 %, fällig 15.05.2047	191	0,15
160	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 3,300 %, fällig 15.05.2050	166	0,13
270	Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, fällig 15.03.2027	336	0,27
340	Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, fällig 15.10.2028	440	0,35
320	Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01.03.2030	335	0,27
60	Texas Instruments Inc, 2,900 %, fällig 03.11.2027	67	0,05
120	Texas Instruments Inc, 2,250 %, fällig 04.09.2029	129	0,10
450	Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2039	566	0,45
270	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	387	0,31
90	Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig 15.06.2039	126	0,10
254	Time Warner Entertainment Co LP, 8,375 %, fällig 15.07.2033	396	0,32
50	T-Mobile USA Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2040	60	0,05
70	T-Mobile USA Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2050	86	0,07
335	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01.02.2026	439	0,35
460	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,250 %, fällig 01.12.2026	588	0,47
50	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 4,450 %, fällig 01.08.2042	57	0,04
20	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 144A, 3,950 %, fällig 15.05.2050	22	0,02
220	Union Pacific Corp, 4,375 %, fällig 10.09.2038	275	0,22
90	Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05.02.2070	103	0,08
202	United Airlines 2014-1 Klasse B Pass Through Trust, Series B, 4,750 %, fällig 11.04.2022	178	0,14
30	United Airlines Holdings Inc, 6,000 %, fällig 01.12.2020	30	0,02
100	United Airlines Holdings Inc, 4,250 %, fällig 01.10.2022	93	0,07
220	UnitedHealth Group Inc, 3,850 %, fällig 15.06.2028	260	0,21
110	UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	115	0,09
120	UnitedHealth Group Inc, 3,500 %, fällig 15.08.2039	140	0,11
50	UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15.05.2040	53	0,04
120	UnitedHealth Group Inc, 4,750 %, fällig 15.07.2045	164	0,13
30	UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	40	0,03
40	UnitedHealth Group Inc, 2,900 %, fällig 15.05.2050	43	0,03
130	US Airways 2012-2 Klasse B Pass Through Trust, 6,750 %, fällig 03.06.2021	112	0,09
560	Verizon Communications Inc, 4,272 %, fällig 15.01.2036	688	0,55
10	Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	14	0,01
40	Verizon Communications Inc, 6,550 %, fällig 15.09.2043	64	0,05
60	Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig 15.08.2046	75	0,06
220	Verizon Communications Inc, 4,522 %, fällig 15.09.2048	290	0,23
70	Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22.03.2050	88	0,07
20	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 3,750 %, fällig 15.02.2027	20	0,02
80	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2030	80	0,06
90	Visa Inc, 2,050 %, fällig 15.04.2030	96	0,08
70	Visa Inc, 2,700 %, fällig 15.04.2040	76	0,06
70	Visa Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2047	87	0,07
200	Visa Inc, 2,000 %, fällig 15.08.2050	189	0,15
60	Walmart Inc, 3,700 %, fällig 26.06.2028	71	0,06
200	Walmart Inc, 4,050 %, fällig 29.06.2048	260	0,21
20	Walt Disney Co/The, 6,200 %, fällig 15.12.2034	29	0,02
23	Walt Disney Co/The, 6,400 %, fällig 15.12.2035	35	0,03
30	Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig 15.11.2037	46	0,04
50	Walt Disney Co/The, 5,400 %, fällig 01.10.2043	69	0,06
10	Walt Disney Co/The, 4,950 %, fällig 15.10.2045	13	0,01
170	Waste Management Inc, 3,150 %, fällig 15.11.2027	190	0,15
110	Wells Fargo & Co, 2,406 %, fällig 30.10.2025 *	116	0,09
10	Wells Fargo & Co, 3,000 %, fällig 23.10.2026	11	0,01
200	Wells Fargo & Co, 3,196 %, fällig 17.06.2027 *	219	0,17
110	Wells Fargo & Co, 3,584 %, fällig 22.05.2028 *	124	0,10
180	Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04.04.2031 *	220	0,17
80	Wells Fargo & Co, 3,068 %, fällig 30.04.2041 *	85	0,07
300	Wells Fargo & Co, 5,375 %, fällig 02.11.2043	403	0,32
200	Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig 07.12.2046	254	0,20
460	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	630	0,50
170	Western Midstream Operating LP, 2,116 %, fällig 13.01.2023 *	162	0,13
230	Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig 01.06.2025	231	0,18
250	Western Midstream Operating LP, 4,750 %, fällig 15.08.2028	253	0,20
80	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15.08.2048	72	0,06
130	Western Midstream Operating LP, 6,250 %, fällig 01.02.2050	130	0,10
90	WPX Energy Inc, 4,500 %, fällig 15.01.2030	86	0,07
		82.278	65,57
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 104.528 USD)		113.672	90,59
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 5,28 % (29. Februar 2020: 3,93 %)			
Bermuda — 0,27 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
330	Bermuda Government International Bond, 144A, 2,375 %, fällig 20.08.2030	337	0,27
Ghana — 0,18 % (29. Februar 2020: 0,41 %)			
250	Ghana Government International Bond, 144A, 8,627 %, fällig 16.06.2049	229	0,18
Israel — 0,50 % (29. Februar 2020: 0,32 %)			
360	Israel Government International Bond, 3,250 %, fällig 17.01.2028	411	0,33
200	Israel Government International Bond, 2,750 %, fällig 03.07.2030	221	0,17
		632	0,50
Peru — 0,09 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
100	Peruvian Government International Bond, 2,783 %, fällig 23.01.2031	109	0,09
Katar — 0,46 % (29. Februar 2020: 0,53 %)			
230	Qatar Government International Bond, 144A, 4,817 %, fällig 14.03.2049	315	0,25
200	Qatar Government International Bond, 144A, 4,400 %, fällig 16.04.2050	260	0,21
		575	0,46
Russland — 0,21 % (29. Februar 2020: 0,23 %)			
RUB 18.110	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	262	0,21
Vereinigte Arabische Emirate — 0,82 % (29. Februar 2020: 0,19 %)			
310	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 0,750 %, fällig 02.09.2023	310	0,25
200	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 3,125 %, fällig 16.04.2030	225	0,18
230	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 3,125 %, fällig 30.09.2049	248	0,20
200	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 3,875 %, fällig 16.04.2050	244	0,19
		1.027	0,82
USA — 2,75 % (29. Februar 2020: 1,18 %)			
140	Alabama Economic Settlement Authority, 3,163 %, fällig 15.09.2025	147	0,12

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
150	American Municipal Power Inc, 7,834 %, fällig 15.02.2041	251	0,20
210	Port Authority of New York & New Jersey, 4,458 %, fällig 01.10.2062	275	0,22
220	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 3,006 %, fällig 15.05.2050	234	0,19
210	State of California, 7,300 %, fällig 01.10.2039	349	0,28
70	State of Illinois, 5,100 %, fällig 01.06.2033	72	0,06
300	United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig 30.06.2022	300	0,24
120	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.07.2025	120	0,09
310	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.05.2030	308	0,24
430	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15.05.2050	409	0,32
1.010	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	991	0,79
		3.456	2,75
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 6.167 USD)		6.627	5,28
Schuldverschreibungen — 0,21 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
170	Asplundh Tree Expert LLC, 0,000 %, fällig 19.08.2027 *		170
100	Delta Air Lines Inc, 5,750 %, fällig 29.04.2023 *		100
Summe Darlehensschuldverschreibungen (Anschaffungskosten 267 USD)		270	0,21

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Kollektive Kapitalanlagen — 1,74 % (29. Februar 2020: 0,08 %)			
2.187	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (Distribución)		2.187
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2.187 USD)		2.187	1,74
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 113.460 USD)		123.067	98,07
Kreditausfallversicherungen — 0,05 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		59	0,05
Devisenterminkontrakte — 1,89 % (29. Februar 2020: 0,03 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		2.374	1,89
Termingeschäfte — 0,13 % (29. Februar 2020: 0,26 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		159	0,13
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		125.659	100,14
Devisenterminkontrakte — (0,09 %) (29. Februar 2020: (0,54 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(119)	(0,09)
Termingeschäfte — 0,00 (29. Februar 2020: (0,13 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(119)	(0,09)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		125.540	100,05
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(57)	(0,05)
Gesamtnettovermögen		$125.483	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 33.690.000 USD und machten 26.83 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
EUR – Euro
GBP – Britisches Pfund Sterling
RUB – Russischer Rubel

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,59
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	0,21
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,72
Finanzderivate	2,03
Sonstige Vermögenswerte	1,45
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
JP Morgan	CDX.NA.IG, 1,000 %	Verkauf	20.06.2025	3.600	$ 59
Nicht realisierte Wertsteigerung von Kreditausfallversicherungen (29. Februar 2020 (in Tsd.):– USD)					$ 59
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)					-
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)					$ 59

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/(Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	14	Verkauf	EUR	12	$ –
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1.169	Verkauf	GBP	892	(24)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	79.675	Verkauf	USD	104.157	2.360
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.017	Verkauf	USD	1.200	14
16.10.2020	BNP Paribas	Kauf	USD	763	Verkauf	EUR	660	(25)
16.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	986	Verkauf	GBP	790	(70)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 33 USD)								$ 2.374
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (668) USD)								(119)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (635) USD)								$ 2.255

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/(Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bund Dezember 2020	(1)	$ (206)	$ 1
Long Gilt Dezember 2020	(5)	(902)	8
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	119	16.571	15
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2020	(3)	(663)	–
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2020	20	2.520	3
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2020	(55)	(9.665)	108
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	(8)	(1.767)	24
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 318 USD)			$ 159
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(152) USD)			-
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 166 USD)			$ 159

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 3,32 % (29. Februar 2020: 10,01 %)			
Mexiko — 1,81 % (29. Februar 2020: 1,97 %)			
1.795	Petroleos Mexicanos, 6,750 %, fällig 21.09.2047	1.502	0,26
10.200	Petroleos Mexicanos, 144A, 7,690 %, fällig 23.01.2050	9.170	1,55
		10.672	1,81
Supranational — 1,51 % (29. Februar 2020: 8,04 %)			
8.930	Inter-American Development Bank, 0,155 %, fällig 009.10.2020 *	8.930	1,51
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 21.336 USD)		19.602	3,32
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 85,75 %(29. Februar 2020: 88,64 %)			
Australien — 7,39 % (29. Februar 2020: 4,59 %)			
AUD 18.300	Australie Government Bond, Series 128, 5,750 %, fällig 15.07.2022	14.879	2,52
AUD 16.375	Australie Government Bond, Series 162, 1,750 %, fällig 21.06.2051	11.623	1,97
AUD 5.110	New South Wales Treasury Corp, 4,000 %, fällig 08.04.2021	3.854	0,65
AUD 8.620	Queensland Treasury Corp, Series 21, 5,500 %, fällig 21.06.2021	6.626	1,12
AUD 8.580	Western Australien Treasury Corp, Series 21, 7,000 %, fällig 15.07.2021	6.701	1,13
		43.683	7,39
Brasilien — 2,56 % (29. Februar 2020: 4,18 %)			
BRL 71.810	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2025	15.157	2,56
Chile — 1,65 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
3.000	Chile Government International Bond, 2,450 %, fällig 31.01.2031	3.175	0,54
5.600	Chile Government International Bond, 3,500 %, fällig 25.01.2050	6.579	1,11
		9.754	1,65
Kolumbien — 4,49 % (29. Februar 2020: 4,47 %)			
COP 94.660.000	Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	26.547	4,49
Indonesien — 4,02 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
IDR 192.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029	15.014	2,54
IDR 116.900.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR68, 8,375 %, fällig 15.03.2034	8.743	1,48
		23.757	4,02
Italien — 3,70 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 16.850	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CAC, 144A, 2,450 %, fällig 01.09.2050	21.908	3,70
Malaysia — 2,87 % (29. Februar 2020: 1,77 %)			
MYR 20.295	Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	5.298	0,90
MYR 44.345	Malaysia Government Bond, Series 0417, 3,899 %, fällig 16.11.2027	11.660	1,97
		16.958	2,87
Mexiko — 10,89 % (29. Februar 2020: 12,10 %)			
MXN 293.500	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	15.857	2,68
MXN 97.400	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	5.021	0,85
MXN 315.500	Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	17.069	2,89
MXN 397.300	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	19.870	3,36
MXN 128.800	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	6.574	1,11
		64.391	10,89
Peru — 1,04 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
5.645	Peruvian Government International Bond, 2,783 %, fällig 23.01.2031	6.161	1,04
Philippinen — 0,83 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
4.575	Philippine Government International Bond, 2,457 %, fällig 05.05.2030	4.895	0,83
Polen — 5,31 % (29. Februar 2020: 5,36 %)			
PLN 71.100	Republic of Poland Government Bond, Series 1020, 5,250 %, fällig 25.10.2020	19.468	3,29
PLN 43.455	Republic of Poland Government Bond, Series 0421, 2,000 %, fällig 25.04.2021	11.955	2,02
		31.423	5,31
Südafrika — 3,39 % (29. Februar 2020: 3,87 %)			
ZAR 240.740	Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	9.023	1,53
ZAR 239.700	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	11.011	1,86
		20.034	3,39
Großbritannien — 19,38 % (29. Februar 2020: 7,28 %)			
GBP 85.200	United Kingdom Gilt, 1,500 %, fällig 22.01.2021	114.585	19,38
USA — 18,23 % (29. Februar 2020: 39,12 %)			
68.800	United States Treasury Floating Rate Note, 0,219 %, fällig 30.04.2022 *	68.884	11,65
23.200	United States Treasury Note/ Bond, 2,375 %, fällig 15.11.2049	28.349	4,79
11.140	United States Treasury Note/ Bond, 1,250 %, fällig 15.05.2050	10.585	1,79
		107.818	18,23
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 517.586 USD)		507.071	85,75
Kollektive Kapitalanlagen — 8,13 % (29. Februar 2020: 1,21 %)			
48.104	Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	48.104	8,13
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 48.104 USD)		48.104	8,13
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 587.026 USD)		574.777	97,20
Devisenterminkontrakte — 3,20 % (29. Februar 2020: 0,45 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		18.935	3,20
Termingeschäfte — 0,43 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		2.527	0,43
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		596.239	100,83
Devisenterminkontrakte — (2,42 %) (29. Februar 2020: (1,84 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(14.304)	(2,42)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(14.304)	(2,42)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		581.935	98,41
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		9.392	1,59
Gesamtnettovermögen		$591.327	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

AUD – Australischer Dollar
BRL – Brasilianischer Real
COP – Kolumbianischer Peso
EUR – Euro
GBP – Britisches Pfund Sterling
IDR – Indonesische Rupiah
MXN – Mexikanischer Peso
MYR – Malaysischer Ringgit
PLN – Polnischer Zloty
ZAR – Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	86,03
Organismen für gemeinsame Anlagen	7,86
Finanzderivate	3,51
Sonstige Vermögenswerte	2,60
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	EUR	3	$ –
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	52	Verkauf	GBP	39	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	376	Verkauf	USD	497	6
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.189	Verkauf	USD	1.407	12
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	40	Verkauf	GBP	30	–
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	547	Verkauf	USD	724	9
02.09.2020	Citi	Kauf	USD	80.556	Verkauf	EUR	70.850	(3.992)
02.09.2020	Citi	Kauf	EUR	37.720	Verkauf	USD	42.657	2.357
02.09.2020	HSBC	Kauf	EUR	33.130	Verkauf	USD	36.891	2.645
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	115	Verkauf	GBP	86	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	230	Verkauf	USD	306	–
03.08.2020	Citi	Kauf	USD	92	Verkauf	GBP	70	(2)
03.08.2020	Citi	Kauf	GBP	28.730	Verkauf	USD	35.670	2.738
03.08.2020	HSBC	Kauf	USD	37.357	Verkauf	GBP	28.660	(956)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	300	Verkauf	AUD	416	(7)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	AUD	1	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	436	Verkauf	AUD	798	(5)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.892	Verkauf	AUD	4.775	(72)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	AUD	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	352	Verkauf	CAD	618	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	243	Verkauf	CAD	323	(4)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	CAD	1	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	CAD	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.348	Verkauf	CAD	3.699	(36)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	664	Verkauf	DKK	4.962	(1)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	69	Verkauf	DKK	433	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	100	Verkauf	DKK	832	1
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	DKK	2	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	ILS	336	Verkauf	EUR	83	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	9.111	Verkauf	EUR	10.082	147
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	MXN	98	Verkauf	EUR	3	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	5	Verkauf	EUR	6	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	MXN	4.345	Verkauf	EUR	161	2
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	PLN	438	Verkauf	EUR	97	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	1	Verkauf	EUR	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NOK	524	Verkauf	EUR	47	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	EUR	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	JPY	2	Verkauf	EUR	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	184	Verkauf	EUR	18	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	494	Verkauf	EUR	48	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	PLN	156	Verkauf	EUR	36	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	10	Verkauf	EUR	8	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	17.193	Verkauf	EUR	14.510	(131)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	38	Verkauf	EUR	24	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	630	Verkauf	EUR	402	3
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	869	Verkauf	EUR	528	10
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	158	Verkauf	EUR	98	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	DKK	50	Verkauf	EUR	6	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	DKK	855	Verkauf	EUR	114	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	ILS	19	Verkauf	EUR	5	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	JPY	614.309	Verkauf	EUR	4.885	(26)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NOK	22	Verkauf	GBP	1	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	JPY	2	Verkauf	GBP	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	48	Verkauf	GBP	26	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	MXN	124	Verkauf	GBP	4	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	PLN	33	Verkauf	GBP	7	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	PLN	1	Verkauf	GBP	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	–	Verkauf	GBP	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	40	Verkauf	GBP	1	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	8	Verkauf	GBP	4	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	GBP	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1.535	Verkauf	GBP	1.168	(25)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NOK	9	Verkauf	GBP	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	MXN	130	Verkauf	GBP	4	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	JPY	34.985	Verkauf	GBP	250	(5)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	2	Verkauf	GBP	2	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	8.779	Verkauf	GBP	7.939	(132)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	DKK	–	Verkauf	GBP	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	DKK	50	Verkauf	GBP	6	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	ILS	11	Verkauf	GBP	2	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	8	Verkauf	GBP	4	–

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	20	Verkauf	GBP	18	$ –
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	32	Verkauf	GBP	18	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	ILS	6	Verkauf	GBP	1	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	50	Verkauf	ILS	172	(1)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	ILS	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	72	Verkauf	ILS	328	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	ILS	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	484	Verkauf	ILS	1.967	(8)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	4.055	Verkauf	JPY	562.296	113
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	2.778	Verkauf	JPY	293.182	9
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	8	Verkauf	JPY	1.022	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	26.804	Verkauf	JPY	3.360.836	260
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	MXN	16	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	139	Verkauf	MXN	4.107	(1)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	MXN	15	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	96	Verkauf	MXN	2.151	(3)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	922	Verkauf	MXN	24.644	(23)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	NOK	1	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	272	Verkauf	NOK	2.898	(6)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	41	Verkauf	NOK	483	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	28	Verkauf	NOK	253	(1)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	NOK	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	112	Verkauf	PLN	544	2
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	77	Verkauf	PLN	285	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	PLN	1	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	PLN	1	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	741	Verkauf	PLN	3.262	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	55	Verkauf	SEK	626	1
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	364	Verkauf	SEK	3.733	2
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	SEK	3	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	38	Verkauf	SEK	326	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SGD	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	82	Verkauf	SGD	148	1
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	SGD	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	57	Verkauf	SGD	77	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	544	Verkauf	SGD	885	(1)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	55.170	Verkauf	USD	65.542	311
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	8.347	Verkauf	USD	10.965	195
01.09.2020	HSBC	Kauf	USD	30.948	Verkauf	IDR	444.800.000	446
01.09.2020	HSBC	Kauf	IDR	444.800.000	Verkauf	USD	30.235	269
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	276	Verkauf	AUD	386	(9)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	51	Verkauf	EUR	43	(1)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	4.753	Verkauf	GBP	3.626	(93)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	1.295	Verkauf	USD	928	27
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	34.343	Verkauf	USD	40.535	463
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	61.539	Verkauf	USD	80.451	1.821
15.09.2020	Citi	Kauf	KRW	21.650.000	Verkauf	USD	17.871	357
15.09.2020	HSBC	Kauf	USD	11.123	Verkauf	CLP	8.550.000	127
15.09.2020	HSBC	Kauf	USD	1.281	Verkauf	KRW	1.520.000	1
15.09.2020	HSBC	Kauf	USD	1.661	Verkauf	KRW	1.980.000	(7)
15.09.2020	HSBC	Kauf	CLP	8.550.000	Verkauf	USD	11.120	(123)
15.09.2020	HSBC	Kauf	KRW	13.920.000	Verkauf	USD	11.625	95
25.09.2020	HSBC	Kauf	USD	1.928	Verkauf	CLP	1.530.000	(40)
25.09.2020	HSBC	Kauf	USD	2.084	Verkauf	CLP	1.600.000	27
25.09.2020	HSBC	Kauf	CLP	6.410.000	Verkauf	USD	7.829	415
02.10.2020	Citi	Kauf	USD	116.325	Verkauf	EUR	101.200	(4.530)
02.10.2020	Citi	Kauf	EUR	34.090	Verkauf	USD	39.419	1.292
02.10.2020	Goldman Sachs	Kauf	EUR	14.640	Verkauf	USD	17.368	115
02.10.2020	HSBC	Kauf	EUR	33.130	Verkauf	USD	36.916	2.648
02.10.2020	UBS	Kauf	USD	4.490	Verkauf	EUR	3.780	(24)
09.10.2020	HSBC	Kauf	USD	10.005	Verkauf	CLP	7.640.000	178
09.10.2020	HSBC	Kauf	CLP	7.640.000	Verkauf	USD	9.635	192
13.10.2020	Citi	Kauf	KRW	8.340.000	Verkauf	USD	7.000	24
14.10.2020	Barclays	Kauf	USD	4.260	Verkauf	MYR	18.000	(71)
14.10.2020	Barclays	Kauf	MYR	66.500	Verkauf	USD	15.541	457
20.10.2020	Citi	Kauf	KRW	5.020.000	Verkauf	USD	4.194	34
20.10.2020	JP Morgan	Kauf	CZK	244.900	Verkauf	USD	10.480	649
20.10.2020	Morgan Stanley	Kauf	USD	867	Verkauf	CZK	19.200	(6)
23.10.2020	HSBC	Kauf	CLP	8.550.000	Verkauf	USD	10.911	89
28.10.2020	Citi	Kauf	KRW	10.460.000	Verkauf	USD	8.742	67
29.10.2020	Citi	Kauf	USD	1.116	Verkauf	RUB	84.000	(9)
29.10.2020	Citi	Kauf	JPY	8.106.000	Verkauf	USD	76.741	(150)

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
29.10.2020	Citi	Kauf	RUB	577.000	Verkauf	USD	8.023	$ (295)
29.10.2020	HSBC	Kauf	USD	2.399	Verkauf	JPY	254.000	(1)
29.10.2020	National Australie Bank	Kauf	USD	2.369	Verkauf	JPY	252.000	(12)
30.10.2020	HSBC	Kauf	HUF	3.190.000	Verkauf	USD	10.798	(96)
05.11.2020	Citi	Kauf	USD	31.442	Verkauf	MXN	721.000	(1.237)
05.11.2020	Citi	Kauf	MXN	217.800	Verkauf	USD	9.579	293
05.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	MXN	11.500	Verkauf	USD	508	13
05.11.2020	National Australie Bank	Kauf	MXN	39.400	Verkauf	USD	1.774	12
13.11.2020	HSBC	Kauf	USD	18.595	Verkauf	ZAR	328.550	(635)
17.11.2020	Citi	Kauf	RUB	1.542.000	Verkauf	USD	20.825	(208)
18.11.2020	HSBC	Kauf	HUF	4.170.000	Verkauf	USD	14.043	(56)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	CZK	308.100	Verkauf	USD	14.048	(45)
20.11.2020	HSBC	Kauf	CLP	11.450.000	Verkauf	USD	14.770	(35)
25.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	41.325	Verkauf	AUD	57.620	(1.183)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 4.164 USD)								$ 18.935
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (17.082) USD)								(14.304)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (12.918) USD)								$ 4.631

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-BTP September 2020	351	$ 61.242	$ 2.527
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)			$ 2.527
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):– USD)			-
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)			$ 2.527

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 2,27 % (29. Februar 2020: 1,92 %)			
2.570	Towd Point Mortgage Trust 2018-3, Series 2018 3, Class A2, 144A, 3,875 %, fällig 25.05.2058 *	2.774	0,36
13.971	Towd Point Mortgage Trust 2018-5, Series 2018 5, Class A1, 144A, 3,250 %, fällig 25.07.2058 *	14.904	1,91
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 16.916 USD)		17.678	2,27
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 8,55 % (29. Februar 2020: 6,35 %)			
6.760	Angel Oak Mortgage Trust 2019-6, Series 2019 6, Class A1, 144A, 2,620 %, fällig 25.11.2059 *	6.837	0,88
22.415	Angel Oak Mortgage Trust 2020-1, Series 2020 1, Class A1, 144A, 2,466 %, fällig 25.12.2059 *	22.751	2,92
3.742	Angel Oak Mortgage Trust I LLC 2019-2, Series 2019 2, Class A1, 144A, 3,628 %, fällig 25.03.2049 *	3.831	0,49
11.380	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust, Series 2017 COR2, Class A3, 3,510 %, fällig 10.09.2050	12.704	1,63
4.950	COMM 2017-PANW Mortgage Trust, Series 2017 PANW, Class D, 144A, 4,343 %, fällig 10.10.2029 *	5.180	0,66
8.350	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C34, Series 2017 C34, Class A3, 3,276 %, fällig 15.11.2052	9.305	1,19
EUR 2.213	Newgate Funding Plc, Series 2007 1X, Class BB, 0,000 %, fällig 01.12.2050 *	2.330	0,30
EUR 3.542	Newgate Funding Plc, Series 2007 2X, Class BB, 0,000 %, fällig 15.12.2050 *	3.721	0,48
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 64.890 USD)		66.659	8,55
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 39,57 % (29. Februar 2020: 31,30 %)			
Kanada — 3,86 % (29. Februar 2020: 1,69 %)			
15.870	Bank of Montreal, 0,772 %, fällig 10.03.2023 *	15.949	2,05
14.020	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,893 %, fällig 17.03.2023 *	14.116	1,81
		30.065	3,86
Deutschland — 1,68 % (29. Februar 2020: 4,99 %)			
13.100	Daimler Finance North America LLC, 144A, 0,706 %, fällig 22.02.2021 *	13.103	1,68
Mexiko — 3,16 % (29. Februar 2020: 2,22 %)			
14.900	Petroleos Mexicanos, 6,750 %, fällig 21.09.2047	12.467	1,60
13.540	Petroleos Mexicanos, 144A, 7,690 %, fällig 23.01.2050	12.172	1,56
		24.639	3,16
Südafrika — 1,18 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
7.380	Anglo American Capital Plc, 144A, 5,625 %, fällig 01.04.2030	9.203	1,18
USA — 29,69 % (29. Februar 2020: 20,50 %)			
7.850	American Express Co, 0,849 %, fällig 05.11.2021 *	7.895	1,01
4.920	Amgen Inc, 3,150 %, fällig 21.02.2040	5.254	0,67
2.830	Amgen Inc, 3,375 %, fällig 21.02.2050	3.101	0,40
3.485	Apache Corp, 4,750 %, fällig 15.04.2043	3.285	0,42
950	Apache Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2044	848	0,11
570	Apache Corp, 5,350 %, fällig 01.07.2049	551	0,07
2.625	Apple Inc, 2,650 %, fällig 11.05.2050	2.723	0,35
15.370	Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	19.318	2,48
2.490	Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01.05.2040	2.901	0,37
3.130	Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01.05.2050	3.764	0,48
3.115	Boeing Co/The, 5,930 %, fällig 01.05.2060	3.826	0,49
11.805	Caterpillar Financial Services Corp, 0,543 %, fällig 15.03.2021 *	11.818	1,52
20.860	Citibank NA, 0,607 %, fällig 12.02.2021 *	20.885	2,68
2.350	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	2.576	0,33
2.765	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	2.881	0,37
1.615	Delta Air Lines Inc, 3,750 %, fällig 28.10.2029	1.443	0,18
5.065	Exxon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15.04.2051	5.702	0,73
21.080	Ford Motor Credit Co LLC, 1,114 %, fällig 05.04.2021 *	20.766	2,66
960	General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2040	1.215	0,16
2.465	General Motors Co, 6,800 %, fällig 01.10.2027	3.018	0,39
3.915	General Motors Co, 6,250 %, fällig 02.10.2043	4.573	0,59
7.035	General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	8.312	1,07
19.735	Goldman Sachs Group Inc/The, 1,006 %, fällig 23.02.2023 *	19.846	2,54
1.570	Hess Corp, 5,600 %, fällig 15.02.2041	1.811	0,23
825	Hess Corp, 5,800 %, fällig 01.04.2047	945	0,12
4.605	Hewlett Packard Enterprise Co, 6,200 %, fällig 15.10.2035	5.769	0,74
3.170	Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	4.406	0,56
1.125	Intel Corp, 4,950 %, fällig 25.03.2060	1.627	0,21
3.575	Jabil Inc, 3,000 %, fällig 15.01.2031	3.646	0,47
595	McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	692	0,09
795	McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	901	0,12
6.535	Oracle Corp, 3,600 %, fällig 01.04.2050	7.294	0,94
6.130	Oracle Corp, 3,850 %, fällig 01.04.2060	7.113	0,91
7.095	Southwest Airlines Co, 5,125 %, fällig 15.06.2027	7.755	0,99
5.335	Steel Dynamics Inc, 3,250 %, fällig 15.01.2031	5.749	0,74
810	United Parcel Service Inc, 5,200 %, fällig 01.04.2040	1.126	0,14
2.340	United Parcel Service Inc, 5,300 %, fällig 01.04.2050	3.462	0,44
7.800	Wells Fargo & Co, 1,270 %, fällig 26.07.2021 *	7.866	1,01
6.875	Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04.04.2031 *	8.397	1,08
4.730	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	6.479	0,83
		231.539	29,69
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 286.889 USD)		308.549	39,57
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 41,18 % (29. Februar 2020: 58,05 %)			
Australien — 1,72 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
AUD 18.910	Australie Government Bond, Series 162, 1,750 %, fällig 21.06.2051	13.423	1,72
Brasilien — 3,25 % (29. Februar 2020: 4,26 %)			
BRL 62.040	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2023	12.751	1,64
BRL 58.900	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	12.589	1,61
		25.340	3,25
Kolumbien — 4,23 % (29. Februar 2020: 4,63 %)			
COP 117.590.000	Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	32.977	4,23
Indonesien — 3,68 % (29. Februar 2020: 3,99 %)			
IDR 293.100.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029	22.921	2,94
IDR 76.500.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR67, 8,750 %, fällig 15.02.2044	5.818	0,74
		28.739	3,68
Mexiko — 5,43 % (29. Februar 2020: 8,57 %)			
MXN 94.900	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	5.127	0,66
MXN 127.000	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	6.547	0,84
MXN 405.900	Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	21.960	2,82
MXN 170.000	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	8.677	1,11
		42.311	5,43
Polen — 1,94 % (29. Februar 2020: 4,38 %)			
PLN 30.095	Republic of Poland Government Bond, Series 1020, 5,250 %, fällig 25.10.2020	8.240	1,06
PLN 25.130	Republic of Poland Government Bond, Series 0421, 2,000 %, fällig 25.04.2021	6.914	0,88
		15.154	1,94
USA — 20,93 % (29. Februar 2020: 32,22 %)			
38.695	United States Treasury Floating Rate Note, 0,259 %, fällig 31.01.2022 *	38.765	4,97
112.845	United States Treasury Floating Rate Note, 0,219 %, fällig 30.04.2022 *	112.982	14,49
11.425	United States Treasury Floating Rate Note, 0,160 %, fällig 31.07.2022 *	11.426	1,47
		163.173	20,93
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 334.400 USD)		321.117	41,18
Kollektive Kapitalanlagen — 4,98 % (29. Februar 2020: 1,72 %)			
38.857	Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	38.857	4,98
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 38.857 USD)		38.857	4,98
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 741.952 USD)		752.860	96,55
Devisenterminkontrakte — 5,28 % (29. Februar 2020: 1,71 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		41.180	5,28
Termingeschäfte — 0,42 % (29. Februar 2020: 0,07 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		3.295	0,42
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		797.335	102,25
Devisenterminkontrakte — (3,18 %) (29. Februar 2020: (3,49 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(24.822)	(3,18)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(24.822)	(3,18)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		772.513	99,07
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		7.266	0,93
Gesamtnettovermögen		$779.779	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 93,331,000 USD und machten 11,97 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

AUD – Australischer Dollar
BRL – Brasilianischer Real
COP – Kolumbianischer Peso
EUR – Euro
IDR – Indonesische Rupiah
MXN – Mexikanischer Peso
PLN – Polnischer Zloty

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	87,92
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,78
Finanzderivate	5,48
Sonstige Vermögenswerte	1,82
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
02.09.2020	Citi	Kauf	USD	81.416	Verkauf	EUR	72.100	$ (4.625)
02.09.2020	HSBC	Kauf	USD	3.328	Verkauf	EUR	2.930	(169)
02.09.2020	HSBC	Kauf	EUR	32.335	Verkauf	USD	36.006	2.581
02.09.2020	JP Morgan	Kauf	EUR	36.820	Verkauf	USD	41.559	2.380
08.09.2020	Citi	Kauf	GBP	45.040	Verkauf	USD	56.122	4.089
11.09.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	65.490	Verkauf	CHF	62.520	(3.696)
11.09.2020	Goldman Sachs	Kauf	CHF	36.530	Verkauf	USD	38.600	1.825
11.09.2020	HSBC	Kauf	USD	22.984	Verkauf	CHF	20.780	(12)
11.09.2020	Morgan Stanley	Kauf	CHF	1.130	Verkauf	USD	1.207	43
14.09.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.492	Verkauf	MYR	6.400	(46)
14.09.2020	Goldman Sachs	Kauf	MYR	157.300	Verkauf	USD	36.755	1.052
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	3.330	Verkauf	EUR	2.815	(30)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	17	Verkauf	GBP	13	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SEK	–	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SEK	–	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	456.992	Verkauf	USD	327.520	9.554
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	12.427	Verkauf	USD	16.246	368
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	113.271	Verkauf	USD	133.691	1.527
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	1.450	Verkauf	USD	166	2
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	280.236	Verkauf	USD	204.216	1.758
15.09.2020	HSBC	Kauf	USD	13.252	Verkauf	CLP	10.420.000	(150)
15.09.2020	HSBC	Kauf	USD	35.706	Verkauf	KRW	42.730.000	(271)
15.09.2020	HSBC	Kauf	CLP	37.910.000	Verkauf	USD	46.494	2.264
15.09.2020	HSBC	Kauf	KRW	46.115.000	Verkauf	USD	38.513	314
15.09.2020	HSBC	Kauf	CLP	8.720.000	Verkauf	USD	11.341	(126)
17.09.2020	Citi	Kauf	USD	15.472	Verkauf	NOK	143.700	(980)
17.09.2020	HSBC	Kauf	USD	29.634	Verkauf	NOK	281.200	(2.559)
17.09.2020	HSBC	Kauf	NOK	424.900	Verkauf	USD	44.552	4.094
02.10.2020	Citi	Kauf	USD	76.916	Verkauf	EUR	66.875	(2.947)
02.10.2020	HSBC	Kauf	EUR	32.335	Verkauf	USD	36.030	2.585
02.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	6.999	Verkauf	EUR	5.880	(23)
09.10.2020	HSBC	Kauf	USD	35.494	Verkauf	BRL	186.000	1.584
09.10.2020	HSBC	Kauf	USD	20.410	Verkauf	BRL	113.880	(351)
09.10.2020	HSBC	Kauf	BRL	158.700	Verkauf	USD	29.991	(1.058)
16.10.2020	Citi	Kauf	USD	20.172	Verkauf	PLN	79.690	(1.471)
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	34.446	Verkauf	COP	126.130.000	834
20.10.2020	Citi	Kauf	KRW	38.530.000	Verkauf	USD	32.186	261
27.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	26.832	Verkauf	IDR	404.900.000	(771)
27.10.2020	JP Morgan	Kauf	IDR	404.900.000	Verkauf	USD	27.350	253
28.10.2020	Citi	Kauf	USD	22.806	Verkauf	KRW	27.260.000	(151)
28.10.2020	Citi	Kauf	KRW	27.260.000	Verkauf	USD	22.782	174
29.10.2020	Citi	Kauf	JPY	3.937.000	Verkauf	USD	37.212	(12)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
29.10.2020	Citi	Kauf	RUB	3.762.000	Verkauf	USD	51.934	$ (1.544)
30.10.2020	Citi	Kauf	PLN	87.000	Verkauf	USD	23.147	483
04.11.2020	HSBC	Kauf	NZD	59.150	Verkauf	USD	39.010	830
04.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	76.742	Verkauf	NZD	115.410	(991)
04.11.2020	JP Morgan	Kauf	NZD	56.260	Verkauf	USD	37.588	306
05.11.2020	Citi	Kauf	USD	24.120	Verkauf	MXN	557.600	(1.153)
05.11.2020	Citi	Kauf	MXN	747.500	Verkauf	USD	32.874	1.007
06.11.2020	HSBC	Kauf	PEN	52.500	Verkauf	USD	14.965	(154)
17.11.2020	Citi	Kauf	RUB	163.000	Verkauf	USD	2.201	(23)
17.11.2020	Citi	Kauf	RUB	1.589.000	Verkauf	USD	21.131	115
20.11.2020	HSBC	Kauf	GBP	38.000	Verkauf	USD	50.064	755
25.11.2020	HSBC	Kauf	AUD	54.240	Verkauf	USD	39.872	142
25.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	52.692	Verkauf	AUD	73.470	(1.509)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 14.297 USD)								$ 41.180
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (29.124) USD)								(24.822)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (14.827) USD)								$ 16.358

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-BTP September 2020	300	$ 52.344	$ 2.160
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2020	(259)	(67.045)	1.135
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 595 USD)			$ 3.295
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(1.426) USD)			-
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (831) USD)			$ 3.295

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 87,71 % (29. Februar 2020: 96,49 %)			
Brasilien — 5,95 % (29. Februar 2020: 4,34 %)			
200	Braskem Netherlands Finance BV, 8,500 %, fällig 23.01.2081 *	210	1,88
205	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 6,125 %, Perpetual *	200	1,78
240	Petrobras Global Finance BV, 5,600 %, fällig 03.01.2031	257	2,29
		667	5,95
Kanada — 2,42 % (29. Februar 2020: 3,15 %)			
155	Air Canada, 7,750 %, fällig 15.04.2021	156	1,39
75	Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.01.2026	79	0,70
35	Cascades Inc/Cascades USA Inc, 5,125 %, fällig 15.01.2026	37	0,33
		272	2,42
China — 3,69 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	China Evergrande Group, 6,250 %, fällig 28.06.2021	197	1,76
205	Sunac China Holdings Ltd, 8,350 %, fällig 19.04.2023	217	1,93
		414	3,69
Kolumbien — 1,63 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 17.01.2027	183	1,63
Frankreich — 1,06 % (29. Februar 2020: 1,01 %)			
EUR 100	Altice France SA/France, 3,375 %, fällig 15.01.2028	119	1,06
Israel — 1,35 % (29. Februar 2020: 3,33 %)			
165	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	152	1,35
Luxemburg — 1,78 % (29. Februar 2020: 1,81 %)			
200	Altice France Holding SA, 6,000 %, fällig 15.02.2028	200	1,78
Mexiko — 5,90 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman, 6,750 %, Perpetual *	200	1,78
200	Cemex SAB de CV, 7,750 %, fällig 16.04.2026	211	1,88
50	Petroleos Mexicanos, 4,875 %, fällig 24.01.2022	51	0,46
240	Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	200	1,78
		662	5,90
Panama — 1,86 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030	208	1,86
Großbritannien — 2,25 % (29. Februar 2020: 2,34 %)			
245	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 6,750 %, fällig 01.10.2026	253	2,25
USA — 57,36 % (29. Februar 2020: 77,57 %)			
50	AES Corp/The, 144A, 3,300 %, fällig 15.07.2025	54	0,48
100	Allegheny Technologies Inc, 7,875 %, fällig 15.08.2023	105	0,94
80	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5,875 %, fällig 20.08.2026	91	0,81
40	Apache Corp, 4,875 %, fällig 15.11.2027	41	0,37
200	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	208	1,86
230	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.04.2025	237	2,11
65	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029	68	0,61
45	Bausch Health Cos Inc, 7,250 %, fällig 30.05.2029	49	0,44
100	Blackstone / GSO Secured Lending Fund, 144A, 3,650 %, fällig 14.07.2023	101	0,90
110	Boise Cascade Co, 144A, 5,625 %, fällig 01.09.2024	113	1,01
35	Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig 01.07.2030	38	0,34
70	CIT Group Inc, 5,000 %, fällig 15.08.2022	73	0,65
130	Clearway Energy Operating LLC, 5,000 %, fällig 15.09.2026	137	1,22
50	Cleveland-Cliffs Inc, 4,875 %, fällig 15.01.2024	49	0,44
55	Cleveland-Cliffs Inc, 1,500 %, fällig 15.01.2025	56	0,50
55	Cleveland-Cliffs Inc, 5,750 %, fällig 01.03.2025	51	0,46
165	Cleveland-Cliffs Inc, 5,875 %, fällig 01.06.2027	152	1,35
45	CommScope Inc, 6,000 %, fällig 01.03.2026	48	0,43
35	CommScope Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.07.2028	37	0,33
40	Dell International LLC / EMC Corp, 7,125 %, fällig 15.06.2024	42	0,37
100	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.06.2024	104	0,92
105	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 6,020 %, fällig 15.06.2026	124	1,10
220	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	217	1,94
35	Edgewell Personal Care Co, 5,500 %, fällig 01.06.2028	37	0,33
100	Embarq Corp, 7,995 %, fällig 01.06.2036	120	1,07
200	Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc, 5,875 %, fällig 15.10.2024	201	1,79
55	Entegris Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2028	58	0,51
180	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21.04.2023	199	1,77
120	Freeport-McMoRan Inc, 4,125 %, fällig 01.03.2028	126	1,12
65	Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig 01.08.2030	70	0,62
50	Genworth Holdings Inc, 7,200 %, fällig 15.02.2021	51	0,45
60	Genworth Holdings Inc, 4,900 %, fällig 15.08.2023	56	0,50
100	Harsco Corp, 144A, 5,750 %, fällig 31.07.2027	105	0,93
175	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 6,250 %, fällig 15.05.2026	187	1,67
145	Iron Mountain Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.03.2028	153	1,36
95	Level 3 Financing Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.09.2027	100	0,89
75	Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01.02.2030	81	0,72
60	Murphy Oil Corp, 6,875 %, fällig 15.08.2024	61	0,54
50	Navios Maritime Acquisition Corp / Navios Acquisition Finance US Inc, 144A, 8,125 %, fällig 15.11.2021	33	0,29
95	NRG Energy Inc, 6,625 %, fällig 15.01.2027	102	0,91
70	Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, fällig 01.09.2030	73	0,65
70	Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig 15.03.2048	53	0,47
95	Owl Rock Capital Corp, 4,000 %, fällig 30.03.2025	96	0,85
370	PetSmart Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.06.2025	382	3,40
70	PVH Corp, 144A, 4,625 %, fällig 10.07.2025	72	0,64
205	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15.06.2025	216	1,92
105	Scientific Games International Inc, 144A, 8,625 %, fällig 01.07.2025	110	0,98
75	Scientific Games International Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.10.2025	74	0,66
60	Select Medical Corp, 144A, 6,250 %, fällig 15.08.2026	65	0,57
35	Sensata Technologies Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.02.2030	37	0,33
140	Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.08.2024	140	1,25
115	Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	115	1,03
120	Sirius XM Radio Inc, 5,375 %, fällig 15.07.2026	126	1,12
35	Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15.11.2028	45	0,40
75	Talen Energy Supply LLC, 6,500 %, fällig 01.06.2025	52	0,47
30	Talen Energy Supply LLC, 144A, 7,250 %, fällig 15.05.2027	31	0,27
35	TEGNA Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.03.2028	35	0,32
75	Tronox Inc, 6,500 %, fällig 01.05.2025	81	0,72
20	Tronox Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.05.2025	21	0,19
100	Tronox Inc, 6,500 %, fällig 15.04.2026	103	0,92
105	ViaSat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.09.2025	105	0,94
55	Vishay Intertechnology Inc, 2,250 %, fällig 15.06.2025	54	0,48
205	Vista Outdoor Inc, 5,875 %, fällig 01.10.2023	209	1,86
100	Wyndham Destinations Inc, 144A, 6,625 %, fällig 31.07.2026	106	0,95
100	Wyndham Destinations Inc, 5,750 %, fällig 01.04.2027	103	0,92
		6.439	57,36
Uruguay — 0,68 % (29. Februar 2020: 1,08 %)			
70	Navios South American Logistics Inc / Navios Logistics Finance US Inc, 144A, 10,750 %, fällig 01.07.2025	76	0,68
Sambia — 1,78 % (29. Februar 2020: 1,86 %)			
200	First Quantum Minerals Ltd, 7,250 %, fällig 15.05.2022	200	1,78
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 9.443 USD)		9.845	87,71
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 3,39 % (29. Februar 2020: 1,80 %)			
Südafrika — 1,60 % (29. Februar 2020: 1,80 %)			
200	Republic of South Africa Government International Bond, 5,750 %, fällig 30.09.2049	179	1,60
Ukraine — 1,79 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Ukraine Government International Bond, 7,253 %, fällig 15.03.2033	201	1,79
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 399 USD)		380	3,39
Kollektive Kapitalanlagen — 4,05 % (29. Februar 2020: 4,51 %)			4,05
455	Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class		455
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 455 USD)		455	4,05
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 10.297 USD)		10.680	95,15
Kreditausfallversicherungen — 2,10 % (29. Februar 2020: 1,08 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		235	2,10
Devisenterminkontrakte — 2,26 % (29. Februar 2020: 0,01 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		253	2,26
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		11.168	99,51
Kreditausfallversicherungen — (0,17 %) (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(19)	(0,17)
Devisenterminkontrakte — (0,26 %) (29. Februar 2020: (1,49 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(29)	(0,26)

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(48)	(0,43)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt	11.120	99,08
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	105	0,92
Gesamtnettovermögen	$11.225	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 3.633.000 USD und machten 32.35 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

EUR – Euro

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	89,40
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,98
Finanzderivate	4,28
Sonstige Vermögenswerte	2,34
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	CCO Holdings LLC, 5,000 %	Verkauf	20.06.2021	$ 180	$ 7
Barclays	Sprint Communications Inc, 5,000 %	Verkauf	20.06.2021	365	13
Barclays	T-Mobile USA Inc, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	335	27
Citi	CenturyLink Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2025	115	(9)
Citi	CenturyLink Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2023	105	(3)
Citi	Cleveland Cliffs Inc, 5,000 %	Verkauf	20.06.2021	95	(1)
Citi	iTraxx Europe, 5,000 %	Verkauf	20.06.2025	1.770	164
Citi	Occidental Petroleum Corporation, 1,000 %	Verkauf	20.06.2021	105	(2)
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	345	22
JP Morgan	United States Steel Corp, 5,000 %	Verkauf	20.06.2021	180	(4)
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2022	280	1
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2022	185	1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Kreditausfallversicherung (29. Februar 2020 (in Tsd.):115 USD)					$ 235
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)					(19)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): 115 USD)					$ 216

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
02.09.2020	Citi	Kauf	EUR	1.260	Verkauf	USD	1.432	$ 71
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	4	Verkauf	CHF	3	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	CHF	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	2.246	Verkauf	EUR	1.425	22
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	3	Verkauf	EUR	3	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	216	Verkauf	GBP	124	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	3	Verkauf	SEK	18	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SEK	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	10.892	Verkauf	USD	8.210	141
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	14	Verkauf	USD	18	–
17.09.2020	HSBC	Kauf	NOK	940	Verkauf	USD	100	8
17.09.2020	JP Morgan	Kauf	USD	98	Verkauf	NOK	940	(10)
02.10.2020	JP Morgan	Kauf	EUR	1.320	Verkauf	USD	1.571	5
09.10.2020	JP Morgan	Kauf	BRL	1.650	Verkauf	USD	319	(19)
20.11.2020	HSBC	Kauf	GBP	250	Verkauf	USD	328	6
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 2 USD)								$ 253
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (159) USD)								(29)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (157) USD)								$ 224

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 0,11 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
655	Towd Point Mortgage Trust 2017-6, Series 2017 6, Class A2, 144A, 3,000 %, fällig 25.10.2057 *	692	0,11
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 636 USD)		692	0,11
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 0,86 % (29. Februar 2020: 0,48 %)			
1.155	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P, Series 2013 375P, Class A, 144A, 3,251 %, fällig 10.05.2035	1.205	0,20
720	COMM 2015-3BP Mortgage Trust, Series 2015 3BP, Class A, 144A, 3,178 %, fällig 10.02.2035	774	0,13
309	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C04, Class 1M2, 5,075 %, fällig 25.11.2024 *	319	0,05
816	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05, Class 1M2, 2,375 %, fällig 25.01.2030 *	806	0,14
EUR 292	Fondo de Titulizacion de Activos UCI 17 17, Class A2, 0,000 %, fällig 17.12.2049 *	323	0,06
EUR 713	GC Pastor Hipotecario 5 FTA 5, Class A2, 0,000 %, fällig 21.06.2046 *	722	0,12
EUR 114	IM Pastor 4 FTA 4, Class A, 0,000 %, fällig 22.03.2044 *	124	0,02
885	STACR Trust 2018-HRP1, Series 2018 HRP1, Class M2, 144A, 1,825 %, fällig 25.04.2043 *	844	0,14
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 5.307 USD)		5.117	0,86
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 33,12 % (29. Februar 2020: 15,74 %)			
Belgien — 1,45 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
5.470	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01.06.2050	6.635	1,11
1.625	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 01.06.2060	2.005	0,34
		8.640	1,45
Brasilien — 0,77 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
4.105	Petrobras Global Finance BV, 6,750 %, fällig 03.06.2050	4.584	0,77
Kanada — 3,29 % (29. Februar 2020: 1,62 %)			
10.665	Bank of Montreal, 0,772 %, fällig 10.03.2023 *	10.718	1,79
8.870	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,893 %, fällig 17.03.2023 *	8.931	1,50
		19.649	3,29
Frankreich — 0,56 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
3.155	Total Capital International SA, 3,127 %, fällig 29.05.2050	3.331	0,56
Deutschland — 1,49 % (29. Februar 2020: 1,96 %)			
8.915	Daimler Finance North America LLC, 144A, 0,706 %, fällig 22.02.2021 *	8.917	1,49
Mexiko — 1,53 % (29. Februar 2020: 1,94 %)			
1.690	Petroleos Mexicanos, 6,750 %, fällig 21.09.2047	1.414	0,23
8.630	Petroleos Mexicanos, 144A, 7,690 %, fällig 23.01.2050	7.758	1,30
		9.172	1,53
USA — 24,03 % (29. Februar 2020: 10,22 %)			
1.350	3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050	1.645	0,28
1.980	American International Group Inc, 4,500 %, fällig 16.07.2044	2.336	0,39
3.175	Amgen Inc, 3,150 %, fällig 21.02.2040	3.390	0,57
1.825	Amgen Inc, 3,375 %, fällig 21.02.2050	2.000	0,33
2.705	Apache Corp, 4,750 %, fällig 15.04.2043	2.550	0,43
755	Apache Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2044	674	0,11
390	Apache Corp, 5,350 %, fällig 01.07.2049	377	0,06
1.690	Apple Inc, 2,650 %, fällig 11.05.2050	1.753	0,29
10.695	Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	13.442	2,25
1.265	Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01.05.2040	1.474	0,25
2.450	Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01.05.2050	2.946	0,49
1.705	Boeing Co/The, 3,950 %, fällig 01.08.2059	1.583	0,27
1.585	Boeing Co/The, 5,930 %, fällig 01.05.2060	1.947	0,33
350	Burlington Northern Santa Fe LLC, 4,700 %, fällig 01.09.2045	475	0,08
1.010	Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20B, 3,950 %, fällig 01.04.2050	1.216	0,20
1.845	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	2.023	0,34
1.935	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	2.016	0,34
1.115	Delta Air Lines Inc, 3,750 %, fällig 28.10.2029	996	0,17
660	Exelon Corp, 4,050 %, fällig 15.04.2030	784	0,13
945	Exelon Corp, 4,700 %, fällig 15.04.2050	1.224	0,21
3.625	Exxon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15.04.2051	4.081	0,68
4.645	FedEx Corp, 5,250 %, fällig 15.05.2050	6.242	1,04
710	General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2040	899	0,15
7.450	General Electric Co, 4,350 %, fällig 01.05.2050	7.575	1,27
1.605	General Motors Co, 6,800 %, fällig 01.10.2027	1.965	0,33
3.075	General Motors Co, 6,250 %, fällig 02.10.2043	3.592	0,60
495	General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	585	0,10
13.425	Goldman Sachs Group Inc/The, 1,006 %, fällig 23.02.2023 *	13.500	2,26
1.230	Hess Corp, 5,600 %, fällig 15.02.2041	1.419	0,24
620	Hess Corp, 5,800 %, fällig 01.04.2047	710	0,12
355	Hewlett Packard Enterprise Co, 6,200 %, fällig 15.10.2035	445	0,07
6.010	Hewlett Packard Enterprise Co, 6,350 %, fällig 15.10.2045	7.764	1,30
1.950	Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	2.711	0,45
690	Intel Corp, 4,950 %, fällig 25.03.2060	998	0,17
1.785	JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	1.951	0,33
1.655	LYB International Finance III LLC, 4,200 %, fällig 01.05.2050	1.821	0,30
370	McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	430	0,07
490	McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	555	0,09
680	McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	833	0,14
810	New York Life Insurance Co, 144A, 3,750 %, fällig 15.05.2050	925	0,15
925	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	1.070	0,18
1.430	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	1.627	0,27
835	Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, fällig 15.03.2040	795	0,13
380	Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig 15.03.2046	378	0,06
1.425	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.04.2046	1.141	0,19
1.860	Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig 15.03.2048	1.411	0,24
730	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.08.2049	564	0,09
4.735	Oracle Corp, 3,600 %, fällig 01.04.2050	5.285	0,88
4.320	Oracle Corp, 3,850 %, fällig 01.04.2060	5.013	0,84
695	Prudential Financial Inc, 4,350 %, fällig 25.02.2050	847	0,14
5.570	Southwest Airlines Co, 5,125 %, fällig 15.06.2027	6.088	1,02
500	United Parcel Service Inc, 5,200 %, fällig 01.04.2040	695	0,12
1.460	United Parcel Service Inc, 5,300 %, fällig 01.04.2050	2.160	0,36
635	Walt Disney Co/The, 4,625 %, fällig 23.03.2040	809	0,14
1.275	Walt Disney Co/The, 4,700 %, fällig 23.03.2050	1.700	0,28
4.730	Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04.04.2031 *	5.777	0,97
3.240	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	4.438	0,74
		143.650	24,03
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 179.899 USD)		197.943	33,12
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 57.76 % (29. Februar 2020: 83,83 %)			
Australien — 1,76 % (29. Februar 2020: 5,01 %)			
AUD 14.850	Australie Government Bond, Series 162, 1,750 %, fällig 21.06.2051	10.541	1,76
Brasilien — 3,06 % (29. Februar 2020: 4,30 %)			
BRL 42.770	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2023	8.790	1,47
BRL 44.520	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	9.516	1,59
		18.306	3,06
Kolumbien — 4,05 % (29. Februar 2020: 4,57 %)			
COP 31.910.000	Colombian TES, Series B, 6,250 %, fällig 26.11.2025	9.292	1,55
COP 53.230.000	Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	14.928	2,50
		24.220	4,05
Indonesien — 3,51 % (29. Februar 2020: 3,90 %)			
IDR 205.400.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029	16.063	2,69
IDR 64.900.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR67, 8,750 %, fällig 15.02.2044	4.936	0,82
		20.999	3,51
Italien — 2,96 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 13.600	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CAC, 144A, 2,450 %, fällig 01.09.2050	17.682	2,96
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
Malaysia — 4,20 % (29. Februar 2020: 4,91 %)			
MYR 10.510	Malaysia Government Bond, Series 0315, 3,659 %, fällig 15.10.2020	2.529	0,42
MYR 27.680	Malaysia Government Bond, Series 0117, 3,882 %, fällig 10.03.2022	6.862	1,15
MYR 30.055	Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480 %, fällig 15.03.2023	7.506	1,26
MYR 9.680	Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	2.527	0,42
MYR 21.520	Malaysia Government Bond, Series 0417, 3,899 %, fällig 16.11.2027	5.658	0,95
		25.082	4,20
Mexiko — 10,22 % (29. Februar 2020: 12,04 %)			
MXN 279.600	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	15.106	2,53
MXN 98.200	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	5.062	0,85
MXN 294.700	Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	15.944	2,67
MXN 373.000	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	18.654	3,12
MXN 123.400	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	6.299	1,05
		61.065	10,22

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Polen — 5,14 % (29. Februar 2020: 5,21 %)			
PLN 90.070	Republic of Poland Government Bond, Series 1020, 5,250 %, fällig 25.10.2020	24.662	4,13
PLN 21.920	Republic of Poland Government Bond, Series 0421, 2,000 %, fällig 25.04.2021	6.030	1,01
		30.692	5,14
Russland — 0,51 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
RUB 200.000	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10.04.2030	3.024	0,51
Südafrika — 2,97 % (29. Februar 2020: 3,85 %)			
ZAR 208.300	Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	7.806	1,31
ZAR 216.400	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	9.941	1,66
		17.747	2,97
Spanien — 0,82 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 4.350	Spain Government Bond, 144A, 1,000 %, fällig 31.10.2050	4.892	0,82
Großbritannien — 18,56 % (29. Februar 2020: 4,98 %)			
GBP 82.500	United Kingdom Gilt, 1,500 %, fällig 22.01.2021	110.954	18,56
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 365.427 USD)		345.204	57,76

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Kollektive Kapitalanlagen — 5,28 % (29. Februar 2020: 1,39 %)			
31.583	Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	31.583	5,28
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Kosten 31.583 USD)		31.583	5,28
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 582.852 USD)		580.539	97,13
Devisenterminkontrakte — 2,00 % (29. Februar 2020: 0,28 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		11.954	2,00
Termingeschäfte — 0,19 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1.143	0,19
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		593.636	99,32
Devisenterminkontrakte — (1,24 %) (29. Februar 2020: (3,00 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(7.385)	(1,24)
Termingeschäfte — (0,05 %) (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(320)	(0,05)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(7.705)	(1,29)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		585.931	98,03
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		11.742	1,97
Gesamtnettovermögen		597.673	100,00

- Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 45 712 000 USD, soit 7,64 % de l'actif net.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
COP	– Kolumbianischer Peso
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
IDR	– Indonesische Rupiah
MXN	– Mexikanischer Peso
MYR	– Malaysischer Ringgit
PLN	– Polnischer Zloty
RUB	– Russischer Rubel
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	9,41
Organismen für gemeinsame Anlagen	5,20
Finanzderivate	2,16
Sonstige Vermögenswerte	2,23
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	$ –
02.09.2020	Citi	Kauf	USD	29.322	Verkauf	EUR	25.170	(714)
02.09.2020	HSBC	Kauf	EUR	23.150	Verkauf	USD	25.778	1.848
02.09.2020	National Australie Bank	Kauf	EUR	2.020	Verkauf	USD	2.380	31
08.09.2020	Citi	Kauf	GBP	22.970	Verkauf	USD	28.518	2.189
08.09.2020	HSBC	Kauf	USD	23.969	Verkauf	GBP	18.320	(521)
08.09.2020	JP Morgan	Kauf	USD	9.300	Verkauf	GBP	7.110	(205)
08.09.2020	JP Morgan	Kauf	GBP	2.460	Verkauf	USD	3.104	185
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	2	Verkauf	AUD	2	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	6.201	Verkauf	AUD	5.726	(46)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	50	Verkauf	AUD	90	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	46	Verkauf	AUD	64	(1)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	37	Verkauf	CAD	50	(1)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	10	Verkauf	CAD	8	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	5.024	Verkauf	CAD	4.430	(12)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	41	Verkauf	CAD	70	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	11	Verkauf	DKK	67	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	2	Verkauf	DKK	9	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	11	Verkauf	DKK	94	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	1.426	Verkauf	DKK	5.946	8
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	817	Verkauf	EUR	688	(4)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	169	Verkauf	EUR	96	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	109.824	Verkauf	EUR	61.430	650
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	876	Verkauf	EUR	969	15
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	–	Verkauf	GBP	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	JPY	–	Verkauf	GBP	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NOK	–	Verkauf	GBP	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	MXN	–	Verkauf	GBP	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	–	Verkauf	GBP	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	32	Verkauf	GBP	17	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	ILS	–	Verkauf	GBP	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	GBP	–	–

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	GBP	–	$ –
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	DKK	–	Verkauf	GBP	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	DKK	–	Verkauf	GBP	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	17.699	Verkauf	GBP	8.955	(50)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	GBP	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	PLN	–	Verkauf	GBP	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	132	Verkauf	GBP	100	(2)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	–	Verkauf	GBP	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	JPY	7	Verkauf	GBP	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	ILS	1	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	2	Verkauf	ILS	5	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	8	Verkauf	ILS	26	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	8	Verkauf	ILS	35	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	1.038	Verkauf	ILS	2.354	(3)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	427	Verkauf	JPY	45.091	1
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	57.515	Verkauf	JPY	4.032.399	663
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	458	Verkauf	JPY	63.500	12
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	15	Verkauf	MXN	447	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	1	Verkauf	MXN	18	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	15	Verkauf	MXN	331	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	7	Verkauf	MXN	98	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	1.974	Verkauf	MXN	29.476	(15)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	NOK	2	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	NOK	39	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	1	Verkauf	NOK	6	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	5	Verkauf	NOK	52	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	584	Verkauf	NOK	3.470	(4)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	3	Verkauf	NZD	3	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	MXN	13	Verkauf	NZD	1	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	PLN	2	Verkauf	NZD	1	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	2	Verkauf	NZD	2	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	2	Verkauf	NZD	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	4	Verkauf	NZD	8	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NOK	2	Verkauf	NZD	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	ILS	1	Verkauf	NZD	–	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	NZD	1	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	36	Verkauf	NZD	55	(1)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	JPY	1.847	Verkauf	NZD	27	(1)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	28	Verkauf	NZD	51	(1)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	DKK	3	Verkauf	NZD	1	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	1.588	Verkauf	PLN	3.904	10
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	13	Verkauf	PLN	61	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	2	Verkauf	PLN	6	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	12	Verkauf	PLN	44	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	6	Verkauf	SEK	70	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	779	Verkauf	SEK	4.477	8
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	6	Verkauf	SEK	50	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	9	Verkauf	SGD	12	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	9	Verkauf	SGD	17	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	1.169	Verkauf	SGD	1.064	5
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	MXN	156	Verkauf	USD	7	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	PLN	21	Verkauf	USD	6	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	24	Verkauf	USD	18	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	ILS	13	Verkauf	USD	4	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	991	Verkauf	USD	1.301	24
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	30	Verkauf	USD	22	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	327	Verkauf	USD	389	1
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	182	Verkauf	USD	123	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	JPY	21.522	Verkauf	USD	204	(1)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	6	Verkauf	USD	4	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	24	Verkauf	USD	3	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NZD	118.157	Verkauf	USD	78.492	1.099
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NOK	18	Verkauf	USD	2	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	DKK	32	Verkauf	USD	5	–
11.09.2020	HSBC	Kauf	USD	1.120	Verkauf	IDR	16.400.000	(5)
11.09.2020	HSBC	Kauf	USD	19.419	Verkauf	IDR	279.100.000	280
11.09.2020	HSBC	Kauf	IDR	295.500.000	Verkauf	USD	20.096	169
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	USD	1	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	47	Verkauf	USD	62	1
15.09.2020	Citi	Kauf	KRW	1.500.000	Verkauf	USD	1.238	25
15.09.2020	HSBC	Kauf	USD	11.228	Verkauf	CLP	8.610.000	154
15.09.2020	HSBC	Kauf	KRW	13.110.000	Verkauf	USD	10.949	89

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2020	HSBC	Kauf	CLP	8.610.000	Verkauf	USD	11.198	$	(124)
25.09.2020	HSBC	Kauf	CLP	4.420.000	Verkauf	USD	5.399		286
02.10.2020	Citi	Kauf	USD	70.119	Verkauf	EUR	61.190		(2.956)
02.10.2020	Citi	Kauf	EUR	19.650	Verkauf	USD	22.499		969
02.10.2020	Citi	Kauf	EUR	490	Verkauf	USD	585		–
02.10.2020	HSBC	Kauf	EUR	23.150	Verkauf	USD	25.796		1.850
02.10.2020	UBS	Kauf	USD	3.861	Verkauf	EUR	3.250		(20)
09.10.2020	HSBC	Kauf	BRL	32.730	Verkauf	USD	6.104		(137)
09.10.2020	HSBC	Kauf	CLP	6.270.000	Verkauf	USD	7.907		157
13.10.2020	Citi	Kauf	KRW	20.110.000	Verkauf	USD	16.878		57
14.10.2020	Barclays	Kauf	MYR	12.600	Verkauf	USD	3.011		20
20.10.2020	Citi	Kauf	KRW	10.540.000	Verkauf	USD	8.805		70
20.10.2020	JP Morgan	Kauf	CZK	237.900	Verkauf	USD	10.180		631
23.10.2020	HSBC	Kauf	CLP	8.540.000	Verkauf	USD	10.901		85
28.10.2020	Citi	Kauf	KRW	9.160.000	Verkauf	USD	7.655		59
29.10.2020	Citi	Kauf	JPY	7.357.000	Verkauf	USD	69.650		(136)
29.10.2020	Citi	Kauf	RUB	212.000	Verkauf	USD	2.948		(108)
30.10.2020	HSBC	Kauf	HUF	3.080.000	Verkauf	USD	10.425		(92)
05.11.2020	Citi	Kauf	USD	27.307	Verkauf	MXN	626.200		(1.075)
05.11.2020	Citi	Kauf	MXN	224.700	Verkauf	USD	9.882		303
13.11.2020	HSBC	Kauf	USD	16.798	Verkauf	ZAR	296.790		(574)
17.11.2020	Citi	Kauf	RUB	1.520.000	Verkauf	USD	20.529		(205)
18.11.2020	HSBC	Kauf	HUF	3.740.000	Verkauf	USD	12.594		(51)
19.11.2020	JP Morgan	Kauf	CZK	272.900	Verkauf	USD	12.443		(40)
20.11.2020	HSBC	Kauf	CLP	3.400.000	Verkauf	USD	4.386		(10)
25.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	9.431	Verkauf	AUD	13.150		(270)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 1.529 USD)								$	11.954
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (16.435) USD)									(7.385)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (14,906) USD)								$	4.569

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
Euro-BTP September 2020	168	$	9.313	$	1.143
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	(186)		(41.089)		(320)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): - USD)				$	1.143
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):- USD)					(320)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): - USD)				$	823

Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 7,84 % (29. Februar 2020: 1,98 %)			
Brasilien — 2,83 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
3.270	Petrobras Global Finance BV, 5,600 %, fällig 03.01.2031	3.505	0,55
9.460	Petrobras Global Finance BV, 6,900 %, fällig 19.03.2049	10.840	1,71
3.235	Petrobras Global Finance BV, 6,750 %, fällig 03.06.2050	3.612	0,57
		17.957	2,83
Chile — 2,91 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
4.060	Corp Nacional del Cobre de Chile, 144A, 3,750 %, fällig 15.01.2031	4.522	0,71
13.005	Corp Nacional del Cobre de Chile, 3,700 %, fällig 30.01.2050	13.985	2,20
		18.507	2,91
Indonesien — 0,35 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
2.040	Hutama Karya Persero PT, 144A, 3,750 %, fällig 11.05.2030	2.239	0,35
Mexiko — 1,75 % (29. Februar 2020: 1,98 %)			
2.340	Petroleos Mexicanos, 6,750 %, fällig 21.09.2047	1.958	0,31
10.165	Petroleos Mexicanos, 144A, 7,690 %, fällig 23.01.2050	9.138	1,44
		11.096	1,75
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 46.412 USD)		49.799	7,84
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 85,16 % (29. Februar 2020: 95,45 %)			
Australien — 4,75 % (29. Februar 2020: 2,78 %)			
AUD 23.315	Australie Government Bond, Series 128, 5,750 %, fällig 15.07.2022	18.956	2,98
AUD 15.795	Australie Government Bond, Series 162, 1,750 %, fällig 21.06.2051	11.212	1,77
		30.168	4,75
Brasilien — 1,28 % (29. Februar 2020: 4,27 %)			
BRL 38.200	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	8.165	1,28
Chile — 0,28 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1.505	Chile Government International Bond, 3,500 %, fällig 25.01.2050	1.768	0,28
Kolumbien — 4,50 % (29. Februar 2020: 4,60 %)			
COP 45.000.000	Colombian TES, Series B, 10,000 %, fällig 24.07.2024	14.707	2,31
COP 45.200.000	Colombian TES, Series B, 7,500 %, fällig 26.08.2026	13.884	2,19
		28.591	4,50
Ungarn — 2,83 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
HUF 815.000	Hungary Government Bond, Series 28/A, 6,750 %, fällig 22.10.2028	3.703	0,58
HUF 4.005.000	Hungary Government Bond, Series 30/A, 3,000 %, fällig 21.08.2030	14.275	2,25
		17.978	2,83
Indonesien — 13,90 % (29. Februar 2020: 10,72 %)			
IDR 605.600.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029	47.358	7,45
IDR 245.900.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR78, 8,250 %, fällig 15.05.2029	18.517	2,91
IDR 300.900.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR68, 8,375 %, fällig 15.03.2034	22.504	3,54
		88.379	13,90
Italien — 3,36 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 3.075	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,850 %, fällig 01.09.2049	5.132	0,81
EUR 12.470	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CAC, 144A, 2,450 %, fällig 01.09.2050	16.213	2,55
		21.345	3,36
Malaysia — 6,22 % (29. Februar 2020: 4,88 %)			
MYR 35.380	Malaysia Government Bond, Series 0111, 4,160 %, fällig 15.07.2021	8.672	1,36
MYR 38.790	Malaysia Government Bond, Series 0416, 3,620 %, fällig 30.11.2021	9.535	1,50
MYR 58.440	Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480 %, fällig 15.03.2023	14.596	2,30
MYR 12.240	Malaysia Government Bond, Series 0417, 3,899 %, fällig 16.11.2027	3.218	0,50
MYR 12.360	Malaysia Government Bond, Series 0317, 4,762 %, fällig 07.04.2037	3.538	0,56
		39.559	6,22
Mexiko — 10,06 % (29. Februar 2020: 14,66 %)			
MXN 462.800	Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	25.038	3,94
MXN 519.700	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	25.991	4,09
MXN 252.600	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	12.893	2,03
		63.922	10,06
Peru — 0,93 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
5.440	Peruvian Government International Bond, 2,783 %, fällig 23.01.2031	5.938	0,93
Russland — 2,38 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
RUB 1.000.300	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10.04.2030	15.125	2,38
Südafrika — 3,54 % (29. Februar 2020: 3,01 %)			
ZAR 185.800	Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	6.963	1,10
ZAR 337.700	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	15.513	2,44
		22.476	3,54
Großbritannien — 6,51 % (29. Februar 2020: 9,16 %)			
GBP 30.765	United Kingdom Gilt, 1,500 %, fällig 22.01.2021	41.376	6,51
USA — 24,62 % (29. Februar 2020: 41,37 %)			
27.730	United States Treasury Floating Rate Note, 0,325 %, fällig 31.07.2021 *	27.782	4,37
41.640	United States Treasury Floating Rate Note, 0,259 %, fällig 31.01.2022 *	41.715	6,56
47.275	United States Treasury Floating Rate Note, 0,219 %, fällig 30.04.2022 *	47.332	7,45
39.665	United States Treasury Floating Rate Note, 0,160 %, fällig 31.07.2022 *	39.670	6,24
		156.499	24,62
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 540.454 USD)		541.289	85,16
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 586.866 USD)		591.088	93,00
Devisenterminkontrakte — 6,42 % (29. Februar 2020: 0,93 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		40.825	6,42
Termingeschäfte — 0,01 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		58	0,01
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		631.971	99,43
Devisenterminkontrakte — (5,42 %) (29. Februar 2020: (2,94 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(34.462)	(5,42)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(34.462)	(5,42)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		597.509	94,01
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		38.077	5,99
Gesamtnettovermögen		$635.586	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 37,244,000 USD und machten 5,86% des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
COP	– Kolumbianischer Peso
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
HUF	– Ungarischer Forint
IDR	– Indonesische Rupiah
MXN	– Mexikanischer Peso
MYR	– Malaysischer Ringgit
RUB	– Russischer Rubel
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	88,11
Finanzderivate	6,09
Sonstige Vermögenswerte	5,80
Gesamtvermögen	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
02.09.2020	Barclays	Kauf	EUR	46.710	Verkauf	USD	52.837	$ 2.905
02.09.2020	Citi	Kauf	USD	87.487	Verkauf	EUR	76.960	(4.353)
02.09.2020	HSBC	Kauf	USD	64.205	Verkauf	EUR	57.035	(3.857)
02.09.2020	HSBC	Kauf	EUR	57.035	Verkauf	USD	63.510	4.553
02.09.2020	UBS	Kauf	EUR	4.130	Verkauf	USD	4.655	273
04.09.2020	Goldman Sachs	Kauf	TRY	178.850	Verkauf	USD	25.871	(1.539)
04.09.2020	HSBC	Kauf	USD	11.477	Verkauf	TRY	85.150	(108)
04.09.2020	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.679	Verkauf	TRY	11.700	87
04.09.2020	National Australie Bank	Kauf	USD	11.647	Verkauf	TRY	82.000	491
08.09.2020	Citi	Kauf	GBP	50.060	Verkauf	USD	62.152	4.770
08.09.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	40.584	Verkauf	GBP	32.250	(2.529)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.489	Verkauf	AUD	2.719	(14)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	210	Verkauf	AUD	292	(5)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.666	Verkauf	AUD	2.752	(41)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.412	Verkauf	CAD	2.461	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	200	Verkauf	CAD	265	(3)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	757	Verkauf	CAD	723	4
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.580	Verkauf	CAD	2.491	(24)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	38	Verkauf	CHF	35	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	145	Verkauf	CHF	95	2
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	303	Verkauf	CHF	327	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	271	Verkauf	CHF	323	4
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	49	Verkauf	DKK	309	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	187	Verkauf	DKK	842	3
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	348	Verkauf	DKK	2.869	6
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	390	Verkauf	DKK	2.903	(1)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	27.235	Verkauf	EUR	30.120	457
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	3.848	Verkauf	EUR	3.239	(19)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	14.596	Verkauf	EUR	8.840	214
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	3.773	Verkauf	GBP	2.067	20
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	995	Verkauf	GBP	757	(18)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	7.878	Verkauf	GBP	7.124	(120)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	43	Verkauf	HKD	399	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	21	Verkauf	HKD	116	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf	HKD	42	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	39	Verkauf	HKD	394	1
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	2.733	Verkauf	JPY	288.429	9
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	21.642	Verkauf	JPY	2.713.462	210
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	19.343	Verkauf	JPY	2.681.216	541
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	10.367	Verkauf	JPY	787.504	210
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	136	Verkauf	NOK	1.593	(2)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	152	Verkauf	NOK	1.611	(4)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	73	Verkauf	NOK	467	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	19	Verkauf	NOK	171	(1)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	174	Verkauf	NZD	344	1
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	195	Verkauf	NZD	348	(2)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	93	Verkauf	NZD	101	1
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	25	Verkauf	NZD	37	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	212	Verkauf	SEK	2.421	4
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	238	Verkauf	SEK	2.447	1
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	30	Verkauf	SEK	260	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	114	Verkauf	SEK	710	2
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	44	Verkauf	SGD	60	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	310	Verkauf	SGD	557	4
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	346	Verkauf	SGD	563	(1)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	166	Verkauf	SGD	163	2
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	19.343	Verkauf	USD	25.406	453
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	10.367	Verkauf	USD	7.462	184
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	21.642	Verkauf	USD	25.711	122
11.09.2020	Goldman Sachs	Kauf	USD	56.460	Verkauf	CHF	53.900	(3.186)
11.09.2020	Goldman Sachs	Kauf	CHF	21.270	Verkauf	USD	22.475	1.062
11.09.2020	HSBC	Kauf	USD	18.759	Verkauf	CHF	16.960	(10)
11.09.2020	Morgan Stanley	Kauf	CHF	3.120	Verkauf	USD	3.296	157
11.09.2020	UBS	Kauf	CHF	14.410	Verkauf	USD	15.340	606
14.09.2020	Goldman Sachs	Kauf	MYR	28.100	Verkauf	USD	6.612	142
14.09.2020	HSBC	Kauf	USD	13.927	Verkauf	INR	1.052.000	(368)
14.09.2020	HSBC	Kauf	INR	1.976.000	Verkauf	USD	25.863	989
17.09.2020	Citi	Kauf	USD	23.278	Verkauf	NOK	216.200	(1.474)
17.09.2020	HSBC	Kauf	USD	44.599	Verkauf	NOK	423.200	(3.852)
17.09.2020	HSBC	Kauf	NOK	639.400	Verkauf	USD	67.043	6.161
17.09.2020	JP Morgan	Kauf	NOK	139.890	Verkauf	USD	15.797	218
25.09.2020	HSBC	Kauf	USD	9.837	Verkauf	CLP	7.550.000	127
25.09.2020	HSBC	Kauf	CLP	19.420.000	Verkauf	USD	23.720	1.256

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
02.10.2020	Barclays	Kauf	EUR	10.450	Verkauf	USD	11.829	$ 651
02.10.2020	Citi	Kauf	USD	101.195	Verkauf	EUR	88.475	(4.463)
02.10.2020	Citi	Kauf	EUR	11.840	Verkauf	USD	14.008	131
02.10.2020	HSBC	Kauf	USD	12.955	Verkauf	EUR	11.500	(779)
02.10.2020	HSBC	Kauf	EUR	57.035	Verkauf	USD	63.553	4.559
02.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	31.090	Verkauf	EUR	26.120	(103)
02.10.2020	JP Morgan	Kauf	EUR	10.850	Verkauf	USD	12.849	108
09.10.2020	HSBC	Kauf	BRL	198.160	Verkauf	USD	37.109	(983)
16.10.2020	Citi	Kauf	PLN	254.910	Verkauf	USD	64.527	4.705
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	18.345	Verkauf	COP	67.200.000	438
19.10.2020	HSBC	Kauf	THB	387.000	Verkauf	USD	12.341	92
20.10.2020	JP Morgan	Kauf	CZK	710.610	Verkauf	USD	30.409	1.884
27.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	45.478	Verkauf	IDR	685.500.000	(1.254)
27.10.2020	JP Morgan	Kauf	IDR	461.300.000	Verkauf	USD	31.160	288
28.10.2020	Citi	Kauf	KRW	3.840.000	Verkauf	USD	3.209	25
29.10.2020	Citi	Kauf	USD	18.705	Verkauf	JPY	1.974.000	53
29.10.2020	Citi	Kauf	JPY	5.971.000	Verkauf	USD	56.557	(139)
29.10.2020	Citi	Kauf	RUB	1.863.000	Verkauf	USD	25.905	(951)
04.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	3.816	Verkauf	NZD	5.800	(90)
04.11.2020	JP Morgan	Kauf	NZD	5.800	Verkauf	USD	3.857	50
05.11.2020	Citi	Kauf	USD	28.748	Verkauf	MXN	659.300	(1.134)
05.11.2020	Citi	Kauf	MXN	637.900	Verkauf	USD	28.054	859
06.11.2020	HSBC	Kauf	PEN	64.900	Verkauf	USD	18.500	(191)
13.11.2020	Goldman Sachs	Kauf	ZAR	202.280	Verkauf	USD	11.497	343
13.11.2020	HSBC	Kauf	USD	34.095	Verkauf	ZAR	602.400	(1.164)
17.11.2020	Citi	Kauf	RUB	1.019.000	Verkauf	USD	13.762	(138)
18.11.2020	HSBC	Kauf	HUF	2.960.000	Verkauf	USD	9.968	(40)
20.11.2020	HSBC	Kauf	CLP	15.198.000	Verkauf	USD	19.436	122
20.11.2020	HSBC	Kauf	GBP	14.370	Verkauf	USD	19.020	198
25.11.2020	HSBC	Kauf	AUD	25.660	Verkauf	USD	18.863	67
25.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	48.446	Verkauf	AUD	67.550	(1.387)
11.12.2020	HSBC	Kauf	KRW	120.260.000	Verkauf	USD	101.592	(115)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 14.764 USD)								$ 40.825
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (46.726) USD)								(34.462)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (31.962) USD)								$ 6.363

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	32	$ 7.069	$ 58
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)			$ 58
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):– USD)			-
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)			$ 58

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 4,28 % (29. Februar 2020: 11,96 %)			
672	Asset Backed Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 2004-HE5, Series 2004 HE5, Class M1, 1,075 %, fällig 25.08.2034 *	662	0,51
754	Centex Home Equity Loan Trust 2005-A, Series 2005 A, Class M1, 0,895 %, fällig 25.01.2035 *	738	0,57
1.201	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-I, Series 2004 I, Class A, 0,452 %, fällig 15.02.2034 *	1.191	0,92
768	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006-HE1, Series 2006 HE1, Class M1, 0,565 %, fällig 25.12.2036 *	764	0,59
1.840	Towd Point Mortgage Trust 2017-4, Series 2017 4, Class A1, 144A, 2,750 %, fällig 25.06.2057 *	1.921	1,48
254	Towd Point Mortgage Trust 2018-3, Series 2018 3, Class A1, 144A, 3,750 %, fällig 25.05.2058 *	274	0,21
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 5.443 USD)		5.550	4,28
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 3,38 % (29. Februar 2020: 10,58 %)			
450	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 4,275 %, fällig 25.07.2039 *	392	0,30
380	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 3,575 %, fällig 25.10.2039 *	315	0,25
797	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA2, Series 2019 DNA2, Class M2, 144A, 2,625 %, fällig 25.03.2049 *	793	0,61
1.130	Lehman XS Trust Series 2005-5N, Series 2005 5N, Class 1A1, 0,475 %, fällig 25.11.2035 *	1.103	0,85
14	Thornburg Mortgage Securities Trust 2004-2, Series 2004 2, Class A1, 0,795 %, fällig 25.06.2044 *	13	0,01
1.735	WaMu Mortgage Pass-Through Series 2004-AR5 Trust, Series 2004 AR5, Class A6, 3,133 %, fällig 25.06.2034 *	1.769	1,36
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 4.369 USD)		4.385	3,38
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 67,36 % (29. Februar 2020: 65,12 %)			
Brasilien — 6,84 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1.320	Braskem Netherlands Finance BV, 5,875 %, fällig 31.01.2050	1.230	0,95
1.205	BRF SA, 144A, 3,950 %, fällig 22.05.2023	1.237	0,95
590	CSN Resources SA, 144A, 7,625 %, fällig 17.04.2026	592	0,46
1.780	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 6,125 %, Perpetual *	1.734	1,34
1.000	Petrobras Global Finance BV, 6,125 %, fällig 17.01.2022	1.059	0,81
2.590	Petrobras Global Finance BV, 5,600 %, fällig 03.01.2031	2.776	2,14
235	Vale Overseas Ltd, 3,750 %, fällig 08.07.2030	247	0,19
		8.875	6,84
Kanada — 1,18 % (29. Februar 2020: 3,15 %)			
1.315	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,893 %, fällig 17.03.2023 *	1.324	1,02
200	Teck Resources Ltd, 144A, 3,900 %, fällig 15.07.2030	206	0,16
		1.530	1,18
Chile — 0,99 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1.200	Corp Nacional del Cobre de Chile, 3,700 %, fällig 30.01.2050	1.290	0,99
China — 3,14 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Baidu Inc, 3,075 %, fällig 07.04.2025	214	0,16
260	JD.com Inc, 4,125 %, fällig 14.01.2050	300	0,23
1.070	Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,240 %, fällig 03.06.2050	1.138	0,88
340	Tencent Music Entertainment Group, 2,000 %, fällig 03.09.2030	339	0,26
1.135	Weibo Corp, 3,375 %, fällig 08.07.2030	1.187	0,91
850	Xiaomi Best Time International Ltd, 144A, 3,375 %, fällig 29.04.2030	904	0,70
		4.082	3,14
Deutschland — 0,26 % (29. Februar 2020: 0,46 %)			
320	Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A, 2,700 %, fällig 26.09.2022	333	0,26
Israel — 0,84 % (29. Februar 2020: 0,31 %)			
1.010	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 144A, 7,125 %, fällig 31.01.2025	1.095	0,84
Mexiko — 2,80 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1.285	Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman, 6,750 %, Perpetual *	1.286	0,99
200	Cemex SAB de CV, 7,750 %, fällig 16.04.2026	211	0,16
445	Cemex SAB de CV, 144A, 7,375 %, fällig 05.06.2027	483	0,37
1.982	Petroleos Mexicanos, 144A, 6,950 %, fällig 28.01.2060	1.652	1,28
		3.632	2,80
Niederlande — 0,39 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
460	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144A, 3,400 %, fällig 01.05.2030	511	0,39
Panama — 0,80 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
995	AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030	1.037	0,80
Großbritannien — 1,50 % (29. Februar 2020: 2,13 %)			
1.440	Fiat Chrysler Automobiles NV, 5,250 %, fällig 15.04.2023	1.529	1,18
400	Natwest Group Plc, 2,359 %, fällig 22.05.2024 *	414	0,32
		1.943	1,50
USA — 48,16 % (29. Februar 2020: 55,99 %)			
200	AES Corp/The, 144A, 3,300 %, fällig 15.07.2025	215	0,17
1.070	Air Lease Corp, 2,250 %, fällig 15.01.2023	1.075	0,83
1.808	Amdocs Ltd, 2,538 %, fällig 15.06.2030	1.886	1,45
1.155	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5,625 %, fällig 20.05.2024	1.265	0,97
1.080	Amgen Inc, 2,300 %, fällig 25.02.2031	1.144	0,88
455	Apache Corp, 4,875 %, fällig 15.11.2027	466	0,36
545	Apple Inc, 2,650 %, fällig 11.05.2050	565	0,44
232	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.02.2025	242	0,19
930	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2026	971	0,75
610	Ares Capital Corp, 4,200 %, fällig 10.06.2024	632	0,49
655	Ares Capital Corp, 4,250 %, fällig 01.03.2025	677	0,52
705	Ares Capital Corp, 3,250 %, fällig 15.07.2025	706	0,54
125	AutoNation Inc, 4,750 %, fällig 01.06.2030	147	0,11
545	Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.03.2024	566	0,44
1.715	Blackstone / GSO Secured Lending Fund, 144A, 3,650 %, fällig 14.07.2023	1.730	1,33
1.235	Block Financial LLC, 3,875 %, fällig 15.08.2030	1.259	0,97
405	Boeing Co/The, 2,700 %, fällig 01.05.2022	413	0,32
1.135	Boise Cascade Co, 144A, 5,625 %, fällig 01.09.2024	1.167	0,90
395	Broadcom Inc, 4,700 %, fällig 15.04.2025	452	0,35
540	Broadcom Inc, 3,459 %, fällig 15.09.2026	593	0,46
535	Broadcom Inc, 4,110 %, fällig 15.09.2028	600	0,46
1.160	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2031	1.215	0,94
430	CF Industries Inc, 144A, 3,400 %, fällig 01.12.2021	442	0,34
1.050	CIT Group Inc, 5,000 %, fällig 15.08.2022	1.100	0,85
560	CIT Group Inc, 3,929 %, fällig 19.06.2024 *	579	0,45
1.210	Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15.01.2024	1.193	0,92
470	CommScope Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.03.2026	500	0,39
645	Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	748	0,58
190	Crown Castle International Corp, 3,700 %, fällig 15.06.2026	215	0,17
325	Crown Castle International Corp, 3,300 %, fällig 01.07.2030	363	0,28
200	CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, fällig 15.02.2031	198	0,15
1.845	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 6,020 %, fällig 15.06.2026	2.179	1,68
EUR 285	DH Europe Finance II Sarl, 1,800 %, fällig 18.09.2049	344	0,27
480	Discovery Communications LLC, 3,625 %, fällig 15.05.2030	533	0,41
2.520	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	2.492	1,92
1.255	Dow Chemical Co/The, 2,100 %, fällig 15.11.2030	1.239	0,95
805	DPL Inc, 144A, 4,125 %, fällig 01.07.2025	850	0,65
220	Embarq Corp, 7,995 %, fällig 01.06.2036	265	0,20
460	Equifax Inc, 3,100 %, fällig 15.05.2030	503	0,39
130	Fifth Third Bancorp, 2,550 %, fällig 05.05.2027	141	0,11
500	Fiserv Inc, 2,250 %, fällig 01.06.2027	531	0,41
1.065	Flex Ltd, 4,875 %, fällig 12.05.2030	1.218	0,94
545	FMC Corp, 3,450 %, fällig 01.10.2029	614	0,47
1.550	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21.04.2023	1.716	1,32
1.115	Freeport-McMoRan Inc, 4,125 %, fällig 01.03.2028	1.168	0,90
860	Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig 01.08.2030	921	0,71
406	FS KKR Capital Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2022	415	0,32
315	FS KKR Capital Corp, 4,625 %, fällig 15.07.2024	317	0,24
610	FS KKR Capital Corp, 4,125 %, fällig 01.02.2025	605	0,47
320	General Electric Co, 3,625 %, fällig 01.05.2030	330	0,25
335	General Motors Co, 6,800 %, fällig 01.10.2027	410	0,32
610	General Motors Co, 6,250 %, fällig 02.10.2043	713	0,55
1.255	General Motors Financial Co Inc, 2,700 %, fällig 20.08.2027	1.259	0,97
395	HCA Inc, 4,750 %, fällig 01.05.2023	435	0,33
380	Hyundai Capital America, 144A, 2,850 %, fällig 01.11.2022	394	0,30
875	Intercontinental Exchange Inc, 1,850 %, fällig 15.09.2032	888	0,68
1.020	International Game Technology Plc, 144A, 5,250 %, fällig 15.01.2029	1.047	0,81
700	Iron Mountain Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.03.2028	738	0,57

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			
USA — (Fortsetzung)			
1.225	Jabil Inc, 3,600 %, fällig 15.01.2030	1.313	1,01
260	L Brands Inc, 5,625 %, fällig 15.10.2023	272	0,21
560	Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01.02.2030	603	0,46
355	Main Street Capital Corp, 5,200 %, fällig 01.05.2024	370	0,29
220	Markel Corp, 3,350 %, fällig 17.09.2029	242	0,19
115	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	133	0,10
180	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	205	0,16
860	Oracle Corp, 3,600 %, fällig 01.04.2050	960	0,74
1.060	Owens Corning, 3,875 %, fällig 01.06.2030	1.196	0,92
1.285	Owl Rock Capital Corp, 4,000 %, fällig 30.03.2025	1.295	1,00
1.150	Owl Rock Capital Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2026	1.159	0,89
960	PetSmart Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.06.2025	990	0,76
800	PVH Corp, 144A, 4,625 %, fällig 10.07.2025	822	0,63
580	Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.08.2024	581	0,45
535	Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	536	0,41
315	Southwest Airlines Co, 5,250 %, fällig 04.05.2025	344	0,26
1.115	Southwest Airlines Co, 5,125 %, fällig 15.06.2027	1.219	0,94
497	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC, 144A, 3,360 %, fällig 20.09.2021	503	0,39
635	Steel Dynamics Inc, 4,125 %, fällig 15.09.2025	650	0,50
500	Steel Dynamics Inc, 3,250 %, fällig 15.01.2031	539	0,41
1.045	T-Mobile USA Inc, 144A, 2,550 %, fällig 15.02.2031	1.094	0,84
620	Vishay Intertechnology Inc, 2,250 %, fällig 15.06.2025	606	0,47
1.095	VMware Inc, 4,700 %, fällig 15.05.2030	1.290	0,99
		62.511	48,16
Sambia — 0,46 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
600	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 15.05.2022	600	0,46
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 83.706 USD)		87.439	67,36

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 12,38 % (29. Februar 2020: 8,62 %)			
Australien — 1,63 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
AUD 2.975	Australie Government Bond, Series 162, 1,750 %, fällig 21.06.2051	2.112	1,63
Brasilien — 1,74 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
BRL 11.030	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2023	2.267	1,74
Ungarn — 2,69 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
HUF 150.000	Hungary Government Bond, Series 28/A, 6,750 %, fällig 22.10.2028	682	0,53
HUF 788.000	Hungary Government Bond, Series 30/A, 3,000 %, fällig 21.08.2030	2.808	2,16
		3.490	2,69
Italien — 1,28 % (29. Februar 2020: 1,23 %)			
EUR 1.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,850 %, fällig 01.09.2049	1.669	1,28
Japan — 0,71 % (29. Februar 2020: 0,83 %)			
JPY 102.500	Japan Government Thirty Year Bond, Series 63, 0,400 %, fällig 20.06.2049	919	0,71
Katar — 0,46 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
510	Qatar Government International Bond, 144A, 3,750 %, fällig 16.04.2030	595	0,46
Saudi Arabien — 0,64 % (29. Februar 2020: 0,78 %)			
795	Saudi Government International Bond, 144A, 2,500 %, fällig 03.02.2027	827	0,64
USA — 3,23 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
4.190	United States Treasury Floating Rate Note, 0,219 %, fällig 30.04.2022 *	4.195	3,23
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 15.922 USD)		16.074	12,38
Kollektive Kapitalanlagen — 5,62 % (29. Februar 2020: 2,03 %)			
7.299	Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	7.299	5,62
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 7.299 USD)		7.299	5,62
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 116.739 USD)		120.747	93,02
Kreditausfallversicherungen — 2,67 %(29. Februar 2020: 0,69 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		3.461	2,67
Devisenterminkontrakte — 0,89 % (29. Februar 2020: 0,53 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1.157	0,89

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Termingeschäfte — 0,07 % (29. Februar 2020: 0,39 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	89	0,07
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	125.454	96,65
Devisenterminkontrakte — (0,58 %) (29. Februar 2020: (0,31 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(761)	(0,58)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(761)	(0,58)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt	124.693	96,07
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	5.112	3,93
Gesamtnettovermögen	$129.805	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 33.710.000 USD, soit 25,99 % de l'actif net.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
AUD – Australischer Dollar
BRL – Brasilianischer Real
EUR – Euro
HUF – Ungarischer Forint
JPY – Japanischer Yen

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	85,92
Organismen für gemeinsame Anlagen	5,53
Finanzderivate	3,57
Sonstige Vermögenswerte	4,98
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	CCO Holdings LLC, 5,000 %	Verkauf	20.06.2021	900	$ 35
Barclays	Sprint Communications Inc, 5,000 %	Verkauf	20.06.2021	1.915	(740)
Barclays	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	1.725	70
Citi	CDX.NA.IG, 1,000 %	Verkauf	20.06.2025	22.355	110
Citi	iTrax Europe, 1,000 %	Verkauf	20.12.2024	3.160	369
Citi	iTraxx Europe, 1,000 %	Verkauf	20.06.2025	16.860	80
Citi	iTraxx Europe, 5,000 %	Verkauf	20.06.2025	23.890	444
JP Morgan	Liberty Media LLC, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	1.700	2.214
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.12.2022	1.925	126
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2022	715	3
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2022	1.115	4
Nicht realisierte Wertsteigerung von Kreditausfallversicherung (29. Februar 2020 (in Tsd.): 488 USD)					$ 3.461
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)					-
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): 488 USD)					$ 3.461

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1.188	Verkauf	EUR	1.005	$ (12)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	71	Verkauf	SEK	623	(1)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	343	Verkauf	SGD	469	(1)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	26	Verkauf	USD	30	–
02.09.2020	Citi	Kauf	USD	5.673	Verkauf	EUR	4.990	(282)
02.09.2020	HSBC	Kauf	USD	2.225	Verkauf	EUR	1.960	(114)
02.09.2020	JP Morgan	Kauf	EUR	5.050	Verkauf	USD	5.971	56
08.09.2020	Citi	Kauf	USD	1.524	Verkauf	GBP	1.210	(93)
08.09.2020	JP Morgan	Kauf	GBP	1.210	Verkauf	USD	1.524	94
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	24	Verkauf	EUR	19	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1.069	Verkauf	EUR	906	(11)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	58	Verkauf	GBP	44	(1)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	15	Verkauf	SGD	20	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	102	Verkauf	USD	75	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	329	Verkauf	USD	236	7
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	2.913	Verkauf	USD	3.808	87
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	59.848	Verkauf	USD	6.848	72
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	3.769	Verkauf	USD	437	(1)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	6.029	Verkauf	USD	4.393	36
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	47.371	Verkauf	USD	55.916	635
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	8	Verkauf	USD	10	–
17.09.2020	HSBC	Kauf	NOK	14.500	Verkauf	USD	1.538	122
17.09.2020	JP Morgan	Kauf	USD	1.507	Verkauf	NOK	14.500	(153)
17.09.2020	JP Morgan	Kauf	NOK	27.900	Verkauf	USD	3.151	44
02.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	2.012	Verkauf	EUR	1.690	(7)
17.11.2020	Citi	Kauf	RUB	103.000	Verkauf	USD	1.373	4
17.11.2020	Citi	Kauf	RUB	186.000	Verkauf	USD	2.512	(26)
24.11.2020	Citi	Kauf	USD	870	Verkauf	JPY	92.000	–
25.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	2.044	Verkauf	AUD	2.850	(59)
Unrealised Appreciation of Forward Foreign Currency Contracts (29 February 2020 (000's): $373)								$ 1.157
Unrealised Depreciation of Forward Foreign Currency Contracts (29 February 2020 (000's): $(219))								761
Net Appreciation of Forward Foreign Currency Contracts (29 February 2020 (000's): $154)								$ 396

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-BTP September 2020	65	$ 11.341	$ 76
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2020	43	5.988	13
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 279 USD)			$ 89
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):– USD)			-
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 279 USD)			$ 89

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 7,06 % (29. Februar 2020: 4,63 %)			
1.575	Drive Auto Receivables Trust 2019-3, Series 2019 3, Klasse D, 3,180 %, fällig 15.10.2026	1.613	3,47
1.625	Drive Auto Receivables Trust 2020-1, Series 2020 1, Klasse D, 2,700 %, fällig 17.05.2027	1.665	3,59
Forderungsbesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 3.221 USD)		3.278	7,06
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 74,08 % (29. Februar 2020: 78,26 %)			
480	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211, Series 2015 1211, Klasse C, 144A, 4,280 %, fällig 10.08.2035 *	515	1,11
512	Angel Oak Mortgage Trust 2019-5, Series 2019 5, Klasse A2, 144A, 2,716 %, fällig 25.10.2049 *	518	1,12
2.637	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC, Series 2017 BIOC, Klasse B, 144A, 1,132 %, fällig 15.07.2032 *	2.626	5,66
295	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P, Series 2013 375P, Klasse C, 144A, 3,635 %, fällig 10.05.2035 *	297	0,64
2.180	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC15, Series 2013 GC15, Klasse C, 5,386 %, fällig 10.09.2046 *	2.248	4,84
2.425	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29, Series 2015 GC29, Klasse C, 4,296 %, fällig 10.04.2048 *	2.387	5,14
760	COMM 2017-PANW Mortgage Trust, Series 2017 PANW, Klasse D, 144A, 4,343 %, fällig 10.10.2029 *	795	1,71
570	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Klasse 1B1, 144A, 4,275 %, fällig 25.07.2039 *	496	1,07
85	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Klasse 1B1, 144A, 3,575 %, fällig 25.10.2039 *	71	0,15
570	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Klasse 1B1, 144A, 3,425 %, fällig 25.01.2040 *	410	0,88
2.230	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05, Klasse 1B1, 4,425 %, fällig 25.01.2031 *	2.092	4,51
48.710	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K027, Klasse X1, 0,866 %, fällig 25.01.2023 *	690	1,49
38.182	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K042, Klasse X1, 1,173 %, fällig 25.12.2024 *	1.478	3,18
440	Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, Series 2020 DNA1, Klasse B2, 144A, 5,425 %, fällig 25.01.2050 *	262	0,57
255	Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Series 2020 DNA2, Klasse B2, 144A, 4,975 %, fällig 25.02.2050 *	137	0,29
699	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA2, Series 2019 DNA2, Klasse M2, 144A, 2,625 %, fällig 25.03.2049 *	696	1,50
2.015	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Series 2019 DNA4, Klasse B2, 144A, 6,425 %, fällig 25.10.2049 *	1.422	3,06
1.645	Freddie Mac STACR Trust 2019-HQA2, Series 2019 HQA2, Klasse M2, 144A, 2,225 %, fällig 25.04.2049 *	1.627	3,51
840	FREMF 2016-K58 Mortgage Trust, Series 2016 K58, Klasse B, 144A, 3,866 %, fällig 25.09.2049 *	920	1,98
790	FREMF 2017-K61 Mortgage Trust, Series 2017 K61, Klasse C, 144A, 3,810 %, fällig 25.12.2049 *	819	1,76
2.500	FREMF 2017-K63 Mortgage Trust, Series 2017 K63, Klasse C, 144A, 4,004 %, fällig 25.02.2050 *	2.627	5,66
33.611	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS5, Series 2017 GS5, Klasse XA, 0,955 %, fällig 10.03.2050 *	1.515	3,26
EUR 600	IM Pastor 3 FTH 3, Klasse B, 0,000 %, fällig 22.03.2043 *	337	0,73
EUR 500	IM Pastor 4 FTA 4, Klasse B, 0,000 %, fällig 22.03.2044 *	346	0,74
1.330	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C15, Series 2013 C15, Klasse C, 5,372 %, fällig 15.11.2045 *	1.314	2,83
1.535	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C32, Series 2015 C32, Klasse C, 4,802 %, fällig 15.11.2048 *	1.403	3,02
EUR 1.206	Landmark Mortgage Securities No 2 Plc 2, Klasse BC, 0,245 %, fällig 17.06.2039 *	1.308	2,82
1.660	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C7, Series 2013 C7, Klasse C, 4,259 %, fällig 15.02.2046 *	1.595	3,43
640	SFAVE Commercial Mortgage Securities Trust 2015-5AVE, Series 2015 5AVE, Klasse D, 144A, 4,534 %, fällig 05.01.2043 *	414	0,89
410	STACR Trust 2018-DNA3, Series 2018 DNA3, Klasse B2, 144A, 7,925 %, fällig 25.09.2048 *	326	0,70
895	WaMu Commercial Mortgage Securities Trust 2007-SL3, Series 2007 SL3, Klasse J, 144A, 3,900 %, fällig 23.03.2045 *	830	1,79
58.656	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC22, Series 2015 LC22, Klasse XA, 0,924 %, fällig 15.09.2058 *	1.877	4,04
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere insgesamt (Kosten 36.128 USD)		34.398	74,08
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 9,49 % (29. Februar 2020: 2,95 %)			
Brasilien — 2,65 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
735	Braskem Netherlands Finance BV, 5,875 %, fällig 31.01.2050	685	1,48
200	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 144A, 6,125 %, Perpetual *	195	0,42
325	Petrobras Global Finance BV, 5,600 %, fällig 03.01.2031	348	0,75
		1.228	2,65
Israel — 0,72 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
305	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,750 %, fällig 01.03.2028	333	0,72
Mexiko — 0,43 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman, 144A, 6,750 %, Perpetual *	200	0,43
Panama — 0,45 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030	209	0,45
USA — 4,80 % (29. Februar 2020: 2,95 %)			
315	CommScope Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.03.2027	341	0,73
960	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	949	2,04
325	General Motors Co, 6,750 %, fällig 01.04.2046	396	0,85
190	Scientific Games International Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.03.2026	195	0,42
330	United States Steel Corp, 144A, 12,000 %, fällig 01.06.2025	350	0,76
		2.231	4,80
Sambia — 0,44 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 01.04.2023	204	0,44
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 4.212 USD)		4.405	9,49
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 0,92 % (29. Februar 2020: 9,92 %)			
Ungarn — 0,92 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
HUF 20.000	Hungary Government Bond, Series 28/A, 6,750 %, fällig 22.10.2028	91	0,19
HUF 95.000	Hungary Government Bond, Series 30/A, 3,000 %, fällig 21.08.2030	338	0,73
		429	0,92
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 440 USD)		429	0,92
Kollektive Kapitalanlagen — 8,16 % (29. Februar 2020: 2,93 %)			
3.787	Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	3.787	8,16
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 3.787 USD)		3.787	8,16
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 47.788 USD)		46.297	99,71
Kreditausfallversicherungen — 1,46 % (29. Februar 2020: 0,46 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		677	1,46
Devisenterminkontrakte — 0,32 % (29. Februar 2020: 0,18 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		146	0,32
Termingeschäfte — 0,09 % (29. Februar 2020: 0,26 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		43	0,09
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		47.163	101,58
Devisenterminkontrakte — (0,94 %) (29. Februar 2020: (0,51 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(435)	(0,94)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(435)	(0,94)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		46.728	100,64
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(294)	(0,64)
Total des actifs nets$		$46.434	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 17.293.000 USD und machten 37.25% des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

EUR – Euro

HUF – Ungarischer Forint

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	88,82
Organismen für gemeinsame Anlagen	7,91
Finanzderivate	1,81
Sonstige Vermögenswerte	1,46
Gesamtvermögen	100,00

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	Sprint Communications Inc, 5,000 %	Verkauf	20.06.2021	795	$ 29
Barclays	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	731	46
Barclays	T-Mobile USA Inc, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	725	58
Citi	CDX.NA.IG, 1,000 %	Verkauf	20.06.2025	1.625	27
Citi	iTraxx Europe, 5,000 %	Verkauf	20.06.2025	5.535	513
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.12.2022	925	1
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2022	520	3
Nicht realisierte Wertsteigerung von Kreditausfallversicherung (29. Februar 2020 (in Tsd.): 201 USD)					$ 677
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (568) USD)					-
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (367) USD)					$ 677

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1.851	Verkauf	BRL	10.262	$ (22)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	BRL	10.262	Verkauf	USD	1.979	(106)
02.09.2020	Barclays	Kauf	USD	3.660	Verkauf	EUR	3.230	(195)
02.09.2020	Citi	Kauf	USD	284	Verkauf	EUR	250	(14)
02.09.2020	HSBC	Kauf	USD	1.475	Verkauf	EUR	1.250	(17)
02.09.2020	HSBC	Kauf	EUR	1.580	Verkauf	USD	1.853	33
02.09.2020	UBS	Kauf	EUR	1.050	Verkauf	USD	1.184	69
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	5	Verkauf	USD	5	–
01.10.2020	BNY Mellon	Kauf	BRL	10.294	Verkauf	USD	1.857	$ 20
02.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	2.547	Verkauf	EUR	2.140	(9)
09.10.2020	HSBC	Kauf	USD	1.094	Verkauf	BRL	5.960	8
09.10.2020	HSBC	Kauf	BRL	5.960	Verkauf	USD	1.149	(62)
17.11.2020	Citi	Kauf	RUB	68.000	Verkauf	USD	919	(10)
18.11.2020	HSBC	Kauf	USD	404	Verkauf	HUF	120.000	2
20.11.2020	HSBC	Kauf	GBP	1.060	Verkauf	USD	1.403	14
24.11.2020	Citi	Kauf	JPY	122.000	Verkauf	USD	1.153	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 79 USD)								$ 146
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (224) USD)								435
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (145) USD)								$ (289)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-BTP September 2020	6	$ 1.047	$ 43
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 112 USD)			$ 43
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):– USD)			-
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 112 USD)			$ 43

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 88,89 % (29. Februar 2020: 92,50 %)			
Brasilien — 7,74 % (29. Februar 2020: 3,81 %)			
200	Braskem Netherlands Finance BV, 8,500 %, fällig 23.01.2081 *	210	1,90
200	BRF SA, 3,950 %, fällig 22.05.2023	205	1,85
200	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 6,125 %, Perpetual *	195	1,76
230	Petrobras Global Finance BV, 5,600 %, fällig 03.01.2031	247	2,23
		857	7,74
Kanada — 2,18 % (29. Februar 2020: 2,80 %)			
130	Air Canada, 144A, 7,750 %, fällig 15.04.2021	130	1,18
105	Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.01.2026	111	1,00
		241	2,18
China — 3,75 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	China Evergrande Group, 6,250 %, fällig 28.06.2021	197	1,79
205	Sunac China Holdings Ltd, 8,350 %, fällig 19.04.2023	217	1,96
		414	3,75
Kolumbien — 1,65 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 17.01.2027	183	1,65
Frankreich — 1,18 % (29. Februar 2020: 1,13 %)			
EUR 110	Altice France SA/France, 3,375 %, fällig 15.01.2028	130	1,18
Israel — 3,08 % (29. Februar 2020: 3,12 %)			
200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 144A, 7,125 %, fällig 31.01.2025	217	1,96
135	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	124	1,12
		341	3,08
Mexiko — 5,94 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 6,750 %, Perpetual *	200	1,81
200	Cemex SAB de CV, 7,750 %, fällig 16.04.2026	211	1,90
50	Petroleos Mexicanos, 4,875 %, fällig 24.01.2022	51	0,46
235	Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	196	1,77
		658	5,94
Panama — 1,88 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030	209	1,88
Großbritannien — 1,49 % (29. Februar 2020: 4,03 %)			
160	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 6,750 %, fällig 01.10.2026	165	1,49
USA — 59,31 % (29. Februar 2020: 75,64 %)			
150	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5,625 %, fällig 20.05.2024	164	1,48
40	Apache Corp, 4,875 %, fällig 15.11.2027	41	0,37
200	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 4,125 %, fällig 15.08.2026	209	1,89
95	Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.03.2024	99	0,89
100	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.04.2025	103	0,93
65	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029	68	0,61
45	Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,250 %, fällig 30.05.2029	49	0,45
100	Blackstone / GSO Secured Lending Fund, 3,650 %, fällig 14.07.2023	101	0,91
150	Boise Cascade Co, 144A, 5,625 %, fällig 01.09.2024	154	1,39
35	Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig 01.07.2030	38	0,34
115	CIT Group Inc, 4,125 %, fällig 09.03.2021	116	1,05
100	CIT Group Inc, 5,000 %, fällig 01.08.2023	106	0,96
120	Clearway Energy Operating LLC, 5,000 %, fällig 15.09.2026	126	1,14
50	Cleveland-Cliffs Inc, 4,875 %, fällig 15.01.2024	49	0,45
20	Cleveland-Cliffs Inc, 9,875 %, fällig 17.10.2025	22	0,20
45	CommScope Inc, 6,000 %, fällig 01.03.2026	48	0,43
35	CommScope Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.07.2028	37	0,34
95	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.06.2024	99	0,89
40	Dell International LLC / EMC Corp, 7,125 %, fällig 15.06.2024	42	0,38
100	Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 6,020 %, fällig 15.06.2026	118	1,07
35	Edgewell Personal Care Co, 5,500 %, fällig 01.06.2028	37	0,34
90	Embarq Corp, 7,995 %, fällig 01.06.2036	108	0,98
110	Encompass Health Corp, 4,500 %, fällig 01.02.2028	113	1,02
50	Entegris Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2028	52	0,47
175	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21.04.2023	194	1,75
110	Freeport-McMoRan Inc, 4,125 %, fällig 01.03.2028	115	1,04
65	Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig 01.08.2030	70	0,63
50	Genworth Holdings Inc, 7,200 %, fällig 15.02.2021	51	0,46
55	Genworth Holdings Inc, 4,900 %, fällig 15.08.2023	51	0,46
100	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,375 %, fällig 15.04.2026	111	1,00
225	Gray Television Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.10.2024	231	2,08
100	Harsco Corp, 144A, 5,750 %, fällig 31.07.2027	105	0,95
100	Hughes Satellite Systems Corp, 5,250 %, fällig 01.08.2026	110	0,99
170	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 6,250 %, fällig 15.05.2026	182	1,64
120	Iron Mountain Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.03.2028	127	1,14
95	Level 3 Financing Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.09.2027	100	0,90
200	Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01.02.2030	215	1,95
55	Murphy Oil Corp, 6,875 %, fällig 15.08.2024	56	0,51
35	Navios Maritime Acquisition Corp / Navios Acquisition Finance US Inc, 144A, 8,125 %, fällig 15.11.2021	23	0,21
100	NRG Energy Inc, 6,625 %, fällig 15.01.2027	107	0,97
70	Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, fällig 01.09.2030	73	0,66
70	Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig 15.03.2048	53	0,48
80	Owl Rock Capital Corp, 4,000 %, fällig 30.03.2025	81	0,73
100	Par Pharmaceutical Inc, 7,500 %, fällig 01.04.2027	107	0,97
315	PetSmart Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.06.2025	325	2,93
70	PVH Corp, 144A, 4,625 %, fällig 10.07.2025	72	0,65
50	Scientific Games International Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.10.2025	49	0,45
45	Select Medical Corp, 144A, 6,250 %, fällig 15.08.2026	48	0,44
30	Sensata Technologies Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.02.2030	32	0,29
200	Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.08.2024	201	1,81
275	Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	275	2,49
115	Sirius XM Radio Inc, 5,375 %, fällig 15.07.2026	121	1,09
175	Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15.11.2028	224	2,02
70	Talen Energy Supply LLC, 6,500 %, fällig 01.06.2025	49	0,44
30	Talen Energy Supply LLC, 144A, 7,250 %, fällig 15.05.2027	31	0,28
105	TEGNA Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.03.2028	106	0,96
90	Tronox Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.05.2025	97	0,87
80	Tronox Inc, 6,500 %, fällig 15.04.2026	83	0,75
90	Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.06.2027	90	0,82
100	ViaSat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.09.2025	100	0,91
95	ViaSat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2027	101	0,91
50	Vishay Intertechnology Inc, 2,250 %, fällig 15.06.2025	49	0,44
50	Winnebago Industries Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.07.2028	54	0,48
90	WR Grace & Co-Conn, 144A, 4,875 %, fällig 15.06.2027	94	0,85
100	Wyndham Destinations Inc, 5,750 %, fällig 01.04.2027	103	0,93
		6.565	59,31
Uruguay — 0,69 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
70	Navios South American Logistics Inc / Navios Logistics Finance US Inc, 10,750 %, fällig 01.07.2025	76	0,69
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 9.405 USD)		9.839	88,89
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 3,44 % (29. Februar 2020: 1,82 %)			
Südafrika — 1,62 % (29. Februar 2020: 1,82 %)			
200	Republic of South Africa Government International Bond, 5,750 %, fällig 30.09.2049	180	1,62
Ukraine — 1,82 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
200	Ukraine Government International Bond, 7,253 %, fällig 15.03.2033	201	1,82
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 399 USD)		381	3,44
Kollektive Kapitalanlagen — 3,49 % (29. Februar 2020: 6,54 %)			
386	Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	386	3,49
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Kosten 386 USD)		386	3,49
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 10.190 USD)		10.606	95,82
Kreditausfallversicherungen — 1,73 % (29. Februar 2020: 0,52 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		191	1,73
Devisenterminkontrakte — 1,18 % (29. Februar 2020: 0,26 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		130	1,18
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		10.927	98,73
Kreditausfallversicherungen — (0,15 %) (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(16)	(0,15)
Devisenterminkontrakte — (0,28 %) (29. Februar 2020: (0,48 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(31)	(0,28)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(47)	(0,43)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		10.880	98,30

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	188	1,70
Gesamtnettovermögen	11.068	100,00

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	91,35
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,45
Finanzderivate	2,88
Sonstige Vermögenswerte	2,32
Gesamtvermögen	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 3.719.000 USD und machten 33.59% des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

Perpetual – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Fortwährende Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

EUR – Euro

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	CCO Holdings LLC, 5,000 %	Verkauf	20.06.2021	95	$ 4
Barclays	Sprint Communications Inc, 5,000 %	Verkauf	20.06.2021	195	7
Barclays	T-Mobile USA Inc, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	130	10
Citi	CenturyLink Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2023	105	(3)
Citi	CenturyLink Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2025	115	(9)
Citi	iTraxx Europe, 5,000 %	Verkauf	20.06.2025	1.695	157
Citi	Occidental Petroleum Corporation, 1,000 %	Verkauf	20.06.2021	105	(2)
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	185	12
JP Morgan	United States Steel Corp, 5,000 %	Verkauf	20.06.2021	95	(2)
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2022	165	1
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.12.2022	205	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Kreditausfallversicherung (29. Februar 2020 (in Tsd.): 55 USD)					$ 191
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)					(16)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): 55 USD)					$ 175

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
02.09.2020	Citi	Kauf	EUR	1.220	Verkauf	USD	1.387	$ 69
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	42	Verkauf	CAD	67	–
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	184	Verkauf	GBP	166	(3)
11.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	7.291	Verkauf	USD	8.661	41
17.09.2020	HSBC	Kauf	NOK	920	Verkauf	USD	98	7
17.09.2020	JP Morgan	Kauf	USD	96	Verkauf	NOK	920	(10)
02.10.2020	JP Morgan	Kauf	EUR	1.460	Verkauf	USD	1.738	6
09.10.2020	JP Morgan	Kauf	BRL	1.610	Verkauf	USD	312	(18)
20.11.2020	HSBC	Kauf	GBP	280	Verkauf	USD	367	7
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 28 USD)								$ 130
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (51) USD)								(31)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (23) USD)								$ 99

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 21,10 % (29. Februar 2020: 9,32 %)			
Brasilien — 0,74 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
2.680	Petrobras Global Finance BV, 6,750 %, fällig 03.06.2050	2.992	0,74
Kanada — 1,65 % (29. Februar 2020: 1,73 %)			
6.585	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,893 %, fällig 17.03.2023 *	6.630	1,65
Frankreich — 0,53 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
2.020	Total Capital International SA, 3,127 %, fällig 29.05.2050	2.133	0,53
Mexiko — 1,69 % (29. Februar 2020: 2,06 %)			
1.180	Petroleos Mexicanos, 6,750 %, fällig 21.09.2047	987	0,25
6.450	Petroleos Mexicanos, 144A, 7,690 %, fällig 23.01.2050	5.799	1,44
		6.786	1,69
USA — 16,49 % (29. Februar 2020: 5,53 %)			
830	3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050	1.011	0,25
3.725	American Express Co, 0,849 %, fällig 05.11.2021 *	3.746	0,93
1.940	Amgen Inc, 3,150 %, fällig 21.02.2040	2.072	0,51
1.115	Amgen Inc, 3,375 %, fällig 21.02.2050	1.222	0,30
1.710	Apache Corp, 4,750 %, fällig 15.04.2043	1.612	0,40
475	Apache Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2044	424	0,11
260	Apache Corp, 5,350 %, fällig 01.07.2049	251	0,06
2.190	Apple Inc, 2,650 %, fällig 11.05.2050	2.272	0,56
6.565	Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	8.251	2,05
990	Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01.05.2040	1.153	0,29
1.545	Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01.05.2050	1.858	0,46
1.235	Boeing Co/The, 5,930 %, fällig 01.05.2060	1.517	0,38
5.420	Caterpillar Financial Services Corp, 0,543 %, fällig 15.03.2021 *	5.426	1,35
5.980	Ford Motor Credit Co LLC, 1,114 %, fällig 05.04.2021 *	5.891	1,46
435	General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2040	551	0,14
1.030	General Motors Co, 6,800 %, fällig 01.10.2027	1.261	0,31
1.950	General Motors Co, 6,250 %, fällig 02.10.2043	2.278	0,57
780	Hess Corp, 5,600 %, fällig 15.02.2041	900	0,22
400	Hess Corp, 5,800 %, fällig 01.04.2047	458	0,11
1.215	Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	1.689	0,42
430	Intel Corp, 4,950 %, fällig 25.03.2060	622	0,15
225	McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	262	0,07
305	McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	346	0,09
415	McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	508	0,13
4.595	Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 0,662 %, fällig 13.01.2023 *	4.616	1,15
530	Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, fällig 15.03.2040	505	0,13
240	Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig 15.03.2046	239	0,06
905	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.04.2046	724	0,18
1.175	Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig 15.03.2048	892	0,22
460	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.08.2049	355	0,09
3.525	Southwest Airlines Co, 5,125 %, fällig 15.06.2027	3.853	0,96
310	United Parcel Service Inc, 5,200 %, fällig 01.04.2040	431	0,11
910	United Parcel Service Inc, 5,300 %, fällig 01.04.2050	1.346	0,33
395	Walt Disney Co/The, 4,625 %, fällig 23.03.2040	503	0,13
795	Walt Disney Co/The, 4,700 %, fällig 23.03.2050	1.060	0,26
2.895	Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04.04.2031 *	3.536	0,88
1.980	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	2.712	0,67
		66.353	16,49
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 78.472 USD)		84.894	21,10
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 60,82 % (29. Februar 2020: 87,81 %)			
Australien — 1,66 % (29. Februar 2020: 1,90 %)			
AUD 9.400	Australie Government Bond, Series 162, 1,750 %, fällig 21.06.2051	6.672	1,66
Brasilien — 7,14 % (29. Februar 2020: 9,49 %)			
BRL 139.700	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2023	28.712	7,14
Kolumbien — 4,31 % (29. Februar 2020: 4,86 %)			
COP 61.890.000	Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	17.357	4,31
Indonesien — 9,20 % (29. Februar 2020: 9,99 %)			
IDR 473.400.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029	37.020	9,20
Malaysia — 4,40 % (29. Februar 2020: 4,61 %)			
MYR 5.240	Malaysia Government Bond, Series 0315, 3,659 %, fällig 15.10.2020	1.261	0,31
MYR 32.800	Malaysia Government Bond, Series 0117, 3,882 %, fällig 10.03.2022	8.131	2,02
MYR 12.225	Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480 %, fällig 15.03.2023	3.053	0,76
MYR 7.475	Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	1.951	0,49
MYR 12.550	Malaysia Government Bond, Series 0417, 3,899 %, fällig 16.11.2027	3.300	0,82
		17.696	4,40
Mexiko — 18,91 % (29. Februar 2020: 22,31 %)			
MXN 207.000	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	11.184	2,78
MXN 201.000	Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	10.875	2,70
MXN 859.000	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	42.959	10,68
MXN 217.000	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	11.076	2,75
		76.094	18,91
Russland — 3,11 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
RUB 827.000	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10.04.2030	12.505	3,11
Südafrika — 8,20 % (29. Februar 2020: 10,74 %)			
ZAR 158.500	Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	5.940	1,48
ZAR 588.500	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	27.034	6,72
		32.974	8,20
Spanien — 0,81 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 2.905	Spain Government Bond, 144A, 1,000 %, fällig 31.10.2050	3.267	0,81
USA — 3,08 % (29. Februar 2020: 23,91 %)			
7.035	United States Treasury Floating Rate Note, 0,219 %, fällig 30.04.2022 *	7.043	1,75
5.350	United States Treasury Floating Rate Note, 0,160 %, fällig 31.07.2022 *	5.351	1,33
		12.394	3,08
Summe Anleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 252.311 USD)		244.691	60,82
Kollektive Kapitalanlagen — 3,91 % (29. Februar 2020: 3,90 %)			
5.420	Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	5.420	1,35
88	Legg Mason Global Funds Plc – Brandywine Global Credit Opportunities Fund – LM Class US$ Capitalización	10.313	2,56
Total d'organismes de placement collectif (Kosten $15.731)		15.733	3,91
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 346.514 USD)		345.318	85,83
Devisenterminkontrakte — 5,92 % (29. Februar 2020: 1,51 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		23.833	5,92
Termingeschäfte — 0,96 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		3.859	0,96
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		373.010	92,71
Kreditausfallversicherungen — (1,28 %)(29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(5.167)	(1,28)
Devisenterminkontrakte — (1,64 %) (29. Februar 2020: (5,15 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(6.613)	(1,64)
Termingeschäfte — (0,17 %) (29. Februar 2020: (4,45 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(663)	(0,17)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(12.443)	(3,09)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		360.567	89,62
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		41.761	10,38
Gesamtnettovermögen		$402.328	100,00

– Als „–" bezeichnete Beträge sind entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Aktien oder weniger als 0,01 %. 1.000 USD, weniger als 1.000 Aktien oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 3,719,000 USD und machten 33,59% des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2020.

ABKÜRZUNGEN:

AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
COP	– Kolumbianischer Peso
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
IDR	– Indonesische Rupiah
MXN	– Mexikanischer Peso
MYR	– Malaysischer Ringgit
PLN	– Polnischer Zloty
RUB	– Russischer Rubel
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	78,78
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,76
Finanzderivate	6,62
Sonstige Vermögenswerte	10,84
Gesamtvermögen	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 %	Kauf	20.06.2025	90.377	$ (5.167)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Kreditausfallversicherungen (29. Februar 2020 (in Tsd.):– USD)					$ (5.167)
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)					-
Nettowertminderung von Kreditausfallversicherung (29. Februar 2020 (in Tsd.):– USD)					$ (5.167)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
02.09.2020	Barclays	Kauf	USD	54.847	Verkauf	EUR	46.690	$ (870)
02.09.2020	Barclays	Kauf	EUR	32.190	Verkauf	USD	37.440	974
02.09.2020	Citi	Kauf	USD	75.505	Verkauf	EUR	66.420	(3.757)
02.09.2020	Citi	Kauf	EUR	70.420	Verkauf	USD	81.521	2.515
11.09.2020	HSBC	Kauf	USD	37.560	Verkauf	IDR	540.000.000	529
11.09.2020	HSBC	Kauf	IDR	540.000.000	Verkauf	USD	36.723	308
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	12	Verkauf	SGD	16	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	8	Verkauf	USD	9	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	13	Verkauf	USD	17	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	88.846	Verkauf	USD	64.744	558
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	430.509	Verkauf	USD	308.540	9.000
15.09.2020	HSBC	Kauf	USD	16.995	Verkauf	CLP	13.370.000	(200)
15.09.2020	HSBC	Kauf	KRW	8.780.000	Verkauf	USD	7.333	60
15.09.2020	HSBC	Kauf	CLP	11.900.000	Verkauf	USD	14.547	758
15.09.2020	HSBC	Kauf	CLP	13.370.000	Verkauf	USD	17.388	(193)
17.09.2020	HSBC	Kauf	NOK	435.600	Verkauf	USD	47.153	2.718
02.10.2020	Citi	Kauf	EUR	3.610	Verkauf	USD	4.270	41
02.10.2020	Citi	Kauf	EUR	40	Verkauf	USD	48	–
02.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	12.498	Verkauf	EUR	10.500	(42)
09.10.2020	HSBC	Kauf	USD	29.345	Verkauf	BRL	158.590	433
09.10.2020	HSBC	Kauf	BRL	158.590	Verkauf	USD	29.267	(354)
14.10.2020	Barclays	Kauf	MYR	144.100	Verkauf	USD	33.676	991
16.10.2020	JP Morgan	Kauf	USD	16.678	Verkauf	COP	61.070.000	404
20.10.2020	Citi	Kauf	KRW	12.980.000	Verkauf	USD	10.843	88
20.10.2020	JP Morgan	Kauf	CZK	374.900	Verkauf	USD	16.043	994
28.10.2020	Citi	Kauf	KRW	5.610.000	Verkauf	USD	4.689	36
29.10.2020	Citi	Kauf	RUB	975.000	Verkauf	USD	13.557	(498)
04.11.2020	JP Morgan	Kauf	NZD	15.400	Verkauf	USD	10.240	132
13.11.2020	Barclays	Kauf	ZAR	1.203.410	Verkauf	USD	68.335	2.101
13.11.2020	Barclays	Kauf	USD	33.475	Verkauf	ZAR	573.210	(75)
13.11.2020	HSBC	Kauf	USD	36.597	Verkauf	ZAR	630.200	(289)
17.11.2020	Citi	Kauf	RUB	1.109.000	Verkauf	USD	14.978	(150)
20.11.2020	HSBC	Kauf	GBP	55.260	Verkauf	USD	72.708	1.193
25.11.2020	JP Morgan	Kauf	USD	6.462	Verkauf	AUD	9.010	(185)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 5.780 USD)								$ 23.833
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (19.699) USD)								(6.613)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (13.919) USD)								$ 17.220

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-BTP September 2020	626	$109.224	$ 2.599
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2020	(208)	(53.843)	1.260
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2020	(332)	(73.341)	(663)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)			$ 3.859
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(16.987) USD)			(663)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (16.987) USD)			$ $ 3.196

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Kollektive Kapitalanlagen — 1,58 % (29. Februar 2020: 1,38 %)			
24	Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	24	1,58
Kollektive Kapitalanlagen insgesamt (Kosten 24 USD)		24	1,58
Stammaktien — 97,73 % (29. Februar 2020: 98,25 %)			
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung — 0,68 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1	Howmet Aerospace Inc	10	0,68
Landwirtschaft — 0,46 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
–	Darling Ingredients Inc	7	0,46
Bekleidung — 0,78 % (29. Februar 2020: 0,35 %)			
–	Hanesbrands Inc	7	0,48
–	Ralph Lauren Corp 'A'	5	0,30
		12	0,78
Automobilhersteller — 2,77 % (29. Februar 2020: 1,81 %)			
–	Cummins Inc	42	2,77
Autoteile und Ausrüstung — 0,96 % (29. Februar 2020: 0,46 %)			
–	Allison Transmission Holdings Inc	6	0,36
–	Lear Corp	9	0,60
		15	0,96
Banken — 17,06 % (29. Februar 2020: 7,97 %)			
2	Bank of America Corp	47	3,11
1	Bank of New York Mellon Corp/The	28	1,86
1	Citigroup Inc	45	2,93
–	Citizens Financial Group Inc	10	0,65
–	East West Bancorp Inc	4	0,29
–	Goldman Sachs Group Inc/The	47	3,07
1	Morgan Stanley	49	3,21
–	Signature Bank/New York NY	5	0,30
–	State Street Corp	20	1,34
–	Zions Bancorp NA	5	0,30
		260	17,06
Biotechnologie — 4,40 % (29. Februar 2020: 4,27 %)			
–	Amgen Inc	15	1,00
–	Biogen Inc	52	3,40
		67	4,40
Chemikalien — 4,52 % (29. Februar 2020: 2,28 %)			
–	Celanese Corp 'A'	17	1,07
–	CF Industries Holdings Inc	9	0,61
–	Eastman Chemical Co	14	0,94
–	LyondellBaSell Industries NV	29	1,90
		69	4,52
Kommerzielle Dienste — 1,49 % (29. Februar 2020: 0,47 %)			
–	ManpowerGroup Inc	6	0,38
–	United Rentals Inc	17	1,11
		23	1,49
Computer — 0,97 % (29. Februar 2020: 6,07 %)			
–	NetApp Inc	15	0,97
Kosmetik und Körperpflege — 1,50 % (29. Februar 2020: 1,34 %)			
–	Procter & Gamble Co/The	23	1,50
Vertrieb und Großhandel — 0,86 % (29. Februar 2020: 0,23 %)			
–	LKQ Corp	13	0,86
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 6,73 % (29. Februar 2020: 7,76 %)			
–	Ally Financial Inc	7	0,47
–	Ameriprise Financial Inc	17	1,09
–	Discover Financial Services	14	0,94
–	Invesco Ltd	4	0,27
–	Jefferies Financial Group Inc	4	0,26
–	OneMain Holdings Inc	3	0,21
–	Santander Consumer USA Holdings Inc	5	0,30
–	Synchrony Financial	12	0,80
–	T Rowe Price Group Inc	36	2,39
		102	6,73
Elektrik — 3,91 % (29. Februar 2020: 2,82 %)			
–	American Electric Power Co Inc	4	0,29
–	Duke Energy Corp	5	0,29
–	Evergy Inc	19	1,27
–	Exelon Corp	5	0,33
–	NextEra Energy Inc	12	0,79
–	Southern Co/The	14	0,94
		59	3,91
Elektrische Komponenten und Zubehör — 3,75 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
1	Emerson Electric Co	57	3,75
Elektronik — 0,61 % (29. Februar 2020: 2,66 %)			
–	Arrow Electronics Inc	9	0,61
Maschinenbau und Bauwesen — 0,45 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
–	TopBuild Corp	7	0,45
Lebensmittel — 0,81 % (29. Februar 2020: 0,74 %)			
–	Kroger Co/The	2	0,17
–	Sysco Corp	10	0,64
		12	0,81
Hand- und Maschinenwerkzeuge — 0,69 % (29. Februar 2020: 0,54 %)			
–	Colfax Corp	5	0,34
–	Regal Beloit Corp	5	0,35
		10	0,69
Gesundheitsprodukte — 0,85 % (29. Februar 2020: 2,35 %)			
–	Henry Schein Inc	13	0,85
Medizinische Dienstleistungen — 2,15 % (29. Februar 2020: 0,14 %)			
–	DaVita Inc	18	1,20
–	Molina Healthcare Inc	15	0,95
		33	2,15
Wohnungsbauunternehmen — 5,18 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
–	DR Horton Inc	31	2,04
–	Lennar Corp	23	1,48
–	Meritage Homes Corp	3	0,22
–	PulteGroup Inc	15	0,97
–	Toll Brothers Inc	7	0,47
		79	5,18
Einrichtungsgegenstände — 0,39 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
–	Tempur Sealy International Inc	6	0,39
Versicherung — 3,54 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
–	Allstate Corp/The	25	1,63
–	Equitable Holdings Inc	8	0,54
–	Lincoln National Corp	6	0,41
–	Primerica Inc	5	0,29
–	Progressive Corp/The	9	0,60
–	Voya Financial Inc	1	0,07
		54	3,54
Internet — 4,06 % (29. Februar 2020: 6,21 %)			
–	E*TRADE Financial Corp	10	0,67
1	eBay Inc	52	3,39
		62	4,06
Unterkunft — 0,97 % (29. Februar 2020: 2,01 %)			
1	MGM Resorts International	15	0,97
Maschinen – Bau und Bergbau — 1,19 % (29. Februar 2020: 2,67 %)			
–	Caterpillar Inc	18	1,19
Medien — 1,56 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
–	Comcast Corp	9	0,60
–	Discovery Inc	5	0,31
–	Walt Disney Co/The	10	0,65
		24	1,56
Metallverarbeitung und -beschläge — 0,33 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
–	Timken Co/The	5	0,33
Öl und Gas — 5,21 % (29. Februar 2020: 1,93 %)			
1	Cabot Oil & Gas Corp	10	0,65
1	ConocoPhillips	44	2,90
1	Continental Resources Inc/OK	9	0,59
–	HollyFrontier Corp	6	0,37
1	Marathon Oil Corp	5	0,36
–	Murphy USA Inc	5	0,34
		79	5,21
Pharmaindustrie 3,45 % (29. Februar 2020: 4,01 %)			
–	Johnson & Johnson	23	1,50
–	Merck & Co Inc	15	1,00
–	Pfizer Inc	14	0,95
		52	3,45
Einzelhandel — 6,50 % (29. Februar 2020: 6,19 %)			
–	Best Buy Co Inc	32	2,12
–	Lowe's Cos Inc	32	2,11
–	Penske Automotive Group Inc	4	0,25
–	Target Corp	17	1,11
–	Walmart Inc	14	0,91
		99	6,50
Halbleiter — 4,96 % (29. Februar 2020: 7,82 %)			
1	Intel Corp	76	4,96
Software — 1,47 % (29. Februar 2020: 2,52 %)			
–	Oracle Corp	22	1,47
Telekommunikation — 1,93 % (29. Februar 2020: 3,45 %)			
–	AT&T Inc	10	0,67
–	Verizon Communications Inc	19	1,26
		29	1,93
Textilien: 0,59 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
–	Mohawk Industries Inc	9	0,59
Stammaktien insgesamt (Kosten 1.405)		1.487	97,73
Erfolgswirksame Gesamtinvestitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 1.429 USD)		1.511	99,31
Devisenterminkontrakte — 0,80 % (29. Februar 2020: 0,21 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		12	0,80
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		1.523	100,11
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		1.523	100,11
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(2)	(0,11)
Gesamtnettovermögen			

\- Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,43
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,56
Finanzderivate	0,78
Sonstige Vermögenswerte	1,23
Gesamtvermögen	100,00

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)				Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	903	Verkauf	USD	1.065	$	12
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 7 USD)								$	12
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (1) USD)									-
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 6 USD)								$	12

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Value Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 97,10 % (29. Februar 2020: 90,80 %)			
Luftfahrt und Verteidigung — 1,67 % (29. Februar 2020: 0,53 %)			
65	Raytheon Technologies Corp	3.952	1,17
82	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	1.686	0,50
		5.638	1,67
Banken — 3,79 % (29. Februar 2020: 6,98 %)			
106	Citigroup Inc	5.436	1,61
305	Wells Fargo & Co	7.370	2,18
		12.806	3,79
Biotechnologie — 4,42 % (29. Februar 2020: 4,03 %)			
118	Alexion Pharmaceuticals Inc	13.424	3,97
5	Biogen Inc	1.519	0,45
		14.943	4,42
Computer — 4,80 % (29. Februar 2020: 2,66 %)			
603	DXC Technology Co	12.052	3,56
109	Western Digital Corp	4.177	1,24
		16.229	4,80
Kosmetik und Körperpflege — 1,30 % (29. Februar 2020: 1,18 %)			
GBP 74	Unilever Plc	4.396	1,30
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 4,10 % (29. Februar 2020: 5,30 %)			
70	Charles Schwab Corp/The	2.490	0,74
168	OneMain Holdings Inc	4.873	1,44
262	Synchrony Financial	6.490	1,92
		13.853	4,10
Elektrik — 4,84 % (29. Februar 2020: 4,76 %)			
275	AES Corp/The	4.888	1,45
180	Exelon Corp	6.626	1,96
251	Vistra Corp	4.833	1,43
		16.347	4,84
Unterhaltung — 1,47 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
102	Six Flags Entertainment Corp	2.214	0,65
13	Vail Resorts Inc	2.771	0,82
		4.985	1,47
Lebensmittel — 0,99 % (29. Februar 2020: 2,99 %)			
87	Conagra Brands Inc	3.341	0,99
Medizinische Produkte — 1,35 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
43	Medtronic Plc	4.568	1,35
Medizinische Dienstleistungen — 1,99 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
22	UnitedHealth Group Inc	6.740	1,99
Holdinggesellschaften – Diversifiziert — 0,65 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
222	East Resources Acquisition Co	2.202	0,65
Wohnungsbauunternehmen — 1,07 % (29. Februar 2020: 1,69 %)			
85	Toll Brothers Inc	3.609	1,07
Einrichtungsgegenstände — 2,22 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
95	Sony Corp ADR	7.507	2,22
Industrie — 0,90 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
480	General Electric Co	3.039	0,90
Versicherungen — 6,54 % (29. Februar 2020: 7,86 %)			
413	American International Group Inc	12.034	3,56
475	Equitable Holdings Inc	10.063	2,98
		22.097	6,54
Internet — 15,09 % (29. Februar 2020: 10,61 %)			
20	Alibaba Group Holding Ltd ADR	5.645	1,67
9	Alphabet Inc	13.959	4,13
4	Amazon.com Inc	14.399	4,26
48	Baidu Inc ADR	5.984	1,77
28	Facebook Inc 'A'	8.267	2,44
82	Uber Technologies Inc	2.764	0,82
		51.018	15,09
Unterkunft — 2,48 % (29. Februar 2020: 0,87 %)			
388	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	7.561	2,24
37	MGM Resorts International	833	0,24
		8.394	2,48
Maschinen – diversifiziert — 1,63 % (29. Februar 2020: 1,03 %)			
EUR 65	KION Group AG	5.507	1,63
Medien — 4,78 % (29. Februar 2020: 0,73 %)			
84	Comcast Corp	3.755	1,11
130	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	4.713	1,39
216	ViacomCBS Inc 'B'	6.021	1,78
13	Walt Disney Co/The	1.675	0,50
		16.164	4,78
Bergbau — 3,85 % (29. Februar 2020: 3,80 %)			
98	Newmont Corp	6.595	1,95
CAD 120	Wheaton Precious Metals Corp	6.424	1,90
		13.019	3,85
Öl und Gas — 6,99 % (29. Februar 2020: 4,08 %)			
540	EQT Corp	8.579	2,54
494	Parsley Energy Inc 'A'	5.305	1,57
45	Pioneer Natural Resources Co	4.669	1,38
128	Total SE ADR	5.080	1,50
		23.633	6,99
Pharmazieunternehmen — 4,53 % (29. Februar 2020: 7,29 %)			
117	AbbVie Inc	11.158	3,30
67	CVS Health Corp	4.137	1,23
		15.295	4,53
Pipelines — 1,10 % (29. Februar 2020: 5,39 %)			
199	Kinder Morgan Inc	2.749	0,81
131	Plains GP Holdings LP 'A'	960	0,29
		3.709	1,10
Immobilien — 0,57 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
33	Howard Hughes Corp/The	1.930	0,57
Einzelhandel — 2,86 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
32	Advance Auto Parts Inc	5.072	1,50
84	TJX Cos Inc/The	4.583	1,36
		9.655	2,86
Halbleiter — 1,00 % (29. Februar 2020: 3,44 %)			
16	NXP Semiconductors NV	2.021	0,60
63	ON Semiconductor Corp	1.353	0,40
		3.374	1,00
Software — 8,08 % (29. Februar 2020: 9,36 %)			
84	Microsoft Corp	18.967	5,61
146	Oracle Corp	8.356	2,47
		27.323	8,08
Telekommunikation — 2,04 % (29. Februar 2020: 1,29 %)			
31	Arista Networks Inc	6.897	2,04
Stammaktien insgesamt (Kosten 289.018 USD)		328.218	97,10
Vorzugsaktien — 1,57 % (29. Februar 2020: 1,53 %)			
Automobilhersteller — 1,57 % (29. Februar 2020: 1,53 %)			
EUR 32	Volkswagen AG	5.303	
Vorzugsaktien insgesamt (Kosten 5.421 USD)		5.303	1,57
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 294.439 USD)		333.521	98,67
Devisenterminkontrakte — 0,00 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		2	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		333.523	98,67
Devisenterminkontrakte — 0,00 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			–
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		333.523	98,67
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		4.490	1,33
Gesamtnettovermögen		$338.013	100,00

- Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

ADR – American Depositary Receipt
CAD – Kanadischer Dollar
EUR – Euro
GBP – Britisches Pfund

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,53
Finanzderivate	-
Sonstige Vermögenswerte	2,47
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2020	BNY Mellon	Achatq	USD	–	Verkauf	SGD	–	$ –
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	–	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	2	Verkauf	USD	2	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	287	Verkauf	USD	209	2
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	21	Verkauf	USD	25	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								$ 2
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								-
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								$ 2

Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 98,27 % (29. Februar 2020: 97,55 %)			
Banken — 4,01 % (29. Februar 2020: 7,79 %)			
72	Bank of America Corp	1.841	0,94
51	JPMorgan Chase & Co	5.092	2,60
25	US Bancorp	907	0,47
		7.840	4,01
Getränke — 2,00 % (29. Februar 2020: 2,51 %)			
33	Coca-Cola Co/The	1.632	0,83
16	PepsiCo Inc	2.283	1,17
		3.915	2,00
Biotechnologie — 0,51 % (29. Februar 2020: 0,52 %)			
4	Amgen Inc	996	0,51
Baumaterialien — 0,46 % (29. Februar 2020: 0,84 %)			
7	Vulcan Materials Co	893	0,46
Chemikalien — 5,55 % (29. Februar 2020: 5,35 %)			
12	Air Products & Chemicals Inc	3.524	1,80
10	Ecolab Inc	2.036	1,04
30	PPG Industries Inc	3.655	1,87
2	Sherwin-Williams Co/The	1.642	0,84
		10.857	5,55
Kommerzielle Dienste — 1,29 % (29. Februar 2020: 1,93 %)			
18	Automatic Data Processing Inc	2.525	1,29
Computer — 8,14 % (29. Februar 2020: 5,93 %)			
101	Apple Inc	12.962	6,63
17	Cognizant Technology Solutions Corp	1.161	0,59
15	International Business Machines Corp	1.801	0,92
		15.924	8,14
Kosmetik und Körperpflege — 1,58 % (29. Februar 2020: 1,45 %)			
22	Procter & Gamble Co/The	3.101	1,58
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 4,07 % (29. Februar 2020: 4,52 %)			
8	CME Group Inc	1.453	0,74
31	Visa Inc 'A'	6.513	3,33
		7.966	4,07
Elektrik — 0,67 % (29. Februar 2020: 0,56 %)			
2	NextEra Energy Inc	579	0,30
6	Sempra Energy	722	0,37
		1.301	0,67
Elektronik — 2,06 % (29. Februar 2020: 2,25 %)			
24	Honeywell International Inc	4.040	2,06
Umweltkontrolle — 1,21 % (29. Februar 2020: 1,39 %)			
21	Waste Management Inc	2.360	1,21
Lebensmittel — 0,91 % (29. Februar 2020: 0,78 %)			
31	Mondelez International Inc	1.789	0,91
Gesundheitsprodukte — 3,67 % (29. Februar 2020: 3,44 %)			
28	Medtronic Plc	2.978	1,52
10	Thermo Fisher Scientific Inc	4.199	2,15
		7.177	3,67
Medizinische Dienstleistungen — 2,08 % (29. Februar 2020: 2,18 %)			
13	UnitedHealth Group Inc	4.072	2,08
Wohnungsbauunternehmen — 0,18 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
8	Toll Brothers Inc	355	0,18
Versicherungen — 4,99 % (29. Februar 2020: 5,84 %)			
17	American International Group Inc	496	0,25
–	Berkshire Hathaway Inc	6.549	3,35
23	Travelers Cos Inc/The	2.720	1,39
		9.765	4,99
Internet — 11,05 % (29. Februar 2020: 7,38 %)			
2	Alphabet Inc	3.203	1,64
2	Alphabet Inc 'A'	2.859	1,46
2	Amazon.com Inc	7.880	4,03
22	Facebook Inc 'A'	6.353	3,24
36	Pinterest Inc	1.335	0,68
		21.630	11,05
Eisen/Stahl — 0,23 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
35	ArcelorMittal SA	441	0,23
Medien — 4,51 % (29. Februar 2020: 5,23 %)			
131	Comcast Corp	5.886	3,01
22	Walt Disney Co/The	2.944	1,50
		8.830	4,51
Diverse Fertigung — 0,58 % (29. Februar 2020: 0,89 %)			
7	3M Co	1.144	0,58
Öl und Gas — 2,23 % (29. Februar 2020: 3,47 %)			
25	Chevron Corp	2.125	1,08
33	Exxon Mobil Corp	1.326	0,68
9	Pioneer Natural Resources Co	915	0,47
		4.366	2,23
Verpackung und Container — 0,62 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
15	Ball Corp	1.209	0,62
Pharmazieunternehmen — 7,56 % (29. Februar 2020: 7,32 %)			
4	AbbVie Inc	383	0,20
7	Becton Dickinson and Co	1.782	0,91
15	CVS Health Corp	925	0,47
29	Johnson & Johnson	4.468	2,28
52	Merck & Co Inc	4.394	2,25
75	Pfizer Inc	2.833	1,45
		14.785	7,56
Pipelines — 0,58 % (29. Februar 2020: 0,90 %)			
82	Kinder Morgan Inc	1.138	0,58
Einzelhandel — 6,46 % (29. Februar 2020: 6,91 %)			
19	Home Depot Inc/The	5.521	2,82
50	TJX Cos Inc/The	2.718	1,39
32	Walmart Inc	4.409	2,25
		12.648	6,46
Halbleiter — 1,46 % (29. Februar 2020: 1,18 %)			
5	ASML Holding NV	1.758	0,90
8	Texas Instruments Inc	1.104	0,56
		2.862	1,46
Software — 13,54 % (29. Februar 2020: 11,57 %)			
11	Adobe Inc	5.899	3,02
10	Fidelity National Information Services Inc	1.495	0,76
69	Microsoft Corp	15.491	7,92
9	Oracle Corp	505	0,26
11	salesforce.com Inc	3.101	1,58
		26.491	13,54
Telekommunikation — 3,78 % (29. Februar 2020: 3,91 %)			
4	Arista Networks Inc	958	0,49
64	AT&T Inc	1.920	0,98
17	T-Mobile US Inc	1.959	1,00
43	Verizon Communications Inc	2.566	1,31
		7.403	3,78
Transport — 2,29 % (29. Februar 2020: 1,28 %)			
4	Canadian Pacific Railway Ltd	1.257	0,64
20	United Parcel Service Inc 'B'	3.219	1,65
		4.476	2,29
Stammaktien insgesamt (Kosten 113.556 USD)		192.299	98,27
Immobilieninvestmentgesellschaft — 1,86 % (29. Februar 2020: 1,89 %)			
REITS — 1,86 % (29. Februar 2020: 1,89 %)			
15	American Tower Corp	3.628	1,86
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 1.436 USD)		3.628	1,86
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		195.927	100,13
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		195.927	100,13
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(250)	(0,13)
Gesamtnettovermögen		$195.677	

- Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	99,63
Sonstige Vermögenswerte	0,37
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 96,79 % (29. Februar 2020: 94,48 %)			
Autoteile und Ausrüstung — 1,03 % (29. Februar 2020: 0,28 %)			
228	Aptiv Plc	19.652	1,03
Getränke — 2,34 % (29. Februar 2020: 1,22 %)			
281	Anheuser-Busch InBev SA/ NV ADR	16.358	0,86
338	Monster Beverage Corp	28.311	1,48
		44.669	2,34
Biotechnologie — 4,41 % (29. Februar 2020: 2,41 %)			
210	Alexion Pharmaceuticals Inc	24.006	1,26
181	Amgen Inc	45.727	2,39
187	BioMarin Pharmaceutical Inc	14.550	0,76
		84.283	4,41
Chemikalien — 1,33 % (29. Februar 2020: 2,57 %)			
129	Ecolab Inc	25.487	1,33
Kommerzielle Dienste — 1,55 % (29. Februar 2020: 1,81 %)			
371	IHS Markit Ltd	29.641	1,55
Computer — 5,71 % (29. Februar 2020: 3,69 %)			
848	Apple Inc	109.178	5,71
Distribution und Großhandel — 1,60 % (29. Februar 2020: 1,73 %)			
84	WW Grainger Inc	30.548	1,60
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 5,58 % (29. Februar 2020: 7,97 %)			
240	American Express Co	24.393	1,27
388	Visa Inc 'A'	82.297	4,31
		106.690	5,58
Elektronik — 1,66 % (29. Februar 2020: 1,96 %)			
191	Honeywell International Inc	31.616	1,66
Medizinische Produkte — 3,83 % (29. Februar 2020: 2,45 %)			
359	Alcon Inc	20.565	1,08
123	Thermo Fisher Scientific Inc	52.642	2,75
		73.207	3,83
Medizinische Dienstleistungen — 3,14 % (29. Februar 2020: 3,13 %)			
192	UnitedHealth Group Inc	60.056	3,14
Internet — 21,84 % (29. Februar 2020: 22,81 %)			
138	Alibaba Group Holding Ltd ADR	39.641	2,07
53	Amazon.com Inc	181.656	9,51
12	Booking Holdings Inc	23.536	1,23
416	Facebook Inc 'A'	121.949	6,38
105	Palo Alto Networks Inc	27.050	1,42
697	Uber Technologies Inc	23.432	1,23
		417.264	21,84
Medien — 3,39 % (29. Februar 2020: 4,27 %)			
751	Comcast Corp	33.640	1,76
236	Walt Disney Co/The	31.160	1,63
		64.800	3,39
Pharmazieunternehmen — 2,55 % (29. Februar 2020: 4,52 %)			
305	Zoetis Inc	48.762	2,55
Einzelhandel — 6,28 % (29. Februar 2020: 5,00 %)			
168	Advance Auto Parts Inc	26.307	1,38
87	Costco Wholesale Corp	30.179	1,58
121	Home Depot Inc/The	34.560	1,81
125	Ulta Beauty Inc	28.895	1,51
		119.941	6,28
Halbleiter — 7,04 % (29. Februar 2020: 5,22 %)			
99	NVIDIA Corp	53.063	2,78
112	NXP Semiconductors NV	14.115	0,74
371	QUALCOMM Inc	44.216	2,31
162	Texas Instruments Inc	23.014	1,21
		134.408	7,04
Software — 19,79 % (29. Februar 2020: 19,22 %)			
131	Adobe Inc	67.144	3,52
326	Akamai Technologies Inc	37.903	1,98
207	Fidelity National Information Services Inc	31.176	1,63
457	Microsoft Corp	102.823	5,38
456	Nutanix Inc	13.083	0,69
229	salesforce.com Inc	62.337	3,26
176	Splunk Inc	38.588	2,02
173	VMware Inc	25.002	1,31
		378.056	19,79
Transport — 3,72 % (29. Februar 2020: 2,42 %)			
199	CH Robinson Worldwide Inc	19.529	1,02
315	United Parcel Service Inc 'B'	51.457	2,70
		70.986	3,72
Stammaktien insgesamt (Kosten 1.226.304 USD)		1.849.244	96,79
Immobilieninvestmentgesellschaft — 1,88 % (29. Februar 2020: 1,79 %)			
REITS — 1,88 % (29. Februar 2020: 1,79 %)			
46	Equinix Inc	35.930	1,88
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 20.220 USD)		35.930	1,88
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.246.524 USD)		1.885.174	98,67
Devisenterminkontrakte — 0,05 % (29. Februar 2020: 0,05 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1.042	0,05
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		1.886.216	98,72
Devisenterminkontrakte — (0,05 %) (29. Februar 2020: (0,05 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(1.024)	(0,05)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(1.024)	(0,05)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		1.885.192	98,67
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		25.334	1,33
Gesamtnettovermögen		$1.910.526	100,00

- B eträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,26
Finanzderivate	0,05
Sonstige Vermögenswerte	1,69
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	16.328	Verkauf	BRL	90.524	$ (195)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1.179	Verkauf	EUR	996	(11)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	127	Verkauf	GBP	96	(1)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.843	Verkauf	USD	2.178	20
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	BRL	10.481	Verkauf	USD	1.871	41
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	BRL	80.043	Verkauf	USD	15.393	(784)
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	1	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	1	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	81	Verkauf	USD	109	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	3.337	Verkauf	EUR	2.823	(33)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	57.917	Verkauf	USD	68.371	769
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	148	Verkauf	USD	178	–
01.10.2020	BNY Mellon	Kauf	BRL	108.266	Verkauf	USD	19.531	212
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 749 USD)								$ 1.042
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (778) USD)								(1.042)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (29) USD)								$ 18

Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 99,54 % (29. Februar 2020: 100,45 %)			
Biotechnologie — 21,42 % (29. Februar 2020: 19,82 %)			
73	Amgen Inc	18.592	2,49
204	Biogen Inc	58.774	7,86
75	Guardant Health Inc	7.159	0,96
234	ImmunoGen Inc	868	0,11
422	Ionis Pharmaceuticals Inc	23.008	3,08
76	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	6.502	0,87
162	Vertex Pharmaceuticals Inc	45.218	6,05
		160.121	21,42
Baustoffe — 1,69 % (29. Februar 2020: 1,76 %)			
310	Johnson Controls International plc	12.635	1,69
Computer — 6,02 % (29. Februar 2020: 7,09 %)			
634	Seagate Technology Plc	30.410	4,07
380	Western Digital Corp	14.598	1,95
		45.008	6,02
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 0,29 % (29. Februar 2020: 0,24 %)			
36	Cohen & Steers Inc	2.174	0,29
Elektronik — 4,00 % (29. Februar 2020: 3,80 %)			
309	TE Connectivity Ltd	29.884	4,00
Unterhaltung — 2,93 % (29. Februar 2020: 3,51 %)			
355	Lions Gate Entertainment Corp	3.216	0,43
114	Madison Square Garden Sports Corp	18.710	2,50
		21.926	2,93
Umweltkontrolle — 0,27 % (29. Februar 2020: 0,19 %)			
45	Pentair Plc	2.018	0,27
Medizinische Produkte — 0,68 % (29. Februar 2020: 1,08 %)			
47	Medtronic Plc	5.044	0,68
Gesundheitsdienstleistungen — 4,12 % (29. Februar 2020: 4,28 %)			
99	UnitedHealth Group Inc	30.837	4,12
Einrichtungsgegenstände — 1,08 % (29. Februar 2020: 0,81 %)			
116	Dolby Laboratories Inc 'A'	8.099	1,08
Interne — 6,05 % (29. Februar 2020: 4,54 %)			
7	Facebook Inc 'A'	2.029	0,27
509	FireEye Inc	7.472	1,00
880	Twitter Inc	35.706	4,78
		45.207	6,05
Eisen/Stahl — 0,27 % (29. Februar 2020: 0,74 %)			
44	Nucor Corp	2.017	0,27
Medien — 27,16 % (29. Februar 2020: 24,55 %)			
611	AMC Networks Inc	14.853	1,99
1.554	Comcast Corp	69.663	9,32
1.215	Discovery Inc	26.808	3,58
455	Discovery Inc	9.083	1,21
98	Liberty Broadband Corp	13.481	1,80
110	Liberty Broadband Corp	15.411	2,06
73	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	2.626	0,35
138	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	5.365	0,72
535	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	19.273	2,58
280	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	10.182	1,36
114	Madison Square Garden Entertainment Corp	8.577	1,15
537	MSG Networks Inc	5.235	0,70
39	ViacomCBS Inc 'B'	1.095	0,15
32	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	1.407	0,19
		203.059	27,16
Öl- und Gasdienstleistungen — 1,59 % (29. Februar 2020: 2,85 %)			
295	Core Laboratories NV	6.168	0,82
479	National Oilwell Varco Inc	5.751	0,77
		11.919	1,59
Pharmazieunternehmen — 2,81 % (29. Februar 2020: 3,56 %)			
41	AbbVie Inc	3.886	0,52
191	Agios Pharmaceuticals Inc	7.835	1,05
43	Alkermes Plc	718	0,09
385	Bausch Health Cos Inc	6.404	0,86
184	Voyager Therapeutics Inc	2.172	0,29
		21.015	2,81
Einzelhandel — 0,25 % (29. Februar 2020: 0,12 %)			
168	Qurate Retail Inc	1.859	0,25
Halbleiter — 7,55 % (29. Februar 2020: 7,59 %)			
78	Broadcom Inc	27.107	3,63
402	Cree Inc	25.363	3,39
78	Intel Corp	3.961	0,53
		56.431	7,55
Software — 11,10 % (29. Februar 2020: 11,37 %)			
91	Autodesk Inc	22.254	2,97
247	Cerence Inc	13.163	1,76
141	Citrix Systems Inc	20.534	2,75
904	Nuance Communications Inc	27.076	3,62
		83.027	11,10
Telekommunikation — 0,26 % (29. Februar 2020: 0,55 %)			
24	GCI Liberty Inc	1.974	0,26
Stammaktien insgesamt (Kosten 628.855 USD)		744.254	99,54
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 628.855 USD)		744.254	99,54
Devisenterminkontrakte — 0,06 % (29. Februar 2020: 0,03 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		470	0,06
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		744.724	99,60
Devisenterminkontrakte — 0,00 % (29. Februar 2020: (0,05 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(27)	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(27)	–
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		744.697	99,60
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		2.982	0,40
Gesamtnettovermögen		$747.679	100,00

\- Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	99,17
Finanzderivate	0,06
Sonstige Vermögenswerte	0,77
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	AUD	–	$ –
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	70	Verkauf	USD	92	1
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	6	Verkauf	USD	7	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	–	Verkauf	USD	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	4	Verkauf	USD	3	–
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	156	Verkauf	USD	207	2
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	58	Verkauf	USD	42	1
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	99	Verkauf	USD	131	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	922	Verkauf	AUD	1.284	(26)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	70	Verkauf	CNH	487	(1)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	19	Verkauf	EUR	17	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	10	Verkauf	GBP	8	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	SEK	4	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	76	Verkauf	SGD	103	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	–	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	PLN	3.852	Verkauf	USD	1.030	16
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	235	Verkauf	USD	27	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	2.877	Verkauf	USD	2.098	18
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.608	Verkauf	USD	2.102	48
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	16.759	Verkauf	USD	12.010	350
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CHF	33	Verkauf	USD	36	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CNH	3.726	Verkauf	USD	533	10
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.705	Verkauf	USD	2.012	24
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 314 USD)								$ 470
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (531) USD)								(27)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (217) USD)								$ 443

Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 70,03 % (29. Februar 2020: 71,36 %)			
Luftfahrt und Verteidigung — 1,50 % (29. Februar 2020: 3,41 %)			
9	Raytheon Technologies Corp	573	1,50
Banken — 1,11 % (29. Februar 2020: 1,25 %)			
17	Bank of America Corp	426	1,11
Getränke — 0,78 % (29. Februar 2020: 1,55 %)			
2	PepsiCo Inc	300	0,78
Biotechnologie — 1,45 % (29. Februar 2020: 0,59 %)			
2	Amgen Inc	557	1,45
Chemikalien — 3,17 % (29. Februar 2020: 1,03 %)			
3	Air Products & Chemicals Inc	932	2,43
13	Huntsman Corp	281	0,74
		1.213	3,17
Computer — 8,56 % (29. Februar 2020: 5,61 %)			
25	Apple Inc	3.282	8,56
Kosmetika und Körperpflege — 2,02 % (29. Februar 2020: 1,74 %)			
6	Procter & Gamble Co/The	776	2,02
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 2,18 % (29. Februar 2020: 1,10 %)			
2	CME Group Inc	290	0,76
5	Intercontinental Exchange Inc	545	1,42
		835	2,18
Elektrik — 4,82 % (29. Februar 2020: 5,25 %)			
3	Brookfield Renewable Corporation	165	0,43
13	Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP #	590	1,54
8	Edison International	427	1,11
2	NextEra Energy Inc	667	1,74
		1.849	4,82
Elektrische Komponenten und Zubehör — 0,81 % (29. Februar 2020: 0,81 %)			
4	Emerson Electric Co	310	0,81
Elektronik — 1,21 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
5	TE Connectivity Ltd	463	1,21
Hand- und Maschinenwerkzeuge — 2,25 % (29. Februar 2020: 1,88 %)			
5	Stanley Black & Decker Inc	863	2,25
Haushaltsprodukte und -waren — 1,47 % (29. Februar 2020: 1,30 %)			
4	Kimberly-Clark Corp	561	1,47
Internet — 1,53 % (29. Februar 2020: 1,10 %)			
25	NortonLifeLock Inc	585	1,53
Investmentgesellschaften — 2,57 % (29. Februar 2020: 4,19 %)			
14	Ares Capital Corp	200	0,52
29	Barings BDC Inc	240	0,63
48	TriplePoint Venture Growth BDC Corp	545	1,42
		985	2,57
Maschinen – Diversifiziert — 1,48 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
9	Otis Worldwide Corp	569	1,48
Pharmazieunternehmen — 6,17 % (29. Februar 2020: 5,94 %)			
4	Johnson & Johnson	634	1,66
14	Merck & Co Inc	1.235	3,22
13	Pfizer Inc	495	1,29
		2.364	6,17
Pipelines — 4,16 % (29. Februar 2020: 9,22 %)			
11	Enbridge Inc	341	0,89
38	Kinder Morgan Inc	524	1,37
30	Rattler Midstream LP, MLP #	250	0,65
23	Williams Cos Inc/The	481	1,25
		1.596	4,16
Außerbörsliche Unternehmensbeteiligungen — 3,33 % (29. Februar 2020: 3,34 %)			
6	Apollo Global Management Inc 'A'	279	0,73
15	Blackstone Group Inc/The	771	2,01
9	Carlyle Group Inc/The	226	0,59
		1.276	3,33
Halbleiter — 7,15 % (29. Februar 2020: 7,85 %)			
7	Maxim Integrated Products Inc	450	1,17
5	Microchip Technology Inc	564	1,47
2	NXP Semiconductors NV	190	0,50
8	QUALCOMM Inc	1.007	2,63
4	Texas Instruments Inc	530	1,38
		2.741	7,15
Software — 8,15 % (29. Februar 2020: 7,49 %)			
11	Microsoft Corp	2.476	6,46
7	Oracle Corp	374	0,97
4	Paychex Inc	275	0,72
		3.125	8,15
Telekommunikation — 2,28 % (29. Februar 2020: 4,29 %)			
17	AT&T Inc	521	1,36
6	Verizon Communications Inc	352	0,92
		873	2,28
Transport — 1,88 % (29. Februar 2020: 1,68 %)			
41	KNOT Offshore Partners LP, MLP #	507	1,32
1	United Parcel Service Inc 'B'	213	0,56
		720	1,88
Stammaktien insgesamt (Kosten 19.936 USD)		26.842	70,03
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 1,77 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Fluggesellschaften — 0,62 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
246	American Airlines Group Inc, 6,500%, fällig 01.07.2025	238	0,62
Biotechnologie — 0,61 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
250	Omeros Corp, 5,250%, fällig 15.02.2026	233	0,61
Freizeit — 0,54 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
170	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250%, fällig 15.06.2023	207	0,54
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 676 USD)		678	1,77
Vorzugsaktien — 15,58 % (29. Februar 2020: 6,14 %)			
Autoteile und Ausrüstung — 1,02 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
4	Aptiv Plc, Series A	391	1,02
Elektrik — 3,01 % (29. Februar 2020: 1,81 %)			
11	DTE Energy Co	491	1,28
6	Sempra Energy, Series B	660	1,73
		1.151	3,01
Medizinische Produkte — 3,03 % (29. Februar 2020: 1,21 %)			
3	Boston Scientific Corp, Series A	309	0,81
–	Danaher Corp, Series A	638	1,66
–	Danaher Corp, Series B	215	0,56
		1.162	3,03
Pharmaziewerte — 1,19 % (29. Februar 2020: 0,77 %)			
4	Becton Dickinson and Co, Series B	190	0,50
6	Elanco Animal Health Inc	264	0,69
		454	1,19
Außerbörsliche Unternehmensbeteiligungen — 2,14 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
15	KKR & Co Inc, Series C	821	2,14
Halbleiter — 5,19 % (29. Februar 2020: 2,35 %)			
2	Broadcom Inc, Series A	1.990	5,19
Vorzugsaktien insgesamt (Kosten 5.093 USD)		5.969	15,58
Immobilieninvestmentgesellschaften — 11,92 % (29. Februar 2020: 19,16 %)			
REITS — 11,92 % (29. Februar 2020: 19,16 %)			
29	AGNC Investment Corp	411	1,07
4	Alexandria Real Estate Equities Inc	699	1,82
3	American Tower Corp	762	1,99
11	Apartment Investment and Management Co	384	1,00
1	AvalonBay Communities Inc	216	0,56
1	Boston Properties Inc	76	0,20
4	Crown Castle International Corp	666	1,74
1	Equinix Inc	777	2,03
3	Equity LifeStyle Properties Inc	188	0,49
3	Equity Residential	188	0,49
2	Prologis Inc	202	0,53
		4.569	11,92
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 3.806 USD)		4.569	11,92
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 29.511 USD)		38.058	99,30
Devisenterminkontrakte — 0,16 % (29. Februar 2020: 0,03 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		63	0,16
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		38.121	99,46
Devisenterminkontrakte — 0,00 % (29. Februar 2020: (0,18 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(2)	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(2)	–
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		38.119	99,46
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		208	0,54
Gesamtnettovermögen		$38.327	100,00

- Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 207.000 USD und machten 0,54 % des Nettovermögens aus.

Master Limited Partnership.

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,89
Finanzderivate	0,16
Sonstige Vermögenswerte	0,95
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	6	Verkauf	AUD	7	$	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	CNH	3		–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	181	Verkauf	EUR	153		(2)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	9	Verkauf	SGD	12		–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	6	Verkauf	USD	5		–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	186	Verkauf	USD	135		1
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.431	Verkauf	USD	1.689		19
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CNH	587	Verkauf	USD	84		2
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	2.019	Verkauf	USD	1.449		41
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 12 USD)								$	63
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (71) USD) (2)									(2)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (59) USD)								$	61

Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 90,49 % (29. Februar 2020: 94,73 %)			
Bekleidung — 2,19 % (29. Februar 2020: 2,36 %)			
41	NIKE Inc	4.597	2,19
Autoteile und Ausrüstung — 1,42 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
35	Aptiv Plc	2.978	1,42
Banken — 3,23 % (29. Februar 2020: 5,91 %)			
147	Bank of America Corp	3.784	1,81
26	First Republic Bank/CA	2.980	1,42
		6.764	3,23
Biotechnologie — 4,38 % (29. Februar 2020: 3,56 %)			
15	Amgen Inc	3.722	1,77
34	BioMarin Pharmaceutical Inc	2.682	1,28
42	Gilead Sciences Inc	2.783	1,33
		9.187	4,38
Baustoffe — 2,15 % (29. Februar 2020: 1,83 %)			
30	Trex Co Inc	4.514	2,15
Chemikalien — 1,64 % (29. Februar 2020: 2,18 %)			
17	Ecolab Inc	3.428	1,64
Kommerzielle Dienste — 1,21 % (29. Februar 2020: 1,90 %)			
18	Automatic Data Processing Inc	2.544	1,21
Computer — 6,73 % (29. Februar 2020: 5,58 %)			
110	Apple Inc	14.119	6,73
Kosmetika und Körperpflege — 1,81 % (29. Februar 2020: 3,99 %)			
66	Unilever NV	3.799	1,81
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 4,41 % (29. Februar 2020: 5,74 %)			
5	BlackRock Inc	3.149	1,50
66	Charles Schwab Corp/The	2.330	1,11
18	Visa Inc 'A'	3.773	1,80
		9.252	4,41
Elektrik — 4,18 % (29. Februar 2020: 4,91 %)			
14	Brookfield Renewable Corporation	734	0,35
57	Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP #	2.579	1,23
12	NextEra Energy Inc	3.432	1,64
33	Ormat Technologies Inc	2.009	0,96
		8.754	4,18
Elektronik — 2,99 % (29. Februar 2020: 1,55 %)			
27	Keysight Technologies Inc	2.640	1,26
38	TE Connectivity Ltd	3.621	1,73
		6.261	2,99
Energie – Alternative Quellen — 5,03 % (29. Februar 2020: 3,87 %)			
31	Enphase Energy Inc	2.395	1,14
19	SolarEdge Technologies Inc	4.208	2,01
78	Vestas Wind Systems A/S ADR	3.949	1,88
		10.552	5,03
Unterhaltung — 1,00 % (29. Februar 2020: 1,11 %)			
10	Vail Resorts Inc	2.090	1,00
Lebensmittel — 1,62 % (29. Februar 2020: 1,49 %)			
104	Hain Celestial Group Inc/The	3.393	1,62
Hand- und Maschinenwerkzeuge — 1,43 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
30	Regal Beloit Corp	2.996	1,43
Gesundheitsprodukte — 2,55 % (29. Februar 2020: 2,45 %)			
26	Danaher Corp	5.344	2,55
Medizinische Dienstleistungen — 2,06 % (29. Februar 2020: 1,59 %)			
14	UnitedHealth Group Inc	4.313	2,06
Versicherungen — 3,88 % (29. Februar 2020: 4,60 %)			
75	Hartford Financial Services Group Inc/The	3.050	1,45
54	Progressive Corp/The	5.090	2,43
		8.140	3,88
Internet — 4,30 % (29. Februar 2020: 2,97 %)			
4	Alphabet Inc 'A'	5.861	2,80
2	Booking Holdings Inc	3.151	1,50
		9.012	4,30
Maschinen – diversifiziert — 1,33 % (29. Februar 2020: 2,78 %)			
12	Rockwell Automation Inc	2.789	1,33
Medien — 3,63 % (29. Februar 2020: 3,98 %)			
86	Comcast Corp	3.872	1,85
28	Walt Disney Co/The	3.744	1,78
		7.616	3,63
Diverse Fertigung — 1,85 % (29. Februar 2020: 2,13 %)			
33	Trane Technologies Plc	3.883	1,85
Büroausstattung — 0,95 % (29. Februar 2020: 1,41 %)			
84	Herman Miller Inc	1.991	0,95
Verpackung und Behälter — 2,45 % (29. Februar 2020: 1,92 %)			
64	Ball Corp	5.133	2,45
Pharmazieunternehmen — 1,63 % (29. Februar 2020: 4,34 %)			
14	Becton Dickinson and Co	3.423	1,63
Einzelhandel — 5,32 % (29. Februar 2020: 7,38 %)			
17	Costco Wholesale Corp	5.942	2,83
18	Home Depot Inc/The	5.210	2,49
		11.152	5,32
Halbleiter — 1,89 % (29. Februar 2020: 2,25 %)			
12	Lam Research Corp	3.968	1,89
Software — 10,32 % (29. Februar 2020: 7,22 %)			
13	Autodesk Inc	3.120	1,49
65	Microsoft Corp	14.540	6,93
18	Synopsys Inc	3.985	1,90
		21.645	10,32
Telekommunikation — 1,41 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
25	T-Mobile US Inc	2.964	1,41
Spielzeug, Spiele und Hobbys — 1,50 % (29. Februar 2020: 0,49 %)			
40	Hasbro Inc	3.141	1,50
Stammaktien insgesamt (Kosten 166.445 USD)		189.742	90,49
Immobilieninvestmentgesellschaften — 2,19 % (29. Februar 2020: 2,31 %)			
REITS — 2,19 % (29. Februar 2020: 2,31 %)			
6	Equinix Inc	4.578	2,19
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 3.836 USD)		4.578	2,19
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 170.281 USD)		194.320	92,68
Devisenterminkontrakte — 0,46 % (29. Februar 2020: 0,02 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		960	0,46
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		195.280	93,14
Devisenterminkontrakte — (0,01 %) (29. Februar 2020: (0,07 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(13)	(0,01)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(13)	(0,01)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		195.267	93,13
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		14.410	6,87
Gesamtnettovermögen		209.677	100,00

\- Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

\# Master Limited Partnership.

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,49
Finanzderivate	0,46
Sonstige Vermögenswerte	7,05
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	526	Verauf	GBP	399	$	(7)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verauf	SEK	18		–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	2	Verauf	USD	2		–
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	243	Verauf	GBP	184		(3)
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verauf	GBP	–		–
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	2	Verauf	USD	4		–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	113	Verauf	GBP	84		–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verauf	GBP	–		–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	45	Verauf	USD	61		–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	208	Verauf	GBP	158		(3)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	33,787	Verauf	USD	44,216		953
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	560	Verauf	USD	661		7
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 10 USD)								$	960
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (34) USD)									(13)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 947 USD)								$	947

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 98,88 % (29. Februar 2020: 95,33 %)				
Australien — 2,12 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
AUD	3	Ansell Ltd	87	0,89
AUD	15	Brambles Ltd	122	1,23
			209	2,12
Brasilien — 1,76 % (29. Februar 2020: 2,39 %)				
	2	StoneCo Ltd 'A'	120	1,22
	1	XP Inc 'A'	53	0,54
			173	1,76
Kanada — 2,73 % (29. Februar 2020: 2,57 %)				
CAD				
	-	Constellation Software Inc/ Canada	145	1,47
CAD	2	Thomson Reuters Corp	124	1,26
			269	2,73
China — 5,39 % (29. Februar 2020: 3,74 %)				
	1	Alibaba Group Holding Ltd ADR	259	2,64
	3	Tencent Holdings Ltd ADR	198	2,01
	1	Zai Lab Ltd ADR	73	0,74
			530	5,39
Dänemark — 0,57 % (29. Februar 2020: 1,09 %)				
	1	Novo Nordisk A/S ADR	56	0,57
Frankreich — 1,91 % (29. Februar 2020: 4,89 %)				
	4	Legrand SA ADR	69	0,71
EUR	–	L'Oreal SA	118	1,20
			187	1,91
Deutschland — 4,46 % (29. Februar 2020: 2,44 %)				
	1	adidas AG ADR	116	1,18
EUR	1	Deutsche Boerse AG	96	0,98
	3	MorphoSys AG ADR	97	0,99
EUR	2	TeamViewer AG, 144A	129	1,31
			438	4,46
Hongkong — 1,64 % (29. Februar 2020: 2,02 %)				
HKD	16	AIA Group Ltd	161	1,64
Japan — 4,98 % (29. Februar 2020: 5,64 %)				
JPY	1	Daiichi Sankyo Co Ltd	95	0,97
JPY	–	Nintendo Co Ltd	247	2,51
JPY	1	Shiseido Co Ltd	71	0,72
JPY	–	Tokyo Electron Ltd	77	0,78
			490	4,98
Niederlande — 3,37 % (29. Februar 2020: 2,13 %)				
EUR	–	Adyen NV, 144A	152	1,54
EUR	–	ASML Holding NV	94	0,95
EUR	1	Just Eat Takeaway.com NV, 144A	86	0,88
			332	3,37
Portugal — 1,11 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
	2	EDP – Energias de Portugal SA ADR	109	1,11
Südkorea — 0,95 % (29. Februar 2020: 0,85 %)				
KRW	2	Samsung Electronics Co Ltd	94	0,95
Spanien — 1,26 % (29. Februar 2020: 0,82 %)				
EUR	2	Amadeus IT Group SA	124	1,26
Schweiz — 5,71 % (29. Februar 2020: 6,87 %)				
CHF	–	Nestle SA	40	0,41
	1	Nestle SA ADR	137	1,40
	2	Novartis AG ADR	131	1,33
CHF	1	Roche Holding AG	194	1,97
	–	Temenos AG ADR	59	0,60
			561	5,71
Taiwan — 1,28 % (29. Februar 2020: 1,29 %)				
	2	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	126	1,28
Großbritannien — 4,46 % (29. Februar 2020: 4,33 %)				
GBP	3	Burberry Group Plc	66	0,68
	–	Diageo Plc ADR	59	0,60
GBP	1	London Stock Exchange Group Plc	174	1,77
GBP	1	Ocado Group Plc	49	0,50
GBP	13	Rentokil Initial Plc	90	0,91
			438	4,46
USA — 55,18 % (29. Februar 2020: 49,73 %)				
	1	Alexion Pharmaceuticals Inc	84	0,86
	–	Alphabet Inc 'A'	174	1,77
	–	Amazon.com Inc	362	3,68
	4	Apple Inc	485	4,93
	–	Arista Networks Inc	91	0,92
	1	Atlassian Corp Plc	111	1,13
	3	Avantor Inc	77	0,78
	2	Chewy Inc	123	1,25
	1	Coca-Cola Co/The	63	0,64
	3	Comcast Corp	116	1,17
	–	DexCom Inc	47	0,48
	1	Ecolab Inc	212	2,16
	1	Elastic NV	142	1,45
	1	Fidelity National Information Services Inc	157	1,60
	1	Guardant Health Inc	100	1,02
	4	Hain Celestial Group Inc/The	130	1,32
	1	IHS Markit Ltd	80	0,81
	1	JPMorgan Chase & Co	57	0,58
	–	Lennox International Inc	114	1,16
	1	Merck & Co Inc	112	1,14
	2	Microsoft Corp	373	3,80
	–	NextEra Energy Inc	120	1,22
	–	NVIDIA Corp	157	1,59
	–	Palo Alto Networks Inc	48	0,49
	2	Procter & Gamble Co/The	243	2,47
	–	S&P Global Inc	178	1,81
	1	salesforce.com Inc	302	3,07
	–	SolarEdge Technologies Inc	100	1,01
	1	Spotify Technology SA	151	1,53
	1	TE Connectivity Ltd	73	0,75
	–	Thermo Fisher Scientific Inc	85	0,86
	2	TJX Cos Inc/The	110	1,11
	2	T-Mobile US Inc	195	1,98
	2	Trex Co Inc	263	2,68
	–	Ulta Beauty Inc	104	1,06
	–	Workday Inc 'A'	88	0,90
			5.427	55,18
Stammaktien insgesamt (Kosten 7.455 USD)			9.724	98,88
Immobilieninvestmentgesellschaften — 0,93 % (29. Februar 2020: 0,85 %)				
USA — 0,93 % (29. Februar 2020: 0,85 %)				
	–	Equinix Inc	92	0,93
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 55 USD)			92	0,93
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 7.510 USD)			9.816	99,81
Devisenterminkontrakte — 0,01 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			1	0,01
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			9.817	99,82
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt			9.817	99,82
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			18	0,18
Gesamtnettovermögen			$9.835	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 367,000 USD und machten 3.73 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

ADR	–	American Depositary Receipt
AUD	–	Australischer Dollar
CAD	–	Kanadischer Dollar
CHF	–	Schweizer Franke
EUR	–	Euro
GBP	–	Britisches Pfund
HKD	–	Hongkong-Dollar
JPY	–	Japanischer Yen
KRW	–	Südkoreanischer Won

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	99,10
Finanzderivate	-
Sonstige Vermögenswerte	0,90
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
01.09.2020	Goldman Sachs	Kauf	GBP	37	Verkauf	USD	49	$	1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								$	1
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)									-
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								$	1

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) €	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 91,74 % (29. Februar 2020: 94,17 %)				
Australien — 8,69 % (29. Februar 2020: 5,35 %)				
AUD	3.306	Atlas Arteria Ltd	13.281	2,01
AUD	4.114	Sydney Airport	14.470	2,19
AUD	3.590	Transurban Group	29.750	4,49
			57.501	8,69
Kanada — 2,04 % (29. Februar 2020: 11,89 %)				
CAD	396	Emera Inc	13.539	2,04
Dänemark — 3,36 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
DKK	187	Orsted A/S, 144A	22.238	3,36
Frankreich — 10,30 % (29. Februar 2020: 5,92 %)				
	191	Aeroports de Paris	16.796	2,54
	1.950	Getlink SE	25.007	3,78
	335	Vinci SA	26.329	3,98
			68.132	10,30
Italien — 9,49 % (29. Februar 2020: 6,04 %)				
	1.758	Atlantia SpA	23.336	3,53
	3.118	Snam SpA	13.375	2,02
	4.299	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	26.067	3,94
			62.778	9,49
Nouvelle-Zélande — 0,38 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
NZD	671	Auckland International Airport Ltd	2.515	0,38
Portugal — 2,01 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
	3.124	EDP – Energias de Portugal SA	13.306	2,01
Spanien — 6,51 % (29. Februar 2020: 8,07 %)				
	115	Aena SME SA, 144A	14.449	2,18
	691	Ferrovial SA	15.467	2,34
	820	Red Electrica Corp SA	13.144	1,99
			43.060	6,51
Großbritannien — 5,57 % (29. Februar 2020: 13,92 %)				
GBP	1.019	Severn Trent Plc	26.498	4,01
GBP	732	SSE Plc	10.343	1,56
			36.841	5,57
USA — 43,39 % (29. Februar 2020: 38,59 %)				
USD	315	American Electric Power Co Inc	20.809	3,14
USD	527	Brookfield Renewable Corporation	22.489	3,40
USD	608	Cheniere Energy Inc	26.546	4,01
USD	610	Clearway Energy Inc 'C'	13.030	1,97
USD	352	CMS Energy Corp	17.838	2,70
USD	553	Edison International	24.316	3,68
USD	319	Essential Utilities Inc	11.368	1,72
USD	452	Exelon Corp	13.973	2,11
USD	108	NextEra Energy Inc	25.150	3,80
USD	310	NextEra Energy Partners LP	15.669	2,37
USD	194	Pinnacle West Capital Corp	11.894	1,80
USD	487	Public Service Enterprise Group Inc	21.304	3,22
USD	308	Sempra Energy	31.879	4,82
USD	191	Union Pacific Corp	30.782	4,65
			287.047	43,39
Stammaktien insgesamt (Kosten 649.836 EUR)			606.957	91,74
Immobilieninvestmentgesellschaften — 6,93 % (29. Februar 2020: 2,82 %)				
USA — 6,93 % (29. Februar 2020: 2,82 %)				
USD	117	American Tower Corp	24.493	3,70
USD	156	Crown Castle International Corp	21.363	3,23
			45.856	6,93
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 44.844 EUR)			45.856	6,93
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 694,680 EUR)			652.813	98,67
Devisenterminkontrakte — 0,15 % (29. Februar 2020: 0,16 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			1.011	0,15
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			653.824	98,82
Devisenterminkontrakte — (0,25 %) (29. Februar 2020: (0,48 %))				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(1.655)	(0,25)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			(1.655)	(0,25)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt			652.169	98,57
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			9.431	1,43
Gesamtnettovermögen			€ 661.600	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 367.000 USD o el 3,73 % del patrimonio neto.

ABKÜRZUNGEN:

AUD – Australischer Dollar
CAD – Kanadischer Dollar
DKK – Dänische Krone
GBP – Britisches Pfund
NZD – Neuseeländischer Dollar
USD – US-Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,89
Finanzderivate	0,15
Sonstige Vermögenswerte	1,96
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.034	Verkauf	BRL	19.816	€ 3
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	BRL	19.816	Verkauf	EUR	3.255	(224)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CNH	85	Verkauf	EUR	10	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	6	Verkauf	EUR	7	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	82	Verkauf	EUR	70	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	GBP	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	63	Verkauf	USD	75	1
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	31	Verkauf	EUR	34	–
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	EUR	–	–
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	GBP	–	–
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.733	Verkauf	GBP	1.551	(5)
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	EUR	–	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	7	Verkauf	GBP	6	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	AUD	–	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	AUD	2	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	49	Verkauf	CNH	400	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	89	Verkauf	CNH	727	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.374	Verkauf	EUR	851	(3)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	5.204	Verkauf	EUR	5.766	63
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	5	Verkauf	EUR	3	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	124.461	Verkauf	EUR	105.476	(1.217)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	105	Verkauf	EUR	87	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	611	Verkauf	EUR	371	6
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CNH	23.721	Verkauf	EUR	2.877	21
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	8	Verkauf	SGD	12	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	7.320	Verkauf	USD	8.667	59
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	202	Verkauf	USD	241	–
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	4.954	Verkauf	AUD	5.221	(44)
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.318	Verkauf	AUD	5.467	(61)
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	5.501	Verkauf	AUD	10.102	(81)
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	210	Verkauf	AUD	381	–
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	59	Verkauf	CAD	104	–
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	822	Verkauf	CAD	1.286	(4)

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.365	Verkauf	CAD	2.379	€ 1
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	65	Verkauf	EUR	73	–
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	750	Verkauf	EUR	482	–
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	17.704	Verkauf	EUR	11.322	47
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	20.387	Verkauf	EUR	22.722	107
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	3.409	Verkauf	GBP	1.956	(1)
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.280	Verkauf	GBP	2.046	(11)
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CAD	30.284	Verkauf	USD	22.990	192
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	20.251	Verkauf	USD	24.045	112
23.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	33.630	Verkauf	USD	44.486	399
01.10.2020	BNY Mellon	Kauf	BRL	19.652	Verkauf	EUR	3.004	(4)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 1.208 EUR)								€ 1.011
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (3.700) EUR)								(1.655)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): (2.492) EUR)								€ (644)

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 90,66 % (29. Februar 2020: 89,94 %)				
Brasilien — 10,02 % (29. Februar 2020: 16,08 %)				
BRL	20	CCR SA	48	2,04
BRL	5	CPFL Energia SA	26	1,10
BRL	11	EcoRodovias Infraestrutura e Logistica SA	27	1,12
BRL	12	Equatorial Energia SA	50	2,08
BRL	10	Neoenergia SA	33	1,39
BRL	11	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA	55	2,29
			239	10,02
Chile — 1,92 % (29. Februar 2020: 1,96 %)				
CLP	153	Aguas Andinas SA	46	1,92
China — 24,39 % (29. Februar 2020: 17,70 %)				
HKD	148	China Everbright International Ltd	89	3,73
HKD	35	China Gas Holdings Ltd	95	4,00
HKD	49	China Merchants Port Holdings Co Ltd	56	2,36
HKD	9	ENN Energy Holdings Ltd	94	3,96
HKD	56	Guangdong Investment Ltd	88	3,68
HKD	38	Jiangsu Expressway Co Ltd	38	1,61
CNY	7	Shanghai International Airport Co Ltd	75	3,14
HKD	50	Shenzhen Expressway Co Ltd	45	1,91
			580	24,39
Indien — 24,34 % (29. Februar 2020: 26,47 %)				
INR	9	Bharti Infratel Ltd	26	1,07
INR	17	Container Corp Of India Ltd	92	3,87
INR	22	Gujarat Gas Ltd	98	4,12
INR	21	Gujarat State Petronet Ltd	57	2,41
INR	22	Indraprastha Gas Ltd	117	4,93
INR	4	Mahanagar Gas Ltd	55	2,30
INR	8	Petronet LNG Ltd	27	1,14
INR	44	Power Grid Corp of India Ltd	107	4,50
			579	24,34
Indonesien — 4,05 % (29. Februar 2020: 4,42 %)				
IDR	358	Jasa Marga Persero Tbk PT	96	4,05
Malaysia — 5,18 % (29. Februar 2020: 2,56 %)				
MYR	62	Malaysia Airports Holdings Bhd	76	3,19
MYR	18	Tenaga Nasional Bhd	47	1,99
			123	5,18
Mexiko — 11,98 % (29. Februar 2020: 14,48 %)				
MXN	28	ALEATICA SAB de CV	24	1,02
MXN	38	GMexico Transportes SAB de CV, 144A	49	2,06
MXN	7	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV 'B'	32	1,32
MXN	6	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	47	2,00
MXN	17	Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	50	2,09
MXN	109	Telesites SAB de CV	83	3,49
			285	11,98
Philippinen — 5,50 % (29. Februar 2020: 4,55 %)				
PHP	37	International Container Terminal Services Inc	79	3,34
PHP	744	Metro Pacific Investments Corp	52	2,16
			131	5,50
Thailand — 3,28 % (29. Februar 2020: 1,23 %)				
THB	7	Electricity Generating PCL	49	2,05
THB	16	Ratch Group PCL	29	1,23
			78	3,28
Stammaktien insgesamt (Kosten 2.633 USD)			2.157	90,66
Immobilieninvestmentgesellschaften — 4,15 % (29. Februar 2020: 4,16 %)				
Mexiko — 4,15 % (29. Februar 2020: 4,16 %)				
MXN	88	CFE Capital S de RL de CV	99	4,15
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten $80)			99	4,15
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 2.713 USD)			2.256	94,81
Devisenterminkontrakte — 0,68 % (29. Februar 2020: 0,42 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			16	0,68
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			2.272	95,49
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt			2.272	95,49
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			107	4,51
Gesamtnettovermögen			2.379	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 367,000 USD und machten 3.73 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

BRL	–	Brasilianischer Real
CLP	–	Chilenischer Peso
CNY	–	Chinesischer Renminbi
HKD	–	Hongkong-Dollar
IDR	–	Indonesische Rupiah
INR	–	Indische Rupie
MXN	–	Mexikanischer Peso
MYR	–	Malaysischer Ringgit
PHP	–	Philippinischer Peso
THB	–	Thailändischer Baht

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,57
Finanzderivate	0,66
Sonstige Vermögenswerte	6,77
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.204	Verkauf	USD	1.421	$	16
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 12 USD)								$	16
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (2) USD)									-
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 10 USD)								$	16

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Kollektive Kapitalanlagen — 2,93 % (29. Februar 2020: 4,68 %)			
12.833	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (Distribution)	12.833	2,93
Kollektive Kapitalanlagen insgesamt (Kosten 12.833 USD)		12.833	2,93
Stammaktien — 96,03 % (29. Februar 2020: 94,48 %)			
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung — 1,31 % (29. Februar 2020: 0,98 %)			
57	AAR Corp	1.148	0,26
108	Astronics Corp	977	0,22
32	Ducommun Inc	1.181	0,27
26	Hexcel Corp	1.026	0,24
35	Spirit AeroSystems Holdings Inc ‘A’	709	0,16
97	Triumph Group Inc	704	0,16
		5.745	1,31
Landwirtschaft — 0,30 % (29. Februar 2020: 0,35 %)			
91	Tejon Ranch Co	1.301	0,30
Fluggesellschaften — 2,03 % (29. Februar 2020: 0,39 %)			
55	Alaska Air Group Inc	2.152	0,49
23	Allegiant Travel Co ‘A’	3.013	0,69
236	JetBlue Airways Corp	2.715	0,62
273	Mesa Air Group Inc	1.001	0,23
		8.881	2,03
Bekleidung — 0,61 % (29. Februar 2020: 0,65 %)			
46	Jerash Holdings US Inc	224	0,05
48	Tapestry Inc	703	0,16
35	Under Armour Inc ‘A’	345	0,08
116	Unifi Inc	1.416	0,32
		2.688	0,61
Automobilhersteller — 0,39 % (29. Februar 2020: 0,09 %)			
141	Wabash National Corp	1.727	0,39
Kfz-Teile und Zubehör — 2,36 % (29. Februar 2020: 2,28 %)			
272	Commercial Vehicle Group Inc	1.222	0,28
38	Cooper Tire & Rubber Co	1.305	0,30
56	Meritor Inc	1.268	0,29
276	Modine Manufacturing Co	1.870	0,43
126	Shyft Group Inc/The	2.515	0,57
1.271	Westport Fuel Systems Inc	2.168	0,49
		10.348	2,36
Banken — 2,48 % (29. Februar 2020: 5,21 %)			
20	FB Financial Corp	531	0,12
77	First Foundation Inc	1.169	0,27
141	Hilltop Holdings Inc	2.912	0,66
30	Seacoast Banking Corp of Florida	610	0,14
17	South State Corp	946	0,21
78	TriState Capital Holdings Inc	1.081	0,25
66	Walker & Dunlop Inc	3.620	0,83
		10.869	2,48
Getränke — 0,55 % (29. Februar 2020: 0,47 %)			
38	Eastside Distilling Inc	51	0,01
53	MGP Ingredients Inc	1.877	0,43
455	Reed’s Inc	462	0,11
		2.390	0,55
Biotechnologie — 0,72 % (29. Februar 2020: 1,08 %)			
28	Emergent BioSolutions Inc	3.167	0,72
Baumaterialien — 5,72 % (29. Februar 2020: 3,88 %)			
36	American Woodmark Corp	3.165	0,72
26	Boise Cascade Co	1.196	0,27
35	Builders FirstSource Inc	1.077	0,25
291	Forterra Inc	3.858	0,88
27	Gibraltar Industries Inc	1.711	0,39
99	Griffon Corp	2.140	0,49
77	JELD-WEN Holding Inc	1.623	0,37
57	Louisiana-Pacific Corp	1.871	0,43
236	LSI Industries Inc	1.618	0,37
26	Patrick Industries Inc	1.450	0,33
125	PGT Innovations Inc	2.274	0,52
115	US Concrete Inc	3.074	0,70
		25.057	5,72
Chemikalien — 2,38 % (29. Februar 2020: 1,67 %)			
57	American Vanguard Corp	804	0,18
148	Ferro Corp	1.848	0,42
126	Huntsman Corp	2.720	0,62
44	Intrepid Potash Inc	414	0,10
166	Kraton Corp	2.329	0,53
205	Olin Corp	2.301	0,53
		10.416	2,38
Gewerbliche Dienstleistungen — 3,26 % (29. Februar 2020: 4,40 %)			
40	ABM Industries Inc	1.530	0,35
397	Cross Country Healthcare Inc	2.542	0,58
148	GP Strategies Corp	1.439	0,33
98	Herc Holdings Inc	4.028	0,92
298	R1 RCM Inc	4.315	0,98
25	TrueBlue Inc	425	0,10
		14.279	3,26
Computer — 1,21 % (29. Februar 2020: 1,16 %)			
203	3D Systems Corp	1.117	0,26
11	Cubic Corp	499	0,12
20	NCR Corp	404	0,09
51	Perspecta Inc	1.064	0,24
170	SecureWorks Corp	2.194	0,50
		5.278	1,21
Distribution und Großhandel — 0,20 % (29. Februar 2020: 0,18 %)			
195	Manitex International Inc	885	0,20
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 3,45 % (29. Februar 2020: 2,14 %)			
131	Air Lease Corp ‘A’	4.082	0,93
144	B Riley Financial Inc	3.852	0,88
46	Evercore Inc ‘A’	2.865	0,65
27	Houlihan Lokey Inc ‘A’	1.553	0,36
86	Moelis & Co ‘A’	2.754	0,63
		15.106	3,45
Elektrik — 0,95 % (29. Februar 2020: 1,04 %)			
121	Ameresco Inc	4.142	0,95
Elektrische Komponenten und Zubehör — 1,02 % (29. Februar 2020: 1,41 %)			
33	Encore Wire Corp	1.714	0,39
7	Generac Holdings Inc	1.339	0,30
78	Insteel Industries Inc	1.433	0,33
		4.486	1,02
Elektronik — 2,99 % (29. Februar 2020: 4,49 %)			
38	Advanced Energy Industries Inc	2.811	0,64
114	Comtech Telecommunications Corp	1.899	0,43
35	Identiv Inc	214	0,05
72	II-VI Inc	3.197	0,73
190	IntriCon Corp	2.312	0,53
55	Stoneridge Inc	1.115	0,26
95	Vishay Intertechnology Inc	1.525	0,35
		13.073	2,99
Energie – Alternative Quellen — 0,07 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
2	Maxeon Solar Technologies Ltd	43	0,01
23	SunPower Corp	253	0,06
		296	0,07
Technik und Bau — 3,05 % (29. Februar 2020: 3,21 %)			
59	Aegion Corp ‘A’	954	0,22
76	Arcosa Inc	3.523	0,80
180	Concrete Pumping Holdings Inc	655	0,15
127	Construction Partners Inc ‘A’	2.366	0,54
60	frontdoor Inc	2.603	0,59
33	Great Lakes Dredge & Dock Corp	310	0,07
225	Iteris Inc	1.032	0,24
268	Mistras Group Inc	1.273	0,29
34	Primoris Services Corp	641	0,15
		13.357	3,05
Umweltkontrolle — 0,58 % (29. Februar 2020: 0,31 %)			
68	CECO Environmental Corp	577	0,13
141	Covanta Holding Corp	1.328	0,30
66	Pure Cycle Corp	641	0,15
		2.546	0,58
Lebensmittel — 0,91 % (29. Februar 2020: 0,28 %)			
102	Chefs’ Warehouse Inc/The	1.517	0,35
58	Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	683	0,15
265	SunOpta Inc	1.802	0,41
		4.002	0,91
Waldprodukte und Papier — 0,41 % (29. Februar 2020: 0,37 %)			
120	P H Glatfelter Co	1.793	0,41
Gesundheitsprodukte — 4,22 % (29. Februar 2020: 4,93 %)			
469	Accuray Inc	1.095	0,25
165	Alphatec Holdings Inc	989	0,23
67	AngioDynamics Inc	623	0,14
60	BioTelemetry Inc	2.378	0,54
77	CareDx Inc	2.641	0,60
8	Cutera Inc	126	0,03
341	Invacare Corp	2.318	0,53
82	Orthofix Medical Inc	2.504	0,57
123	RA Medical Systems Inc	42	0,01
99	Sientra Inc	379	0,09
236	SmileDirectClub Inc	1.916	0,44
379	Surgalign Holdings Inc	844	0,19
111	Varex Imaging Corp	1.231	0,28
504	ViewRay Inc	1.379	0,32
		18.465	4,22
Medizinische Dienstleistungen — 3,07 % (29. Februar 2020: 3,73 %)			
67	Acadia Healthcare Co Inc	2.084	0,48
759	Community Health Systems Inc	3.922	0,89
54	RadNet Inc	781	0,18
118	Select Medical Holdings Corp	2.358	0,54
226	Surgery Partners Inc	4.307	0,98
		13.452	3,07
Wohnungsbauunternehmen — 6,07 % (29. Februar 2020: 3,84 %)			
242	Beazer Homes USA Inc	2.965	0,68
12	Cavco Industries Inc	2.244	0,51
40	Century Communities Inc	1.424	0,32
522	Horizon Global Corp	3.143	0,72
10	Installed Building Products Inc	860	0,20
25	LGI Homes Inc	2.822	0,64
35	M/I Homes Inc	1.498	0,34
22	MDC Holdings Inc	943	0,22
458	New Home Co Inc/The	1.986	0,45
81	Skyline Champion Corp	2.313	0,53
80	Taylor Morrison Home Corp ‘A’	1.890	0,43
32	Toll Brothers Inc	1.359	0,31
93	TRI Pointe Group Inc	1.573	0,36
29	Winnebago Industries Inc	1.571	0,36
		26.591	6,07
Einrichtungsgegenstände — 0,05 % (29. Februar 2020: 0,14 %)			
34	VOXX International Corp ‘A’	211	0,05
Versicherungen — 3,08 % (29. Februar 2020: 3,30 %)			
46	HCI Group Inc	2.540	0,58
241	Heritage Insurance Holdings Inc	3.142	0,72
105	NMI Holdings Inc ‘A’	1.809	0,41
57	Old Republic International Corp	912	0,21
89	Radian Group Inc	1.379	0,32
86	Stewart Information Services Corp	3.686	0,84
		13.468	3,08
Internet — 2,28 % (29. Februar 2020: 1,94 %)			
48	Cars.com Inc	414	0,10
220	comScore Inc	580	0,13
82	Eventbrite Inc	878	0,20
29	Leaf Group Ltd	140	0,03
496	Limelight Networks Inc	2.811	0,64
508	Magnite Inc	3.728	0,85
108	QuinStreet Inc	1.423	0,33
		9.974	2,28

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — (Fortsetzung)			
Eisen/Stahl — 1,40 % (29. Februar 2020: 1,72 %)			
152	Allegheny Technologies Inc	1.266	0,29
21	Carpenter Technology Corp	451	0,10
363	Cleveland-Cliffs Inc	2.393	0,55
43	Commercial Metals Co	891	0,20
72	Shiloh Industries Inc	28	0,01
164	Universal Stainless & Alloy Products Inc	1.113	0,25
		6.142	1,40
Unterkunft — 0,18 % (29. Februar 2020: 0,50 %)			
125	Century Casinos Inc	770	0,18
Maschinen – Bau und Bergbau — 1,49 % (29. Februar 2020: 1,54 %)			
36	Astec Industries Inc	1.869	0,43
169	Bloom Energy Corp	2.650	0,60
50	Hyster-Yale Materials Handling Inc	2.001	0,46
		6.520	1,49
Maschinen – diversifiziert — 1,34 % (29. Februar 2020: 2,11 %)			
94	Gencor Industries Inc	1.183	0,27
42	Ichor Holdings Ltd	1.058	0,24
350	Intevac Inc	2.109	0,48
24	Mueller Water Products Inc ‘A’	265	0,06
47	Perceptron Inc	199	0,05
289	Power Solutions International Inc	1.034	0,24
		5.848	1,34
Metallherstellung und -hardware — 1,17 % (29. Februar 2020: 2,16 %)			
110	Northwest Pipe Co	3.109	0,71
48	Park-Ohio Holdings Corp	764	0,18
195	Synalloy Corp	1.243	0,28
		5.116	1,17
Bergbau — 1,29 % (29. Februar 2020: 0,94 %)			
276	Century Aluminum Co	2.724	0,62
592	Ferroglobe Plc	297	0,07
310	Livent Corp	2.623	0,60
		5.644	1,29
Diverse Fertigung — 2,15 % (29. Februar 2020: 2,18 %)			
28	EnPro Industries Inc	1.625	0,37
9	Fabrinet	651	0,15
75	Haynes International Inc	1.411	0,32
188	LiqTech International Inc	1.307	0,30
151	Lydall Inc	2.833	0,65
78	Trinity Industries Inc	1.601	0,36
		9.428	2,15
Büro- und Büroausrüstung — 0,54 % (29. Februar 2020: 0,25 %)			
434	Pitney Bowes Inc	2.384	0,54
Büromöbel — 0,08 % (29. Februar 2020: 0,14 %)			
47	Interface Inc ‘A’	359	0,08
Öl und Gas — 1,18 % (29. Februar 2020: 1,70 %)			
672	Baytex Energy Corp	345	0,08
108	Earthstone Energy Inc ‘A’	317	0,07
241	Matador Resources Co	2.342	0,54
122	Montage Resources Corp	626	0,14
105	Patterson-UTI Energy Inc	404	0,09
189	Trecora Resources	1.142	0,26
		5.176	1,18
Öl- und Gasdienstleistungen — 0,75 % (29. Februar 2020: 1,83 %)			
249	Archrock Inc	1.635	0,37
5	DMC Global Inc	161	0,04
215	Newpark Resources Inc	423	0,10
147	Ranger Energy Services Inc	397	0,09
199	TETRA Technologies Inc	136	0,03
123	US Silica Holdings Inc	550	0,12
		3.302	0,75
Verpackung und Container — 0,34 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
58	TriMas Corp	1.471	0,34
Pharmazieunternehmen — 2,96 % (29. Februar 2020: 2,01 %)			
169	Flexion Therapeutics Inc	1.966	0,45
214	Option Care Health Inc	2.484	0,57
364	Owens & Minor Inc	6.038	1,38
40	Pacira BioSciences Inc	2.483	0,56
		12.971	2,96
Immobilien — 0,44 % (29. Februar 2020: 0,36 %)			
174	Realogy Holdings Corp	1.923	0,44
Einzelhandel — 6,03 % (29. Februar 2020: 2,85 %)			
25	America’s Car-Mart Inc/TX	2.512	0,57
127	Aspen Aerogels Inc	1.080	0,25
41	BJ’s Restaurants Inc	1.279	0,29
554	Carrols Restaurant Group Inc	3.695	0,84
110	Chuy’s Holdings Inc	2.442	0,56
48	Conn’s Inc	611	0,14
19	Dunkin’ Brands Group Inc	1.430	0,33
151	Hudson Ltd	1.135	0,26
42	Kura Sushi USA Inc	508	0,12
8	Lithia Motors Inc ‘A’	2.016	0,46
156	Lumber Liquidators Holdings Inc	3.734	0,85
256	Noodles & Co ‘A’	1.948	0,44
16	Red Robin Gourmet Burgers Inc	178	0,04
123	Regis Corp	912	0,21
104	Rite Aid Corp	1.348	0,31
25	Ruth’s Hospitality Group Inc	258	0,06
25	Sonic Automotive Inc ‘A’	1.060	0,24
4	Texas Roadhouse Inc ‘A’	264	0,06
		26.410	6,03
Sparkassen — 0,22 % (29. Februar 2020: 0,24 %)			
39	Axos Financial Inc	968	0,22
Halbleiter — 6,00 % (29. Februar 2020: 7,38 %)			
353	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	4.796	1,10
227	Amkor Technology Inc	2.763	0,63
133	Amtech Systems Inc	762	0,17
8	Brooks Automation Inc	401	0,09
90	Cohu Inc	1.545	0,35
19	CTS Corp	393	0,09
81	FormFactor Inc	2.115	0,48
88	Kulicke & Soffa Industries Inc	2.110	0,48
61	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	2.185	0,50
14	MKS Instruments Inc	1.638	0,38
92	Onto Innovation Inc	2.867	0,66
117	Ultra Clean Holdings Inc	2.868	0,66
152	Veeco Instruments Inc	1.808	0,41
		26.251	6,00
Software — 4,77 % (29. Februar 2020: 4,13 %)			
34	Allscripts Healthcare Solutions Inc	308	0,07
242	Avaya Holdings Corp	3.760	0,86
424	Avid Technology Inc	3.429	0,78
612	Castlight Health Inc	848	0,19
216	Cloudera Inc	2.856	0,65
190	Digi International Inc	2.586	0,59
96	Ebix Inc	2.214	0,51
167	Evolent Health Inc ‘A’	2.388	0,55
237	Kaleyra Inc	1.489	0,34
155	Mobilelron Inc	1.010	0,23
		20.888	4,77
Telekommunikation — 5,30 % (29. Februar 2020: 4,29 %)			
400	A10 Networks Inc	3.414	0,78
130	ADTRAN Inc	1.438	0,33
60	Aviat Networks Inc	1.305	0,30
291	CalAmp Corp	2.375	0,54
233	Ceragon Networks Ltd	537	0,12
10	Ciena Corp	567	0,13
181	DZS Inc	1.883	0,43
169	Frequency Electronics Inc	1.723	0,39
446	Infinera Corp	3.248	0,74
38	InterDigital Inc	2.312	0,53
40	Iridium Communications Inc	1.111	0,25
126	Ooma Inc	1.719	0,39
251	PCTEL Inc	1.594	0,37
		23.226	5,30
Transport — 2,47 % (29. Februar 2020: 3,11 %)			
87	Ardmore Shipping Corp	321	0,07
56	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	3.179	0,73
262	Dorian LPG Ltd	2.214	0,50
98	GasLog Ltd	290	0,07
262	Navigator Holdings Ltd	2.428	0,55
154	Radiant Logistics Inc	814	0,19
141	Teekay LNG Partners LP	1.558	0,36
		10.804	2,47
Speditions- und Leasinggeschäft — 0,21 % (29. Februar 2020: 0,20 %)			
139	General Finance Corp	907	0,21
Stammaktien insgesamt (Kosten 421.052 USD)		420.501	96,03
Immobilieninvestmentgesellschaften — 1,37 % (29. Februar 2020: 0,78 %)			
REITS — 1,37 % (29. Februar 2020: 0,78 %)			
63	Alexander & Baldwin Inc	769	0,18
162	Armada Hoffler Properties Inc	1.640	0,37
117	CatchMark Timber Trust Inc ‘A’	1.161	0,27
63	Ryman Hospitality Properties Inc	2.411	0,55
		5.981	1,37
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 6.673 USD)		5.981	1,37
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 440.558 USD)		439.315	100,33
Devisenterminkontrakte — 0,10 % (29. Februar 2020: 0,03 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		449	0,10
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		439.764	100,43
Devisenterminkontrakte — (0,03 %) (29. Februar 2020: (0,09 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(158)	(0,03)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(158)	(0,03)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		439.606	100,40
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(1.730)	(0,40)
Gesamtnettovermögen		437.876	100,00

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,60
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,91
Finanzderivate	0,10
Sonstige Vermögenswerte	0,39
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	AUD	1	$ –
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1.745	Verkauf	BRL	9.677	(21)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	14	Verkauf	EUR	12	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	–	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	76	Verkauf	SGD	103	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	BRL	9.677	Verkauf	USD	1.863	(97)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	27	Verkauf	USD	31	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	44	Verkauf	USD	58	1
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	134	Verkauf	USD	98	–
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	69	Verkauf	USD	50	1
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	189	Verkauf	USD	250	3
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	26	Verkauf	GBP	20	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	33	Verkauf	USD	45	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	600	Verkauf	AUD	833	(17)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	823	Verkauf	CNH	5.721	(11)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	80	Verkauf	EUR	68	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	557	Verkauf	EUR	472	(6)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SEK	2	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	19	Verkauf	SEK	172	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	849	Verkauf	SGD	1.164	(6)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CNH	14.552	Verkauf	USD	2.085	37
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	247	Verkauf	USD	296	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	6.064	Verkauf	USD	7.155	80
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	385	Verkauf	USD	503	12
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	550	Verkauf	USD	62	1
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	95	Verkauf	USD	11	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	10.257	Verkauf	USD	7.354	215
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	PLN	2.444	Verkauf	USD	654	10
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	11.285	Verkauf	USD	8.224	70
01.10.2020	BNY Mellon	Kauf	BRL	9.777	Verkauf	USD	1.764	19
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 138 USD)								$ 449
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (424) USD)								(158)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (286) USD)								$ 291

Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Kollektive Kapitalanlagen — 2,61 % (29. Februar 2020: 3,23 %)			
10	iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	1.006	1,62
616	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (Distribution)	616	0,99
Kollektive Kapitalanlagen insgesamt (Kosten 1.501 USD)		1.622	2,61
Stammaktien — 97,58 % (29. Februar 2020: 97,13 %)			
Bekleidung — 2,28 % (29. Februar 2020: 1,52 %)			
57	Wolverine World Wide Inc	1.417	2,28
Kfz-Teile und Zubehör — 4,24 % (29. Februar 2020: 3,60 %)			
59	Meritor Inc	1.333	2,15
41	Miller Industries Inc/TN	1.299	2,09
		2.632	4,24
Baumaterialien — 4,99 % (29. Februar 2020: 5,92 %)			
20	Gibraltar Industries Inc	1.235	1,99
13	Patrick Industries Inc	740	1,19
CAD 33	Stella-Jones Inc	1.128	1,81
		3.103	4,99
Chemikalien — 1,64 % (29. Februar 2020: 1,77 %)			
5	Quaker Chemical Corp	1.020	1,64
Gewerbliche Dienstleistungen — 8,30 % (29. Februar 2020: 6,04 %)			
14	Cass Information Systems Inc	530	0,85
28	Forrester Research Inc	1.004	1,62
60	Heidrick & Struggles International Inc	1.299	2,09
42	Korn Ferry	1.277	2,06
24	Vectrus Inc	1.047	1,68
		5.157	8,30
Computer — 3,52 % (29. Februar 2020: 3,40 %)			
26	Insight Enterprises Inc	1.563	2,52
8	MAXIMUS Inc	624	1,00
		2.187	3,52
Kosmetika und Körperpflege — 2,32 % (29. Februar 2020: 1,78 %)			
32	Inter Parfums Inc	1.440	2,32
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 8,39 % (29. Februar 2020: 4,90 %)			
21	Air Lease Corp 'A'	661	1,06
24	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	948	1,52
CAD 53	Genworth MI Canada Inc	1.459	2,35
19	Houlihan Lokey Inc 'A'	1.097	1,77
33	Lazard Ltd 'A'	1.047	1,69
		5.212	8,39
Elektrische Komponenten und Zubehör — 0,86 % (29. Februar 2020: 1,28 %)			
23	Light Inc	534	0,86
Elektronik — 6,02 % (29. Februar 2020: 6,73 %)			
5	Coherent Inc	538	0,87
16	FARO Technologies Inc	878	1,41
18	Gentex Corp	486	0,78
63	Kimball Electronics Inc	852	1,37
30	Vishay Intertechnology Inc	481	0,78
20	Vishay Precision Group Inc	504	0,81
		3.739	6,02
Engineering und Konstruktion — 3,93 % (29. Februar 2020: 4,30 %)			
27	Arcosa Inc	1.248	2,01
17	Comfort Systems USA Inc	863	1,39
23	Sterling Construction Co Inc	328	0,53
		2.439	3,93
Lebensmittel — 2,38 % (29. Februar 2020: 2,79 %)			
23	Industrias Bachoco SAB de CV ADR	881	1,42
19	Tootsie Roll Industries Inc	595	0,96
		1.476	2,38
Hand- und Maschinenwerkzeuge — 2,28 % (29. Februar 2020: 2,39 %)			
43	Colfax Corp	1.418	2,28
Medizinische Produkte — 2,54 % (29. Februar 2020: 1,87 %)			
5	Bio-Techne Corp	1.151	1,85
24	Natus Medical Inc	430	0,69
		1.581	2,54
Wohnungsbauunternehmen — 2,19 % (29. Februar 2020: 1,66 %)			
8	LCI Industries	939	1,51
15	Skyline Champion Corp	421	0,68
		1.360	2,19
Versicherungen — 3,50 % (29. Februar 2020: 6,26 %)			
26	FBL Financial Group Inc	976	1,57
13	RLI Corp	1.201	1,93
		2.177	3,50
Freizeit — 2,51 % (29. Februar 2020: 2,25 %)			
4	Johnson Outdoors Inc	346	0,55
58	MasterCraft Boat Holdings Inc	1.216	1,96
		1.562	2,51
Unterkunft — 1,19 % (29. Februar 2020: 1,61 %)			
120	Century Casinos Inc	739	1,19
Maschinen – diversifiziert — 2,11 % (29. Februar 2020: 1,89 %)			
11	Kadant Inc	1.310	2,11
Metallherstellung und -hardware — 0,80 % (29. Februar 2020: 1,01 %)			
18	Northwest Pipe Co	498	0,80
Diverse Fertigung — 5,64 % (29. Februar 2020: 3,51 %)			
18	ESCO Technologies Inc	1.586	2,55
7	Fabrinet	511	0,82
14	John Bean Technologies Corp	1.410	2,27
		3.507	5,64
Büroausstattung — 0,92 % (29. Februar 2020: 1,61 %)			
51	Kimball International Inc	570	0,92
Öl- und Gasdienstleistungen — 2,99 % (29. Februar 2020: 4,10 %)			
CAD 242	Pason Systems Inc	1.105	1,78
NOK 58	TGS NOPEC Geophysical Co ASA	750	1,21
		1.855	2,99
Verpackung und Behälter — 0,54 % (29. Februar 2020: 0,64 %)			
8	UFP Technologies Inc	336	0,54
Pharmazieunternehmen — 2,16 % (29. Februar 2020: 1,51 %)			
7	BioSpecifics Technologies Corp	435	0,70
141	Catalyst Pharmaceuticals Inc	463	0,75
23	Coherus Biosciences Inc	443	0,71
		1.341	2,16
Außerbörsliche Unternehmensbeteiligungen — 2,56 % (29. Februar 2020: 2,47 %)			
111	Kennedy-Wilson Holdings Inc	1.590	2,56
Immobilien — 0,76 % (29. Februar 2020: 1,37 %)			
17	Marcus & Millichap Inc	473	0,76
Einzelhandel — 0,66 % (29. Februar 2020: 3,25 %)			
55	Regis Corp	408	0,66
Halbleiter — 8,54 % (29. Februar 2020: 7,47 %)			
8	Cabot Microelectronics Corp	1.261	2,03
22	Cohu Inc	375	0,60
30	Kulicke & Soffa Industries Inc	717	1,16
12	MKS Instruments Inc	1.393	2,24
18	Nova Measuring Instruments Ltd	938	1,51
10	Onto Innovation Inc	304	0,49
8	Silicon Motion Technology Corp ADR	316	0,51
		5.304	8,54
Software — 3,48 % (29. Februar 2020: 3,33 %)			
19	J2 Global Inc	1.332	2,15
14	Simulations Plus Inc	827	1,33
		2.159	3,48
Textilien — 0,52 % (29. Februar 2020: 0,67 %)			
2	UniFirst Corp/MA	325	0,52
Transport — 2,82 % (29. Februar 2020: 2,54 %)			
10	Landstar System Inc	1.290	2,08
3	Saia Inc	459	0,74
		1.749	2,82
Stammaktien insgesamt (Kosten 57.811 USD)		60.618	97,58
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 59.312 USD)		62.240	100,19
Devisenterminkontrakte — 0,00 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		62.241	100,19
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		62.241	100,19
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(117)	(0,19)
Gesamtnettovermögen		62.124	100,00

- Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

ABKÜRZUNGEN:

ADR –American Depositary Receipt
ETF – Börsengehandelter Fonds (Exchange Traded Fund)
CAD – Kanadischer Dollar
NOK – Norwegische Krone

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,12
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,60
Finanzderivate	-
Sonstige Vermögenswerte	0,28
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	52	Verkauf	USD	6	$	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	44	Verkauf	USD	52		1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								$	1
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)									-
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								$	1

Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) €	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 97,72 % (29. Februar 2020: 98,46 %)			
Australien — 1,57 % (29. Februar 2020: 2,60 %)			
GBP 16	BHP Group Plc	299	0,91
GBP 4	Rio Tinto Plc	220	0,66
		519	1,57
Belgien — 0,77 % (29. Februar 2020: 0,65 %)			
8	Telenet Group Holding NV	253	0,77
Dänemark — 6,56 % (29. Februar 2020: 6,09 %)			
DKK 4	Coloplast A/S	564	1,71
DKK 17	Novo Nordisk A/S	919	2,78
DKK 11	Pandora A/S	684	2,07
		2.167	6,56
Finnland — 5,49 % (29. Februar 2020: 6,83 %)			
28	Kesko Oyj	536	1,62
10	Neste Oyj	448	1,36
8	Orion Oyj	316	0,96
20	UPM-Kymmene Oyj	513	1,55
		1.813	5,49
Frankreich — 7,26 % (29. Februar 2020: 9,87 %)			
34	Eutelsat Communications SA	295	0,89
18	Quadient SA	208	0,63
10	Sanofi	810	2,45
4	Sodexo SA	283	0,86
10	Total SE	336	1,02
24	Veolia Environnement SA	467	1,41
		2.399	7,26
Deutschland — 11,70 % (29. Februar 2020: 14,82 %)			
4	Allianz SE	722	2,18
60	Aroundtown SA	282	0,85
48	Deutsche Telekom AG	719	2,17
2	Hannover Rueck SE	320	0,97
3	LEG Immobilien AG	423	1,28
1	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	349	1,06
14	TAG Immobilien AG	358	1,08
10	Talanx AG	327	0,99
157	Telefonica Deutschland Holding AG	368	1,12
		3.868	11,70
Italien — 3,75 % (29. Februar 2020: 4,24 %)			
37	Enel SpA	283	0,86
13	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	575	1,74
88	Snam SpA	381	1,15
		1.239	3,75
Jordanien — 1,05 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
GBP 13	Hikma Pharmaceuticals Plc	346	1,05
Niederlande — 3,32 % (29. Februar 2020: 2,03 %)			
29	Koninklijke Ahold Delhaize NV	745	2,25
5	Wolters Kluwer NV	354	1,07
		1.099	3,32
Norwegen — 3,79 % (29. Februar 2020: 3,94 %)			
NOK 28	DNB ASA	385	1,17
NOK 25	Mowi ASA	408	1,23
NOK 33	Telenor ASA	461	1,39
		1.254	3,79
Portugal — 1,08 % (29. Februar 2020: 1,20 %)			
39	Galp Energia SGPS SA	358	1,08
Russland — 1,05 % (29. Februar 2020: 0,90 %)			
GBP 95	Evraz Plc	347	1,05
Spanien — 6,35 % (29. Februar 2020: 7,84 %)			
23	Enagas SA	473	1,43
21	Endesa SA	487	1,48
19	Naturgy Energy Group SA	305	0,92
31	Red Electrica Corp SA	497	1,50
100	Telefonica SA	337	1,02
		2.099	6,35
Schweden — 5,02 % (29. Februar 2020: 5,51 %)			
SEK 11	ICA Gruppen AB	458	1,38
SEK 68	Skandinaviska Enskilda Banken AB	581	1,76
SEK 10	Swedish Match AB	620	1,88
		1.659	5,02
Schweiz — 18,87 % (29. Februar 2020: 16,61 %)			
CHF 4	Baloise Holding AG	488	1,48
CHF 4	Banque Cantonale Vaudoise	349	1,06
CHF 5	Galenica AG, 144A	314	0,95
CHF 3	Helvetia Holding AG	283	0,86
CHF 9	Nestle SA	913	2,76
CHF 15	Novartis AG	1.055	3,19
CHF 4	Roche Holding AG	1.284	3,88
CHF –		SGS SA	564
CHF 3	Swiss Prime Site AG	228	0,69
CHF 6	Swiss Re AG	418	1,26
CHF 1	Swisscom AG	340	1,03
		6.236	18,87
Großbritannien — 20,09 % (29. Februar 2020: 15,33 %)			
GBP 14	Admiral Group Plc	415	1,26
GBP 88	BP Plc	262	0,79
GBP 12	British American Tobacco Plc	343	1,04
GBP 19	Bunzl Plc	520	1,57
GBP 12	Diageo Plc	350	1,06
GBP 155	Direct Line Insurance Group Plc	514	1,56
GBP 40	GlaxoSmithKline Plc	669	2,02
GBP 63	IG Group Holdings Plc	561	1,70
GBP 23	Imperial Brands Plc	326	0,99
GBP 801	Lloyds Banking Group Plc	256	0,77
22	Royal Dutch Shell Plc 'A'	279	0,84
GBP 141	Royal Mail Plc	285	0,86
GBP 34	Sage Group Plc/The	279	0,84
GBP 57	Tate & Lyle Plc	436	1,32
7	Unilever NV	355	1,07
GBP 8	Unilever Plc	416	1,26
GBP 300	Vodafone Group Plc	375	1,14
		6.641	20,09
Stammaktien insgesamt (Kosten 35.883 EUR)		32.297	97,72
Immobilieninvestmentgesellschaften — 0,61 % (29. Februar 2020: 1,19 %)			
Frankreich — 0,61 % (29. Februar 2020: 1,19 %)			
14	Klepierre SA	202	0,61
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 585 EUR)		202	0,61
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 36.468 EUR)		32.499	98,33
Devisenterminkontrakte — 0,08 % (29. Februar 2020: 0,05 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		27	0,08
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		32.526	98,41
Devisenterminkontrakte — (0,18 %) (29. Februar 2020: (0,37 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(60)	(0,18)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(60)	(0,18)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		32.466	98,23
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		584	1,77
Gesamtnettovermögen		€ 33.050	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 314.000 € und machten 0,95 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

CHF – Schweizer Franke
DKK – Dänische Krone
GBP – Britisches Pfund
NOK – Norwegische Krone
SEK – Schwedische Krone

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,12
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,60
Finanzderivate	-
Sonstige Vermögenswerte	0,28
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	AUD	–	€	–
09.01.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–		–
09.02.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	20	Verkauf	EUR	12		–
09.02.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	USD	1		–
15.09..2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	18	Verkauf	AUD	30		–
15.09..2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	27	Verkauf	CNH	218		–
15.09..2020	BNY Mellon	Kauf	USD	6.021	Verkauf	EUR	5.103		(59)
15.09..2020	BNY Mellon	Kauf	CNH	796	Verkauf	EUR	97		1
15.09..2020	BNY Mellon	Kauf	PLN	791	Verkauf	EUR	179		1
15.09..2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	3	Verkauf	EUR	2		–
15.09..2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	297	Verkauf	EUR	184		(1)
15.09..2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	–		–
15.09..2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	2.384	Verkauf	EUR	1.448		25
15.09..2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	SGD	1		–
15.09..2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	9	Verkauf	SGD	14		–
15.09..2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	13	Verkauf	USD	15		–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	54	Verkauf	USD	64		–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 19 EUR)								€	27
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (149) EUR)									(60)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (130) EUR)								€	(33)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 96,19 % (29. Februar 2020: 94,41 %)			
Australien — 4,58 % (29. Februar 2020: 5,45 %)			
AUD 151	Aurizon Holdings Ltd	482	1,29
AUD 68	Coca-Cola Amatil Ltd	455	1,22
AUD 6	Commonwealth Bank of Australie	283	0,76
AUD 38	McMillan Shakespeare Ltd	256	0,69
AUD 141	Orora Ltd	233	0,62
		1.709	4,58
China — 32,34 % (29. Februar 2020: 27,34 %)			
HKD 753	Bank of Communications Co Ltd	394	1,05
HKD 2.260	CGN Power Co Ltd, 144A	492	1,32
HKD 490	China Aircraft Leasing Group Holdings Ltd	449	1,20
HKD 603	China CITIC Bank Corp Ltd	252	0,68
HKD 678	China Communications Services Corp Ltd	444	1,19
HKD 1.133	China Construction Bank Corp	798	2,14
HKD 301	China Medical System Holdings Ltd	339	0,91
HKD 96	China Pacific Insurance Group Co Ltd	266	0,71
HKD 868	China Railway Group Ltd	446	1,20
HKD 240	China Shenhua Energy Co Ltd	398	1,07
HKD 1.390	China Telecom Corp Ltd	454	1,22
HKD 74	China Vanke Co Ltd	231	0,62
HKD 424	China Yuhua Education Corp Ltd, 144A	407	1,09
HKD 529	CITIC Ltd	482	1,29
HKD 1.356	CITIC Telecom International Holdings Ltd	471	1,26
HKD 857	Dali Foods Group Co Ltd, 144A	526	1,41
HKD 308	EEKA Fashion Holdings Ltd	355	0,95
HKD 565	Far East Horizon Ltd	500	1,34
HKD 400	Fu Shou Yuan International Group Ltd	414	1,11
HKD 294	Guangdong Investment Ltd	460	1,23
HKD 64	Hengan International Group Co Ltd	504	1,35
HKD 1.127	Huaneng Power International Inc	468	1,25
HKD 720	Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	342	0,92
HKD 226	Shenzhen Expressway Co Ltd	205	0,55
HKD 594	Sinopec Engineering Group Co Ltd	263	0,70
HKD 224	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	421	1,13
HKD 407	Uni-President China Holdings Ltd	372	1,00
HKD 2.542	Yuexiu Property Co Ltd	486	1,30
HKD 728	Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	431	1,15
		12.070	32,34
Hongkong — 9,06 % (29. Februar 2020: 6,18 %)			
HKD 100	AIA Group Ltd	1.024	2,74
HKD 51	CLP Holdings Ltd	501	1,34
HKD 1.214	Giordano International Ltd	204	0,55
HKD 280	HKT Trust & HKT Ltd	400	1,07
HKD 96	Hysan Development Co Ltd	304	0,81
HKD 237	Lifestyle International Holdings Ltd	216	0,58
HKD 320	Stella International Holdings Ltd	311	0,84
HKD 41	VTech Holdings Ltd	237	0,64
HKD 106	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	182	0,49
		3.379	9,06
Indien — 9,14 % (29. Februar 2020: 8,46 %)			
INR 8	Dr Reddy's Laboratories Ltd	433	1,16
INR 452	Firstsource Solutions Ltd	379	1,02
INR 79	HCL Technologies Ltd	734	1,97
INR 68	Infosys Ltd	845	2,26
INR 1.749	NHPC Ltd	515	1,38
INR 264	REC Ltd	382	1,02
INR 72	Vedanta Ltd	125	0,33
		3.413	9,14
Indonesien — 3,40 % (29. Februar 2020: 3,77 %)			
IDR 1.055	Bank Mandiri Persero Tbk PT	432	1,16
IDR 900	Indofood Sukses Makmur Tbk PT	471	1,26
IDR 1.861	Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT	367	0,98
		1.270	3,40
Malaysia — 3,32 % (29. Februar 2020: 3,26 %)			
MYR 1.642	Astro Malaysia Holdings Bhd	305	0,82
MYR 264	MISC Bhd	482	1,29
MYR 115	Public Bank Bhd	453	1,21
		1.240	3,32
Pakistan — 0,68 % (29. Februar 2020: 0,65 %)			
PKR 246	MCB Bank Ltd	254	0,68
Philippinen — 2,72 % (29. Februar 2020: 2,18 %)			
PHP 962	Aboitiz Power Corp	528	1,41
PHP 11	Globe Telecom Inc	488	1,31
		1.016	2,72
Südkorea — 11,83 % (29. Februar 2020: 10,40 %)			
KRW 12	GS Retail Co Ltd	339	0,91
KRW 4	Hansol Paper Co Ltd	50	0,13
35	KT Corp ADR	344	0,92
KRW 8	KT&G Corp	571	1,53
KRW 41	LG Uplus Corp	417	1,12
KRW 47	Samsung Electronics Co Ltd	2.123	5,69
KRW 3	SK Telecom Co Ltd	572	1,53
		4.416	11,83
Taiwan — 18,43 % (29. Februar 2020: 17,23 %)			
TWD 312	Asia Cement Corp	453	1,21
TWD 84	Bioteque Corp	399	1,07
TWD 502	Kindom Development Co Ltd	676	1,81
TWD 322	Lite-On Technology Corp	510	1,37
TWD 191	Nan Kang Rubber Tire Co Ltd	307	0,82
TWD 17	Poya International Co Ltd	335	0,90
TWD 46	President Chain Store Corp	424	1,14
TWD 91	SCI Pharmtech Inc	400	1,07
TWD 252	Synnex Technology International Corp	376	1,01
TWD 170	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.479	6,64
TWD 228	Uni-President Enterprises Corp	518	1,39
		6.877	18,43
Thailand — 0,69 % (29. Februar 2020: 6,41 %)			
THB 119	Tisco Financial Group PCL, NVDR	258	0,69
Stammaktien insgesamt (Kosten 40.390 USD)		35.902	96,19
Immobilieninvestmentgesellschaften — 2,31 % (29. Februar 2020: 4,42 %)			
Australien — 1,08 % (29. Februar 2020: 1,08 %)			
AUD 110	Charter Hall Long Wale REIT	401	1,08
Hongkong — 0,53 % (29. Februar 2020: 0,51 %)			
HKD 229	Fortune Real Estate Investment Trust	198	0,53
Singapur — 0,70 % (29. Februar 2020: 2,83 %)			
SGD 726	First Real Estate Investment Trust	262	0,70
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 1.222 USD)		861	2,31
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizuleg-enden Zeitwert (Kosten 41.612 USD)		36.763	98,50
Devisenterminkontrakte — 0,43 % (29. Februar 2020: 0,01 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		162	0,43
Summe der erfolgswirksam zum beizuleg-enden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		36.925	98,93
Devisenterminkontrakte — 0,00 % (29. Februar 2020: (0,33 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		–	–
Summe der erfolgswirksam zum beizuleg-enden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		–	–
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		36.925	98,93
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		399	1,07
Gesamtnettovermögen		$37.324	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.767.000 USD, soit 4,74 % de l'actif net.

ABKÜRZUNGEN:

ADR	– American Depositary Receipt
NVDR	– Non Voting Depository Receipt
AUD	– Australischer Dollar
HKD	– Hongkong-Dollar
IDR	– Indonesische Rupiah
INR	– Indische Rupie
KRW	– Südkoreanischer Won
MYR	– Malaysischer Ringgit
PHP	– Philippinischer Peso
PKR	– Pakistanische Rupie
SGD	– Singapur-Dollar
THB	– Thailändischer Baht
TWD	– Taiwanesischer Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,02
Finanzderivate	0,43
Sonstige Vermögenswerte	1,55
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	HKD	–	Verkauf	USD	–	$ –
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	HKD	269	Verkauf	USD	35	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	HKD	–	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	HKD	100	Verkauf	USD	13	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	13	Verkauf	AUD	18	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	CNH	8	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	24	Verkauf	SGD	32	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	218	Verkauf	USD	159	1
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	PLN	9.307	Verkauf	USD	2.488	39
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CNH	1.757	Verkauf	USD	251	5
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	5.591	Verkauf	USD	4.007	117
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 8 USD)								$ 162
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (215) USD)								–
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (207) USD)								$ 162

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 96,79 % (29. Februar 2020: 95,20 %)			
Brasilien — 2,39 % (29. Februar 2020 : 6,79 %)			
BRL 6	Ambev SA	13	0,10
BRL 1	Atacadao SA	4	0,03
BRL –	B2W Cia Digital	6	0,05
BRL 1	B3 SA – Brésil Bolsa Balcao	12	0,10
BRL 3	CCR SA	7	0,06
BRL 1	Centrais Eletricas Brésileiras SA	4	0,04
BRL 1	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	6	0,05
BRL 1	Energisa SA	4	0,03
BRL 1	Engie Brésil Energia SA	4	0,03
BRL 2	Equatorial Energia SA	10	0,08
BRL 1	Hapvida Participacoes e Investimentos SA, 144A	11	0,09
BRL 2	Hypera SA	10	0,08
BRL 2	Klabin SA	7	0,06
BRL 2	Localiza Rent a Car SA	13	0,11
BRL 2	Lojas Renner SA	13	0,10
BRL 1	Magazine Luiza SA	19	0,15
BRL 1	Natura & Co Holding SA	9	0,07
BRL 2	Notre Dame Intermedica Participacoes SA	27	0,21
BRL 2	Petrobras Distribuidora SA	8	0,07
BRL 4	Petroleo Brésileiro SA	17	0,14
BRL –	Raia Drogasil SA	6	0,05
BRL 3	Rumo SA	10	0,08
BRL 1	Suzano SA	5	0,04
BRL 6	TIM Participacoes SA	16	0,13
BRL 3	Vale SA	34	0,27
BRL 2	WEG SA	22	0,17
		297	2,39
Chile — 1,93 % (29. Februar 2020: 2,19 %)			
CLP 29	Aguas Andinas SA	9	0,07
CLP 480	Banco de Chile	40	0,32
CLP 1	Banco de Credito e Inversiones SA	19	0,16
CLP 711	Banco Santander Chile	27	0,22
CLP 15	Cencosud SA	23	0,18
CLP 1	Cia Cervecerias Unidas SA	7	0,06
CLP 83	Colbun SA	13	0,10
CLP 16	Empresas CMPC SA	33	0,26
CLP 338	Enel Americas SA	48	0,39
CLP 272	Enel Chile SA	21	0,17
		240	1,93
China — 30,69 % (29. Februar 2020: 25,51 %)			
HKD 5	3SBio Inc, 144A	6	0,05
–	51job Inc ADR	4	0,03
HKD 3	AAC Technologies Holdings Inc	16	0,13
CNY 2	AECC Aviation Power Co Ltd	10	0,08
HKD 6	Agile Group Holdings Ltd	8	0,07
HKD 9	Agricultural Bank of China Ltd	3	0,02
CNY 2	Aier Eye Hospital Group Co Ltd	14	0,12
HKD 8	Air China Ltd	6	0,04
TWD 1	Airtac International Group	22	0,18
1	Alibaba Group Holding Ltd ADR	230	1,84
HKD 10	Alibaba Health Information Technology Ltd	24	0,19
HKD 2	A-Living Services Co Ltd, 144A	8	0,06
HKD 44	Aluminum Corp of China Ltd	11	0,09
CNY 3	Anhui Conch Cement Co Ltd	28	0,22
HKD 9	Anhui Conch Cement Co Ltd	65	0,52
HKD 1	Anhui Gujing Distillery Co Ltd	13	0,10
HKD 1	ANTA Sports Products Ltd	10	0,08
CNY 5	AVIC Electromechanical Systems Co Ltd	7	0,05
HKD 10	AviChina Industry & Technology Co Ltd	6	0,05
CNY 1	AVICOPTER Plc	8	0,07
–	Baidu Inc ADR	25	0,20
HKD 62	Bank of China Ltd	20	0,16
HKD 6	Bank of Communications Co Ltd	3	0,02
CNY 29	Baoshan Iron & Steel Co Ltd	21	0,17
HKD 8	Beijing Capital International Airport Co Ltd	6	0,05
HKD 3	Beijing Enterprises Holdings Ltd	8	0,06
HKD 38	Beijing Enterprises Water Group Ltd	15	0,12
CNY 2	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd	17	0,14
CNY 6	BOE Technology Group Co Ltd	5	0,04
HKD 3	BYD Electronic International Co Ltd	13	0,10
HKD 69	CGN Power Co Ltd, 144A	15	0,12
HKD 5	China Aoyuan Group Ltd	6	0,05
CNY 3	China Avionics Systems Co Ltd	8	0,06
HKD 14	China Communications Construction Co Ltd	8	0,06
HKD 10	China Communications Services Corp Ltd	7	0,05
HKD 5	China Conch Venture Holdings Ltd	22	0,17
HKD 72	China Construction Bank Corp	51	0,41
HKD 8	China Everbright International Ltd	5	0,04
HKD 6	China Evergrande Group	14	0,11
HKD 3	China Feihe Ltd, 144A	6	0,05
HKD 16	China Gas Holdings Ltd	44	0,36
HKD 13	China Hongqiao Group Ltd	8	0,07
HKD 16	China Jinmao Holdings Group Ltd	10	0,08
HKD 4	China Lesso Group Holdings Ltd	7	0,06
HKD 6	China Life Insurance Co Ltd	15	0,12
HKD 25	China Longyuan Power Group Corp Ltd	16	0,13
HKD 5	China Medical System Holdings Ltd	6	0,04
HKD 10	China Mengniu Dairy Co Ltd	49	0,40
HKD 3	China Merchants Bank Co Ltd	14	0,11
CNY 4	China Merchants Bank Co Ltd	24	0,19
HKD 4	China Merchants Port Holdings Co Ltd	5	0,04
HKD 4	China Mobile Ltd	28	0,22
CNY 11	China Molybdenum Co Ltd	7	0,05
HKD 27	China Molybdenum Co Ltd	11	0,09
HKD 30	China National Building Material Co Ltd	42	0,34
HKD 12	China Oilfield Services Ltd	9	0,08
HKD 11	China Overseas Land & Investment Ltd	31	0,25
HKD 5	China Overseas Property Holdings Ltd	4	0,04
HKD 2	China Pacific Insurance Group Co Ltd	7	0,05
HKD 138	China Petroleum & Chemical Corp	63	0,51
CNY 28	China Petroleum & Chemical Corp	16	0,13
HKD 46	China Power International Development Ltd	9	0,07
HKD 8	China Railway Construction Corp Ltd	6	0,05
HKD 10	China Railway Group Ltd	5	0,04
HKD 4	China Resources Beer Holdings Co Ltd	26	0,21
HKD 18	China Resources Cement Holdings Ltd	26	0,21
HKD 6	China Resources Gas Group Ltd	28	0,23
HKD 8	China Resources Land Ltd	37	0,30
HKD 12	China Resources Power Holdings Co Ltd	14	0,11
HKD 20	China Shenhua Energy Co Ltd	32	0,26
CNY 6	China Shenhua Energy Co Ltd	13	0,11
HKD 10	China Southern Airlines Co Ltd	5	0,04
CNY 25	China State Construction Engineering Corp Ltd	19	0,15
HKD 8	China State Construction International Holdings Ltd	6	0,05
HKD 16	China Telecom Corp Ltd	5	0,04
HKD 34	China Tower Corp Ltd, 144A	6	0,05
CNY 2	China Vanke Co Ltd	9	0,07
HKD 5	China Vanke Co Ltd	14	0,11
CNY 11	China Yangtze Power Co Ltd	30	0,24
HKD 10	CIFI Holdings Group Co Ltd	8	0,07
HKD 16	CITIC Ltd	15	0,12
HKD 6	CITIC Securities Co Ltd	13	0,11
HKD 106	CNOOC Ltd	120	0,96
CNY –	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	12	0,10
HKD 10	COSCO SHIPPING Energy Transportation Co Ltd	5	0,04
HKD 19	Country Garden Holdings Co Ltd	24	0,19
HKD 4	Country Garden Services Holdings Co Ltd	28	0,22
HKD 13	CRRC Corp Ltd	6	0,05
HKD 15	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	33	0,26
HKD 8	Dali Foods Group Co Ltd, 144A	5	0,04
HKD 5	ENN Energy Holdings Ltd	52	0,42
CNY 1	Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd	24	0,19
HKD 8	Fosun International Ltd	8	0,07
CNY 1	Ganfeng Lithium Co Ltd	6	0,05
–	GDS Holdings Ltd ADR	16	0,13
HKD 5	Geely Automobile Holdings Ltd	11	0,09
HKD 2	Genscript Biotech Corp	4	0,03
HKD 6	Greentown Service Group Co Ltd	8	0,06
HKD 18	Guangdong Investment Ltd	28	0,23
HKD 4	Guangzhou R&F Properties Co Ltd	6	0,04
CNY 4	Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd	19	0,15
HKD 2	Hansoh Pharmaceutical Group Co Ltd, 144A	9	0,08
HKD 3	Hengan International Group Co Ltd	20	0,16
CNY 9	Hengli Petrochemical Co Ltd	26	0,21
HKD 24	Huaneng Power International Inc	10	0,08
HKD 49	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	27	0,22
CNY 6	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd	34	0,27
15	Inner Mongolia Yitai Coal Co Ltd	11	0,09
HKD 3	Innovent Biologics Inc, 144A	17	0,13
–	JD.com Inc ADR	31	0,25
HKD 4	Jiangsu Expressway Co Ltd	4	0,03
CNY 2	Jiangsu Hengrui Medicine Co Ltd	24	0,20
CNY 1	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co Ltd	21	0,16
HKD 10	Jiangxi Copper Co Ltd	12	0,09
HKD 5	Kingboard Holdings Ltd	14	0,12
HKD 7	Kingdee International Software Group Co Ltd	18	0,14
HKD 3	Kingsoft Corp Ltd	16	0,13
HKD 24	Kunlun Energy Co Ltd	18	0,14
CNY –	Kweichow Moutai Co Ltd	78	0,63
HKD 5	KWG Group Holdings Ltd	9	0,07
HKD 11	Lee & Man Paper Manufacturing Ltd	7	0,05
HKD 26	Lenovo Group Ltd	17	0,14
HKD 4	Logan Group Co Ltd	7	0,06
HKD 6	Longfor Group Holdings Ltd, 144A	29	0,23
CNY 1	Luzhou Laojiao Co Ltd	22	0,17
HKD 2	Meituan Dianping	49	0,40
CNY 1	Muyuan Foodstuff Co Ltd	9	0,07
–	NetEase Inc ADR	49	0,39
CNY 1	New Hope Liuhe Co Ltd	6	0,04
–	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	15	0,12
CNY 24	PetroChina Co Ltd	15	0,12
HKD 118	PetroChina Co Ltd	41	0,33
HKD 8	PICC Property & Casualty Co Ltd	6	0,05
–	Pinduoduo Inc ADR	9	0,07
HKD 1	Ping An Healthcare and Technology Co Ltd, 144A	15	0,12
HKD 5	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	48	0,39
CNY 4	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A'	39	0,31
CNY 8	Poly Developments and Holdings Group Co Ltd	19	0,16
HKD 7	Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	3	0,03
CNY 10	Rongsheng Petro Chemical Co Ltd	29	0,24
CNY 6	Sany Heavy Industry Co Ltd	18	0,15
HKD 8	Seazen Group Ltd	7	0,06
HKD 10	Semiconductor Manufacturing International Corp	32	0,25
CNY 1	SF Holding Co Ltd	17	0,13
CNY 2	Shandong Gold Mining Co Ltd	7	0,06
HKD 4	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	9	0,07
HKD 2	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	8	0,07
HKD 5	Shenzhen International Holdings Ltd	7	0,06
CNY –	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd	5	0,04
HKD 1	Shenzhou International Group Holdings Ltd	8	0,06
HKD 4	Shimao Group Holdings Ltd	16	0,13
HKD 14	Sino-Ocean Group Holding Ltd	3	0,03

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — (Fortsetzung)			
China — (Fortsetzung)			
HKD 30	Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd	6	0,05
HKD 4	Sinopharm Group Co Ltd	9	0,07
HKD 3	Sinotruk Hong Kong Ltd	7	0,05
HKD 9	Sun Art Retail Group Ltd	12	0,09
HKD 7	Sunac China Holdings Ltd	29	0,24
HKD 2	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	34	0,27
–	TAL Education Group ADR	15	0,12
HKD 4	Tencent Holdings Ltd	239	1,92
HKD 8	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	15	0,12
HKD 4	TravelSky Technology Ltd	8	0,07
–	Trip.com Group Ltd ADR	9	0,07
HKD 2	Tsingtao Brewery Co Ltd	18	0,15
HKD 5	Uni-President China Holdings Ltd	5	0,04
–	Vipshop Holdings Ltd ADR	5	0,04
CNY 3	Wanhua Chemical Group Co Ltd	36	0,29
HKD 17	Want Want China Holdings Ltd	12	0,09
HKD 7	Weichai Power Co Ltd	14	0,11
CNY 4	Wens Foodstuffs Group Co Ltd	15	0,12
CNY 1	Wuliangye Yibin Co Ltd	38	0,31
HKD 1	WuXi AppTec Co Ltd, 144A	10	0,08
CNY 1	WuXi AppTec Co Ltd	16	0,13
HKD 3	Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	65	0,52
HKD 32	Xiaomi Corp 'B', 144A	100	0,80
HKD 14	Xinyi Solar Holdings Ltd	18	0,14
HKD 12	Yanzhou Coal Mining Co Ltd	9	0,07
HKD 2	Yihai International Holding Ltd	31	0,25
–	Yum China Holdings Inc	12	0,09
–	Zai Lab Ltd ADR	12	0,10
HKD 10	Zhaojin Mining Industry Co Ltd	11	0,09
HKD 3	Zhuzhou CRRC Times Electric Co Ltd	8	0,07
CNY 27	Zijin Mining Group Co Ltd	29	0,23
HKD 48	Zijin Mining Group Co Ltd	33	0,26
CNY 1	ZTE Corp	6	0,05
HKD 2	ZTE Corp	7	0,06
1	ZTO Express Cayman Inc ADR	30	0,24
		3.824	30,69
Kolumbien — 0,28 % (29. Februar 2020: 0,52 %)			
COP 3	Bancolombia SA	20	0,16
COP 3	Grupo de Inversiones Suramericana SA	15	0,12
		35	0,28
Ägypten — 0,54 % (29. Februar 2020: 0,75 %)			
EGP 16	Commercial International Bank Egypt SAE	67	0,54
Griechenland — 0,74 % (29. Februar 2020: 1,13 %)			
EUR 1	FF Group †∞	5	0,04
EUR 3	Hellenic Telecommunications Organization SA	47	0,38
EUR 1	JUMBO SA	20	0,16
EUR 2	OPAP SA	19	0,16
		91	0,74
Hongkong — 0,71 % (29. Februar 2020: 0,89 %)			
HKD 38	Hanergy Mobile Energy Holding Group Co Ltd †∞		–
–	Hutchison China MediTech Ltd ADR	10	0,08
CNY 2	Luxshare Precision Industry Co Ltd	14	0,11
HKD 14	Nine Dragons Paper Holdings Ltd	16	0,13
HKD 26	Sino Biopharmaceutical Ltd	30	0,24
HKD 8	SSY Group Ltd	5	0,04
HKD 1	Vinda International Holdings Ltd	3	0,03
HKD 5	Wharf Holdings Ltd/The	10	0,08
		88	0,71
Ungarn — 0,49 % (29. Februar 2020: 1,07 %)			
HUF 2	OTP Bank Nyrt	60	0,49
Indien — 8,16 % (29. Februar 2020: 6,29 %)			
INR 3	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd	17	0,13
INR 2	Ambuja Cements Ltd	6	0,05
INR 1	Asian Paints Ltd	23	0,18
INR 1	Aurobindo Pharma Ltd	13	0,11
INR –	Avenue Supermarts Ltd, 144A	7	0,06
INR 1	Axis Bank Ltd	9	0,07
INR –	Bajaj Auto Ltd	13	0,10
INR –	Bajaj Finance Ltd	10	0,08
INR 1	Berger Paints India Ltd	5	0,04
INR 1	Bharat Petroleum Corp Ltd	4	0,03
INR 9	Bharti Airtel Ltd	66	0,53
INR 2	Bharti Infratel Ltd	6	0,05
INR 2	Biocon Ltd	8	0,07
INR –	Britannia Industries Ltd	4	0,03
INR 2	Cipla Ltd/India	18	0,14
INR 2	Container Corp Of India Ltd	9	0,07
INR 1	Dabur India Ltd	4	0,04
INR –	Divi's Laboratories Ltd	15	0,12
INR –	Dr Reddy's Laboratories Ltd	28	0,22
INR –	Eicher Motors Ltd	12	0,10
INR 14	GAIL India Ltd	18	0,14
INR 1	Godrej Consumer Products Ltd	7	0,06
INR 1	Grasim Industries Ltd	9	0,07
INR 2	Havells India Ltd	17	0,14
INR 1	HCL Technologies Ltd	13	0,11
INR 1	HDFC Life Insurance Co Ltd, 144A	5	0,04
INR –	Hero MotoCorp Ltd	11	0,09
INR 4	Hindalco Industries Ltd	10	0,08
INR 1	Hindustan Unilever Ltd	35	0,28
INR 1	Housing Development Finance Corp Ltd	35	0,28
INR 4	ICICI Bank Ltd	23	0,19
INR 2	Indraprastha Gas Ltd	10	0,08
INR –	Info Edge India Ltd	13	0,11
INR 4	Infosys Ltd	45	0,36
INR 1	InterGlobe Aviation Ltd, 144A	9	0,07
INR 6	ITC Ltd	15	0,12
INR 3	JSW Steel Ltd	10	0,08
INR –	Jubilant Foodworks Ltd	11	0,09
INR 3	Larsen & Toubro Ltd	42	0,33
INR 1	Lupin Ltd	14	0,11
INR 2	Mahindra & Mahindra Ltd	16	0,13
INR –	Maruti Suzuki India Ltd	31	0,25
INR –	Nestle India Ltd	8	0,07
INR 20	NTPC Ltd	27	0,21
INR 3	Oil & Natural Gas Corp Ltd	3	0,03
INR –	Pidilite Industries Ltd	7	0,06
INR –	Piramal Enterprises Ltd	7	0,06
INR 15	Power Grid Corp of India Ltd	38	0,30
INR 3	Reliance Industries Ltd	87	0,70
INR –	Shree Cement Ltd	9	0,07
INR 1	Siemens Ltd	10	0,08
INR 2	State Bank of India	5	0,04
INR 4	Sun Pharmaceutical Industries Ltd	25	0,20
INR 1	Tata Consultancy Services Ltd	29	0,23
INR 7	Tata Motors Ltd	13	0,10
INR 1	Tata Steel Ltd	7	0,06
INR 1	Titan Co Ltd	10	0,08
INR –	Torrent Pharmaceuticals Ltd	9	0,07
INR –	UltraTech Cement Ltd	16	0,13
INR 1	United Spirits Ltd	4	0,03
INR 2	UPL Ltd	10	0,08
INR 4	Vedanta Ltd	8	0,06
INR 3	Zee Entertainment Enterprises Ltd	9	0,07
		1.017	8,16
Indonesien — 4,05 % (29. Februar 2020: 4,62 %)			
IDR 84	Ace Hardware Indonesia Tbk PT	9	0,07
IDR 192	Adaro Energy Tbk PT	14	0,11
IDR 236	Astra International Tbk PT	83	0,67
IDR 22	Bank Central Asia Tbk PT	46	0,37
IDR 45	Bank Mandiri Persero Tbk PT	19	0,15
IDR 19	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	7	0,05
IDR 128	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	31	0,25
IDR 366	Barito Pacific Tbk PT	21	0,17
IDR 46	Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT	20	0,16
IDR 4	Gudang Garam Tbk PT	13	0,10
IDR 73	Hanjaya Mandala Sampoerna Tbk PT	8	0,07
IDR 36	Indah Kiat Pulp & Paper Corp Tbk PT	23	0,18
IDR 20	Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT	16	0,13
IDR 16	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	11	0,09
IDR 35	Indofood Sukses Makmur Tbk PT	18	0,15
IDR 45	Semen Indonesia Persero Tbk PT	33	0,26
IDR 352	Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT	69	0,56
IDR 45	Unilever Indonesia Tbk PT	26	0,21
IDR 22	United Tractors Tbk PT	34	0,27
IDR 26	XL Axiata Tbk PT	4	0,03
		505	4,05
Malaysia — 6,67 % (29. Februar 2020: 4,08 %)			
MYR 29	Axiata Group Bhd	21	0,17
MYR 1	Carlsberg Brewery Malaysia Bhd	6	0,05
MYR 23	CIMB Group Holdings Bhd	18	0,14
MYR 75	Dialog Group Bhd	65	0,52
MYR 31	DiGi.Com Bhd	30	0,24
MYR 1	Fraser & Neave Holdings Bhd	6	0,05
MYR 13	Gamuda Bhd	11	0,08
MYR 52	Genting Bhd	44	0,35
MYR 71	Genting Malaysia Bhd	39	0,31
MYR 6	HAP Seng Consolidated Bhd	10	0,08
MYR 12	Hartalega Holdings Bhd	47	0,38
MYR 2	Hong Leong Bank Bhd	6	0,04
MYR 13	IHH Healthcare Bhd	17	0,14
MYR 20	IJM Corp Bhd	6	0,05
MYR 14	IOI Corp Bhd	15	0,12
MYR 2	Kuala Lumpur Kepong Bhd	10	0,08
MYR 12	Malayan Banking Bhd	21	0,17
MYR 11	Malaysia Airports Holdings Bhd	13	0,11
MYR 23	Maxis Bhd	28	0,22
MYR 12	MISC Bhd	23	0,18
MYR –	Nestle Malaysia Bhd	10	0,04
MYR 44	Petronas Chemicals Group Bhd	57	0,46
MYR 6	Petronas Dagangan Bhd	29	0,23
MYR 7	Petronas Gas Bhd	27	0,22
MYR 3	PPB Group Bhd	13	0,11
MYR 26	Press Metal Aluminium Holdings Bhd	32	0,26
MYR 9	Public Bank Bhd	36	0,28
MYR 4	QL Resources Bhd	10	0,08
MYR 7	RHB Bank Bhd	7	0,06
MYR 25	Sime Darby Bhd	13	0,11
MYR 11	Sime Darby Plantation Bhd	14	0,11
MYR 14	Telekom Malaysia Bhd	14	0,11
MYR 20	Tenaga Nasional Bhd	52	0,42
MYR 11	Top Glove Corp Bhd	68	0,55
MYR 10	Westports Holdings Bhd	8	0,07
MYR 29	YTL Corp Bhd	5	0,04
		831	6,67
Mexiko — 2,78 % (29. Februar 2020: 2,22 %)			
MXN 20	Alfa SAB de CV	13	0,10
MXN 87	America Movil SAB de CV	53	0,43
MXN 1	Arca Continental SAB de CV	4	0,03
MXN 75	Cemex SAB de CV	24	0,19
MXN 2	Coca-Cola Femsa SAB de CV	6	0,05
MXN 4	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	20	0,16
MXN –	Gruma SAB de CV	5	0,04
MXN 3	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	23	0,19
MXN 2	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	19	0,15
MXN 3	Grupo Bimbo SAB de CV	6	0,04
MXN 3	Grupo Carso SAB de CV	5	0,04
MXN 16	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	53	0,43
MXN 16	Grupo Financiero Inbursa SAB de CV	12	0,10
MXN 15	Grupo Mexico SAB de CV	39	0,31
MXN 6	Grupo Televisa SAB	8	0,06
MXN 1	Industrias Penoles SAB de CV	12	0,10
MXN 3	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	5	0,04
MXN 5	Orbia Advance Corp SAB de CV	7	0,06
MXN 2	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	11	0,09
MXN 9	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	21	0,17
		346	2,78
Peru — 0,78 % (29. Februar 2020: 0,65 %)			
2	Cia de Minas Buenaventura SAA ADR	24	0,19
–	Credicorp Ltd	39	0,32
1	Southern Copper Corp	34	0,27
		97	0,78
Philippinen — 2,87 % (29. Februar 2020: 2,13 %)			
PHP 13	Aboitiz Equity Ventures Inc	13	0,11
PHP –	Altus Property Ventures Inc	-	-
PHP 2	Ayala Corp	25	0,20

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — (Fortsetzung)			
Philippinen — (Fortsetzung)			
PHP	53 Ayala Land Inc	32	0,25
PHP	11 Bank of the Philippine Islands	15	0,12
PHP	23 BDO Unibank Inc	41	0,33
PHP	1 Globe Telecom Inc	37	0,30
PHP	1 GT Capital Holdings Inc	5	0,04
PHP	6 International Container Terminal Services Inc	13	0,11
PHP	14 JG Summit Holdings Inc	19	0,15
PHP	72 Megaworld Corp	4	0,03
PHP	131 Metro Pacific Investments Corp	9	0,07
PHP	22 Metropolitan Bank & Trust Co	15	0,12
PHP	2 PLDT Inc	67	0,53
PHP	11 Robinsons Land Corp	3	0,03
PHP	1 SM Investments Corp	20	0,16
PHP	66 SM Prime Holdings Inc	40	0,32
		358	2,87
Polen — 1,71 % (29. Februar 2020: 1,83 %)			
PLN	1 Bank Polska Kasa Opieki SA	14	0,11
PLN	– CD Projekt SA	59	0,48
PLN	2 Cyfrowy Polsat SA	15	0,12
PLN	1 Grupa Lotos SA	7	0,05
PLN	– mBank SA	3	0,03
PLN	4 Orange Polska SA	8	0,07
PLN	2 Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	34	0,27
PLN	16 Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo SA	23	0,18
PLN	4 Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	24	0,19
PLN	3 Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	20	0,16
PLN	– Santander Bank Polska SA	6	0,05
		213	1,71
Katar — 0,73 % (29. Februar 2020: 1,01 %)			
QAR	19 Industries Qatar QSC	52	0,42
QAR	5 Masraf Al Rayan QSC	6	0,04
QAR	2 Qatar Islamic Bank SAQ	7	0,06
QAR	5 Qatar National Bank QPSC	26	0,21
		91	0,73
Rumänien — 0,14 % (29. Februar 2020: 0,24 %)			
ZAR	4 NEPI Rockcastle Plc	18	0,14
Russland — 3,42 % (29. Februar 2020: 2,62 %)			
	6 Alrosa PJSC	5	0,04
	4 Gazprom PJSC ADR	20	0,17
	– LUKOIL PJSC	22	0,17
	4 Magnit PJSC GDR	52	0,41
	1 MMC Norilsk Nickel PJSC ADR	36	0,29
	9 Mobile TeleSystems PJSC ADR	85	0,68
	5 Moscow Exchange MICEX-RTS PJSC	10	0,08
	– Novatek PJSC GDR	11	0,09
	2 Novolipetsk Steel PJSC	5	0,04
	1 PhosAgro PJSC GDR	7	0,05
RUB	1 Polymetal International Plc	15	0,12
RUB	– Polyus PJSC	18	0,15
	1 Rosneft Oil Co PJSC GDR	4	0,03
	25 Sberbank of Russia PJSC	75	0,60
	1 Severstal PJSC	7	0,06
	1 Tatneft PJSC	6	0,05
	11.340 VTB Bank PJSC	5	0,04
	1 X5 Retail Group NV GDR	44	0,35
		427	3,42
Südafrika — 2,80 % (29. Februar 2020: 6,91 %)			
ZAR	– Anglo American Platinum Ltd	9	0,07
ZAR	4 Aspen Pharmacare Holdings Ltd	30	0,24
ZAR	1 Bid Corp Ltd	14	0,11
ZAR	1 Clicks Group Ltd	9	0,07
ZAR	3 FirstRand Ltd	7	0,06
ZAR	2 Gold Fields Ltd	26	0,21
ZAR	2 Impala Platinum Holdings Ltd	17	0,14
ZAR	– Kumba Iron Ore Ltd	4	0,03
ZAR	15 Life Healthcare Group Holdings Ltd	14	0,11
ZAR	6 MTN Group Ltd	21	0,17
ZAR	2 MultiChoice Group	9	0,07
ZAR	– Naspers Ltd	89	0,72
ZAR	1 Nedbank Group Ltd	5	0,04
ZAR	1 Northam Platinum Ltd	11	0,09
ZAR	8 Old Mutual Ltd	6	0,04
ZAR	2 Sanlam Ltd	6	0,05
ZAR	1 Sasol Ltd	10	0,08
ZAR	1 Shoprite Holdings Ltd	9	0,07
ZAR	5 Sibanye Stillwater Ltd	16	0,13
ZAR	1 SPAR Group Ltd/The	6	0,04
ZAR	1 Standard Bank Group Ltd	8	0,07
ZAR	– Tiger Brands Ltd	4	0,04
ZAR	2 Vodacom Group Ltd	15	0,12
ZAR	2 Woolworths Holdings Ltd/South Africa	4	0,03
		349	2,80
Südkorea — 7,65 % (29. Februar 2020: 7,15 %)			
KRW	– Amorepacific Corp	15	0,12
KRW	– Celltrion Healthcare Co Ltd	12	0,09
KRW	– Celltrion Inc	48	0,39
KRW	– Celltrion Pharm Inc	3	0,03
KRW	– CJ CheilJedang Corp	10	0,08
KRW	– Coway Co Ltd	9	0,07
KRW	– Daelim Industrial Co Ltd	6	0,05
KRW	– E-MART Inc	8	0,06
KRW	1 GS Holdings Corp	14	0,12
KRW	1 Hana Financial Group Inc	13	0,10
KRW	– Hanmi Pharm Co Ltd	6	0,05
KRW	– Helixmith Co Ltd	5	0,04
KRW	– HLB Inc	5	0,04
KRW	– Hyundai Engineering & Construction Co Ltd	9	0,08
KRW	– Hyundai Heavy Industries Holdings Co Ltd	7	0,05
KRW	– Hyundai Mobis Co Ltd	20	0,16
KRW	– Hyundai Motor Co	37	0,30
KRW	– Kakao Corp	38	0,31
KRW	– Kangwon Land Inc	5	0,04
KRW	1 KB Financial Group Inc	21	0,17
KRW	– Kia Motors Corp	13	0,10
KRW	– Korea Aerospace Industries Ltd	7	0,06
KRW	5 Korea Electric Power Corp	81	0,65
KRW	– Korea Gas Corp	9	0,08
KRW	– Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	5	0,04
KRW	– Korea Zinc Co Ltd	8	0,06
KRW	– KT&G Corp	22	0,17
KRW	– LG Chem Ltd	62	0,49
KRW	– LG Corp	13	0,11
KRW	– LG Electronics Inc	15	0,12
KRW	– LG Household & Health Care Ltd	31	0,25
KRW	1 LG Uplus Corp	7	0,05
KRW	– Lotte Chemical Corp	7	0,06
KRW	– NAVER Corp	59	0,47
KRW	– NCSoft Corp	20	0,16
KRW	– Orion Corp/Republic of Korea	9	0,07
KRW	– POSCO	25	0,20
KRW	– Samsung Biologics Co Ltd, 144A	22	0,17
KRW	– Samsung C&T Corp	14	0,11
KRW	1 Samsung Electronics Co Ltd	53	0,42
KRW	– Samsung Fire & Marine Insurance Co Ltd	5	0,04
KRW	1 Samsung Heavy Industries Co Ltd	6	0,05
KRW	– Samsung Life Insurance Co Ltd	10	0,08
KRW	– Samsung SDI Co Ltd	9	0,07
KRW	1 Shinhan Financial Group Co Ltd	18	0,15
KRW	– SK Holdings Co Ltd	12	0,10
KRW	– SK Hynix Inc	11	0,09
KRW	– SK Innovation Co Ltd	60	0,48
KRW	– SK Telecom Co Ltd	9	0,07
KRW	– S-Oil Corp	21	0,17
KRW	1 Woori Financial Group Inc	8	0,07
KRW	– Yuhan Corp	11	0,09
		953	7,65
Taiwan — 6,93 % (29. Februar 2020: 4,21 %)			
TWD	5 Asia Cement Corp	7	0,06
TWD	7 Cathay Financial Holding Co Ltd	9	0,08
TWD	2 Chailease Holding Co Ltd	9	0,07
TWD	7 Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	9	0,07
TWD	30 China Airlines Ltd	9	0,07
TWD	24 China Development Financial Holding Corp	7	0,06
TWD	24 China Steel Corp	17	0,13
TWD	13 Chunghwa Telecom Co Ltd	48	0,39
TWD	20 CTBC Financial Holding Co Ltd	13	0,10
TWD	12 E.Sun Financial Holding Co Ltd	11	0,09
TWD	1 Eclat Textile Co Ltd	14	0,11
TWD	25 Eva Airways Corp	10	0,08
TWD	31 Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd	18	0,15
TWD	30 Far Eastern New Century Corp	27	0,22
TWD	6 Far EasTone Telecommunications Co Ltd	13	0,10
TWD	2 Feng TAY Enterprise Co Ltd	14	0,11
TWD	12 First Financial Holding Co Ltd	9	0,07
TWD	8 Formosa Chemicals & Fibre Corp	19	0,15
TWD	30 Formosa Petrochemical Corp	84	0,67
TWD	9 Formosa Plastics Corp	24	0,19
TWD	5 Formosa Taffeta Co Ltd	5	0,04
TWD	9 Fubon Financial Holding Co Ltd	13	0,10
TWD	2 Giant Manufacturing Co Ltd	21	0,17
TWD	2 Hiwin Technologies Corp	26	0,21
TWD	3 Hon Hai Precision Industry Co Ltd	8	0,07
TWD	2 Hotai Motor Co Ltd	41	0,33
TWD	11 Hua Nan Financial Holdings Co Ltd	6	0,05
TWD	1 MediaTek Inc	19	0,15
TWD	10 Mega Financial Holding Co Ltd	10	0,08
TWD	12 Nan Ya Plastics Corp	25	0,20
TWD	1 Nien Made Enterprise Co Ltd	12	0,09
TWD	17 Pou Chen Corp	16	0,13
TWD	3 President Chain Store Corp	28	0,22
TWD	5 Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd/The	7	0,06
TWD	20 SinoPac Financial Holdings Co Ltd	8	0,06
TWD	3 Standard Foods Corp	6	0,05
TWD	15 Taishin Financial Holding Co Ltd	7	0,06
TWD	11 Taiwan Cement Corp	15	0,12
TWD	9 Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	6	0,05
TWD	19 Taiwan High Speed Rail Corp	21	0,17
TWD	6 Taiwan Mobile Co Ltd	21	0,17
TWD	6 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	87	0,70
TWD	13 Tatung Co Ltd	8	0,06
TWD	29 Uni-President Enterprises Corp	66	0,53
TWD	17 Yuanta Financial Holding Co Ltd	11	0,09
		864	6,93
Thailand — 6,36 % (29. Februar 2020: 8,00 %)			
THB	7 Advanced Info Service PCL ∞	39	0,32
THB	27 Airports of Thailand PCL	49	0,39
THB	83 Asset World Corp PCL	10	0,08
THB	6 B Grimm Power PCL	8	0,07
THB	2 Bangkok Bank PCL	7	0,06
THB	11 Bangkok Commercial Asset Management PCL	8	0,07
THB	87 Bangkok Dusit Medical Services PCL	58	0,47
THB	47 Bangkok Expressway & Metro PCL	14	0,11
THB	4 Berli Jucker PCL	5	0,04
THB	59 BTS Group Holdings PCL	20	0,16
THB	4 Bumrungrad Hospital PCL	14	0,11
THB	35 Central Pattana PCL	53	0,43
THB	21 Central Retail Corp PCL, 144A	20	0,16
THB	13 Charoen Pokphand Foods PCL ∞	14	0,11
THB	22 CP ALL PCL ∞	44	0,35
THB	2 Electricity Generating PCL	14	0,11
THB	10 Energy Absolute PCL	14	0,11
THB	5 Global Power Synergy PCL	10	0,08
THB	14 Gulf Energy Development PCL	14	0,11
THB	26 Home Product Center PCL	12	0,10
THB	44 Home Product Center PCL ∞	21	0,17
THB	11 Indorama Ventures PCL	8	0,07
THB	13 Intouch Holdings PCL	23	0,18
THB	60 IRPC PCL	5	0,04
THB	5 Kasikornbank PCL	13	0,10
THB	5 Kasikornbank PCL	13	0,10
THB	25 Krung Thai Bank PCL ∞	8	0,06
THB	6 Krungthai Card PCL	6	0,05
THB	131 Land & Houses PCL	31	0,25
THB	18 Minor International PCL	13	0,11
THB	21 Minor International PCL ∞	15	0,12
THB	5 Muangthai Capital PCL	9	0,07
THB	3 Osotspa PCL	3	0,03
THB	6 PTT Exploration & Production PCL	16	0,13
THB	8 PTT Global Chemical PCL	11	0,09
THB	8 PTT Global Chemical PCL ∞	11	0,09
THB	19 PTT PCL ∞	23	0,18
THB	24 PTT PCL	28	0,22
THB	6 Ratch Group PCL	10	0,08
THB	4 Siam Cement PCL/The	49	0,39
THB	4 Siam Commercial Bank PCL/The ∞	10	0,08
THB	4 Srisawad Corp PCL	6	0,05

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — (Fortsetzung)				
Thailand — (Fortsetzung)				
THB	6	Thai Oil PCL	8	0,06
THB	12	Thai Union Group PCL ∞	6	0,04
THB	149	TMB Bank PCL	5	0,04
THB	6	Total Access Communication PCL	7	0,06
THB	72	True Corp PCL ∞	8	0,06
			793	6,36
Türkei — 1,67 % (29. Februar 2020: 2,42 %)				
TRY	30	Akbank T.A.S.	20	0,16
TRY	4	Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS	11	0,09
TRY	7	BIM Birlesik Magazalar AS	69	0,55
TRY	13	Haci Omer Sabanci Holding AS	14	0,11
TRY	13	KOC Holding AS	26	0,21
TRY	4	TAV Havalimanlari Holding AS	7	0,06
TRY	11	Turk Hava Yollari AO	16	0,13
TRY	25	Turkiye Garanti Bankasi AS	23	0,19
TRY	17	Turkiye Is Bankasi AS	12	0,09
TRY	37	Yapi ve Kredi Bankasi AS	10	0,08
			208	1,67
Vereinigte Arabische Emirate — 2,03 % (29. Februar 2020: 1,06 %)				
AED	19	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	28	0,22
AED	84	Aldar Properties PJSC	47	0,38
AED	13	Dubai Islamic Bank PJSC	14	0,12
AED	59	Emaar Malls PJSC	22	0,18
AED	76	Emaar Properties PJSC	60	0,48
AED	9	Emirates NBD Bank PJSC	25	0,20
AED	18	First Abu Dhabi Bank PJSC	57	0,45
			253	2,03
Vereinigte Republik Tansania — 0,22 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
ZAR	1	AngloGold Ashanti Ltd	28	0,22
USA — 0,05 % (29. Februar 2020: 0,13 %)				
BRL	2	JBS SA	6	0,05
Stammaktien insgesamt (Kosten 11.646 USD)			12.059	96,79
Vorzugsaktien — 1,57 % (29. Februar 2020: 2,69 %)				
Brasilien — 0,69 % (29. Februar 2020: 1,99 %)				
BRL	3	Banco Bradesco SA	10	0,08
BRL	3	Cia Energetica de Minas Gerais	6	0,05
BRL	2	Itau Unibanco Holding SA	11	0,09
BRL	2	Itausa SA	4	0,03
BRL	1	Lojas Americanas SA	8	0,06
BRL	5	Petroleo Brésileiro SA	22	0,17
BRL	3	Telefonica Brésil SA	25	0,21
			86	0,69
Chile — 0,45 % (29. Februar 2020: 0,26 %)				
CLP	3	Embotelladora Andina SA	6	0,05
CLP	2	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'B'	50	0,40
			56	0,45
Kolumbien — 0,29 % (29. Februar 2020: 0,27 %)				
COP	5	Bancolombia SA	36	0,29
Südkorea — 0,14 % (29. Februar 2020: 0,17 %)				
KRW	–	LG Chem Ltd	7	0,06
KRW	–	Samsung Electronics Co Ltd	10	0,08
			17	0,14
Vorzugsaktien insgesamt (Kosten 215 USD)			195	1,57
Immobilieninvestmentgesellschaften — 0,17 % (29. Februar 2020: 1,14 %)				
Südafrika — 0,17 % (29. Februar 2020: 0,56 %)				
ZAR	29	Growthpoint Properties Ltd	21	0,17
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 37 USD)			21	0,17
Bezugsrechte — 0,00 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
Thailand — 0,00 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
THB	1	Gulf Energy Development PCL (Rights)	–	–
Bezugsrechte insgesamt (Kosten –USD)			–	–
Warrants — 0,00 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
Thailand — 0,00 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
THB	2	Minor International PCL ∞	1	–
THB	–	Srisawad Corporation PCL ∞		–
			1	–
Gewährleistungsfrist gesamt (Anschaffungskosten –USD)			1	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 11.898 USD)			12.276	98,53
Termingeschäfte — 0,16 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			19	0,16
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			12.295	98,69
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt			12.295	98,69
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			164	1,31
Gesamtnettovermögen			12.459$	100,00

–	Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.
144A	Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 368,000 USD und machten 2.95 % des Nettovermögens aus.
†	Illiquide.
∞	Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

ABKÜRZUNGEN:

ADR	– American Depositary Receipt
GDR	– Hinterlegungsschein für ausländische Aktien
AED	– Dirham des Emirats Arabes Unis
BRL	– Brasilianischer Real
CLP	– Chilenischer Peso
CNY	– Chinesischer Renminbi
COP	– Kolumbianischer Peso
EGP	– Ägyptisches Pfund
EUR	– Euro
HKD	– Hongkong-Dollar
HUF	– Ungarischer Forint
IDR	– Indonesische Rupiah
INR	– Indische Rupie
KRW	– Südkoreanischer Won
MXN	– Mexikanischer Peso
MYR	– Malaysischer Ringgit
PHP	– Philippinischer Peso
PLN	– Polnischer Zloty
QAR	– Riyal qatari
RUB	– Russischer Rubel
THB	– Thai Baht
TRY	– Türkische Lira
TWD	– Taiwanesischer Dollar
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt-vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,01
Finanzderivate	0,15
Sonstige Vermögenswerte	1,40
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/(Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Mini MSCI Emerging Markets Index September 2020	3	$ 165	$ 19
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): - USD)			$ 19
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.):(20) USD)			-
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (20) USD)			$ 19

Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 94,39 % (29. Februar 2020: 87,85 %)			
Australien — 1,19 % (29. Februar 2020: 2,78 %)			
AUD 47	Aurizon Holdings Ltd	149	1,19
Autriche — 1,08 % (29. Februar 2020: 0,96 %)			
EUR 4	Oesterreichische Post AG	135	1,08
Brasilien — 0,71 % (29. Februar 2020: 0,99 %)			
BRL 23	Petrobras Distribuidora SA	89	0,71
Kanada — 2,80 % (29. Februar 2020: 3,97 %)			
CAD 2	Canadian Imperial Bank of Commerce	159	1,27
CAD 5	Canadian Utilities Ltd	123	0,98
CAD 3	Genworth MI Canada Inc	68	0,55
		350	2,80
China — 6,31 % (29. Februar 2020: 5,18 %)			
HKD 17	China Mobile Ltd	115	0,92
HKD 266	China Petroleum & Chemical Corp	122	0,98
HKD 102	CITIC Ltd	93	0,74
1	CNOOC Ltd ADR	90	0,72
HKD 140	Huaneng Power International Inc	58	0,47
HKD 252	Huishang Bank Corp Ltd	83	0,67
HKD 185	Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	88	0,70
HKD 33	Sunac China Holdings Ltd	139	1,11
		788	6,31
Finnland — 1,00 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 3	Orion Oyj	124	1,00
Frankreich — 2,53 % (29. Februar 2020: 2,50 %)			
EUR 2	Sanofi	213	1,70
EUR 4	SCOR SE	104	0,83
		317	2,53
Deutschland — 3,94 % (29. Februar 2020: 3,59 %)			
EUR 8	Deutsche Telekom AG	140	1,12
EUR 1	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	230	1,84
EUR 3	Talanx AG	123	0,98
		493	3,94
Grèce — 0,88 % (29. Februar 2020: 0,96 %)			
EUR 8	Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA	110	0,88
Hongkong — 2,41 % (29. Februar 2020: 2,03 %)			
HKD 146	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	164	1,31
HKD 96	HKT Trust & HKT Ltd	137	1,10
		301	2,41
Italien — 1,40 % (29. Februar 2020: 1,44 %)			
EUR 8	Assicurazioni Generali SpA	128	1,03
EUR 9	Snam SpA	47	0,37
		175	1,40
Japan — 10,57 % (29. Februar 2020: 8,87 %)			
JPY 1	Daito Trust Construction Co Ltd	89	0,71
JPY 6	KDDI Corp	163	1,30
JPY 24	Marubeni Corp	142	1,14
JPY 22	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	129	1,03
JPY –	Nintendo Co Ltd	108	0,86
JPY 7	Nippon Telegraph & Telephone Corp	150	1,20
JPY 5	NTT DOCOMO Inc	133	1,07
JPY 11	SoftBank Corp	140	1,12
JPY 4	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	124	0,99
JPY 14	Tohoku Electric Power Co Inc	144	1,15
		1.322	10,57
Malaysia — 1,69 % (29. Februar 2020: 2,02 %)			
MYR 428	Astro Malaysia Holdings Bhd	79	0,63
MYR 75	Malayan Banking Bhd	132	1,06
		211	1,69
Mexiko — 1,22 % (29. Februar 2020: 1,00 %)			
MXN 57	Grupo Mexico SAB de CV	153	1,22
Niederlande — 1,16 % (29. Februar 2020: 0,00 %)			
EUR 5	Koninklijke Ahold Delhaize NV	145	1,16
Nouvelle-Zélande — 1,87 % (29. Februar 2020: 2,70 %)			
NZD 84	Genesis Energy Ltd	170	1,36
NZD 35	Z Energy Ltd	64	0,51
		234	1,87
Norwegen — 0,88 % (29. Februar 2020: 2,25 %)			
NOK 12	Austevoll Seafood ASA	110	0,88
Russland — 0,74 % (29. Februar 2020: 0,86 %)			
19	Gazprom PJSC ADR	93	0,74
Singapur — 1,17 % (29. Februar 2020: 1,56 %)			
SGD 10	Venture Corp Ltd	146	1,17
Spanien — 4,34 % (29. Februar 2020: 4,13 %)			
EUR 5	Enagas SA	125	1,00
EUR 7	Endesa SA	181	1,45
EUR 5	Naturgy Energy Group SA	98	0,78
EUR 7	Red Electrica Corp SA	138	1,11
		542	4,34
Schweden — 1,76 % (29. Februar 2020: 1,54 %)			
SEK 16	Skandinaviska Enskilda Banken AB	162	1,30
SEK 3	Swedbank AB	58	0,46
		220	1,76
Schweiz — 2,91 % (29. Februar 2020: 2,72 %)			
CHF 1	Roche Holding AG	245	1,96
CHF 1	Swiss Re AG	119	0,95
		364	2,91
Taiwan — 4,73 % (29. Februar 2020: 3,08 %)			
TWD 85	Asia Cement Corp	123	0,99
TWD 142	King Yuan Electronics Co Ltd	151	1,21
TWD 46	Radiant Opto-Electronics Corp	170	1,35
TWD 13	Simplo Technology Co Ltd	147	1,18
		591	4,73
Türkei — 0,92 % (29. Februar 2020: 0,95 %)			
TRY 96	Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	115	0,92
Großbritannien — 3,53 % (29. Februar 2020: 5,54 %)			
GBP 39	Direct Line Insurance Group Plc	156	1,25
GBP 7	GlaxoSmithKline Plc	144	1,15
GBP 6	Imperial Brands Plc	93	0,74
GBP 17	Legal & General Group Plc	48	0,39
		441	3,53
USA — 32,65 % (29. Februar 2020: 25,86 %)			
2	AbbVie Inc	198	1,58
8	AES Corp/The	145	1,16
3	Altria Group Inc	122	0,97
1	Amgen Inc	198	1,59
4	AT&T Inc	125	1,00
3	Brinker International Inc	125	1,00
3	Bristol-Myers Squibb Co	174	1,39
1	Broadcom Inc	197	1,58
2	Cisco Systems Inc	105	0,84
1	Clorox Co/The	156	1,25
3	CVS Health Corp	158	1,26
5	Flowers Foods Inc	125	1,00
12	Ford Motor Co	83	0,67
2	General Mills Inc	141	1,13
3	Gilead Sciences Inc	175	1,40
7	H&R Block Inc	104	0,83
1	Hershey Co/The	149	1,19
1	International Business Machines Corp	154	1,23
1	Kimberly-Clark Corp	143	1,15
4	Kroger Co/The	136	1,08
–	Lockheed Martin Corp	177	1,42
5	Pfizer Inc	199	1,59
1	Pinnacle West Capital Corp	59	0,47
2	Prudential Financial Inc	108	0,87
2	Southern Co/The	83	0,67
2	Target Corp	242	1,93
2	Valero Energy Corp	95	0,76
1	Walmart Inc	205	1,64
		4.081	32,65
Stammaktien insgesamt (Kosten 11.932 USD)		11.799	94,39
Immobilieninvestmentgesellschaften — 5,22 % (29. Februar 2020: 7,57 %)			
Frankreich — 0,60 % (29. Februar 2020: 1,01 %)			
EUR 5	Klepierre SA	74	0,60
Singapur — 1,01 % (29. Februar 2020: 2,19 %)			
SGD 90	Mapletree Commercial Trust	127	1,01
USA — 3,61 % (29. Februar 2020: 4,37 %)			
5	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A'	108	0,87
8	Kimco Realty Corp	94	0,75
1	Public Storage	149	1,19
6	Starwood Property Trust Inc	100	0,80
		451	3,61
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 788 USD)		652	5,22
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 12.720 USD)		12.451	99,61
Devisenterminkontrakte — 0,17 % (29. Februar 2020: 0,12 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		21	0,17
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		12.472	99,78
Devisenterminkontrakte — (0,07 %) (29. Februar 2020: (0,51 %))			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(9)	(0,07)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		(9)	(0,07)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt		12.463	99,71
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		37	0,29
Gesamtnettovermögen		12.500 $	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 88.000 USD o el 0,70 % del patrimonio neto.

ABKÜRZUNGEN:

ADR	– American Depositary Receipt
AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
CAD	– Kanadischer Dollar
CHF	– Schweizer Franke
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund
HKD	– Hongkong-Dollar
JPY	– Japanischer Yen
MXN	– Mexikanischer Peso
MYR	– Malaysischer Ringgit
NOK	– Norwegische Krone
NZD	– Neuseeländischer Dollar
SEK	– Schwedische Krone
SGD	– Singapur-Dollar
TRY	– Türkische Lira
TWD	– Taiwanesischer Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,78
Finanzderivate	0,17
Sonstige Vermögenswerte	1,05
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	3	Verkauf	AUD	4	$ –
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf	SGD	7	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	53	Verkauf	USD	38	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	975	Verkauf	USD	699	21
18.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	366	Verkauf	GBP	277	(4)
18.09.2020	Citi	Kauf	USD	272	Verkauf	CAD	359	(3)
18.09.2020	Northern Trust	Kauf	USD	1.708	Verkauf	EUR	1.432	(2)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 16 USD)								$ 21
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (68) USD)								(9)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (52) USD)								$ 12

Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 96,24 % (29. Februar 2020: 95,83 %)				
China — 42,39 % (29. Februar 2020: 41,14 %)				
HKD	130	Alibaba Group Holding Ltd	4.663	7,48
	8	Alibaba Group Holding Ltd ADR	2.156	3,46
HKD	218	China Mobile Ltd	1.525	2,45
HKD	927	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	2.050	3,29
HKD	179	ENN Energy Holdings Ltd	1.986	3,19
HKD	1.282	Guangdong Investment Ltd	2.004	3,21
HKD	522	Minth Group Ltd	1.758	2,82
HKD	220	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2.343	3,76
HKD	84	Shenzhou International Group Holdings Ltd	1.348	2,16
HKD	81	Tencent Holdings Ltd	5.523	8,86
HKD	513	TravelSky Technology Ltd	1.065	1,71
			26.421	42,39
Hongkong — 8,47 % (29. Februar 2020: 9,67 %)				
HKD	258	AIA Group Ltd	2.644	4,24
	25	Jardine Matheson Holdings Ltd	1.033	1,66
HKD	126	Techtronic Industries Co Ltd	1.599	2,57
			5.276	8,47
Indien — 12,85 % (29. Februar 2020: 10,97 %)				
INR	97	Godrej Consumer Products Ltd	857	1,38
INR	159	HDFC Bank Ltd	2.403	3,86
	9	HDFC Bank Ltd ADR	428	0,69
INR	61	Hero MotoCorp Ltd	2.502	4,01
INR	60	Tata Consultancy Services Ltd	1.817	2,91
			8.007	12,85
Singapur — 8,46 % (29. Februar 2020: 9,20 %)				
SGD	781	Singapore Technologies Engineering Ltd	1.955	3,14
SGD	135	United Overseas Bank Ltd	1.941	3,11
SGD	94	Venture Corp Ltd	1.376	2,21
			5.272	8,46

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Südkorea — 15,36 % (29. Februar 2020: 13,31 %)				
KRW	36	Coway Co Ltd	2.430	3,90
KRW	2	LG Household & Health Care Ltd	2.000	3,21
KRW	8	Orion Corp/Republic of Korea	929	1,49
KRW	93	Samsung Electronics Co Ltd	4.214	6,76
			9.573	15,36
Taiwan — 7,61 % (29. Februar 2020: 5,96 %)				
TWD	325	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	4.740	7,61
Thailand — 1,10 % (29. Februar 2020: 1,99 %)				
THB	295	Siam Commercial Bank PCL/ The ∞	688	1,10
Stammaktien insgesamt (Kosten 52.082 USD)			59.977	96,24
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 52.082 USD)			59.977	96,24
Devisenterminkontrakte — 0,05 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			29	0,05
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			60.006	96,29
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt			60.006	96,29
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			2.318	3,71
Gesamtnettovermögen			62.324 $	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert durch oder nach Ermessen des Managers oder des jeweiligen Anlageverwalters.

ABKÜRZUNGEN:

ADR	– American Depositary Receipt
HKD	– Hongkong-Dollar
INR	– Indische Rupie
KRW	– Südkoreanischer Won
SGD	– Singapur-Dollar
THB	– Thailändischer Baht
TWD	– Taiwanesischer Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	70,96
Finanzderivate	0,03
Sonstige Vermögenswerte	29,01
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	229	Verkauf	GBP	172	$ –
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	16.314	Verkauf	USD	21.779	29
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								$ 29
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								–
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								$ 29

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) €	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 65,60 % (29. Februar 2020: 86,57 %)				
Dänemark — 8,18 % (29. Februar 2020: 5,67 %)				
DKK	17	Carlsberg AS	1.965	1,88
DKK	13	DSV PANALPINA A/S	1.652	1,58
DKK	60	Novo Nordisk A/S	3.300	3,15
DKK	19	Royal Unibrew A/S	1.644	1,57
			8.561	8,18
Faroer-Inseln — 3,83 % (29. Februar 2020: 2,29 %)				
NOK	76	Bakkafrost P/F	4.005	3,83
Frankreich — 12,93 % (29. Februar 2020: 13,22 %)				
	91	Bureau Veritas SA	1.726	1,65
	91	Cie de Saint-Gobain	3.090	2,95
	12	Dassault Systemes SE	1.952	1,87
	70	La Francaise des Jeux SAEM, 144A	2.171	2,08
	54	Sanofi	4.584	4,38
			13.523	12,93
Deutschland — 5,47 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
	60	HeidelbergCement AG	3.182	3,04
	17	Volkswagen AG	2.540	2,43
			5.722	5,47
Ungarn — 3,25 % (29. Februar 2020: 4,16 %)				
HUF	120	OTP Bank Nyrt	3.402	3,25
Irland — 2,70 % (29. Februar 2020: 1,49 %)				
	90	CRH Plc	2.827	2,70
Italien — 3,14 % (29. Februar 2020: 5,81 %)				
	427	Poste Italiane SpA, 144A	3.287	3,14
Niederlande — 1,50 % (29. Februar 2020: 6,38 %)				
	42	JDE Peet's BV	1.563	1,50
Schweden — 3,72 % (29. Februar 2020: 7,81 %)				
SEK	25	Autoliv Inc	1.684	1,61
SEK	226	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	2.208	2,11
			3.892	3,72
Schweiz — 13,01 % (29. Februar 2020: 12,98 %)				
CHF	70	Novartis AG	5.034	4,81
CHF	1	SGS SA	1.567	1,50
CHF	11	Sika AG	2.142	2,05
	62	STMicroelectronics NV	1.576	1,51
CHF	9	Temenos AG	1.285	1,23
CHF	32	Vontobel Holding AG	2.003	1,91
			13.607	13,01
Türkei — 2,52 % (29. Februar 2020: 1,60 %)				
TRY	340	BIM Birlesik Magazalar AS	2.631	2,52
Großbritannien — 5,35 % (29. Februar 2020: 23,22 %)				
GBP	237	Auto Trader Group Plc, 144A	1.485	1,42
GBP	111	Britvic Plc	1.058	1,01
GBP	618	Ibstock Plc, 144A	1.055	1,01
GBP	282	Marshalls Plc	1.989	1,90
GBP	1	Travis Perkins Plc	10	0,01
			5.597	5,35
Stammaktien insgesamt (Kosten 67.243 EUR)			68.617	65,60
Termineinlagen — 10,55 % (29. Februar 2020: 2,35 %)				
	11.041	Sumitomo Mitsui Trust Bank, (0,710) %, fällig 01.09.2020	11.041	10,55
Termineinlagen insgesamt (Kosten 11.041 EUR)			11.041	10,55
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 78.284 EUR)			79.658	76,15
Devisenterminkontrakte — 0,16 % (29. Februar 2020: 0,64 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			163	0,16
Differenzkontrakte —4,39 % (29. Februar 2020: 3,73 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			4.591	4,39
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			84.412	80,70
Devisenterminkontrakte — (0,61 %) (29. Februar 2020: (0,35 %))				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(632)	(0,61)
Differenzkontrakte —(1,60 %) (29. Februar 2020: (1,22 %))				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(1.674)	(1,60)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			(2.306)	(2,21)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt			82.106	78,49
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			22.499	21,51
Gesamtnettovermögen			104.605 €	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2020 beliefen sich diese Wertpapiere auf 7.998.000 USD und machten 7,65 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

CHF	–	Schweizer Franke
DKK	–	Dänische Krone
GBP	–	Britisches Pfund
HUF	–	Ungarischer Forint
NOK	–	Norwegische Krone
SEK	–	Schwedische Krone
TRY	–	Türkische Lira

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	63,49
Einlagen bei Kreditinstituten	10,22
Finanzderivate	4,40
Sonstige Vermögenswerte	21,89
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
09.01.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.953	Verkauf	BRL	12.757	€ 2
09.01.2020	BNY Mellon	Kauf	BRL	12.609	Verkauf	EUR	2.071	(143)
09.01.2020	BNY Mellon	Kauf	BRL	148	Verkauf	EUR	22	1
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	EUR	–	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	14.012	Verkauf	CHF	15.080	32
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	11.246	Verkauf	DKK	83.770	(7)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	JPY	42.665	Verkauf	EUR	342	(4)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	NOK	2.298	Verkauf	EUR	218	3
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	838	Verkauf	EUR	81	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SEK	18.812	Verkauf	EUR	1.824	(2)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	TRY	1.316	Verkauf	EUR	151	(1)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CHF	2.038	Verkauf	EUR	1.895	(5)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	DKK	7.645	Verkauf	EUR	1.027	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	DKK	12.308	Verkauf	EUR	1.654	(1)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	30.552	Verkauf	EUR	25.891	(297)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.809	Verkauf	EUR	2.005	21
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	HUF	75.880	Verkauf	EUR	214	(2)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	6.052	Verkauf	GBP	5.468	(70)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	16	Verkauf	GBP	14	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.773	Verkauf	HUF	1.308.865	94
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	7	Verkauf	JPY	948	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	4.118	Verkauf	NOK	43.933	(95)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	223	Verkauf	SEK	2.308	(1)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.802	Verkauf	SEK	39.216	3
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.470	Verkauf	TRY	21.764	(2)
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	372	Verkauf	TRY	3.261	1
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	EUR	608	Verkauf	USD	718	6
01.10.2020	BNY Mellon	Kauf	BRL	12.614	Verkauf	EUR	1.928	(2)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 1.215 EUR)								€ 163
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (662) EUR)								(632)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (29. Februar 2020 (in Tsd.): 553 EUR)								€ (469)

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020 – *(Fortsetzung)*

Aufstellung der Differenzkontrakte

	Kontrakte	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
A2A SpA	(1.811.014)	€ (2.213)	€ 21
Aareal Bank AG	(79.325)	(1.487)	(188)
Allianz SE	(21.466)	(3.907)	2
Alstom SA	(22.678)	(1.061)	(33)
Bankia SA	(965.051)	(1.018)	519
BASF SE	(41.111)	(2.102)	(153)
Carnival Plc	(55.641)	(639)	(88)
Compass Group Plc	(92.201)	(1.250)	(72)
Daimler AG	(59.671)	(2.559)	(504)
Deutsche EuroShop AG	(86.127)	(1.076)	395
Deutsche Lufthansa AG	(39.077)	(344)	(29)
Eni SpA	(144.270)	(1.124)	162
Greggs Plc	(31.766)	(503)	20
Grieg Seafood ASA	(83.201)	(705)	81
Hammerson Plc	(1.000.000)	(542)	229
Hargreaves Lansdown Plc	67.879	1.224	239
Heineken NV	(25.859)	(2.005)	146
Industria de Diseno Textil SA	(52.975)	(1.248)	444
Jupiter Fund Management Plc	(664.950)	(1.556)	(20)
Klepierre SA	(55.754)	(769)	172
Persimmon Plc	62.191	1.811	511
Pirelli & C SpA, 144A	(285.023)	(1.034)	4
Rational AG	(4.702)	(2.522)	(301)
Roche Holding AG	(8.866)	(2.599)	169
Royal Dutch Shell A Shares	(76.647)	(955)	151
Siegfried Holding AG	(2.569)	(1.220)	(171)
Snam SpA	(194.481)	(834)	80
Technogym SpA, 144A	(218.498)	(1.642)	(115)
Telefonica SA	(367.782)	(1.214)	1.041
Travis Perkins Plc	87.359	1.198	204
TUI AG (LSE)	(231.445)	(852)	1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 7.084 €)			€ 4.591
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (2.319) €)			(1.674)
Nettowertsteigerung aus Differenzkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): 4.765 €)			€ 2.917

La contraparte de los contratos por diferencia es UBS.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 98,32 % (29. Februar 2020: 94,47 %)				
Australien — 3,37 % (29. Februar 2020: 3,96 %)				
AUD	11	CSL Ltd	2.248	3,37
Kanada — 1,64 % (29. Februar 2020: 1,57 %)				
CAD	10	Canadian National Railway Co	1.095	1,64
China — 6,89 % (29. Februar 2020: 5,71 %)				
	8	Alibaba Group Holding Ltd ADR	2.332	3,50
HKD	33	Tencent Holdings Ltd	2.255	3,39
			4.587	6,89
Dänemark — 3,66 % (29. Februar 2020: 3,52 %)				
DKK	14	Coloplast A/S	2.440	3,66
Frankreich — 6,54 % (29. Februar 2020: 5,83 %)				
EUR	3	Kering SA	1.946	2,92
EUR	7	L'Oreal SA	2.410	3,62
			4.356	6,54
Deutschland — 2,93 % (29. Februar 2020: 2,74 %)				
EUR	6	adidas AG	1.953	2,93
Hongkong — 3,07 % (29. Februar 2020: 3,63 %)				
HKD	199	AIA Group Ltd	2.042	3,07
Irland — 3,09 % (29. Februar 2020: 2,53 %)				
EUR	16	Kerry Group Plc	2.059	3,09
Italien — 6,01 % (29. Februar 2020: 5,89 %)				
EUR	11	Ferrari NV	2.129	3,20
EUR	48	Moncler SpA	1.872	2,81
			4.001	6,01
Schweden — 9,94 % (29. Februar 2020: 7,73 %)				
SEK	85	Assa Abloy AB	1.979	2,97
SEK	56	Atlas Copco AB	2.589	3,89
SEK	28	Hexagon AB	2.052	3,08
			6.620	9,94
Schweiz — 3,80 % (29. Februar 2020: 3,80 %)				
CHF	3	Straumann Holding AG	2.531	3,80
Taiwan — 4,69 % (29. Februar 2020: 3,95 %)				
TWD	214	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	3.121	4,69
Großbritannien — 3,93 % (29. Februar 2020: 8,67 %)				
	10	Linde Plc	2.614	3,93
USA — 38,76 % (29. Februar 2020: 34,94 %)				
	6	Accenture Plc 'A'	1.463	2,20
	5	Adobe Inc	2.521	3,79
	7	ANSYS Inc	2.440	3,66
	12	CyberArk Software Ltd	1.348	2,02
	4	Illumina Inc	1.441	2,16
	13	Masimo Corp	2.873	4,31
	8	Mastercard Inc	2.755	4,14
	3	Mettler-Toledo International Inc	2.447	3,67
	14	Microsoft Corp	3.084	4,63
	14	ResMed Inc	2.442	3,67
	15	Starbucks Corp	1.225	1,84
	6	Veeva Systems Inc 'A'	1.779	2,67
			25.818	38,76
Stammaktien insgesamt (Kosten 51.491 USD)			65.485	98,32
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (Kosten 51.491 USD)			65.485	98,32
Devisenterminkontrakte — 0,04 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			29	0,04
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			65.514	98,36
Devisenterminkontrakte — 0,00 % (29. Februar 2020: (0,01 %))				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			–	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			–	–
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt			65.514	98,36
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			1.092	1,64
Gesamtnettovermögen			66.606 $	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

ABKÜRZUNGEN:

ADR	–	American Depositary Receipt
AUD	–	Australischer Dollar
CAD	–	Kanadischer Dollar
CHF	–	Schweizer Franke
DKK	–	Dänische Krone
EUR	–	Euro
HKD	–	Hongkong-Dollar
SEK	–	Schwedische Krone
TWD	–	Taiwanesischer Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,16
Finanzderivate	0,04
Sonstige Vermögenswerte	1,80
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	GBP	4	$	–
03.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–		–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	10	Verkauf	GBP	7		–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	GBP	990	Verkauf	USD	1.294		29
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								$	29
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (2) USD)									–
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): (2) USD)								$	29

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 54,13 % (29. Februar 2020: 45,42 %)				
Australien — 20,71 % (29. Februar 2020: 15,71 %)				
AUD	15	AGL Energy Ltd	159	1,63
AUD	65	APA Group	500	5,10
AUD	119	Aurizon Holdings Ltd	381	3,89
AUD	349	AusNet Services	469	4,78
AUD	164	Spark Infrastructure Group	268	2,73
AUD	26	Transurban Group	253	2,58
			2.030	20,71
China — 4,31 % (29. Februar 2020: 4,68 %)				
HKD	270	Guangdong Investment Ltd	422	4,31
Hongkong — 7,08 % (29. Februar 2020: 7,37 %)				
HKD	48	CLP Holdings Ltd	466	4,75
HKD	126	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	128	1,31
HKD	24	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	100	1,02
			694	7,08
Indien — 5,84 % (29. Februar 2020: 3,87 %)				
INR	781	NHPC Ltd	230	2,34
INR	140	Power Grid Corp of India Ltd	343	3,50
			573	5,84
Malaysia — 4,95 % (29. Februar 2020: 4,19 %)				
MYR	90	Petronas Gas Bhd	363	3,70
MYR	140	Westports Holdings Bhd	122	1,25
			485	4,95
Nouvelle-Zélande — 1,87 % (29. Februar 2020: 1,54 %)				
NZD	44	Contact Energy Ltd	183	1,87
Philippinen — 3,14 % (29. Februar 2020: 4,19 %)				
PHP	55	Manila Electric Co	308	3,14
Singapur — 1,74 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
SGD	240	NetLink NBN Trust	171	1,74
Thailand — 4,49 % (29. Februar 2020: 3,87 %)				
THB	923	Digital Telecommunications Infrastructure Fund	440	4,49
Stammaktien insgesamt (Kosten 5.399 USD)			5.306	54,13

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Immobilieninvestmentgesellschaften — 44,41 % (29. Februar 2020: 49,86 %)				
Australien — 15,18 % (29. Februar 2020: 19,79 %)				
AUD	154	Charter Hall Retail REIT	390	3,98
AUD	24	Dexus	156	1,59
AUD	45	GPT Group/The	128	1,30
AUD	81	Scentre Group	135	1,38
AUD	145	Shopping Centres Australasia Property Group	239	2,43
AUD	58	Stockland	168	1,72
AUD	103	Vicinity Centres	109	1,12
AUD	83	Waypoint REIT	163	1,66
			1.488	15,18
Hongkong — 9,51 % (29. Februar 2020: 8,48 %)				
HKD	382	Fortune Real Estate Investment Trust	330	3,36
CNY	853	Hui Xian Real Estate Investment Trust	217	2,22
HKD	49	Link REIT	385	3,93
			932	9,51
Indien — 4,28 % (29. Februar 2020: 4,38 %)				
INR	85	Embassy Office Parks REIT	420	4,28
Nouvelle-Zélande — 1,90 % (29. Februar 2020: 1,43 %)				
NZD	269	Kiwi Property Group Ltd	186	1,90
Singapur — 13,54 % (29. Februar 2020: 14,32 %)				
SGD	196	Ascendas India Trust	193	1,97
SGD	145	CapitaLand Commercial Trust	178	1,82
SGD	178	CapitaLand Mall Trust	255	2,60
SGD	51	Frasers Centrepoint Trust	95	0,97
SGD	88	Keppel DC REIT	187	1,91
SGD	187	Mapletree Industrial Trust	419	4,27
			1.327	13,54
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 4.694 USD)			4.353	44,41
Erfolgwirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizuleg-enden Zeitwert (Kosten 10.093 USD)			9.659	98,54
Devisenterminkontrakte — 0,18 % (29. Februar 2020: 0,00 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			17	0,18

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Summe der erfolgswirksam zum beizuleg-enden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	9.676	98,72
Devisenterminkontrakte — (0,01 %) (29. Februar 2020: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	–	(0,01)
Summe der erfolgswirksam zum beizuleg-enden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	–	(0,01)
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt	9.676	98,71
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	126	1,29
Gesamtnettovermögen	9.802$	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

ABKÜRZUNGEN:

AUD	–	Australischer Dollar
CNY	–	Chinesischer Renminbi
HKD	–	Hongkong-Dollar
INR	–	Indische Rupie
MYR	–	Malaysischer Ringgit
NZD	–	Neuseeländischer Dollar
PHP	–	Philippinischer Peso
SGD	–	Singapur-Dollar
THB	–	Thailändischer Baht

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,80
Finanzderivate	0,17
Sonstige Vermögenswerte	2,03
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2020	BNY Mellon	Kauf	MYR	51	Verkauf	USD	12	$ –
02.09.2020	BNY Mellon	Kauf	PHP	514	Verkauf	USD	11	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	13	Verkauf	AUD	18	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	CNH	–	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	USD	22	Verkauf	SGD	30	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	CNH	6	Verkauf	USD	1	–
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	AUD	496	Verkauf	USD	355	10
15.09.2020	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.314	Verkauf	USD	959	7
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								$ 17
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD)								–
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (29. Februar 2020 (in Tsd.): – USD) – USD								$ 17

Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) $	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 97,74 % (29. Februar 2020: 95,14 %)				
Brasilien — 4,02 % (29. Februar 2020: 4,17 %)				
BRL	56	B3 SA – Brésil Bolsa Balcao	603	1,68
	31	Cosan Ltd	567	1,58
BRL	118	Odontoprev SA	275	0,76
			1.445	4,02
China — 37,22 % (29. Februar 2020: 31,30 %)				
	12	Alibaba Group Holding Ltd ADR	3.568	9,92
HKD	230	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	207	0,58
HKD	178	China Gas Holdings Ltd	487	1,35
HKD	410	CNOOC Ltd	464	1,29
HKD	944	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	527	1,46
HKD	38	Meituan Dianping	1.241	3,45
HKD	110	Minth Group Ltd	370	1,03
CNH	150	Ping An Bank Co Ltd	331	0,92
HKD	105	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	1.121	3,11
EUR	10	Prosus NV	1.036	2,88
HKD	102	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	427	1,19
HKD	31	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	460	1,28
HKD	46	Tencent Holdings Ltd	3.151	8,76
			13.390	37,22
Hongkong — 2,27 % (29. Februar 2020: 2,48 %)				
HKD	80	AIA Group Ltd	815	2,27
Ungarn — 1,81 % (29. Februar 2020: 2,92 %)				
HUF	19	OTP Bank Nyrt	653	1,81
Indien — 10,87 % (29. Februar 2020: 11,87 %)				
INR	18	Asian Paints Ltd	468	1,30
INR	30	HDFC Bank Ltd	461	1,28
INR	57	ICICI Bank Ltd	303	0,84
INR	14	Kotak Mahindra Bank Ltd	273	0,76
INR	6	Maruti Suzuki India Ltd	591	1,64
INR	28	Reliance Industries Ltd	781	2,17
INR	49	Titan Co Ltd	725	2,02
INR	6	UltraTech Cement Ltd	310	0,86
			3.912	10,87
Indonesien — 2,09 % (29. Februar 2020: 2,89 %)				
IDR	2.039	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	492	1,37
IDR	1.316	Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT	259	0,72
			751	2,09
Malaysia — 0,60 % (29. Februar 2020: 0,85 %)				
MYR	392	Genting Malaysia Bhd	215	0,60
Mexiko — 0,52 % (29. Februar 2020: 2,06 %)				
MXN	115	Orbia Advance Corp SAB de CV	185	0,52
Peru — 2,53 % (29. Februar 2020: 3,17 %)				
	3	Credicorp Ltd	420	1,17
	10	Southern Copper Corp	490	1,36
			910	2,53
Philippinen — 0,62 % (29. Februar 2020: 0,65 %)				
PHP	157	Robinsons Retail Holdings Inc	224	0,62
Russland — 2,86 % (29. Februar 2020: 3,72 %)				
	7	LUKOIL PJSC ADR	452	1,26
	30	Sberbank of Russia PJSC ADR	360	1,00
	9	TCS Group Holding Plc GDR	215	0,60
			1.027	2,86
Südkorea — 16,79 % (29. Februar 2020: 15,26 %)				
KRW	3	LG Chem Ltd	1.593	4,43
KRW	–	LG Household & Health Care Ltd	449	1,25
KRW	2	NAVER Corp	596	1,66
KRW	50	Samsung Electronics Co Ltd	2.290	6,36
KRW	2	Samsung SDI Co Ltd	658	1,83
KRW	7	SK Hynix Inc	455	1,26
			6.041	16,79
Taiwan — 11,92 % (29. Februar 2020: 10,83 %)				
TWD	55	Delta Electronics Inc	353	0,98
TWD	25	Globalwafers Co Ltd	336	0,93
TWD	2	Largan Precision Co Ltd	231	0,64
TWD	231	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	3.369	9,37
			4.289	11,92
Türkei — 0,51 % (29. Februar 2020: 0,64 %)				
TRY	95	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	184	0,51
USA — 3,11 % (29. Februar 2020: 2,33 %)				
	3	EPAM Systems Inc	1.118	3,11
Stammaktien insgesamt (Kosten 30.962 USD)			35.159	97,74
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			35.159	97,74
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt			35.159	97,74
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			812	2,26
Gesamtnettovermögen			35.971 $	100,00

– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1,000 USD, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

ABKÜRZUNGEN:

ADR	–	American Depositary Receipt
GDR	–	Hinterlegungsschein für ausländische Aktien
BRL	–	Brasilianischer Real
CNH	–	Chinesischer Renminbi
EUR	–	Euro
HKD	–	Hongkong-Dollar
HUF	–	Ungarischer Forint
IDR	–	Indonesische Rupiah
INR	–	Indische Rupie
KRW	–	Südkoreanischer Won
MXN	–	Mexikanischer Peso
MYR	–	Malaysischer Ringgit
PHP	–	Philippinischer Peso
TRY	–	Türkische Lira
TWD	–	Taiwanesischer Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtver-mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,99
Sonstige Vermögenswerte	3,01
Gesamtvermögen	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2020

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) €	% des Netto-inventar-werts
Stammaktien — 95,03 % (29. Februar 2020: 94,82 %)				
Dänemark — 3,84 % (29. Februar 2020: 4,64 %)				
DKK	2	Coloplast A/S	246	3,84
Frankreich — 14,52 % (29. Februar 2020: 10,18 %)				
	2	Dassault Systemes SE	247	3,86
	1	Kering SA	402	6,28
	1	L'Oreal SA	281	4,38
			930	14,52
Deutschland — 14,71 % (29. Februar 2020: 13,81 %)				
	1	adidas AG	360	5,61
	12	Infineon Technologies AG	290	4,53
	1	Linde Plc	292	4,57
			942	14,71
Irland — 3,78 % (29. Februar 2020: 2,16 %)				
	2	Kerry Group Plc	242	3,78
Italien — 12,88 % (29. Februar 2020: 12,65 %)				
	3	Ferrari NV	483	7,54
	11	Moncler SpA	342	5,34
			825	12,88
Niederlande — 7,42 % (29. Februar 2020: 5,81 %)				
	1	ASML Holding NV	448	7,00
	1	JDE Peet's BV	27	0,42
			475	7,42
Schweden — 17,91 % (29. Februar 2020: 16,12 %)				
SEK	15	Assa Abloy AB	300	4,68
SEK	8	Atlas Copco AB	305	4,76
SEK	14	EQT AB	226	3,52
SEK	5	Hexagon AB	317	4,95
			1.148	17,91

Nennwert (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) €	% des Netto-inventar-werts
Schweiz — 13,17 % (29. Februar 2020: 13,59 %)				
CHF	–	Partners Group Holding AG	207	3,24
CHF	–	Straumann Holding AG	413	6,44
CHF	2	Temenos AG	224	3,49
			844	13,17
USA — 6,80 % (29. Februar 2020: 6,30 %)				
USD	2	CyberArk Software Ltd	144	2,25
USD	–	Mettler-Toledo International Inc	291	4,55
			435	6,80
Stammaktien insgesamt (Kosten 4.948 EUR)			6.087	95,03
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			6.087	95,03
Erfolgswirksam zum beizulegender Zeitwert finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten insgesamt			6.087	95,03
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			318	4,97
Gesamtnettovermögen			6.405 €	100,00

– Beträge, die mit „–" bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1,000 EUR, weniger als 1,000 Anteile, weniger als 0.01 %.

ABKÜRZUNGEN:

CHF – Schweizer Franke
DKK – Dänische Krone
SEK – Schwedische Krone
USD – US-Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Netto-inven-tar-werts
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,40
Sonstige Vermögenswerte	5,60
Gesamtvermögen	100,00

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund Zum 31. August 2020	Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund Zum 29. Februar 2020	Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund Zum 31. August 2020	Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund Zum 29. Februar 2020	Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund Zum 31. August 2020	Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund Zum 29. Februar 2020	Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund Zum 31. August 2020	Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund Zum 29. Februar 2020
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	$ 1	$ –	$ 125	$ 2.554	$ 47.361	$ 20.621	€ 4.722	€ 749
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	1.718	5.233	14.616	27.902	1.239	2.069
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	1.141.927	1.023.332	318.464	338.709	1.721.625	1.561.330	103.572	122.256
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	726	–	–
Optionen	–	–	68	562	1.236	3.099	–	39
Swapkontrakte	–	–	508	341	8.228	2.111	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	110	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	41	8	5.776	1.518	209	116
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	239	2.187	5.338	11.483	183	881
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	5.999	15.617	38.100	60.528	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	7.932	3.101	19.147	18.714	–	–
Zinsforderungen	68	436	1.535	1.498	9.489	7.633	746	830
Dividendenforderungen	–	–	5	38	12	10	15	52
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**1.141.996**	**1.023.768**	**336.634**	**369.848**	**1.870.928**	**1.715.785**	**110.686**	**126.992**
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	–	897	–	1	3	3	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	287	1.946	1.962	9.926	72	665
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	84	1.473	478	7.695	53	146
Swapkontrakte	–	–	455	3.515	31	10.140	98	81
Swaptions	–	–	–	–	–	463	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	7.049	4.601	24	56
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	502	412	4.479	7.061	86	1.133
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	54.993	25.000	20.965	44.120	153.751	136.526	–	711
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	8	640	62	81	52	50	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	110	474	204	212	846	690	3	3
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	28	23	19	17	91	73	9	8
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	23	28	55	39	–	–
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	–	–	265	1.550	1.249	3.622	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	589	387	50	87	153	253	41	61
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**55.728**	**26.524**	**23.813**	**53.441**	**170.197**	**181.142**	**389**	**2.864**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**$1.086.268**	**$ 997.244**	**$ 312.821**	**$ 316.407**	**$ 1.700.731**	**$ 1.534.643**	**€ 110.297**	**€124.128**

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund Zum 31. August 2020	Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund Zum 29. Februar 2020	Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^ Zum 31. August 2020	Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^ Zum 29. Februar 2020	Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^ Zum 31. August 2020	Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^ Zum 29. Februar 2020	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund Zum 31. August 2020	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund Zum 29. Februar 2020
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	$ 1.956	$ 1.080	$ 14	$ 23	$ 17	$ 1	$ 349	$ 14.007
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	493	109	–	–	–	–	927	821
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	88.978	106.032	–	–	–	–	45.511	44.460
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	2	17
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	536	59	–	–	–	–	60	31
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	72	–	–	–	–	92	59
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	2.830	705	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	507	505	–	–	–	–	5	26.389
Zinsforderungen	1.040	999	–	–	–	–	148	123
Dividendenforderungen	24	23	–	–	–	–	–	1
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	23	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	22
Gesamtumlaufvermögen	**96.364**	**109.584**	**14**	**23**	**17**	**24**	**47.094**	**85.930**
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	19	95
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	27	96	–	–	–	–	43	67
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	26	45
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	166	370	–	–	–	–	334	241
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	331	–	–	–	–	–	63	400
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	1.637	1.102	–	–	–	–	–	9.271
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	32	32	–	–	–	–	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	87	96	–	–	–	–	5	7
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	9	8	3	3	–	–	6	4
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	8	9	–	–	–	–	1	1
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	165	16	–	–	–	–	28	28.249
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	81	112	11	20	17	24	25	42
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**2.543**	**1.841**	**14**	**23**	**17**	**24**	**550**	**38.422**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**$ 93.821**	**$ 107.743**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 46.544**	**$ 47.508**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund		Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund		Legg Mason 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	
Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020
$ 1.047	$ 330	$ 47.063	$ 17.944	$ 112	$ 5	$ 264	$ 404	$ 481	$ 592
34	31	2.429	7.063	491	137	68	104	48	86
25.584	20.839	604.740	720.021	179.837	170.281	18.185	17.681	36.657	41.593
–	–	79	56	–	–	–	–	–	–
–	–	31	757	–	–	–	2	–	–
–	–	–	–	33	4	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
17	6	11.403	2.729	60	13	43	114	6	3
11	13	184	23	12	51	2	–	4	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
184	4	106	26	230	1.166	4	380	–	–
–	–	3.396	551	2.457	181	1	145	–	–
345	245	6.159	6.612	2.369	2.182	201	203	442	532
–	–	–	3	1	11	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
27.222	**21.468**	**675.590**	**755.785**	**185.602**	**174.031**	**18.768**	**19.033**	**37.638**	**42.806**
83	29	–	6	343	2.499	–	2	–	–
–	–	192	723	49	50	4	24	–	–
–	–	–	–	–	–	–	9	–	–
–	–	–	1.886	–	–	12	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
12	6	2.188	7.723	86	15	17	25	4	–
–	30	132	2.161	–	97	–	64	1	71
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
259	262	1.672	2.569	1.404	1.388	204	–	200	–
13	13	57	71	71	72	7	7	–	–
27	21	192	224	107	100	24	24	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
6	3	39	38	14	10	6	3	6	4
–	–	14	15	10	10	–	–	–	–
92	–	410	6.013	167	492	206	–	–	150
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–				
47	63	134	186	70	105	52	70	24	37
539	**427**	**5.030**	**21.615**	**2.321**	**4.838**	**532**	**228**	**235**	**262**
$ 26.683	**$ 21.041**	**$ 670.560**	**$ 734.170**	**$ 183.281**	**$ 169.193**	**$ 18.236**	**$ 18.805**	**$ 37.403**	**$ 42.544**

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund		Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		Legg Mason Western Asset Global Credit Absolute Return Fund^		Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	
Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020
$ 4.386	$ 3.295	$ 1.448	$ 453	$ –	$ 463	$ 16.384	$ 8.523	$ 253	$ 399
2.905	6.218	3.471	3.577	–	–	2.471	4.306	1.578	1.755
536.177	565.829	393.804	277.063	–	–	236.001	265.873	74.938	77.686
–	–	–	–	–	–	584	176	–	53
–	–	–	–	–	–	7	126	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1.948	1.095	7.327	766	–	–	3.502	1.064	24	105
–	2.657	399	–	–	–	273	1.911	61	327
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
79	7.302	2	–	–	–	3.004	5.630	–	–
2.459	1.209	1.297	472	–	–	2.041	85	–	–
6.347	6.722	2.323	1.623	–	–	1.755	1.774	714	645
10	27	7	19	–	–	57	97	4	7
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
554.311	**594.354**	**410.078**	**283.973**	**–**	**463**	**266.079**	**289.565**	**77.572**	**80.977**
				–					
–	2.197	–	2.507		–	47	387	196	–
–	15	5	81	–	–	154	1.317	10	285
–	–	–	–	–	–	119	381	–	–
–	–	414	564	–	–	–	10	511	805
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
59	1.462	3.330	2.868	–	–	2.382	2.689	651	418
939	–	91	1.174	–	–	188	2.079	78	245
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
79	7.566	2	–	–	–	9.138	18.584	298	–
10	11	–	–	–	–	–	–	–	–
325	362	101	57	–	–	48	52	3	3
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
33	30	25	15	–	–	17	14	8	6
27	32	3	1	–	–	–	–	–	–
585	7.877	468	88	–	–	–	14	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
550	868	53	83	–	463	63	80	35	54
				–					
2.607	**20.420**	**4.492**	**7.438**		**463**	**12.156**	**25.607**	**1.790**	**1.816**
$ 551.704	**$ 573.934**	**$ 405.586**	**$ 276.535**	**$ –**	**$ –**	**$ 253.923**	**$ 263.958**	**$ 75.782**	**$ 79.161**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund Zum 31. August 2020	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund Zum 29. Februar 2020	Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ Zum 31. August 2020	Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ Zum 29. Februar 2020	Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^ Zum 31. August 2020	Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^ Zum 29. Februar 2020	Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ Zum 31. August 2020	Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ Zum 29. Februar 2020
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	€ 2.424	€ 2.361	$ 123.691	$ 107.536	$ 32	$ 37	$ 12.201	$ 13.084
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	210	210	524.752	1.099.657	–	–	3.875	8.596
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	50.554	55.285	6.395.461	7.363.283	–	–	968.050	859.741
Verpfändete Anlagen	–	–	5.464	41.845	–	–	–	1.007
Optionen	–	–	23.110	30.509	–	–	1.233	4.581
Swapkontrakte	–	–	107.962	15.933	–	–	4.843	1.698
Swaptions	–	–	–	1.098	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	7	365	113.230	94.894	–	–	23.499	3.957
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	77.088	289.066	–	–	1.228	6.584
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	4.141	2.804	–	–	1.843	3.514
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	7.224	15.051	–	–	720	302
Zinsforderungen	655	771	110.090	72.434	–	–	9.623	8.408
Dividendenforderungen	–	–	318	455	–	–	30	33
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	7	6	–	–	–	2	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**53.857**	**58.998**	**7.492.531**	**9.134.565**	**32**	**39**	**1.027.145**	**911.505**
KURZFRISTIGE PASSIVA:		–						
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	–	87.769	25.108	–	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	6.384	233.792	–	–	2.948	3.283
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	61.615	114.048	–	–	252	2.572
Swapkontrakte	–	–	7.258	700.274	–	–	1.241	6.761
Swaptions	–	117	2.313	577	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	90	–	85.095	109.828	–	–	4.709	10.082
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	151.622	161.732	–	–	1.427	4.663
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	1.720	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	194	–	16.952	111.386	–	–	8.003	11.879
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	7.064	7.781	–	–	25	21
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	5	–	–	–	–	–	–
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	6	–	387	390	3	3	55	44
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	464	515	–	–	–	–
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	–	–	9.079	22.152	–	–	25	25
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	53	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	37		689	9.032	29	36	101	178
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**327**	**1.895**	**436.691**	**1.496.615**	**32**	**39**	**18.786**	**39.508**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**€ 53.530**	**€ 57.103**	**$ 7.055.840**	**$ 7.637.950**	**$ –**	**$ –**	**$ 1.008.359**	**$ 871.997**

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund Zum 31. August 2020	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund Zum 29. Februar 2020	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ Zum 31. August 2020	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ Zum 29. Februar 2020	Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^ Zum 31. August 2020	Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^ Zum 29. Februar 2020	Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund Zum 31. August 2020	Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund Zum 29. Februar 2020
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	$ 926	$ 14	$ 23	7.233	$ –	$ –	$ 2.877	$ 359
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	2.435	5.741	8.291	8.575	80	64	2.470	2.541
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	574.777	929.385	752.860	829.077	10.680	10.955	580.539	556.850
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	235	115	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	18.935	4.164	41.180	14.297	253	2	11.954	1.529
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	2.527	–	3.295	595	–	–	1.143	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	6.547	–	–	–	–	–	772	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	427	5.353	–	622	–	–	339	2
Zinsforderungen	4.513	8.613	5.628	6.054	188	173	6.340	4.835
Dividendenforderungen	1.145	979	787	707	1	–	731	519
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**612.232**	**954.249**	**812.064**	**867.160**	**11.437**	**11.309**	**607.165**	**566.635**
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	4	310	3.093	2	35	143	3	4
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	2.140	–	3.830	598	90	110	1.060	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	19	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	14.304	17.082	24.822	29.124	29	159	7.385	16.435
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	1.426	–	65	320	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	39	–	–	–	–	120	337	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	1	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	379	477	330	418	1	5	221	206
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	38	48	45	44	5	3	37	29
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	37	45	1	5	–	–	2	4
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	3.170	3.670	–	–	–	–	–	467
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	794	1.950	164	940	33	47	127	558
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**20.905**	**23.582**	**32.285**	**32.557**	**212**	**653**	**9.492**	**17.703**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**$ 591.327**	**$ 930.667**	**$ 779.779**	**$ 834.603**	**$ 11.225**	**$ 10.656**	**$ 597.673**	**$ 548.932**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^		Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^		Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^		Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	
Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020
$ 44	$ 52	$ –	$ 688	$ –	$ –	£ 2.370	£ 1.293	$ 335	$ 191
–	–	3.497	11.591	1.484	5.948	218	141	395	282
–	–								
–	–	1.149.496	1.921.956	890.269	1.186.753	111.292	110.342	123.067	123.108
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	241	906	–	–	–	–	59	–
–	–	–	165	–	99	–	–	–	–
–	–	4.086	3.417	33	15	106	10	2.374	33
–	–	1.182	6.904	279	2.661	48	91	159	318
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	161	33	51.969	191.316	–	–	–	114
–	–	34	9.677	–	–	–	–	–	–
–	–	3.592	5.066	2.821	3.536	1.636	1.608	1.121	1.137
–	3	14	202	13	121	4	1	–	3
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
44	55	–	–	–	–	–	–	–	–
	21.468	**1.162.303**	**1.960.605**	**946.868**	**1.390.449**	**115.674**	**113.486**	**127.510**	**125.186**
–									
	29	542	187	863	4.970	10	–	–	–
–	–	–	–	147	2.482	–	–	222	257
–	–								
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	932	2.507	–	–	–	–	–	–
–	–	–	166	–	100	–	–	–	–
–	–	99	334	–	–	6	70	119	668
–	–	1.174	15.538	507	6.039	4	98	–	152
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	11.112	144.204	299.984	–	–	1.634	320
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	429	671	1	1	–	–	9	9
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
3	3	64	91	46	53	8	7	10	8
–	–	8	8	–	–	–	–	1	1
–	–	112	8.682	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	– –	– –	– –	–	–	–	–	–	–
41	52	206	281	95	155	22	39	32	53
44	**55**	**3.566**	**39.577**	**145.863**	**313.784**	**50**	**214**	**2.027**	**1.468**
$ –	**$ –**	**$ 1.158.737**	**$ 1.921.028**	**$ 801.005**	**$ 1.076.665**	**£ 115.624**	**£ 113.272**	**$ 125.483**	**$ 123.718**

Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^		Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^		Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^		Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund^	
Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020
$ 27.277	$ 1.114	$ 880	$ 818	$ 8	$ 282	$ –	$ –	$ 20	$ 24
2.272	14.891	1.259	1	309	918	77	57	–	–
591.088	1.592.623	120.747	69.825	46.297	42.814	10.606	10.624	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	3.461	488	677	201	191	55	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
40.825	14.764	1.157	373	146	79	130	28	–	–
58	–	89	279	43	112	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1.999	–	773	–	–	–	–	–	–	–
–	130	2.232	63	–	23	–	–	–	–
5.784	15.667	1.425	575	379	114	180	163	–	–
1.514	1.487	8	10	–	2	1	1	–	–
–	–	–	–	–	–	2	2	–	6
–	–	–	–	1	–	–	–	–	–
670.817	**1.640.676**	**132.031**	**72.432**	**47.860**	**44.545**	**11.187**	**10.930**	**20**	**30**
87	6	–	3	725	–	34	131	–	–
–	–	350	580	136	240	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	568	16	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
34.462	46.726	761	219	435	224	31	51	–	–
–	–	–	–	–	–	–	56	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	877	–	–	–	–	110	–	–
–	–	2	1	–	–	–	–	–	–
143	169	79	47	32	18	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
37	80	11	6	8	5	5	2	3	3
–	–	9	6	1	–	–	–	–	–
–	–	64	448	30	30	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
502	2.881	73	93	59	75	33	46	17	27
35.231	**49.862**	**2.226**	**1.403**	**1.426**	**1.160**	**119**	**396**	**20**	**30**
$ 635.586	**$ 1.590.814**	**$ 129.805**	**$ 71.029**	**$ 46.434**	**$ 43.385**	**$ 11.068**	**$ 10.534**	**$ –**	**$ –**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ Zum 31. August 2020	Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ Zum 29. Februar 2020	Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ Zum 31. August 2020	Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ Zum 29. Februar 2020	Legg Mason ClearBridge Value Fund Zum 31. August 2020	Legg Mason ClearBridge Value Fund Zum 29. Februar 2020	Legg Mason ClearBridge Growth Fund^ Zum 31. August 2020	Legg Mason ClearBridge Growth Fund^ Zum 29. Februar 2020
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	$ 24.344	$ 2.077	$ –	$ 2	$ 6.875	$ 20.766	$ 73	$ 70
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	17.248	24.871	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	345.318	386.019	1.511	3.289	333.521	306.850	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	23.833	5.780	12	7	2	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	3.859	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	189	–	–	–	1.365	1.917	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	694	–	–	3	30	–	–
Zinsforderungen	3.562	4.473	–	–	–	4	–	–
Dividendenforderungen	2	11	3	7	215	231	–	–
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	**16**	30	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**418.355**	**423.925**	**1.542**	**3.335**	**341.981**	**329.798**	**73**	**70**
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	3.872	–	–	1.671	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	3.000	62	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	5.167	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	6.613	19.699	–	1	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	663	16.987	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	1.788	2.365	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	14	25	–	–	209	228	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	25	23	4	3	28	24	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	1	–	–	12	14	–	–
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	–	–	–	–	186	1.160	45	45
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	545	1.174	17	30	74	107	28	25
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**16.027**	**41.843**	**21**	**34**	**3.968**	**3.898**	**73**	**70**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**$ 402.328**	**$ 382.082**	**$ 1.521**	**$ 3.301**	**$ 338.013**	**$ 325.900**	**$ –**	**$ –**

(in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund Zum 31. August 2020	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund Zum 29. Februar 2020	Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ Zum 31. August 2020	Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ Zum 29. Februar 2020	Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^ Zum 31. August 2020	Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^ Zum 29. Februar 2020	Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ Zum 31. August 2020	Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ Zum 29. Februar 2020
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	$ 267	$ 2.639	$ 1.494	$ 1.635	$ 52	$ 339	€ 8.579	€ 32.179
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	540	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	38.058	38.453	194.320	48.203	9.816	8.140	652.813	750.612
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	63	12	960	10	1	–	1.011	1.208
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	25	–	31	–	362	7.525
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	20	30	13.116	396	–	–	1.942	14.523
Zinsforderungen	5	1	3	1	–	–	–	–
Dividendenforderungen	73	46	172	47	5	5	1.649	1.269
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	15	–	1	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**38.486**	**41.181**	**210.090**	**50.307**	**9.905**	**8.485**	**666.896**	**807.316**
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	63	20	–	–	–	1	381
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	930
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	2	71	13	34	–	–	1.655	3.700
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	548	25	507	50	–	1.463	12.236
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	850	3.400
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	36	41	109	–	4	–	546	614
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	7	5	15	5	5	3	52	45
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	5	7	15	2	–	–	67	67
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	75	611	200	58	–	–	585	11.893
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	34	51	16	29	11	19	77	112
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**159**	**1.397**	**413**	**635**	**70**	**22**	**5.296**	**33.378**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**$ 38.327**	**$ 39.784**	**$ 209.677**	**$ 49.672**	**$ 9.835**	**$ 8.463**	**€ 661.600**	**€ 773.938**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^		Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund^		Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund		Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020
$ 55	$ 21	$ 24	$ 24	$ 453	$ 2.343	$ 26.792	$ 63.917	$ 5.540	$ 3
–	–	–	–	–	–	1.040	270	–	–
–	–	–	–	195.927	192.364	1.885.174	1.464.212	744.254	950.054
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	1.042	749	470	314
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	440	730	4.161	4	8.542
–	–	–	–	71	131	2.599	9.007	17	758
–	–	–	–	–	2	–	11	–	4
–	–	–	–	204	235	1.214	1.122	197	344
–	39	–	9	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
55	**60**	**24**	**33**	**196.655**	**195.515**	**1.918.591**	**1.543.449**	**750.482**	**960.019**
–	–	–	–	572	630	1.250	66	138	5.158
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	1.024	778	27	531
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	648	730	8.136	4	2.346
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	186	203	1.243	1.083	557	764
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
2	2	–	–	18	15	132	97	62	65
–	–	–	–	29	34	171	160	71	96
–	–	–	–	126	475	3.342	11.837	1.670	4.892
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
53	58	24	33	47	72	173	286	274	341
55	**60**	**24**	**33**	**978**	**2.077**	**8.065**	**22.443**	**2.803**	**14.193**
$ –	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 195.677**	**$ 193.438**	**$ 1.910.526**	**$ 1.521.006**	**$ 747.679**	**$ 945.826**

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund		Legg Mason PCM US Equity Fund^		Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund	
Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020
$ 155	$ 146	$ –	$ 686	$ –	$ 358	$ 23	$ 23	€ 164	€ 11
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
2.256	2.588	439.315	447.792	62.240	68.300	–	–	32.499	40.633
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
16	12	449	138	1	–	–	–	27	19
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	18	1.193	2.163	76	–	–	–	–	–
–	–	308	287	68	53	–	–	2	32
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
5	–	212	203	29	34	–	–	561	509
5	15	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
2.437	**2.779**	**441.477**	**451.269**	**62.414**	**68.745**	**23**	**23**	**33.253**	**41.204**
–	–	870	2	8	–	–	–	–	13
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	2	158	424	–	–	–	–	60	149
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	400	590	96	–	–	–	–	–
4	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	425	470	75	86	–	–	30	43
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
4	2	37	31	9	7	–	–	6	5
–	–	76	83	13	16	–	–	2	5
–	–	1.471	1.408	40	510	–	–	13	100
–	–	–	–	1	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
50	89	164	203	48	69	23	23	92	115
58	**93**	**3.601**	**3.211**	**290**	**688**	**23**	**23**	**203**	**430**
$ 2.379	**$ 2.686**	**$ 437.876**	**$ 448.058**	**$ 62.124**	**$ 68.057**	**$ –**	**$ –**	**€ 33.050**	**€ 40.774**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund		Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund	
	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	$ 457	$ 772	$ 60	$ 1	$ 183	$ 198	$ 71	$ 66
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	–	–	25	30	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	36.763	63.289	–	–	12.276	12.067	12.451	13.490
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	162	8	–	–	–	–	21	16
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	19	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	2	25	–	–	–	–	7	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	3	141	–	–	–	20	–	25
Zinsforderungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	119	272	–	–	22	22	55	40
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	4	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**37.506**	**64.507**	**60**	**1**	**12.525**	**12.341**	**12.605**	**13.637**
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	9	–	–	–	–	–	–	22
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	215	–	–	–	–	9	68
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	20	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	8	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	40	42	–	–	2	–	13	16
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	7	6	–	–	5	3	5	3
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	6	11	–	–	–	–	–	1
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	56	34	59	–	–	–	27	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	64	163	1	1	59	133	43	58
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**182**	**471**	**60**	1	**66**	**156**	**105**	**168**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**$ 37.324**	**$ 64.036**	**$ –**	**$ –**	**$ 12.459**	**$ 12.185**	**$ 12.500**	**$ 13.469**

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^		Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund^		Legg Mason Martin Currie North American Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	
	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	$ 121	$ 149	¥ 1.595	¥ 2.264	$ –	$ 129	$ 1.154	$ 2.041
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:					–			
Anlagen	–	–	–	–	–	–	65.485	32.289
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	29	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	–	–	–	–	23	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	5	6
Zinsforderungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	–	–	–	–	–	–	18	34
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	7	631	940	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	**121**	**156**	**2.226**	**3.204**	**–**	**129**	**66.714**	**34.370**
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	2
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	22	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	32	16
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	60	60	–	–	8	5
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	2	1
Verbindlichkeiten gegenüber Anteilsinhabern	97	123	–	–	–	–	23	133
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	24	33	2.166	3.144	–	129	21	33
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	**121**	**156**	**2.226**	**3.204**	**–**	**129**	**108**	**190**
Gesamtnettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist	**$ –**	**$ –**	**¥ –**	**¥ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 66.606**	**$ 34.180**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Congruix Japan Equity Fund^		Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^	
Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020
¥ 90.556	¥ 91.494	$ 4.571	$ 8.660	$ 31	$ 16	€ 15.929	€ 5.541	$ 51	$ 103
–	–	–	–	–	–	3.498	4.697	–	–
–	–	59.977	157.851	–	–	79.658	176.973	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	29	–	–	–	163	1.215	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	4.591	7.084	–	–
–	–	19.753	–	–	–	3.887	1.815	–	–
–	–	–	19	–	–	113	100	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	196	416	–	–	237	198	–	–
–	–	–	–	–	29	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
90.556	**91.494**	**84.526**	**166.946**	**31**	**45**	**108.076**	**197.623**	**51**	**103**
–	–	–	–	–	–	199	251	–	–
–	–	–	–	–	–	410	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	632	662	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	1.674	2.319	–	–
–	–	490	–	–	–	153	3.954	–	–
–	–	–	1.966	–	–	–	–	–	–
–	–	59	141	–	–	139	242	–	–
–	–	–	–	–	–	–	22	–	–
–	–	12	14	3	3	14	14	–	–
–	–	2	13	–	–	16	28	–	–
–	–	21.579	14	–	–	98	108	51	–
–	–	–	–	–	–	57	44	–	–
–	–	–	–	–	–	19	51	–	–
90.556	91.494	60	80	28	42	60	81	–	103
90.556	**91.494**	**22.202**	**2.228**	**31**	**45**	**3.471**	**7.776**	**51**	**103**
¥ –	**¥ –**	**$ 62.324**	**$ 164.718**	**$ –**	**$ –**	**€ 104.605**	**€ 189.847**	**$ –**	**$ –**

Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund		Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund^		Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^		Legg Mason Global Funds Plc	
Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020	Zum 31. August 2020	Zum 29. Februar 2020
$ 128	$ 382	$ 1.073	$ 843	$ 25	$ 15	€ 311	€ 323	$ 406.024	$ 358.525
–	–	–	–	–	–	–	–	607.598	1.249.257
9.659	7.853	35.159	28.397	–	–	6.087	5.819	23.308.784	26.299.352
–	–	–	–	–	–	–	–	6.127	43.863
–	–	–	–	–	–	–	–	25.687	39.696
–	–	–	–	–	–	–	–	126.438	21.852
–	–	–	–	–	–	–	–	–	1.472
17	–	–	–	–	–	–	–	317.485	155.349
–	–	–	–	–	–	–	–	97.866	326.391
–	–	–	–	–	–	–	–	5.479	7.821
–	50	–	248	–	–	24	–	147.240	317.014
–	–	–	–	–	–	–	1	68.883	110.352
–	–	–	–	–	–	–	–	192.048	166.327
62	53	17	52	–	–	1	6	10.447	10.176
10	16	–	–	–	17	25	24	77	261
–	–	–	–	–	–	–	–	1	22
9.876	**8.354**	**36.249**	**29.540**	**25**	**32**	**6.448**	**6.173**	**25.320.184**	**29.107.730**
–	–	–	–	–	–	–	–	99.535	49.114
–	–	–	–	–	–	–	–	23.615	257.695
–	–	–	–	–	–	–	–	62.637	126.384
–	–	–	–	–	–	–	–	16.173	727.119
–	–	–	–	–	–	–	–	2.313	1.306
–	–	–	–	–	–	–	–	199.320	278.436
–	–	–	–	–	–	–	–	162.625	221.848
–	–	–	–	–	–	–	–	1.998	2.560
23	50	194	–	–	–	12	–	422.652	717.047
–	–	–	–	–	–	–	–	1.332	6.699
–	–	19	6	–	–	–	–	14.672	16.262
–	–	–	–	–	–	–	–	–	24
5	3	7	4	2	3	5	3	1.590	1.487
–	–	1	1	–	–	–	–	1.169	1.269
–	–	–	1	–	–	–	–	45.993	118.206
–	–	–	–	–	–	–	–	69	49
–	–	–	–	–	–	–	–	23	56
46	60	57	107	23	29	26	32	8.254	24.349
74	**113**	**278**	**119**	**25**	**32**	**43**	**35**	**1.063.970**	**2.549.910**
$ 9.802	**$ 8.241**	**$ 35.971**	**$ 29.421**	**$ –**	**$ –**	**€ € 6.405**	**€ € 6.138**	**$ 24.256.214**	**$ 26.557.820**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USDK/0 EUR/0 YEN/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 YEN/1.000 GBP.

Die Euro-Beträge für den Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, den Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, den uro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^, den Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund, den Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ und den Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^ wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2020 zum USD.EUR-Wechselkurs von 0,8380 umgerechnet (29. Februar 2020: 0,9058).

Die Yen-Beträ¤ge für den Legg Mason Congruix Japan Equity Fund und den Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund^ wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2020 zum USD/JPY-Wechselkurs von 105,9150 in US-Dollar umgerechnet (29. Februar 2020: 107,8600) Die britischen Pfund-Beträge für den Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2020 zum USD.GBP-Wechselkurs von 0,7481 in US-Dollar umgerechnet (29. Februar 2020: 0,7799).

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2020			29. Februar 2020			28. Februar 2019		
	Total VL (in Tsd.)	Nbre d'Actions (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 149.831	1.367	109,61	$ 158.319	1.445	109,56	$ 122.389	1.133	108,01
Klasse A USD, ausschüttend (D)	835.120	835.134	1,00	745.435	745.135	1,00	819.631	819.350	1,00
Klasse B USD, thesaurierend	221	2	104,89	221	2	104,87	264	3	103,84
Klasse B USD, ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	51	51	1,00
Klasse C USD, thesaurierend	5.337	51	103,68	5.263	51	103,67	5.247	51	102,92
Klasse C USD, ausschüttend (D)	518	519	1,00	374	374	1,00	225	225	1,00
Klasse X USD, ausschüttend (D)	94.418	94.419	1,00	86.585	86.583	1,00	1	1	1,00
Klasse A (G) USD, thesaurierend	491	4	109,83	499	5	109,79	541	5	108,23
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	284	285	1,00	404	404	1,00	426	426	1,00
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	48	48	1,00	144	144	1,00	330	330	1,00
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 42.463	277	153,56	$ 73.304	497	147,58	$ 11.129	83	133,30
Klasse A USD, ausschüttend (D)	114.258	1.011	113,03	141.618	1.294	109,46	120.608	1.193	101,07
Klasse B USD, ausschüttend (D)	2	–	113,13	2	–	109,55	67	1	101,04
Klasse C USD, thesaurierend	11.750	82	143,42	9.868	71	138,19	4.668	37	125,45
Klasse C USD, ausschüttend (D)	9.281	82	113,06	5.715	52	109,49	2.819	28	101,09
Klasse E USD, thesaurierend	4.437	42	106,47	1.348	13	102,63	–	–	–
Klasse F USD, thesaurierend	72.438	524	138,37	43.800	330	132,62	7.668	64	119,13
Klasse F USD, ausschüttend (D)	16.623	150	111,14	7.147	66	107,62	3.169	32	99,37
Klasse X USD, thesaurierend	3.794	31	121,07	3.239	28	116,08	2.044	20	104,35
Klasse X USD, ausschüttend (D)	349	3	109,97	476	4	106,50	525	5	98,34
Klasse Premier USD, thesaurierend	32.258	267	120,65	27.203	236	115,50	196	2	103,48
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	3.596	27	112,72	1.155	10	108,78	–	–	–
Klasse GA USD, thesaurierend	1.485	10	151,01	1.449	10	144,93	1.518	12	130,54
Klasse GE USD, thesaurierend	87	1	142,20	83	1	136,88	75	1	124,04
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 222.173	1.283	173,13	$ 168.516	1.006	167,57	$ 134.687	899	149,79
Klasse A USD, ausschüttend (D)	54.760	442	123,99	51.550	426	121,11	33.130	299	110,86
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	25.916	243	106,45	1.524	15	105,04	1.872	19	97,71
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	7.474	97	104,37	5.306	78	103,86	3.039	44	97,55
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	10.656	79	112,61	5.446	45	109,90	703	6	101,06
Klasse B USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	24	–	142,17
Klasse B USD, ausschüttend (D)	249	2	123,93	195	2	120,93	141	1	110,70
Klasse C USD, thesaurierend	31.551	199	158,41	23.443	153	153,71	8.384	61	138,09
Klasse C USD, ausschüttend (D)	14.887	119	124,86	11.847	97	121,97	4.904	44	111,64
Klasse E USD, thesaurierend	31.923	246	129,93	23.217	184	126,14	8.192	72	113,44
Klasse F USD, thesaurierend	455.141	3.369	135,10	459.375	3.526	130,28	191.012	1.653	115,58
Klasse F USD, ausschüttend (D)	12.734	110	116,27	9.964	88	113,58	51	–	103,89
Klasse X USD, thesaurierend	43.865	348	125,94	42.091	346	121,54	4.863	45	108,03
Klasse X USD, ausschüttend (D)	3.761	35	108,13	1.655	16	105,63	967	10	96,67
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	6.935	55	105,43	3.117	28	102,61	39	–	101,99
Klasse Premier USD, thesaurierend	705.557	4.372	161,39	598.264	3.849	155,43	440.775	3.204	137,55
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	357	3	117,43	51.121	445	114,80	1.060	10	105,06
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	66.905	478	117,18	71.846	572	113,82	87.784	744	103,72
Klasse LM EUR, thesaurierend	2.056	14	122,87	2.404	17	127,75	1.945	16	109,40
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	82	–	157,52	27	–	152,63	35	–	136,94
Klasse A (G) USD, thesaurierend	954	5	175,43	923	5	169,67	824	5	151,45
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1.283	10	124,95	1.340	11	122,06	1.554	14	111,73
Klasse B (G) USD, ausschüttend (D)	4	–	124,97	4	–	122,07	4	–	111,73
Klasse L (G) USD, thesaurierend	251	2	164,08	247	2	159,09	222	2	142,72
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1.257	10	124,97	1.221	10	122,08	1.099	10	111,74
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund									
Klasse A USD, ausschüttend (D)	€ 257	2	130,12	€ 236	2	120,04	€ 220	2	115,33
Klasse A EUR, ausschüttend (D)	1.401	12	113,42	1.353	12	112,77	1.591	15	105,14
Klasse C USD, ausschüttend (D)	161	1	130,13	161	1	120,34	215	2	115,94
Klasse F EUR, ausschüttend (Q)	1	–	129,82	1	–	129,00	1	–	120,12
Klasse X EUR, ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	1	–	100,02
Klasse Premier EUR, thesaurierend	1.009	9	109,39	868	8	108,30	–	–	–
Klasse LM EUR, thesaurierend	105.953	941	112,60	119.975	1.078	111,32	110.763	1.080	102,52
Klasse GA EUR, thesaurierend	968	7	137,42	976	7	136,40	1.057	8	126,66
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	429	3	125,28	441	4	124,82	449	4	116,25
Klasse GE EUR, thesaurierend	118	1	129,40	117	1	128,83	201	2	120,35
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 7.054	46	152,78	$ 3.640	24	148,98	$ 3.067	21	145,70
Klasse A USD, ausschüttend (D)	3.102	36	86,37	3.560	41	86,11	4.463	51	87,89
Klasse A USD, ausschüttend (M)	227	2	91,28	259	3	90,97	89	1	92,84
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	316	3	93,33	370	4	93,51	1.643	17	96,75
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	31	–	91,19	66	1	92,19	75	1	96,34
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	816	5	135,84	893	6	133,53	82	1	134,21
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	495	41	92,92	519	43	93,64	1.295	104	97,59
Klasse B USD, thesaurierend	27	–	146,96	110	1	143,50	132	1	140,73
Klasse B USD, ausschüttend (D)	95	1	86,35	93	1	86,09	145	2	87,88
Klasse C USD, thesaurierend	3.209	22	142,79	1.275	9	139,60	1.947	14	137,21
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1.905	22	86,34	2.201	26	86,08	2.669	30	87,87
Klasse F USD, thesaurierend	2.531	25	100,89	1.425	15	98,18	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	491	4	110,04	–	–	–	–	–	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend	710	5	151,22	845	6	147,53	990	7	144,47
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	4.671	53	87,91	4.741	54	87,65	5.442	61	89,47
Klasse B (G) USD, ausschüttend (D)	5	–	88,01	5	–	87,75	5	–	89,57
Klasse L (G) USD, thesaurierend	843	6	141,54	885	6	138,43	874	6	136,24
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	155	2	87,91	154	2	87,65	242	3	89,48
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 17.665	105	167,75	$ 23.852	144	165,19	$ 23.839	155	153,85
Klasse A USD, ausschüttend (D)	40.561	350	116,03	43.654	376	116,09	40.316	359	112,44
Klasse A USD, ausschüttend (M)	2.987	30	98,34	3.272	33	98,40	3.780	40	95,34
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1.288	14	94,07	1.462	15	95,21	1.001	11	94,13
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	65	1	91,97	182	3	94,10	74	1	93,95
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	7.998	46	146,58	7.931	49	145,60	7.689	48	139,53
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	5.625	56	84,67	5.568	59	85,46	6.317	65	85,22
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	393	4	73,98	491	6	75,18	491	6	75,98
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	682	5	97,24	740	6	98,15	943	7	96,69
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	119	10	90,59	121	10	92,23	115	10	91,82
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.001	1.397	0,98	1.035	1.455	0,99	1.177	1.614	0,99
Klasse B USD, thesaurierend	33	–	157,50	33	–	155,29	31	–	144,99
Klasse B USD, ausschüttend (D)	442	4	116,03	710	6	116,11	375	3	112,44
Klasse C USD, thesaurierend	9.068	59	152,88	10.470	69	150,92	10.996	78	141,27
Klasse C USD, ausschüttend (D)	15.156	131	116,02	16.220	140	116,08	17.968	160	112,42
Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.393	26	895,14	1.549	26	925,46	243	4	938,40
Klasse E USD, thesaurierend	2.498	19	134,54	2.669	20	132,88	1.887	15	124,50
Klasse E USD, ausschüttend (D)	796	8	96,62	811	8	96,67	1.078	12	93,63
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	532	4	110,30	603	5	109,90	534	4	105,96
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	53	1	86,37	50	1	87,17	40	–	86,92
Klasse F USD, thesaurierend	4.407	29	154,01	3.602	24	151,20	5.818	42	139,98
Klasse F USD, ausschüttend (D)	10.890	113	96,65	11.793	122	96,70	9.695	104	93,66

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2020			29. Februar 2020			28. Februar 2019		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund (Fortsetzung)									
Klasse X USD, ausschüttend (D)	$ 2.409	25	96,79	$ 3.241	33	96,85	$ 64	1	93,80
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	121	1	93,13	117	1	93,98	109	1	92,41
Klasse Premier USD, thesaurierend	60.832	328	185,55	121.997	670	181,95	45.900	273	168,02
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	18.304	152	120,18	21.905	182	120,24	33.682	289	116,50
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	1.985	16	113,34	1.842	16	112,25	30.024	280	107,12
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	6.722	39	143,64	5.982	38	142,07	4.185	27	134,97
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	83	1	81,80	78	1	82,56	95	1	82,32
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	62.826	336	139,86	64.023	361	138,31	105.616	613	129,83
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	47.677	380	93,82	48.664	401	94,69	52.466	424	93,26
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	265	2	82,96	1.129	10	83,96	1.856	17	83,11
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert)	2	–	89,80	43	–	90,86	293	2	89,72
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	7.628	220	127,62	7.472	233	125,91	4.445	143	117,23
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	74.237	925	108,79	71.162	994	109,92	76.692	1.005	107,57
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	263.817	1.361	145,05	249.697	1.360	143,15	241.425	1.360	133,81
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 22.760	124	183,62	$ 21.792	122	178,18	$ 25.597	153	167,57
Klasse A USD, ausschüttend (D)	37.769	483	78,22	36.152	465	77,78	31.703	413	76,72
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1.281	14	94,37	1.572	17	93,82	1.063	11	92,50
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	7.155	86	83,50	993	12	83,46	591	7	83,54
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1.483	15	80,85	1.376	15	81,10	1.446	15	82,27
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	485	826	0,80	412	715	0,80	383	642	0,81
Klasse B USD, thesaurierend	13	–	182,35	13	–	177,18	45	–	167,04
Klasse B USD, ausschüttend (D)	901	12	78,25	1.040	13	77,81	1.394	18	76,75
Klasse C USD, thesaurierend	3.198	18	176,56	4.137	24	171,77	4.824	30	162,35
Klasse C USD, ausschüttend (D)	3.934	50	78,24	3.987	51	77,80	4.319	56	76,74
Klasse E USD, thesaurierend	3.364	20	167,08	3.752	23	162,63	4.942	32	153,86
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1.268	13	97,75	2.765	28	97,22	2.985	31	95,90
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	300	2	101,63	272	2	99,79	–	–	–
Klasse F USD, thesaurierend	2.396	14	166,61	1.514	9	161,20	1.138	8	150,68
Klasse F USD, ausschüttend (D)	142	2	93,05	1.048	11	92,72	297	3	91,43
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1	–	103,48	1	–	101,04	–	–	–
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	149	1	102,86
Klasse Premier USD, thesaurierend	43.125	250	172,35	34.426	207	166,53	3.034	20	155,28
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	879	6	104,39	822	6	101,84	–	–	–
LM-Klasse in USD, thesaurierend	32.860	180	182,55	25.201	143	176,00	23.392	143	163,37
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	17.055	198	86,30	24.780	289	85,79	38.226	452	84,58
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	117	1	105,32	11	–	102,83	41	–	158,41
Klasse A (G) USD, thesaurierend	224	1	187,60	294	2	181,91	291	2	170,82
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1.463	19	77,60	1.537	20	77,17	1.799	24	76,12
Klasse L (G) USD, thesaurierend	176	1	175,45	190	1	170,55	249	2	160,96
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	792	10	77,59	922	12	77,16	1.257	17	76,12
Klasse GF USD, thesaurierend	140	1	166,36	184	1	161,15	2.091	14	151,03
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 5.022	28	182,45	$ 3.616	21	176,11	$ 3.984	24	167,11
Klasse A USD, ausschüttend (D)	2.177	20	110,77	2.213	20	108,56	3.860	36	107,45
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1.136	11	100,19	1.277	13	98,18	1.822	19	97,16
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	12	–	78,10	10	–	77,54	55	1	78,18
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	216	1	138,24	135	1	134,44	247	2	131,27
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	390	4	76,76	427	5	75,79	484	6	77,16
Klasse A GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	49	–	94,47	46	–	93,14	48	–	93,65
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	11	18	0,81	88	152	0,81	113	187	0,82
Klasse B USD, ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	7	–	107,40
Klasse C USD, thesaurierend	316	2	166,94	386	2	161,54	462	3	154,06
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1.623	15	110,71	1.874	17	108,51	2.626	24	107,38
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1.305	14	94,67	1.960	21	92,78	1.521	17	91,81
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	12	–	97,66	11	–	95,37	11	–	93,81
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	24	–	85,75	21	–	84,67	21	–	86,24
Klasse F USD, thesaurierend	37	–	161,12	173	1	155,02	176	1	146,08
Klasse X USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	113,89
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	17	–	91,69	16	–	90,40	24	–	90,92
Klasse Premier USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1.479	6	237,85
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.665	11	132,65	1.504	11	128,44	1.301	9	124,19
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	24	–	82,17	21	–	81,06	57	1	81,61
Klasse A (G) USD, thesaurierend	738	4	190,07	787	4	183,30	1.239	7	173,51
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	976	10	99,30	1.183	12	97,32	1.280	13	96,30
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1.292	7	177,76	1.275	7	171,85	1.251	8	163,49
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1.194	12	99,27	1.782	18	97,31	2.124	22	96,29
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ –	–	116,24	$ 1	–	113,96	$ 1	–	105,11
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1	–	101,82	1	–	100,73	1	–	94,72
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	489	4	101,90	381	3	99,71	–	–	–
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	36.913	362	101,88	42.161	418	100,79	37.500	396	94,77
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 7.521	42	179,06	$ 10.569	61	173,88	$ 26.325	160	164,59
Klasse A USD, ausschüttend (D)	9.250	120	76,90	11.164	147	76,09	12.816	170	75,55
Klasse A USD, ausschüttend (M)	13.942	164	85,11	15.940	189	84,19	17.625	211	83,58
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	2.998	37	80,14	4.200	52	80,29	4.817	59	81,08
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	9.088	130	94,63	9.438	151	95,88	12.124	175	97,83
Klasse A EUR, thesaurierend	2.143	17	106,97	2.491	20	112,26	2.860	24	103,14
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	593	6	80,03	555	6	79,97	621	7	81,69
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	7.042	12.373	0,77	2.293	4.095	0,78	2.394	4.085	0,79
Klasse B USD, thesaurierend	102	1	176,50	99	1	171,60	149	1	162,85
Klasse B USD, ausschüttend (D)	337	4	76,74	337	4	75,93	539	7	75,41
Klasse C USD, thesaurierend	1.459	8	171,85	1.734	10	167,29	1.539	10	159,15
Klasse C USD, ausschüttend (D)	5.754	75	76,56	6.063	80	75,76	7.344	98	75,22
Klasse E USD, thesaurierend	913	6	157,70	1.334	9	153,60	1.770	12	146,29
Klasse E USD, ausschüttend (D)	218	2	94,26	273	3	93,27	229	2	92,60
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	111	1	102,81	3	–	100,65
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	37	–	79,54	38	–	79,37	32	–	81,07
Klasse F USD, thesaurierend	357	2	159,56	538	3	154,40	311	2	145,16
Klasse F USD, ausschüttend (D)	568	6	89,50	940	11	88,59	975	11	87,95
Klasse X USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	85	1	118,78
Klasse X USD, ausschüttend (D)	3.216	32	100,29	2.799	28	99,23	1.655	17	98,52
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	2.291	21	81,66	1.914	18	81,56	762	7	82,35
Klasse Premier USD, thesaurierend	18.006	86	210,13	24.054	118	203,09	2.432	13	190,43
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	1.975	23	85,33	8.811	103	85,21
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.067	14	126,68	2.507	18	123,53	5.855	43	119,22
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	37	–	88,80	35	–	88,70	42	–	89,58
LM-Klasse in USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1.421	12	113,75
Klasse A (G) USD, thesaurierend	2.428	13	182,19	2.469	14	176,79	2.891	17	167,11
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	2.156	28	76,91	2.316	30	76,10	2.409	32	75,56
Klasse L (G) USD, thesaurierend	581	3	170,41	638	4	165,78	675	4	157,49
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	717	9	76,91	919	12	76,11	1.299	17	75,56

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2020			29. Februar 2020			28. Februar 2019		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ –	–	–	$	–	–	$ –	4.630	112,61
Klasse A USD, ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	494	415	98,69
Klasse B USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	39	–	106,25
Klasse C USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	2.869	28	103,10
Klasse C USD, ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	1.705	18	96,53
Klasse A (G) USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	617	5	112,49
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	2.555	26	98,55
Klasse L (G) USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	35	–	105,99
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	299	3	96,30
Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ –	–	–	$	–	–	$ 3.968	40	99,17
Klasse B USD, ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	47	1	90,07
Klasse C USD, ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	189	2	87,96
Klasse A (G) USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	321	3	97,03
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	502	6	90,84
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	177	2	86,64
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 1.210	8	147,77	$ 1.774	12	143,51	$ 3.809	28	137,81
Klasse A USD, ausschüttend (A)	4.375	34	127,18	6.067	48	125,31	7.235	60	121,27
Klasse B USD, thesaurierend	58	1	103,67	57	1	100,82	74	1	97,05
Klasse C USD, thesaurierend	–	–	–	71	1	105,91	505	5	102,20
Klasse C USD, ausschüttend (A)	506	4	124,61	505	4	122,44	691	6	118,51
LM-Klasse in USD, thesaurierend	40.182	369	108,98	38.826	369	105,30	25.026	250	100,10
Klasse A (G) USD, thesaurierend	5	–	154,69	5	–	150,09	474	3	143,81
Klasse A (G) USD, ausschüttend (A)	58	–	123,99	57	–	122,31	55	–	118,37
Klasse L (G) USD, thesaurierend	136	1	144,39	132	1	140,44	128	1	135,27
Klasse L (G) USD, ausschüttend (A)	14	–	114,91	14	–	113,02	13	–	109,39
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 43.320	265	163,24	$ 52.900	329	160,69	$ 59.949	404	148,54
Klasse A USD, ausschüttend (D)	9.788	87	112,64	10.398	92	112,49	10.842	101	107,40
Klasse A USD, ausschüttend (M)	20.517	198	103,74	27.023	261	103,60	13.996	142	98,90
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	60.172	748	80,42	68.262	841	81,14	44.949	570	78,83
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	32.681	488	90,83	31.171	520	92,03	18.510	289	90,32
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	376	3	100,22	350	3	99,57	323	3	95,08
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	10.152	778	89,36	17.638	1.366	90,13	8.696	664	87,72
Klasse A EUR, thesaurierend	4.255	17	215,38	5.202	21	229,25	1.679	7	205,71
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.551	20	109,09	2.203	18	108,23	1.843	16	102,98
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	613	5	111,91	679	5	122,98	870	7	113,99
Klasse A GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	34	–	89,10
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	17.527	1.413	96,13	20.206	1.614	97,57	20.181	1.658	95,53
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1.613	1.444	1,52	1.809	1.679	1,50	2.160	2.091	1,40
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3.334	5.402	0,84	2.115	3.466	0,85	1.524	2.479	0,83
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	1.054	1.614	0,89	3.251	4.919	0,92	137	213	0,87
Klasse B USD, thesaurierend	115	1	158,24	113	1	155,97	105	1	144,54
Klasse B USD, ausschüttend (D)	111	1	112,56	137	1	112,42	227	2	107,38
Klasse C USD, thesaurierend	2.263	15	153,13	2.515	17	151,12	2.501	18	140,40
Klasse C USD, ausschüttend (D)	2.398	21	112,67	2.867	25	112,53	3.247	30	107,43
Klasse E USD, thesaurierend	625	5	132,40	557	4	130,72	568	5	121,57
Klasse E USD, ausschüttend (D)	233	2	103,55	230	2	103,42	214	2	98,74
Klasse F USD, thesaurierend	7.305	49	148,11	6.703	46	145,51	2.444	18	133,97
Klasse F USD, ausschüttend (D)	682	7	103,61	500	5	103,47	477	5	98,78
Klasse X USD, thesaurierend	849	8	110,22	299	3	99,72	1	–	101,82
Klasse X USD, ausschüttend (M)	2.527	25	99,72	2.490	25	99,59	2.708	28	95,06
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	608	6	96,52
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1.250	11	96,84
Klasse Premier USD, thesaurierend	55.885	317	176,28	50.697	293	172,96	53.625	338	158,85
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	–	–	–	88	1	111,82	15.331	144	106,68
Klasse Premier EUR, thesaurierend	125.982	711	148,50	121.577	699	157,51	99.919	626	140,43
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	5.702	40	120,73	5.180	39	119,39	5.742	45	112,83
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	80.631	685	98,70	80.602	671	108,84	61.640	537	100,88
Klasse Premier EUR ausschüttend (M)	12.741	102	105,09	12.724	102	113,45	10.005	84	105,09
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M)	206	1	116,60	169	1	121,21	117	1	111,91
LM-Klasse in USD, thesaurierend	45.496	242	187,92	43.279	235	183,83	55.218	329	167,81
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 9.214	70	130,81	$ 1.468	12	127,36	$ 912	8	121,11
Klasse A USD, ausschüttend (M)	5.510	50	110,36	554	5	107,64	628	6	103,14
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	6.637	55	101,10	693	6	99,10	16	–	96,90
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	3	–	100,84	–	–	–	–	–	–
Klasse A SEK ausschüttend (M) (abgesichert)	1	–	100,75	–	–	–	–	–	–
Klasse B USD, thesaurierend	337	3	110,96	328	3	108,17	313	3	103,12
Klasse C USD, thesaurierend	857	7	123,70	700	6	120,73	715	6	115,39
Klasse C USD, ausschüttend (M)	319	3	110,04	302	3	107,42	100	1	102,93
Klasse E USD, thesaurierend	1.021	9	116,74	491	4	114,00	822	8	109,06
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1.180	11	105,87	1.152	11	103,39	1.138	11	99,14
Klasse F USD, thesaurierend	1.892	15	130,21	194	2	126,52	183	2	119,83
Klasse F USD, ausschüttend (D)	322	3	100,84	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD, ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–	1	–	97,76
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	867	7	100,76	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	17.970	127	141,43	1.996	15	137,25	1.316	10	129,66
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	18.530	147	105,49	3.172	28	103,06	–	–	–
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	512	4	98,69	191	2	96,94	194	2	95,58
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	61	–	134,25	118	1	130,96	76	–	125,73
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	2.377	17	105,62	1.951	15	103,56	2.253	17	100,83
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)	22.768	216	105,34	12.698	123	102,93	6.333	64	98,97
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	3.899	33	98,11	3.330	31	96,54	440	4	95,47
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	309.317	2.293	100,90	247.197	1.945	99,11	84.941	661	96,82
Klasse S AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1.992	27	100,43	–	–	–	–		–
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^									
Klasse A USD, ausschüttend (A)	$ 57	1	107,01	$ 57	1	107,42	$ 52	1	99,43
Klasse A USD, ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	2.514	22	115,12
Klasse X USD, thesaurierend	155	1	118,76	102	1	117,22	1.447	14	106,11
Klasse Premier USD, thesaurierend	94.812	591	160,37	97.723	618	158,05	115.046	807	142,65
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	43.585	318	114,90	57.901	460	114,12	49.307	409	105,99
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert)	7.445	100	110,03	4.962	73	108,94	3.781	56	99,14
Klasse LM USD, thesaurierend	3.370	30	111,75	2.954	27	109,91	–	–	–
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	104.499	1.177	115,81	100.259	1.177	114,34	77.746	989	103,42
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^									
Klasse A USD, ausschuttend	$ 1 607	11	148,33	$ 3 147	22	143,70	$ 409	3	127,85
Klasse A USD, ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	1.741	16	109,57
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	664	4	132,04	547	4	129,02	423	3	118,12
Klasse X USD, thesaurierend (D) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1	–	102,06
Klasse LM USD, thesaurierend	73.511	426	172,68	75.467	454	166,28	66.342	454	146,17

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2020			29. Februar 2020			28. Februar 2019		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund									
Klasse A EUR, ausschüttend (D)	€ 86	1	98,37	€ 259	3	101,31	€ 177	2	101,21
Klasse Premier EUR, thesaurierend	180	2	102,91	670	6	103,79	–	–	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	202	2	100,74	211	2	101,71	65.144	385	169,05
Klasse LM EUR, thesaurierend	44.580	254	175,24	46.826	266	176,36	10.818	106	102,06
Klasse LM EUR, ausschüttend (Q)	8.482	86	99,17	9.137	90	102,03			
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 1.153.649	7.857	146,83	$ 1.259.519	8.988	140,13	$ 1.245.618	9.644	129,17
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	325.816	3.120	104,42	440.689	4.332	101,73	387.644	3.917	98,97
Klasse A USD, ausschüttend (S)	138.314	1.184	116,78	110.113	970	113,49	164.019	1.506	108,90
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	7.421	92	109,75	7.586	110	106,03	2.659	38	98,86
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	54.914	721	103,27	58.259	878	101,85	27.044	380	100,24
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	25.959	188	124,95	25.222	202	120,46	26.798	233	114,74
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	2.070	94	150,98	2.269	110	143,52	4.627	235	131,96
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	5.227	306	117,01	5.228	321	113,54	4.263	259	110,20
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	665.598	4.330	128,81	677.301	4.946	124,04	678.424	5.067	117,72
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	11.200	91	102,63	16.676	137	110,46	9.368	80	102,35
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	17.295	142	101,76	32.274	292	100,01	–	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	18.756	145	108,38	27.380	233	106,28	34.699	290	105,10
Klasse A GBP, thesaurierend	680	3	158,19	557	3	157,36	1.488	8	140,33
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	22.471	126	133,78	100.871	605	130,06	55.357	343	121,84
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	29.981	230	97,44	35.547	289	95,88	20.864	166	94,97
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	864	65	102,65	839	65	101,12	–	–	–
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	5	–	100,35	–	–	–
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	63.666	4.687	117,50	63.521	5.375	113,55	63.285	5.428	107,68
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	25.799	25.098	1,40	41.277	42.863	1,34	38.168	41.450	1,24
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	78.263	104.233	1,02	98.354	137.007	1,00	53.142	73.347	0,98
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus (e)	7	9	0,99	–	–	–	–	–	–
Klasse B USD, thesaurierend	614	5	132,70	551	4	126,80	733	6	117,17
Klasse C USD, thesaurierend	79.608	599	132,97	86.190	678	127,22	84.384	716	117,85
Klasse C USD, ausschüttend (S)	9.190	80	115,59	11.422	102	112,29	13.618	126	107,76
Klasse A JPY, ausschüttend (M) Plus (e)	210	2	9,673,67	205	2	9,597,54	–	–	–
Klasse A NOK, thesaurierend (abgesichert)	2.148	177	106,02	1.340	122	103,16	723	64	96,30
Klasse E USD, thesaurierend	38.020	289	131,37	44.635	355	125,75	45.442	390	116,61
Klasse E USD, ausschüttend (S)	3.151	27	115,27	4.480	40	111,97	5.705	53	107,46
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	11.609	83	116,62	11.825	95	112,62	12.631	103	107,53
Klasse F USD, thesaurierend	172.170	1.239	139,00	197.803	1.494	132,39	160.329	1.319	121,54
Klasse F USD, ausschüttend (S)	13.590	115	118,30	16.560	144	115,00	23.485	213	110,33
Klasse X USD, thesaurierend	288.005	1.957	147,14	288.619	2.061	140,07	298.902	2.327	128,46
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	40.594	370	109,58	69.812	656	106,49	71.346	692	103,08
Klasse X USD, ausschüttend (S)	29.861	257	116,39	32.868	290	113,15	17.550	162	108,56
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)	41.948	296	127,95	39.146	307	123,05	42.944	368	116,61
Klasse X EUR, thesaurierend	22.765	122	156,35	23.044	130	160,90	5.143	32	143,30
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	256.926	1.616	133,25	246.582	1.745	127,98	276.085	2.008	120,86
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	27.967	230	101,80	26.698	236	102,51	17.946	156	100,87
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	9.722	78	104,82	8.629	77	102,14	8.113	71	100,57
Klasse X GBP, thesaurierend	9.229	42	162,96	8.782	42	161,72	5.980	31	143,38
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	130.133	698	139,41	131.924	768	134,02	126.647	763	125,13
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	9.873	72	103,12	10.745	83	101,20	8.385	63	99,74
Klasse X SGD, thesaurierend (abgesichert)	4.999	4.710	1,44	4.288	4.324	1,38	2.746	2.911	1,28
Klasse Premier USD, thesaurierend	737.266	4.806	153,39	886.628	6.077	145,91	520.945	3.899	133,62
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	107.968	930	116,13	119.928	1.062	112,91	64.386	594	108,32
Klasse Premier AUD, thesaurierend (abgesichert)	4.862	58	114,41	3.930	55	110,16	2.997	41	102,03
Klasse Premier AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	54.600	641	115,53	47.810	643	114,07	53.297	678	110,76
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	169.925	5.544	167,91	211.643	5.879	160,99	187.702	4.862	145,01
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	22.426	166	122,07	22.667	186	117,33	31.032	279	111,04
Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)	10.449	90	104,71	11.898	112	102,79	12.050	118	101,95
Klasse Premier EUR, thesaurierend	43.742	226	162,31	23.876	130	166,92	6.567	39	148,41
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	857.316	5.497	130,70	809.243	5.844	125,44	877.414	6.522	118,27
Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	106.657	837	106,76	73.703	637	104,73	77.615	659	103,56
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	283.897	1.622	130,90	351.520	2.180	125,75	374.134	2.406	117,24
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	356.509	2.649	100,69	371.070	2.931	98,75	307.196	2.384	97,17
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	94.469	816	12,259,09	105.369	969	11,734,52	84.544	854	11,035,98
Klasse Premier JPY, ausschüttend (S) (abgesichert)	9.932	100	10,519,66	9.538	100	10,288,34	–	–	–
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	4.531	148	112,42	5.195	189	107,64	3.925	149	99,51
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	324	23	121,34	5.575	458	116,90	7.443	624	110,14
Klasse S USD, thesaurierend	15.538	99	157,57	30.464	204	149,59	41.131	301	136,44
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	236.685	1.405	141,19	208.694	1.398	135,24	225.498	1.561	127,00
Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	86.745	1.065	110,39	67.660	952	109,05	56.143	748	105,86
Klasse LM EUR, thesaurierend	1.717	10	137,05	1.904	12	140,27	1.546	11	123,42
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^									
Klasse A USD, ausschüttend (D)	$ –	–	–	$ –	–	–	$ 59	1	94,77
Klasse Premier USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	33,791	117.71		
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	1,633	85.70		
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 24	–	112,01	$ 25	–	114,29	$ 23	–	106,76
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1	–	93,90	1	–	98,10	3	–	96,12
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	24	–	101,70	94	1	104,59	104	1	100,52
Klasse C USD, thesaurierend	1	–	111,45	1	–	113,85	1	–	106,43
Klasse E USD, thesaurierend	–	–	–	1	–	113,85	1	–	106,43
Klasse F USD, thesaurierend	10.146	88	114,85	8.552	73	116,83 años	4.756	44	108,48
Klasse X CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)	50	1	85,93	50	1	90,14	66	1	90,64
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	5.857	48	102,59	4.855	42	105,11	–	–	–
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1.273	10	95,13	893	7	99,94	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	15.734	133	99,00	14.536	130	101,34	–	–	–
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	27.143	204	99,39	25.563	196	101,65	–	–	–
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	81.186	1.016	108,33	51.649	716	110,67	17.913	245	102,89
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	31.652	268	99,13	30.112	269	101,27	–	–	–
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	835.268	5.158	121,15	735.665	4.640	123,66	706.649	4.603	115,75
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^									
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	$ –	–	–	$ –	–	–	$ 100	1	92,57
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	97	1	94,39
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	97	1	92,25
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	11	–	93,12
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	394	3	91,26
Klasse Premier USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1.103	11	103,43
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	592	5	96,61
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	5.245	60	9,743,84
Klasse Premier JPY, ausschüttend (S) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	41.813	495	9,412,17
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	22	–	93,53
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^									
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	$ 75	1	84,21	$ 77	1	99,23	$ 84	1	94
Klasse D EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.653	15	92,09	2.112	18	105,72	1.815	16	100,56
Klasse D EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	2.958	30	83,03	3.486	32	97,58	1.884	17	97,34
Klasse D USD, thesaurierend	24.911	250	99,46	39.063	344	113,53	23.357	223	104,95

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2020			29. Februar 2020			28. Februar 2019		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ (Fortsetzung)									
Klasse D USD, ausschüttend (M)	$ 27.396	311	88,10	$ 8.939	87	103,00	$ 12.231	122	99,86
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	9.399	110	85,31	2.008	20	100,38	1.974	20	98,71
Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)	1.856	18	92,52	1.433	13	106,07	601	6	100,64
Klasse M GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	909	8	85,04	1.021	8	99,50	1.040	8	98,04
Klasse F USD, thesaurierend	428	4	101,75	571	5	116,05	5.458	51	107,11
Klasse M USD, thesaurierend	1.316	15	90,09	742	7	102,52	–	–	–
Klasse M USD, ausschüttend (M)	1.575	18	87,74	1.819	18	102,57	752	8	99,43
Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)	56	1	94,65	60	1	108,31	196	2	102,50
Klasse Premier USD, thesaurierend	294.461	2.375	123,98	776.683	5.509	140,98	381.663	2.951	129,35
Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)	12.379	138	89,61	16.447	157	104,69	7.494	74	101,67
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	306.225	2.275	112,81	464.987	3.266	128,97	200.844	1.451	121,71
Klasse Premier EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert)	28.479	284	83,96	29.216	269	98,57	19.616	175	98,51
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	9.497	85	84,08	42.436	337	98,09	34.877	270	97,31
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	52.973	500	11,223,61	–	–	–	–	–	–
Klasse LM USD, thesaurierend	382.191	2.988	127,90	529.928	3.654	145,01	482.993	3.652	132,25
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^									
Actions de Distribution (M) Plus (e) Klasse A USD	$ 12	–	94,01	$ 10	–	95,11	$ 10	–	92,16
Klasse Premier USD, thesaurierend	1.830	18	104,43	1.681	16	103,59	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.889	23	104,90	2.322	20	104,74	–	–	–
Klasse LM USD, thesaurierend	796.274	6.987	113,96	1.072.652	9.503	112,87	893.928	8.542	104,66
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^									
Klasse A GBP, thesaurierend	£ 1	–	117,46	£ 1	–	115,54	£ 1	–	105,05
Klasse LM GBP, thesaurierend	115.623	964	119,99	113.271	964	117,55	85.166	801	106,27
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 8.157	64	126,59	$ 7.621	63	121,93	$ 4.611	43	107,20
Klasse Premier USD, thesaurierend	10.784	95	113,52	17.437	160	108,98	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.200	9	115,14	964	8	111,57	–	–	–
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	105.342	638	123,52	97.696	638	119,44	112.071	800	105,65
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund									
KlasseA USD, thesaurierend	$ 18.877	124	152,55	$ 21.756	146	148,61	$ 36.078	247	145,82
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1.938	20	98,56	2.356	24	96,74	2.740	28	97,20
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	291	3	98,54	290	3	97,59	–	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (S)	46.112	381	120,89	56.954	478	119,08	56.302	469	120,00
Klasse A AUD, ausschüttend (M) Plus (abgesichert)	664	12	77,89	1.328	26	78,13	392	7	80,68
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	566	5	89,86	711	7	88,46	43.370	427	89,39
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	52.637	291	151,44	58.026	343	153,41	65.247	378	151,68
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	799	8	78,78	779	9	79,60	877	9	82,56
Klasse A EUR, ausschüttend (S)	58	1	90,12	71	1	95,98	77	1	93,88
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	11.344	91	104,21	11.798	100	106,75	15.251	124	108,28
Klasse A GBP, thesaurierend	108	1	102,95	105	1	104,56	103	1	99,19
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	352	3	83,78	455	4	83,23	531	5	85,15
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	6.705	45	112,67	7.154	48	115,60	8.505	55	115,98
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	–	–	–	4	–	97,23	–	–	–
Klasse A SGD, thesaurierend	386	496	1,06	503	663	1,06	140	186	1,01
Klasse B USD, thesaurierend	74	1	139,07	72	1	135,65	130	1	133,44
Klasse B USD, ausschüttend (S)	201	2	120,83	265	2	119,04	322	3	119,97
Klasse C USD, thesaurierend	1.180	9	134,80	1.169	9	131,64	1.115	9	129,82
Klasse C USD, ausschüttend (S)	2.650	22	120,33	3.205	27	118,50	5.542	46	119,42
Klasse E USD, thesaurierend	1.288	12	103,07	1.604	16	100,71	2.291	23	99,42
Klasse E EUR (abgesichert)	22	–	92,41	20	–	91,24	41	–	92,77
Klasse E EUR(abgesichert) (IH)	1.985	15	108,94	2.347	19	110,69	3.587	29	109,95
Klasse F USD, thesaurierend	2.453	23	107,71	2.992	29	104,72	3.225	32	102,34
Klasse F USD, ausschüttend (S)	156	2	89,20	152	2	87,87	107	1	88,55
Klasse R USD, ausschüttend (S)	–	–	–	75	1	87,79	125	1	88,46
Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	118	1	93,01	224	2	95,33	5.966	47	95,65
Klasse X USD, thesaurierend	4.956	46	107,84	10.989	105	104,79	17.085	167	102,31
Klasse X USD, ausschüttend (S)	362	4	89,64	384	4	88,31	607	7	88,99
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	528	5	97,11	2.500	24	95,33	92.473	848	95,89
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	1.432	12	102,04	1.389	12	103,13	19.599	170	101,27
Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1.126	10	91,87	1.367	13	94,19	2.473	23	95,58
Klasse X GBP, thesaurierend	38.402	232	123,58	54.671	341	125,23	121.124	772	118,22
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	40.331	311	97,15	40.952	334	95,53	8.469	67	94,93
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	482	3	105,58	5.529	40	106,92	5.427	39	103,94
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)	30.395	276	82,48	31.695	300	82,35	34.251	306	84,48
Klasse X GBP,, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	17.988	142	95,04	38.786	310	97,59	54.794	422	97,92
Klasse Premier USD thesaurierend	145.017	1.160	124,99	190.725	1.572	121,36	142.026	1.200	118,31
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	5.510	60	92,48	10.374	114	91,12	10.558	115	91,82
Klasse Premier EUR, thesaurierend	9.610	56	143,45	18.781	113	150,75	41.806	257	142,76
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	38.759	345	94,15	46.941	460	92,39	28.457	270	92,74
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	77.236	506	127,86	97.818	686	129,15	77.022	535	126,59
Klasse Premier EUR, thesaurierend (S)	–	–	–	–	–	–	1.644	15	96,79
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	5.845	53	83,07	52.009	491	82,58	15.474	138	84,46
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M)(abgesichert) (IH)	3.083	23	102,41	18.765	139	105,35	11.026	79	105,65
Klasse LM USD, thesaurierend	3.789	36	105,77	3.398	33	102,39	–	–	–
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	15.512	131	117,98	129.179	1.096	117,88	124.224	1.111	111,77
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 981	8	118,48	$ 23.730	210	113,18	$ 25.225	221	114,01
Klasse A USD, ausschüttend (A)	216	2	96,69	11.264	119	94,63	11.561	118	97,91
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	3.692	32	97,91	614	6	94,35	977	9	97,81
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	2	–	93,38	–	–	89,90	1	–	92,62
Klasse A SGD, thesaurierend	–	–	–	1.133	1.555	1,01	–	–	–
Klasse C USD, thesaurierend	124	1	103,93	119	1	99,56	120	1	100,79
Klasse E USD, thesaurierend	305	3	103,25	292	3	98,96	704	7	100,28
Klasse E USD, ausschüttend (A)	312	3	98,13	367	4	95,78	330	3	99,11
Klasse F USD, thesaurierend	1.003	9	108,45	956	9	103,42	3.209	31	103,76
Klasse F USD, ausschüttend (A)	32	–	95,23	32	–	93,50	33	–	96,75
Klasse X USD, thesaurierend	63	1	99,95	60	1	95,29	659	7	95,61
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	12	–	92,87
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.883	21	102,73	2.676	21	98,72	2.769	21	100,74
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	190	2	90,41	179	2	87,55	280	2	91,92
Klasse Premier USD, thesaurierend	73.807	658	112,24	108.776	1.017	106,93	189.466	1.770	107,07
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	152	2	95,07	7.764	83	93,55	10.710	111	96,80
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	91.232	694	110,20	109.195	934	105,85	165.190	1.332	109,06
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	36.987	381	81,30	55.318	621	80,63	69.294	709	85,96
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	13.542	115	87,74	24.931	229	85,01	39.623	335	89,24
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	165	15	94,43	145	15	90,82	488	48	93,52
Klasse Premier SGD, thesaurierend (abgesichert)	206.233	248.517	1,13	192.557	248.517	1,08	200.035	248.517	1,09
Klasse LM USD, thesaurierend	10.179	87	116,61	9.654	87	110,59	164.148	1.496	109,73
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	337.679	3.149	145,38	284.841	3.149	138,84	300.802	3.043	139,37
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	22.795	161	106,65

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2020			29. Februar 2020			28. Februar 2019		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 20	–	118,87	$ 64	1	113,97	$ 3.966	37	108,61
Klasse A USD, ausschüttend (D)	108	1	98,24	86	1	97,18	216	2	97,34
Klasse Premier USD, thesaurierend	719	5	144,64	687	5	138,24	3.962	30	130,83
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	23	–	140,80	21	–	137,59	21	–	131,13
Klasse LM USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	80.679	720	112,05
Klasse S CAD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	10.355	100	135,35	9.798	100	131,78	8.720	92	124,22
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 3.067	25	124,58	$ 18.015	152	118,20	$ 28.381	246	115,41
Klasse A USD, ausschüttend (M)	695	6	111,41	12.442	117	106,78	13.531	126	107,00
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1	–	93,29	7	–	89,51	19	–	90,01
Klasse A SGD, thesaurierend	2.032	2.592	1,07	–	–	–	–	–	–
Klasse C USD, thesaurierend	1.365	12	114,93	1.366	12	109,31	1.511	14	107,27
Klasse E USD, thesaurierend	628	6	112,73	684	6	107,28	2.658	25	105,38
Klasse F USD, thesaurierend	2.839	26	108,00	2.307	23	102,27	2.162	22	99,45
Klasse C USD, ausschüttend (M)	879	9	95,49	843	9	91,51	868	9	91,69
Klasse X USD, thesaurierend	311	3	112,59	295	3	106,56	286	3	103,52
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	63	1	86,81	57	1	84,27	46	–	85,94
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	538	4	102,48	–	–	–	4	–	102,42
Klasse Premier USD, thesaurierend	359.139	2.762	130,05	291.302	2.369	122,99	344.914	2.891	119,30
Klasse Premier USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	1.232	10	118,55	2.323	20	115,68	2.204	20	109,81
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–	8.065	86	93,26
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	2.877	22	97,87	2.968	24	97,71	3.571	28	97,50
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	19.086	180	157,32	17.450	180	155,06	18.214	180	148,65
Klasse LM USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	40.400	374	107,99
Klasse LM EUR, thesaurierend	5.882	44	112,43	6.753	53	114,60	5.445	45	107,20
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	197.039	1.603	182,45	192.120	1.714	179,29	179.551	1.544	170,77
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 99	1	101,99	$ 1.307	13	101,20	$ 166	2	98,81
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	5	–	98,81	5	–	100,01	–	–	–
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	74.694	1.000	101,27	71.037	1.000	109,05	–	–	–
Klasse BW LM GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	–	–	–	241.581	1.311	143,76	418.149	2.342	134,64
Klasse BW LM GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	109.541	776	105,53	734.473	5.183	110,52	742.293	5.183	107,98
Klasse BW Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	255.047	2.101	101,71	269.871	2.289	106,82	240.311	2.090	101,11
Klasse BW Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	120.880	614	147,19	165.634	855	151,16	302.835	1.605	142,28
Klasse BW Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	23.028	163	105,56	49.823	351	110,77	188.533	1.313	108,25
Klasse BW Premier USD, thesaurierend	1	–	125,61	1	–	123,72	1	–	119,05
Klasse BW Premier USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	27.095	256	106,01	32.198	304	105,91	20.441	203	100,94
Klasse X USD, thesaurierend	5	–	107,73	6	–	106,45	1	–	102,91
Klasse Premier USD, thesaurierend	25.186	238	105,81	24.873	238	104,50	33.680	333	101,07
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	5	–	100,00	5	–	100,72	–	–	–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 8.950	63	143,05	$ 4.938	37	134,03	$ 2.016	17	119,89
Klasse A USD, ausschüttend (A)	30	–	100,24	–	–	–	–	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (D)	30	–	100,15	–	–	–	–	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	7.313	72	102,26	5.733	59	97,92	19.359	213	90,75
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	6.488	49	112,02	5.590	48	106,04	9.549	86	97,65
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	18.836	155	101,99	17.384	159	98,81	16.258	152	94,05
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	15.546	142	91,45	12.205	125	88,46	14.255	148	84,40
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	888	7	96,24	646	5	93,04	817	7	87,59
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	4.469	5.641	1,08	275	368	1,04	49	69	0,97
Klasse C USD, ausschüttend (D)	31	–	113,03	30	–	107,57	30	–	98,36
Klasse E USD, thesaurierend	75	1	109,37	–	–	–	–	–	–
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	30	–	109,84	1	–	104,20	1	–	96,45
Klasse F USD, ausschüttend (D)	1.176	11	109,40	1.100	11	104,12	–	–	–
Klasse X USD, ausschüttend (D)	246	2	109,84	234	2	104,54	481	5	95,60
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	3.226	31	105,66	244	2	100,87	407	4	92,96
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	3.698	33	94,90	3.478	34	91,55	3.607	37	86,86
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	927	7	100,07	1.328	11	96,49	2.221	19	90,37
Klasse Premier USD, thesaurierend	479	5	105,56	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1.089	10	107,74	931	9	102,80	492	5	94,61
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.915	13	123,07	667	5	116,01	9.303	77	106,06
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1.065	9	96,04	1.139	11	92,58	2.554	26	87,74
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	141	1	100,54	204	2	96,85	219	2	90,56
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	7.319	515	122,85	4.256	353	115,90	5.967	521	105,75
Klasse S USD, thesaurierend	36.192	352	102,96	–	–	–	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.865	21	113,35	3.648	31	106,82	9.253	83	97,60
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	4.681	36	108,01	4.188	36	104,02	2.456	22	98,42
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1.858	13	103,66	2.609	20	99,77	3.127	25	93,18
Klasse LM AUD, ausschüttend (Q) (abgesichert)	242	3	108,92	201	3	104,41	195	3	96,35
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 11.092	105	105,28	$ 508	4	117,05	$ 806	7	109,05
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	5	–	94,74	5	–	106,09	8	–	101,75
Klasse Premier USD, thesaurierend	23.142	211	109,59	28.965	238	121,46	29.466	262	112,42
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	2.729	99	103,94
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	418	3	106,29
Klasse LM USD, thesaurierend	10.312	88	117,39	11.363	88	129,35	10.397	88	118,35
Klasse S BRL, thesaurierend (abgesichert)	1.883	103	100,29	2.544	103	110,61	–	–	–
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^									
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	$ 12	–	95,36	$ 11	–	93,91	$ 11	–	93,53
Klasse S EUR, ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)	11.056	100	92,65	10.523	100	95,32	10.914	100	95,96
Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ –	–	–	$ –	–	–	$ 1	–	99,49
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	1	–	92,19
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	28.135	255	97,09
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 9	–	91,15	$ 10	–	94,12	$ 11	–	103,75
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	340	506	0,91	3.745	5.470	0,95	–	–	–
Klasse X USD, thesaurierend	10	–	92,65	10	–	95,26	11	–	104,19
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	17	–	78,31	16	–	83,96	11	–	100,26
Klasse Premier USD, thesaurierend	14.781	159	92,94	16.992	178	95,49	1.067	10	104,27
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	10	–	87,76	9	–	91,11	11	–	102,47
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	321.403	4.740	91,94	295.192	4.740	95,60	351.762	4.740	104,62
Klasse LM SGD, thesaurierend (abgesichert)	65.758	95.926	0,93	66.108	96.043	0,96	10	14	1,04
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 18	–	139,62	$ 153	1	126,81	$ 208	2	131,29
Klasse Premier USD, thesaurierend	412	3	145,94	373	3	131,92	676	5	135,28
Klasse S USD, thesaurierend	–	–	–	1.857	16	115,54	1.900	16	118,20
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.091	7	134,11	918	7	122,03	1.947	13	128,32

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2020			29. Februar 2020			28. Februar 2019		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
Legg Mason ClearBridge Value Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 11.648	104	111,53	$ 13.068	125	104,51	$ 15.603	144	108,62
Klasse A USD, ausschüttend (A)	21.340	101	211,89	21.259	107	198,56	25.581	124	206,36
Klasse A EUR, thesaurierend	292	2	118,29	289	2	119,85	1.881	14	121,00
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	26	–	108,52	23	–	102,60	25	–	109,57
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	15	–	149,85	28	–	146,53	29	–	147,22
Klasse A SGD, thesaurierend	1.773	2.560	0,94	1.818	2.801	0,90	2.408	3.570	0,91
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	216	164	1,79	140	114	1,70	640	487	1,78
Klasse C USD, thesaurierend	371	3	113,76	868	8	106,87	1.307	12	111,64
Klasse C USD, ausschüttend (A)	1.219	6	193,63	2.185	12	181,90	2.576	14	190,01
Klasse F USD, thesaurierend	1.885	9	219,15	1.780	9	204,74	1.978	9	211,51
Klasse F USD, ausschüttend (A)	169	1	121,61	158	1	114,09	182	2	117,98
Klasse X USD, ausschüttend (A)	2.449	16	152,06	1.437	10	142,77	1.582	11	147,63
Klasse Premier USD, thesaurierend	296.370	1.504	196,99	282.618	1.539	183,65	287.897	1.524	188,92
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	79	1	135,58	90	1	127,72	312	2	132,05
Klasse Premier EUR, thesaurierend	161	1	152,22	139	1	153,40	471	3	153,06
Galleon Klasse	–	–	–	–	–	–	28	–	140,85
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ –	–	–	$ –	–	–	$ 754	7	100,67
Klasse A USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	374	3	110,67
Klasse C USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	144	1	98,42
Klasse C USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	68	1	108,03
Klasse Premier USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	15.958	149	107,14
Klasse LM USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	14.761	152	97,10
Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$			$			$		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	138	1	102,87
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	–	–	–	–	–	–	515	6	88,87
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	514	5	96,23
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	422	4	94,80
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	503	5	81,84
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	534	6	92,31
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	433	4	98,51
Klasse LM USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	433	4	85,02
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 28.310	109	258,93	$ 31.070	141	219,93	$ 34.723	168	206,53
Klasse A USD, ausschüttend (A)	12.367	48	258,75	12.343	56	219,77	16.128	78	206,38
Klasse A EUR, thesaurierend	1.103	3	317,75	2.785	9	291,79	4.555	15	265,98
Klasse B USD, thesaurierend	474	2	236,54	543	3	201,41	574	3	190,09
Klasse B USD, ausschüttend (A)	1.007	4	242,23	931	5	206,25	1.258	6	194,67
Klasse C USD, thesaurierend	16.793	71	236,51	16.745	83	201,39	18.119	95	190,07
Klasse C USD, ausschüttend (A)	19.724	81	242,16	17.974	87	206,19	24.665	127	194,61
Klasse E USD, thesaurierend	16.529	60	276,01	14.773	63	235,31	14.450	65	222,65
Klasse E USD, ausschüttend (A)	1.015	4	276,17	837	4	235,45	915	4	222,78
Klasse F USD, thesaurierend	21.814	91	239,94	16.642	82	203,18	18.458	97	189,66
Klasse F USD, ausschüttend (A)	3.174	10	318,78	2.634	10	270,97	1.810	7	253,74
Klasse X USD, ausschüttend (A)	2.661	13	206,07	3.494	20	175,20	11.507	70	164,05
Klasse X EUR, thesaurierend	230	1	240,21	101	–	219,79	209	1	199,06
Klasse Premier USD, thesaurierend	2.913	9	327,81	12.704	46	277,08	3.542	14	257,66
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	3.184	8	384,39	3.398	10	327,66	3.251	11	306,76
Klasse Premier EUR, thesaurierend	35.112	85	344,58	29.678	85	314,83	27.598	85	284,15
Klasse LM USD, thesaurierend	13.294	75	177,70	11.152	74	149,73	2.571	19	138,36
Klasse LM EUR, thesaurierend	3.220	16	169,29	3.257	19	154,24	2.894	18	138,34
Klasse A (G) USD, thesaurierend	4.230	16	269,81	3.815	17	228,77	4.579	21	214,08
Klasse B (G) USD, thesaurierend	4	–	252,16	3	–	214,43	6	–	201,68
Klasse L (G) USD, thesaurierend	3.159	13	252,41	3.789	18	214,55	3.764	19	201,78
Klasse GA USD, thesaurierend	4.145	15	271,71	3.739	16	230,57	3.693	17	216,13
Klasse GA EUR, thesaurierend	363	1	327,35	309	1	300,28	346	1	273,27
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	706	2	326,33	599	2	299,34	625	2	272,33
Klasse GE USD, thesaurierend	137	1	253,56	116	1	215,98	165	1	203,99
Klasse GE EUR, thesaurierend	9	–	305,25	7	–	281,04	46	–	257,63
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 273.727	685	399,62	$ 224.061	747	300,13	$ 241.848	875	276,38
Klasse A USD, ausschüttend (A)	47.049	118	399,81	37.898	126	300,28	41.887	151	276,51
Klasse A EUR, thesaurierend	123.683	193	538,12	91.081	189	436,94	86.866	196	390,56
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	9.230	36	212,14	8.053	45	160,52	11.494	67	151,80
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	38	–	109,63
Klasse B USD, thesaurierend	348	1	368,27	347	1	277,28	529	2	256,61
Klasse B USD, ausschüttend (A)	151	–	373,89	130	–	281,51	120	–	260,54
Klasse C USD, thesaurierend	29.408	80	368,39	20.993	76	277,37	19.575	76	256,71
Klasse C USD, ausschüttend (A)	14.862	40	373,96	13.344	47	281,56	39.719	152	260,59
Klasse E USD, thesaurierend	17.705	81	219,48	18.161	110	165,46	14.742	96	153,52
Klasse E USD, ausschüttend (A)	893	4	212,85	1.182	7	160,46	1.720	12	148,89
Klasse F USD, thesaurierend	134.053	623	215,30	106.377	660	161,22	79.268	537	147,57
Klasse F USD, ausschüttend (A)	26.503	123	214,85	22.217	138	160,88	19.654	133	147,26
Klasse U USD, thesaurierend	267.216	1.660	161,02	225.116	1.872	120,28	318.493	2.907	109,57
Klasse U EUR, thesaurierend	200.284	1.011	165,96	135.651	917	134,01	103.769	770	118,49
Klasse X USD, thesaurierend	39.589	164	240,90	52.159	289	180,36	54.938	333	165,05
Klasse X EUR, thesaurierend	3.343	18	158,08	4.274	30	127,99	2.343	18	113,70
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	21.835	96	189,72	16.764	106	143,04	6.523	43	134,46
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1.631	10	143,42
Klasse X GBP, thesaurierend	22.730	70	242,05	14.274	59	189,02	570	3	167,52
Klasse Premier USD, thesaurierend	339.307	1.344	252,45	281.696	1.493	188,68	273.110	1.587	172,06
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	6.585	55	119,13	4.428	50	89,08	–	–	–
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	20.336	681	163,60	6.587	237	124,16	3.367	114	111,29
Klasse Premier EUR, thesaurierend	94.345	396	199,41	56.380	317	161,08	410	3	142,58
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	35.104	140	209,89	44.911	257	158,02	23.769	141	147,88
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	3.072	24	107,89	1.408	15	87,28	–	–	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend	72.123	221	243,77	51.320	211	190,00	4.004	18	167,83
Klasse LM USD, thesaurierend	82.463	357	231,20	62.981	366	172,27	83.007	532	156,11
Klasse LM EUR, thesaurierend	795	3	220,22	793	4	177,44	687	4	156,06
Klasse A (G) USD, thesaurierend	9.804	24	415,42	7.718	25	311,46	7.980	28	285,80
Klasse B (G) USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	3	–	269,46
Klasse L (G) USD, thesaurierend	11.887	31	388,58	9.129	31	292,06	8.578	32	269,36
Klasse GA USD, thesaurierend	1.733	4	493,61	1.300	4	370,39	1.731	5	340,46
Klasse GA EUR, thesaurierend	363	1	527,63	273	1	427,98	255	1	381,82
Klasse GE USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	7	–	319,34
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ $101.579	483	210,47	$ 111.269	570	195,16	$ 186.764	951	196,43
Klasse A USD, ausschüttend (A)	23.667	112	210,60	25.352	130	195,28	42.369	216	196,55
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	11.554	96	162,69	10.783	107	154,79	14.264	128	157,64
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	37	–	112,73	237	2	105,17	237	2	109,08
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	479	24	138,85	442	24	128,59	758	39	129,30
Klasse A EUR, thesaurierend	12.719	37	284,75	16.599	53	285,66	23.525	74	279,08
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.597	9	151,20	32.233	207	141,21	19.792	119	146,05

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2020			29. Februar 2020			28. Februar 2019		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund (Fortsetzung)									
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	$ 14	–	109,37	$ 12	–	102,11	$ 399	3	105,87
Klasse A GBP, thesaurierend	765	4	148,90	734	4	143,96	988	5	140,07
Klasse A HKD, thesaurierend	1.310	81	125,62	2.112	140	117,18	1.901	125	118,92
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	27	1	157,46	28	2	149,31	43	3	154,65
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	2.062	1.613	1,74	1.839	1.573	1,63	2.446	2.005	1,65
Klasse B USD, thesaurierend	777	4	205,51	873	5	191,03	1.731	9	193,15
Klasse B USD, ausschüttend (A)	1.489	8	196,93	1.556	8	183,06	1.849	10	185,18
Klasse C USD, thesaurierend	10.488	51	205,45	10.458	55	190,98	14.764	76	193,19
Klasse C USD, ausschüttend (A)	14.266	72	196,93	16.594	91	183,06	31.683	171	185,18
Klasse E USD, thesaurierend	13.418	66	204,64	14.611	77	190,46	18.726	97	193,15
Klasse E USD, ausschüttend (A)	1.113	5	204,67	1.105	6	190,49	2.148	11	193,18
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	224	1	129,17	212	2	121,05	281	2	126,19
Klasse F USD, thesaurierend	12.382	53	233,37	13.095	61	215,74	19.799	92	215,84
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1.784	8	233,53	1.734	8	215,89	2.664	12	215,99
Klasse X USD, thesaurierend	9.819	59	167,32	13.156	85	154,65	35.409	229	154,64
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1.146	6	185,98	1.785	10	171,89	11.479	67	171,88
Klasse X EUR, thesaurierend	898	5	160,81	811	5	160,66	1.807	10	155,88
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	161	1	125,10	2.729	21	116,41	4.635	34	119,67
Klasse X GBP, thesaurierend	32.106	120	200,10	33.635	136	192,88	67.134	271	186,50
Klasse Premier USD, thesaurierend	357.651	1.290	277,16	438.890	1.716	255,71	490.790	1.926	254,80
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	147	1	103,40
Klasse Premier EUR, thesaurierend	3.511	11	271,76	2.859	10	271,11	18.505	62	262,43
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	42	–	129,77	458	3	120,60	851	6	123,55
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	11	–	256,31	10	–	256,58	21	–	248,86
Klasse Premier GBP, thesaurierend	255	2	109,32	653	5	105,23	59.027	439	101,36
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	2.167	12	130,37	11.997	77	122,01	16.174	99	123,70
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	98.132	297	247,02	147.586	482	238,61	402.225	1.315	230,62
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	1.059	30	129,63	764	25	120,98	1.154	36	121,52
Klasse LM USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1.736	17	102,34
Klasse LM EUR, thesaurierend	935	6	140,45	967	6	139,65	873	6	134,19
Klasse A (G) USD, thesaurierend	19.509	89	219,84	18.912	93	203,48	22.005	108	204,09
Klasse B (G) USD, thesaurierend	7	–	205,65	12	–	190,84	13	–	192,37
Klasse L (G) USD, thesaurierend	8.225	40	205,63	8.451	44	190,81	9.269	48	192,34
Klasse GA EUR, thesaurierend	135	–	298,83	125	–	299,18	138	–	291,55
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	62	–	297,69	57	–	298,04	70	–	290,53
Klasse GE USD, thesaurierend	62	–	259,67	58	–	241,40	58	–	244,25
Klasse GE EUR, thesaurierend	35	–	278,40	33	–	279,78	33	–	274,74
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 10.549	86	122,81	$ 10.649	89	119,27	$ 10.906	96	113,27
Klasse A USD, ausschüttend (A)	175	2	97,68	246	3	97,73	346	4	94,98
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	2.336	30	79,08	3.497	44	78,72	8.382	107	78,65
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	107	1	92,65	106	1	91,54	124	1	90,36
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	1.209	12	97,16	1.147	12	95,83	332	4	92,68
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.478	27	74,67	1.562	31	76,44	3.634	66	77,21
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	85	7	80,52	83	7	80,47	154	13	80,55
Klasse A EUR, thesaurierend	116	1	101,71	119	1	106,77	133	1	98,42
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.136	10	97,56	208	2	95,62	80	1	93,33
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	333	4	77,31	308	4	77,11	322	4	78,23
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	860	84	78,94	1.442	142	79,05	3.537	349	79,60
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	132	234	0,77	232	419	0,77	517	899	0,78
Klasse B USD, thesaurierend	13	–	108,47	13	–	105,60	45	–	100,80
Klasse B USD, ausschüttend (A)	–	–	–	13	–	97,20	12	–	94,50
Klasse C USD, thesaurierend	989	8	117,85	1.232	11	114,73	1.318	12	109,51
Klasse C USD, ausschüttend (A)	227	2	97,59	255	3	97,21	245	3	94,50
Klasse C USD, ausschüttend (Q)	66	1	90,20	65	1	88,93	221	3	86,03
Klasse F USD, thesaurierend	18.248	158	115,16	18.346	165	111,50	20.510	195	105,26
Klasse F EUR, thesaurierend	48	–	105,28	47	–	110,19	50	–	100,96
Klasse F EUR, ausschüttend (A)	72	1	89,20	72	1	96,98	70	1	91,45
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	92	1	96,50	90	1	95,04	31	–	93,24
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	56	1	92,63	52	1	92,10	54	1	92,85
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	24	–	95,49
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 1	–	127,29	$ –	–	–	$ –	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (A)	334	2	199,60	340	2	166,89	147	1	146,53
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	577	3	180,13	175	1	151,88	144	1	137,01
Klasse A SEK, thesaurierend	58.660	5.168	98,19	1	–	92,29	–	–	–
Klasse F USD, thesaurierend	484	4	127,56	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD, thesaurierend	1.378	13	106,70	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD, ausschüttend (A)	425	2	205,40	1.525	9	171,27	333	2	149,54
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	79	–	185,59	154	1	155,97	142	1	139,88
Klasse X GBP, thesaurierend	12.359	42	220,17	5.475	22	191,19	471	2	161,29
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1.937	13	112,48	864	7	95,14	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	11.922	104	114,30	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	8	–	206,14	348	2	172,11	303	2	150,18
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	8	–	188,79	313	2	158,43	288	2	141,59
Klasse Premier GBP, thesaurierend	1.965	6	235,86	1.003	4	204,63	576	3	172,00
Klasse S USD, thesaurierend	41.302	282	146,41	19.697	162	121,55	6.589	63	105,08
Klasse S EUR, thesaurierend	1	–	105,59	–	–	–	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	1	–	110,81	–	–	–	–	–	–
Klasse S GBP, thesaurierend	31.575	206	114,80	16.095	126	99,30	–	–	–
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	44.094	284	116,07	2.887	23	97,74	–	–	–
Klasse S GBP, ausschüttend (Q)	2.567	17	113,95	795	6	99,14	–	–	–
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 702	5	140,27	$ 672	6	111,79	$ 498	5	99,62
Klasse Premier USD, thesaurierend	9.133	64	143,35	7.791	69	113,68	4.513	45	100,28
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	€ 164	19	10,54	€ 98	10	10,73	€ 1	–	10,12
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	47.541	5.069	11,19	77.350	6.985	12,22	5.524	575	10,93
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	39.899	5.433	8,76	43.130	4.863	9,79	3.299	405	9,26
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	2.024	204	11,85	3.305	302	12,07	1.638	162	11,52
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	366	70	8,50	231	40	9,69	–	–	–
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2.696	2.529	8,71	2.664	2.106	9,74	–	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend	86.136	7.858	10,96	98.029	8.146	12,03	78.665	7.128	11,04
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	1.224	128	9,55	867	86	10,02	–	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	1.982	195	10,18	1.324	117	11,33	3	–	10,69
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	822	1.555	0,86	915	1.455	0,97	249	416	0,92
Klasse C USD, thesaurierend	188	22	10,22	257	27	10,40	236	27	9,86
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)	684	76	10,72	588	55	11,74	243	26	10,54
Klasse E USD, thesaurierend	1.536	153	11,96	1.638	148	12,20	896	88	11,61
Klasse F USD, thesaurierend	860	97	10,62	1.066	109	10,75	1.166	132	10,08
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)	2.066	223	11,07	3.011	276	12,05	17	2	10,70
Klasse X USD, thesaurierend	389	45	10,31	425	45	10,43	–	–	–
Klasse X USD, ausschüttend (A)	336	38	10,54	376	39	10,66	324	36	10,19
Klasse X EUR, thesaurierend	50.418	4.602	10,96	50.974	4.257	11,97	13	1	10,87

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2020			29. Februar 2020			28. Februar 2019		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ (Fortsetzung)									
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	€ –	–	–	€ 358	36	10,02	€ –	–	–
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	309	28	9,68	130	11	10,31	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	5.419	483	13,39	4.491	367	13,51	2.504	226	12,60
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	2.952	1.505	12,82	4.100	1.441	14,05	2.651	932	12,15
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	37.794	6.161	9,55	43.380	6.336	10,15	61.661	9.630	9,58
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) Plus (e)	9.444	1.527	9,63	10.334	1.509	10,15	30.357	4.729	9,61
Klasse Premier EUR, thesaurierend	210.805	11.974	17,60	287.330	14.949	19,22	117.196	6.735	17,40
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	38.572	3.815	10,11	14.036	1.331	10,55	–	–	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend	2.005	142	12,63	2.145	139	13,30	2.318	166	12,00
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	5.688	470	10,80	6.498	470	11,90	5.859	470	10,69
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	75.446	3.802	17,71	81.523	3.785	18,55	78.247	3.804	17,64
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)	29.620	2.389	11,07	29.321	2.146	11,77	5.697	449	10,89
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert)	4.215	517	9,73	4.044	424	10,53	–	–	–
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 190	3	75,35	$ 219	2	88,93	$ 199	2	91,20
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	150	2	73,25	178	2	87,04	182	2	89,91
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	629	7	70,75	690	7	83,91	745	7	87,87
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	619	7	69,04	732	7	85,53	745	7	85,23
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	791	9	71,23	867	9	84,40	934	9	88,21
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 112.171	630	178,02	$ 111.679	671	166,44	$ 196.967	1.078	182,74
Klasse A USD, ausschüttend (A)	60.501	112	540,65	66.558	132	505,48	86.332	156	554,97
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	6.916	66	141,87	5.001	56	138,32	8.766	80	153,83
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	1.289	75	117,95	832	53	110,35	1.158	64	121,19
Klasse A EUR, thesaurierend	8.303	36	195,32	9.369	43	197,39	17.211	72	210,41
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	3.080	19	138,56	4.156	29	130,98	11.639	69	147,78
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	122	1	105,93	104	1	100,09	169	1	112,93
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	512	3	112,90	902	6	108,22	1.365	9	120,89
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	619	2	210,33	675	3	205,08	721	2	217,64
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	54	3	137,09	35	3	132,53	90	6	149,66
Klasse A SGD, thesaurierend	2.229	1.710	1,77	1.982	1.626	1,70	2.620	1.957	1,81
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	7.396	5.872	1,71	2.538	2.176	1,62	3.620	2.724	1,80
Klasse B USD, thesaurierend	107	1	186,17	106	1	174,49	135	1	192,53
Klasse B USD, ausschüttend (A)	5	–	498,00	4	–	466,90	6	–	515,21
Klasse C USD, thesaurierend	2.507	13	186,49	2.503	14	174,80	5.332	28	192,88
Klasse C USD, ausschüttend (A)	4.040	8	494,66	4.858	10	463,64	6.634	13	511,60
Klasse E USD, thesaurierend	1.676	10	167,66	1.798	11	157,34	2.970	17	174,06
Klasse E USD, ausschüttend (A)	307	2	167,63	336	2	157,32	608	3	174,03
Klasse E EUR, thesaurierend	333	1	201,81	435	2	204,70	522	2	219,78
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	141	1	112,74	151	1	106,92	340	2	121,55
Klasse F USD, thesaurierend	7.862	41	190,72	8.058	45	177,78	12.198	63	194,01
Klasse F USD, ausschüttend (A)	180	1	190,92	196	1	177,97	705	4	194,22
Klasse R USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	7	–	115,61
Klasse R EUR thesaurierend	173	1	150,81	159	1	152,03	169	1	161,19
Klasse X USD, thesaurierend	7.002	42	168,49	10.278	65	156,94	23.071	135	171,01
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1.270	11	116,82	1.583	15	108,81	2.264	19	118,57
Klasse X EUR, thesaurierend	9.577	83	96,40	1.952	18	96,99	2.206	19	102,61
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	703	5	121,00	2.027	16	113,95	12.000	83	127,77
Klasse X GBP, thesaurierend	21.154	77	204,76	23.923	94	198,87	38.280	138	209,53
Klasse X GBP, ausschüttend (A)	1.098	4	187,41	1.032	4	181,98	2.139	8	191,96
Klasse Premier USD, thesaurierend	118.670	539	220,29	112.162	548	204,83	271.040	1.219	222,41
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	1.757	101	95,64	2.148	103	92,92	2.546	96	99,70
Klasse Premier EUR, thesaurierend	6.968	22	267,09	4.192	14	268,56	6.555	20	282,97
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.801	18	129,98	2.874	21	122,18	12.071	78	136,39
Klasse Premier GBP, thesaurierend	45.692	177	193,26	62.906	262	187,38	149.111	571	196,77
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	661	28	87,59	546	26	83,03	1.453	60	90,94
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 28.323	169	167,17	$ 29.062	180	161,86	$ 39.559	235	168,55
Klasse A USD, ausschüttend (A)	8.045	28	283,17	8.577	31	274,22	10.668	37	285,56
Klasse A EUR, thesaurierend	1.613	6	244,85	1.227	4	256,29	2.195	7	259,04
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	52	–	121,84	49	–	119,19	78	1	127,45
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	57	–	173,56	66	–	181,83	31	–	183,73
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	89	–	250,28	104	–	252,78	34	–	254,47
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	6	–	123,46	6	–	123,00	8	1	131,55
Klasse B USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	27	–	166,97
Klasse B USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	16	–	265,11
Klasse C USD, thesaurierend	2.515	15	164,21	2.605	16	159,40	3.630	22	166,82
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2.713	10	259,62	2.929	12	252,04	4.246	16	263,78
Klasse E USD, thesaurierend	584	3	177,09	739	4	172,14	1.624	9	180,62
Klasse E USD, ausschüttend (A)	4	–	104,27	115	1	172,11	136	1	180,59
Klasse E EUR, thesaurierend	20	–	103,51	18	–	108,77	7	–	110,73
Klasse F USD, thesaurierend	4.752	23	204,25	4.806	24	197,20	5.749	28	204,12
Klasse F USD, ausschüttend (A)	74	–	218,50	59	–	211,47	92	–	218,89
Klasse R USD, thesaurierend	384	3	120,10	553	5	116,02	978	8	120,21
Klasse X USD, thesaurierend	497	3	147,29	3.881	27	142,11	5.650	38	146,88
Klasse X USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	8	–	102,87
Klasse Premier USD, thesaurierend	1.216	5	221,43	1.042	5	213,25	922	4	219,63
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	6.887	45	154,60	7.659	51	150,34	12.351	79	155,51
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	1.463	6	185,49	1.685	7	188,03	2.509	10	188,12
Klasse LM EUR, thesaurierend	1.004	6	137,58	1.028	7	142,78	949	6	141,65
Klasse A (G) USD, thesaurierend	872	5	184,85	924	5	178,47	1.041	6	184,73
Klasse L (G) USD, thesaurierend	954	6	172,80	923	6	167,26	960	6	174,00
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	€ 679	9	90,43	€ 749	9	88,69 € 1,102	€ 14	92.52	
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	1.175	12	120,66	1.687	15	126,85	2.435	22	125,14
Klasse A USD, ausschüttend (A)	977	7	167,41	1.113	7	170,87	1.678	10	182,78
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3.875	53	87,67	7.006	82	94,83	7.931	90	99,88
Klasse A USD, ausschüttend (Q) (abgesichert)	–	–	–	1	–	99,97	1	–	101,42
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.470	28	83,81	1.602	29	92,45	4.067	66	98,32
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	72	6	92,14	211	16	99,81	109	8	105,31
Klasse A EUR, thesaurierend	290	2	165,69	328	2	175,15	461	3	177,20
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	80	1	143,18	557	4	157,47	2.758	17	163,47
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	291	3	88,01	327	3	94,90	382	4	99,80
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	179	367	0,79	241	432	0,86	334	566	0,91
Klasse B USD, thesaurierend	113	2	84,15	120	2	82,74	255	3	86,79
Klasse B USD, ausschüttend (A)	48	–	165,50	51	–	168,09	52	–	179,74
Klasse C USD, thesaurierend	145	2	85,96	709	9	84,51	940	12	88,54
Klasse C USD, ausschüttend (A)	1.118	8	165,38	1.219	8	167,96	1.444	9	179,62
Klasse C USD, ausschüttend (Q) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	19	–	101,03
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	333	4	103,69	321	4	103,08
Klasse E USD, ausschüttend (Q) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1	–	100,83
Klasse F USD, thesaurierend	1.563	17	110,87	1.640	17	108,41	1.430	14	112,34
Klasse F USD, ausschüttend (Q) (abgesichert)	–	–	–	1	–	100,01	1	–	101,45

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2020			29. Februar 2020			28. Februar 2019		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund (Fortsetzung)									
Klasse Premier USD, thesaurierend	$ 1.297	17	93,27	$ 1.643	20	90,98	$ –	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend	45	–	120,35	48	–	126,58	185	1	126,79
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	182	8	105,28	150	6	111,13	55	2	109,27
Klasse LM USD, thesaurierend	3.107	31	118,10	2.961	28	114,89	3.986	38	117,90
Klasse LM EUR, thesaurierend	2.390	21	113,24	2.672	23	118,76	2.310	20	118,17
Klasse A (G) USD, thesaurierend	838	11	93,32	902	11	91,42	1.037	12	95,01
Klasse B (G) USD, thesaurierend	1	–	86,73	1	–	85,16	2	–	88,98
Klasse L (G) USD, thesaurierend	181	2	87,50	191	2	85,93	194	2	89,75
Klasse GA USD, thesaurierend	795	6	159,87	839	6	156,67	1.022	7	162,92
Klasse GA EUR, thesaurierend	12.014	71	170,10	13.318	74	179,66	18.525	102	181,34
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	87	1	136,10	114	1	150,04	119	1	155,69
Klasse GE USD, thesaurierend	38	–	147,82	40	–	145,40	40	–	152,36
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 3.821	29	130,71	$ 5.640	43	132,68	$ 6.194	42	145,76
Klasse A USD, ausschüttend (A)	3.830	17	219,72	4.295	19	230,43	6.329	24	258,91
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	6.565	76	86,91	10.723	119	90,09	15.914	154	103,25
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	4.096	63	87,83	4.288	71	92,51	7.552	99	107,46
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	255	22	78,50	368	31	81,55	294	21	93,78
Klasse A EUR, thesaurierend	79	1	110,97	118	1	121,76	516	3	129,92
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	2.365	212	86,54	3.367	291	90,24	6.714	506	104,17
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	137	198	0,94	137	194	0,98	172	205	1,13
Klasse B USD, ausschüttend (A)	36	–	214,71	79	–	224,31	88	–	252,04
Klasse C USD, thesaurierend	87	1	90,59	194	2	92,18	214	2	101,78
Klasse C USD, ausschüttend (A)	1.480	7	213,55	1.784	8	223,09	2.289	9	250,67
Klasse E USD, thesaurierend	68	1	124,51	100	1	126,89	111	1	140,49
Klasse E USD, ausschüttend (A)	10	–	90,62	10	–	94,48	12	–	106,14
Klasse F USD, thesaurierend	24	–	115,64	24	–	117,06	73	1	127,85
Klasse F USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	208	2	113,27
Klasse X USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	1	–	126,96
Klasse X EUR, thesaurierend	4.533	43	87,93	4.586	43	96,16	4.656	40	101,82
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	2.521	77	120,34	2.393	76	122,75	3.134	88	134,78
Klasse S USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	2.371	23	105,38
Klasse GA USD, thesaurierend	6.785	52	131,46	7.271	54	133,42	8.636	59	146,49
Klasse GA EUR, thesaurierend	176	1	140,12	202	1	153,73	234	1	163,82
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	20	–	121,78	21	–	138,15	31	–	150,62
Klasse LM SGD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	17.978	27.864	0,90	20.217	27.952	0,98
Klasse GE USD, thesaurierend	436	4	121,96	444	4	124,24	491	4	137,44
Klasse GE EUR, thesaurierend	–	–	130,90	14	–	143,53	15	–	154,11
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 144	2	68,89	$ 154	2	66,82	$ 290	4	73,23
Klasse A USD, ausschüttend (A)	63	1	71,73	61	1	70,77	110	1	78,51
Klasse A EUR, thesaurierend	5	–	96,86	4	–	101,53	3	–	108,00
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	33	–	92,95	33	–	95,61	37	–	102,53
Klasse B USD, thesaurierend	–	–	–	127	1	97,35	–	–	–
Klasse B USD, ausschüttend (A)	8	–	70,27	8	–	69,02	9	–	76,57
Klasse C USD, thesaurierend	8	–	72,00	40	1	70,01	44	1	77,11
Klasse C USD, ausschüttend (A)	77	1	70,23	74	1	68,98	82	1	76,54
Klasse E USD, thesaurierend	38	–	81,33	37	–	79,18	117	1	87,44
Klasse X GBP, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	2	–	125,28
Klasse Premier USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	103,14
Klasse Premier EUR, thesaurierend	12.083	90	112,95	11.647	89	117,89	12.611	89	124,28
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 2.013	12	162,64	$ 2.144	13	167,25	$ 2.263	13	169,48
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1.068	12	91,84	1.278	13	96,81	1.574	15	102,82
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	722	11	87,49	930	15	94,24	1.101	15	101,28
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1.096	93	91,64	1.189	95	97,16	579	44	103,97
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	34	50	0,93	13	19	0,99	32	41	1,06
Klasse X USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	40	–	119,82
Klasse Premier USD, thesaurierend	1.780	20	89,30	1.736	19	91,36	–	–	–
Klasse GA USD, thesaurierend	3.446	21	165,78	3.700	22	170,54	3.797	22	172,85
Klasse GA EUR, thesaurierend	1.696	7	199,04	1.794	7	221,32	3.258	13	217,80
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	335	2	172,20	362	2	198,41	382	2	200,23
Klasse GE USD, thesaurierend	41	–	154,72	42	–	159,76	43	–	163,15
Klasse GE EUR, thesaurierend	269	1	185,65	281	1	207,22	302	1	205,38
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 12	–	136,66	$ 1	–	122,73	$ 4	–	128,67
Klasse M GBP, ausschüttend (A)	2.695	115	17,57	66.097	3.138	16,35	73.014	3.282	16,72
Klasse E USD, thesaurierend	–	–	–	1	–	119,66	1	–	126,09
Klasse F USD, thesaurierend	1	–	140,07	1	–	125,42	1	–	130,70
Klasse M US, ausschüttend (A)	48.918	3.332	14,68	43.809	3.334	13,14	84.791	6.111	13,88
Klasse M EUR, ausschüttend (A)	267	14	15,95	26.826	1.585	15,40	46.400	2.596	15,65
Klasse Premier USD, thesaurierend	10.083	98	102,81	8.127	88	91,83	8.421	88	95,16
Klasse Premier GBP, thesaurierend	348	2	106,25	19.856	156	98,52	42.006	319	98,88
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^									
Klasse A USD, ausschüttend (A)	$ –	–	–	$ –	–	–	$ 2.791	196	14,27
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	111	6	15,30
Klasse X USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	1	–	138,62
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^									
Klasse A (PF) USD, thesaurierend	€ 1	–	98,33	€ 1	–	95,92	€ 1	–	101,53
Klasse A (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	1	–	102,34	1	–	107,81	1	–	106,76
Klasse A (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)	6.410	550	13,90	8.361	628	14,63	11.269	888	14,49
Klasse A (PF) EUR, thesaurierend	3.843	41	93,68	5.417	55	99,31	6.879	68	101,21
Klasse A (PF) EUR, ausschüttend (A)	3.877	319	12,16	8.237	640	12,88	16.113	1.230	13,10
Klasse A (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)	4	–	12,75	256	16	13,50	359	23	13,59
Klasse E (PF) USD, thesaurierend	–	–	–	1	–	93,03	1	–	99,36
Klasse E (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	1	–	104,61	1	–	104,42
Klasse F (PF) USD, thesaurierend	1	–	100,09	1	–	97,37	1	–	102,62
Klasse F (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	1	–	104,03	1	–	109,36	1	–	107,82
Klasse J (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	1.834	20	100,79	1.732	20	98,86
Klasse J (PF) JPY, thesaurierend (abgesichert)	330	5	8,883,46	43.642	560	9,311,54	59.723	808	9,345,95
Klasse M (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)	1.964	167	14,01	2.484	186	14,72	4.730	372	14,50
Klasse M (PF) EUR, thesaurierend	23.321	245	95,20	32.284	321	100,67	63.519	622	102,08
Klasse M (PF) EUR, ausschüttend (A)	42.990	3.389	12,69	59.347	4.428	13,40	87.235	6.428	13,57
Klasse M (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)	1.495	101	13,24	2.199	134	14,01	8.582	525	14,03
Klasse M (PF) NOK, ausschüttend (A) (abgesichert)	22	2	95,72	23	2	102,03	98	9	101,46
Klasse M (PF) SEK, ausschüttend (A) (abgesichert)	1.800	197	94,42	1.841	197	99,89	2.989	310	101,02
Klasse Premier (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	16.628	194	102,46	21.333	218	107,53	9.495	102	106,12
Klasse Premier (PF) BRL, thesaurierend (abgesichert)	1.917	128	98,16	2.583	124	103,14	2.247	96	99,84
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^									
Klasse A USD, ausschüttend (A)	$ –	–	–	$ –	–	–	$ 15.297	503	30,42
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	201	20	8,96
Klasse X USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	341	2	153,82

Bilanz – *(Fortsetzung)*

	31. August 2020			29. Februar 2020			28. Februar 2019		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund^									
Klasse A (PF) USD, thesaurierend	¥ –	–	–	¥ –	–	–	¥ 118	–	106,41
Klasse A (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	122	–	109,81
Klasse A (PF) EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	133	–	104,93
Klasse A (PF) EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	52.608	36	11,44
Klasse A (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	10.026	6	11,90
Klasse E (PF) USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	115	–	104,19
Klasse E (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	119	–	107,84
Klasse F (PF) USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	119	–	107,60
Klasse F (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	123	–	111,39
Klasse M (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	311.380	224	12,55
Klasse M (PF) EUR, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	125	–	98,44
Klasse M (PF) EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	4.665.324	3.160	11,67
Klasse M (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	128.986	71	12,30
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 429	2	184,82	$ 319	2	153,08	$ 6	–	140,20
Klasse A EUR, thesaurierend	3.050	15	171,20	992	6	153,71	9	–	135,46
Klasse E USD, thesaurierend	1	–	124,25	1	–	103,20	–	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend	3	–	176,64	11	–	158,08	10	–	138,35
Klasse X GBP, thesaurierend	1.073	4	187,88	883	4	160,85	478	3	141,67
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	743	3	176,73	159	1	147,96	86	–	137,09
Klasse Premier USD, thesaurierend	19.109	99	193,23	5.674	36	159,16	7	–	144,17
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	569	3	121,85	324	2	101,84	–	–	–
Klasse S USD, thesaurierend	413	4	101,27	–	–	–	–	–	–
Klasse S GBP, thesaurierend	41.216	158	195,50	25.817	120	166,80	22.634	117	145,78
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund									
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	$ –	–	–	$ 5	–	90,98	$ –	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	428	5	92,31	457	5	101,08	450	4	104,25
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	3	–	90,84	–	–	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) Plus	426	6	93,28	455	6	115,43	447	6	108,96
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus (e)	428	4	85,47	457	4	101,17	450	4	101,27
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	–	–	–	3	–	91,23	–	–	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	42	62	0,92	76	103	1,03	37	49	1,03
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	356	5	104,85	–	–	–	–	–	–
Klasse D CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1	–	105,47	–	–	–	–	–	–
Klasse D HKD, ausschüttend (M) Plus	1	–	105,49	–	–	–	–	–	–
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	952	1.232	1,05	–	–	–	–	–	–
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	486	5	105,49	–	–	–	–	–	–
Klasse D USD, thesaurierend	257	2	106,85	–	–	–	–	–	–
Klasse X AUD, thesaurierend	217	3	108,04	85	1	130,12	70	1	116,57
Klasse X USD, thesaurierend	299	3	116,19	440	4	123,73	361	3	120,68
Klasse S GBP, thesaurierend	441	3	119,20	468	3	131,91	453	3	123,51
Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)	441	3	97,69	468	3	110,75	453	3	108,81
Klasse LM AUD, thesaurierend	5.027	64	106,67	5.324	64	127,89	3.616	45	113,58
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^									
Klasse A USD, thesaurierend	$ 2.977	28	106,62	$ 1.598	17	93,97	$ 1.077	12	90,45
Klasse E USD, thesaurierend	1	–	120,75	1	–	106,74	1	–	103,45
Klasse F USD, thesaurierend	719	5	133,05	1	–	116,91	1	–	111,74
Klasse X USD, thesaurierend	637	6	113,52	559	6	99,68	534	6	95,22
Klasse Premier USD, thesaurierend	3.584	31	114,61	2.796	28	100,46	895	9	95,63
Klasse S USD, thesaurierend	2.083	15	138,61	1.725	14	121,37	2.079	18	115,31
Klasse S EUR, thesaurierend	25.970	200	108,81	22.741	200	103,45	21.606	200	94,62
Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund^									
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	$ –	–	–	$ –	–	–	$ 1.422	15	92,92
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	1.432	15	93,62
Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	199	2	96,74
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^									
Klasse A EUR, thesaurierend	€ 615	5	130,73	€ 569	5	119,97	€ 465	4	106,43
Klasse X EUR, thesaurierend	580	4	132,51	546	5	121,14	467	4	106,67
Klasse Premier EUR, thesaurierend	2.544	19	133,35	2.129	17	121,70	1.868	17	106,78
Klasse S EUR, thesaurierend	2.666	23	115,51	2.894	28	105,21	–	–	–

Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USDK/0 EUR/0 JPY/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 JPY/1.000 GBP.

Der NIW pro Anteil beinhaltet rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile, die auf die jeweilige Währung jeder relevanten Anteilsklasse lauten.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Gesamtergebnisrechnung

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund		Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund		Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund		Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	$ 2.362	$ 11.277	$ 4.032	$ 3.108	$ 23.340	$ 22.533	€ 727	€ 855
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	30	10	5.460	2.713	31.408	18.513	2.857	1.115
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	3.161	8.611	8.347	56.531	(2.402)	7.968
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	2.392	11.287	12.653	14.432	63.095	97.577	1.182	9.938
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	3.151	2.837	1.254	804	4.433	3.373	17	19
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	139	120	97	54	482	352	37	37
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	157	117	271	218	1	2
Anwaltsgebühren	10	10	1	1	6	5	1	–
Prüfungsgebühren	10	11	20	14	20	21	12	13
Druckgebühren	35	67	11	10	52	67	4	8
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	9	2	4	1
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	2	5	1	1	3	5	–	1
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	60	57	29	21	135	79	13	13
Gesamtaufwendungen	3.407	3.107	1.570	1.022	5.411	4.122	89	94
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(1.431)	–	–	–	–	–	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	1.976	**3.107**	**1.570**	**1.022**	**5.411**	**4.122**	**89**	94
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**416**	**8.180**	**11.083**	**13.410**	**57.684**	**93.455**	**1.093**	**9.844**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(665)	(7.044)	(1.074)	(1.729)	(1.245)	(760)	(2)	(3)
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	**(249)**	**1.136**	**10.009**	**11.681**	**56.439**	**92.695**	**1.091**	**9.841**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	–	(5)	(1)	(94)	(96)	(13)	(6)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ (249)**	**$ 1.136**	**$ 10.004**	**$ 11.680**	**$ 56.345**	**$ 92.599**	**€ 1.078**	**€ 9.835**

(in Tsd.)	Legg Mason 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	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	$ 2.456	$ 3.967	$ –	$ 157	$ –	$ 28	$ 198	$ 671
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	–	–	–	–	–	–	(2)
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(1.291)	(985)	–	14	–	(5)	2.158.056	(621)
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	2.280	(482)	–	93	–	3	(2.156.699)	1.135
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	3.445	2.500	–	264	–	26	1.555	1.183
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	489	709	–	96	–	13	33	52
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	33	38	–	5	–	1	18	13
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	46	72	–	9	–	1	5	8
Anwaltsgebühren	–	1	–	–	–	–	–	–
Prüfungsgebühren	21	21	–	10	–	14	14	14
Druckgebühren	4	10	–	1	–	–	1	3
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	1	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	19	24	–	9	–	10	8	9
Gesamtaufwendungen	612	876	–	130	–	39	79	99
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(2)	(3)	–	(12)	–	(19)	(1)	(4)
Nettoaufwendungen insgesamt	610	873	–	118	–	20	78	95
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**2.835**	**1.627**	**–**	**146**	**–**	**6**	**1.477**	**1.088**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(1.190)	(2.006)	–	(15)	–	(1)	(86)	(53)
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	**1.645**	**(379)**	**–**	**131**	**–**	**5**	**1.391**	**1.035**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(10)	(17)	–	–	–	–	(3)	–
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ 1.635**	**$ (396)**	**$ –**	**$ 131**	**$ –**	**$ 5**	**$ 1.388**	**$ 1.035**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund		Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund		Legg Mason 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	
Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
$ 649	$ 664	$ 14.947	$ 20.126	$ 5.090	$ 4.985	$ 446	$ 742	$ 857	$ 1.036
–	–	3	1	–	–	–	–	–	–
–	–	(2)	(3)	–	(3)	–	–	–	(2)
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
(436)	(170)	(9.676)	(34.550)	(4.494)	(1.796)	480	(663)	247	(120)
706	56	28.436	4.174	3.656	4.219	29	571	(243)	1.826
919	550	33.708	(10.252)	4.252	7.405	955	650	861	2.740
136	143	1.149	1.318	564	579	138	176	1	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
11	8	205	214	54	49	9	8	15	14
11	12	81	94	56	62	9	11	–	–
–	–	3	3	1	–	–	–	–	–
14	14	21	23	21	21	14	14	10	11
1	2	25	57	6	14	1	2	1	3
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	6	2	1	–	–	–	–	–
–	–	1	4	–	1	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
8	14	78	49	22	23	9	12	7	8
181	193	1.569	1.764	725	749	180	223	34	36
(12)	(15)	–	(1)	–	–	(11)	(11)	–	–
169	178	1.569	1.763	725	749	169	212	34	36
750	**372**	**32.139**	**(12.015)**	**3.527**	**6.656**	**786**	**438**	**827**	**2.704**
(233)	(338)	(4.091)	(5.976)	(1.821)	(2.249)	(134)	(308)	(808)	(969)
517	**34**	**28.048**	**(17.991)**	**1.706**	**4.407**	**652**	**130**	**19**	**1.735**
(2)	–	(254)	(219)	(13)	(5)	(9)	(5)	1	–
$ 515	**$ 34**	**$ 27.794**	**$ (18.210)**	**$ 1.693**	**$ 4.402**	**$ 643**	**$ 125**	**$ 20**	**$ 1.735**

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund		Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		Legg Mason Western Asset Global Credit Absolute Return Fund^		Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	
Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
$ 11.583	$ 12.529	$ 2.349	$ 1.578	$ –	$ –	$ 2.390	$ 3.858	1.129	1.208
2	–	–	–	–	–	–	–	–	–
21	51	1	3	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
7.007	(10.027)	(1.462)	(10.908)	–	–	149.262.925	(1.423)	514	1.153
(3.218)	21.593	24.106	2.251	–	–	(149.258.037)	12.014	1.334	4.266
15.395	24.146	24.994	(7.076)	–	–	7.278	14.449	2.977	6.627
2.005	1.868	463	214	–	–	232	339	28	16
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
169	155	102	47	–	–	70	79	27	24
159	150	10	3	–	–	–	4	4	2
3	2	1	1	–	–	1	1	–	–
21	23	14	14	–	–	14	15	14	15
19	36	10	6	–	–	9	16	3	5
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1	–	2	–	–	–	1	–	1	–
1	2	–	1	–	–	1	1	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
67	57	32	25	–	–	36	29	11	13
2.445	2.293	634	311	–	–	364	484	88	75
(25)	(31)	–	(5)	–	–	–	–	–	–
2.420	2.262	634	306	–	–	364	484	88	75
12.975	**21.884**	**24.360**	**(7.382)**	**–**	**–**	**6.914**	**13.965**	**2.889**	**6.552**
(6.798)	(6.038)	(1.988)	(1.461)	–	–	–	(21)	–	(9)
6.177	**15.846**	**22.372**	**(8.843)**	**–**	**–**	**6.914**	**13.944**	**2.889**	**6.543**
(360)	(572)	(24)	(13)	–	–	(83)	(67)	(10)	(9)
$ 5.817	**$ 15.274**	**$ 22.348**	**$ (8.856)**	**$ –**	**$ –**	**6.831**	**$ 13.877**	**$ 2.879**	**$ 6.534**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung– *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^		Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	€ 1.230	€ 1.596	$ 154.982	$ 203.848	$ –	$ 1.604	$ 21.368	$ 22.084
Zinsen	–	–	6	11	–	–	1	–
Ausgleich	–	–	137	(384)	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(326)	685	491.278.643	689.450	–	(1.233)	9.874.403	(42.746)
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(1.381)	618	(490.987.581)	(903.103)	–	(596)	(9.860.235)	(10.321)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	(477)	2.899	446.187	(10.178)	–	(225)	35.537	(30.983)
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	2	2	39.773	41.894	–	87	127	22
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	19	24	2.102	2.121	–	13	265	225
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	2.602	2.858	–	–	–	–
Anwaltsgebühren	–	–	32	32	–	–	4	4
Prüfungsgebühren	12	13	20	21	–	17	14	15
Druckgebühren	2	5	256	533	–	6	29	43
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	6	6	60	14	–	–	2	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	14	34	–	–	2	3
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	9	11	594	264	–	12	69	57
Gesamtaufwendungen	50	61	45.453	47.771	–	135	512	369
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	(21)	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	50	61	45.453	47.771	–	114	512	369
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**(527)**	**2.838**	**400.734**	**(57.949)**	**–**	**(339)**	**35.025**	**(31.352)**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(184)	(246)	(29.855)	(40.163)	–	(71)	(28)	(2)
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	**(711)**	**2.592**	**370.879**	**(98.112)**	**–**	**(410)**	**34.997**	**(31.354)**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	(3)	(7.036)	(7.857)	–	(60)	(239)	(235)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**€ (711)**	**€ 2.589**	**$ 363.843**	**$(105.969)**	**$ –**	**$ (470)**	**$ 34.758**	**$(31.589)**

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund		Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	$ 10.608	$ 21.389	$ 11.431	$ 23.516	$ 300	$ 2.288	$ 9.327	$ 13.828
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	(141)	19	(100)	(104)	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(47.742)	(39.154)	18.166	(103.873)	(430)	(246)	(8.115)	(17.234)
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	59.828	20.708	59.781	19.767	752	404	36.830	6.870
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	22.553	2.962	89.278	(60.694)	622	2.446	38.042	3.464
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	2.333	3.339	2.117	3.136	23	55	1.169	1.461
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	237	311	241	316	6	29	173	191
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	220	399	15	32	–	3	10	38
Anwaltsgebühren	4	5	4	5	–	–	2	3
Prüfungsgebühren	20	23	13	16	14	14	21	14
Druckgebühren	31	79	28	87	–	7	19	45
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	1	–	–	–	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	2	5	1	5	–	1	1	3
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	110	82	75	60	7	11	53	46
Gesamtaufwendungen	2.958	4.243	2.494	3.657	50	120	1.448	1.801
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	–	–	(1)	(19)	(3)	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	2.958	4.243	2.494	3.656	31	117	1.448	1.801
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**19.595**	**(1.281)**	**86.784**	**(64.350)**	**591**	**2.329**	**36.594**	**1.663**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(2.361)	(3.117)	(2.052)	(3.582)	(3)	(9)	(86)	(422)
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	**17.234**	**(4.398)**	**84.732**	**(67.932)**	**588**	**2.320**	**36.508**	**1.241**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(166)	(374)	(377)	(770)	–	(13)	(297)	(491)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ 17.068**	**$ (4.772)**	**$ 84.355**	**$ (68.702)**	**$ 588**	**$ 2.307**	**$ 36.211**	**$ 750**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^		Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^		Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^		Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	
Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
$ –	$ 833	$ 28.570	$ 41.794	$ 13.651	$ 15.513	£ 1.353	£ 1.250	$ 2.221	$ 2.608
–	–	12	–	2	–	–	1	–	–
–	–	1	5	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	(923)	(100.179)	(16.547)	(2.415)	(2.240)	499	(159)	1.619	(5.628)
–	2.761	(185.292)	34.994	(5.088)	32.598	560	6.752	3.631	4.046
–	2.671	(256.888)	60.246	6.150	45.871	2.412	7.844	7.471	1.026
–	157	2.601	2.436	6	1	–	–	48	28
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	18	374	386	256	283	37	31	38	36
–	–	41	31	–	–	–	–	6	4
–	–	8	6	4	4	–	–	–	1
–	15	14	14	14	14	8	8	14	14
–	5	57	79	34	63	4	6	4	9
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	13	–	2	–	1	–	–	–
–	–	3	5	2	4	–	1	–	1
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	8	130	76	73	44	9	8	13	10
–	203	3.241	3.033	391	413	59	54	123	103
–	(7)	–	(18)	–	–	–	–	–	–
–	196	3.241	3.015	391	413	59	54	123	103
–	**2.475**	**(260.129)**	**57.231**	**5.759**	**45.458**	**2.353**	**7.790**	**7.348**	**923**
–	(529)	(2.119)	(2.525)	–	(2)	–	–	–	–
–	**1.946**	**(262.248)**	**54.706**	**5.759**	**45.456**	**2.353**	**7.790**	**7.348**	**923**
–	(11)	–		–	–	(1)	–	(13)	3
$ –	**$ 1.935**	**$ (262.248)**	**$ 54.706**	**$ 5.759**	**$ 45.456**	**£ 2.352**	**£ 7.790**	**$ 7.335**	**$ 926**

Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^		Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^		Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^		Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund^	
Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
$ 21.353	$ 43.236	$ 1.333	$ 1.554	$ 702	$ 916	$ 275	$ 263	$ –	$ 722
–	1	–	–	–	–	–	–	–	–
(6.624)	–	7	(5)	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
(131.542)	(58.817)	5.249	2.990	(1.938)	546	323	(254)	–	(723)
72.851	5.973	4.088	829	(3.146)	507	499	124	–	99
(43.962)	(9.607)	10.677	5.368	(4.382)	1.969	1.097	133	–	98
903	1.409	355	441	178	182	20	21	–	50
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
340	548	30	32	20	15	6	5	–	10
–	–	43	51	3	1	–	–	–	–
7	9	–	–	–	–	–	–	–	–
14	16	14	14	14	14	14	14	–	14
52	175	2	8	1	4	–	1	–	2
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1	1	–	–	–	–	–	–	–	–
3	10	–	1	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
112	34	20	27	10	17	9	11	–	11
1.432	2.202	464	574	226	233	49	52	–	87
–	–	(5)	(8)	(14)	(17)	(22)	(23)	–	(15)
1.432	2.202	459	566	212	216	27	29	–	72
(45.394)	**(11.809)**	**10.218**	**4.802**	**(4.594)**	**1.753**	**1.070**	**104**	**–**	**26**
(15.152)	(18.260)	(1.148)	(1.341)	–	–	(535)	(611)	–	–
(60.546)	**(30.069)**	**9.070**	**3.461**	**(4.594)**	**1.753**	**535**	**(507)**	**–**	**26**
(468)	(2.056)	(15)	1	(11)	(29)	(1)	–	–	–
$ (61.014)	**$ (32.125)**	**$ 9.055**	**$ 3.462**	**$ (4.605)**	**$ 1.724**	**$ 534**	**$ (507)**	**$ –**	**$ 26**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung– *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^		Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^		Legg Mason ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund^	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	$ 9.698	$ 12.847	$ 30	$ 45	$ 3.545	$ 3.668	$ –	$ –
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	–	–	–	2	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	2	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(19.891)	(36.481)	97	181	546	(326)	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	35.287	(34.568)	105	(299)	20.757	4.328	–	–
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	25.094	(58.202)	232	(73)	24.850	7.670	2	–
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	81	20	4	8	1.152	1.402	–	–
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	108	115	4	3	104	114	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	1	–	–	–	63	97	–	–
Anwaltsgebühren	2	2	–	–	1	2	–	–
Prüfungsgebühren	13	12	13	15	14	14	–	–
Druckgebühren	13	20	–	–	11	24	–	–
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	1	2	–	–	1	2	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	2	–
Sonstige Aufwendungen	32	22	5	6	35	27	–	–
Gesamtaufwendungen	251	193	26	32	1.381	1.682	2	–
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	–	(20)	(21)	–	–	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	251	193	6	11	1.381	1.682	2	–
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**24.843**	**(58.395)**	**226**	**(84)**	**23.469**	**5.988**	**–**	**–**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	–	(1)	–	–	(7)	(5)	–	–
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	**24.843**	**(58.396)**	**226**	**(84)**	**23.462**	**5.983**	**–**	**–**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(511)	(502)	(9)	(13)	(857)	(861)	–	–
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ 24.332**	**$ (58.898)**	**$ 217**	**$ (97)**	**$ 22.605**	**$ 5.122**	**$ –**	**$ –**

(in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^		Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^		Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	$ 749	$ 1.062	$ 635	$ 76	$ 63	$ 49	€ 11.020	€ 10.129
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	–	–	–	–	–	(5)	(6)
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(3.066)	1.261	3.726	149	(44)	57	(48.882)	3.126
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	4.022	783	25.248	718	2.056	313	(41.732)	16.528
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	1.705	3.106	29.609	943	2.075	419	(79.599)	29.777
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	205	278	261	11	29	19	3.288	2.007
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	16	17	38	5	5	3	229	142
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	33	47	63	3	1	1	413	152
Anwaltsgebühren	–	–	–	–	–	–	3	2
Prüfungsgebühren	14	15	7	7	7	7	12	10
Druckgebühren	1	3	2	1	–	–	26	25
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	111	18
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	1	2
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	12	14	9	8	5	9	71	50
Gesamtaufwendungen	281	374	380	35	47	39	4.154	2.408
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(15)	(14)	(16)	(13)	(11)	(15)	(2)	(12)
Nettoaufwendungen insgesamt	266	360	364	22	36	24	4.152	2.396
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**1.439**	**2.746**	**29.245**	**921**	**2.039**	**395**	**(83.751)**	**27.381**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(169)	(327)	(7)	(1)	–	–	(1.908)	(2.592)
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	**1.270**	**2.419**	**29.238**	**920**	**2.039**	**395**	**(85.659)**	**24.789**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(137)	(150)	(172)	(21)	(15)	(11)	(1.669)	(880)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ 1.133**	**$ 2.269**	**$ 29.066**	**$ 899**	**$ 2.024**	**$ 384**	**€ (87.328)**	**€ 23.909**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^		Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund^		Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund		Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
$ –	$ 618	$ –	$ 125	$ 1.680	$ 2.040	$ 6.628	$ 7.473	$ 4.617	$ 9.245
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	(2)	(1)	–	–	(41)	(195)
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	(2.675)	–	(30)	8.409	10.882	68.272	89.555	22.000	(48.644)
–	371	–	(122)	21.131	4.640	437.917	4.133	27.790	10.101
–	(1.686)	–	(27)	31.218	17.561	512.817	101.161	54.366	(29.493)
–	50	–	16	1.022	1.253	6.472	6.056	3.437	5.815
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	10	–	1	62	67	538	467	260	431
–	2	–	3	161	221	884	940	445	754
–	–	–	–	1	1	7	7	4	7
–	11	–	12	14	14	20	21	21	21
–	3	–	–	7	15	54	93	32	115
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	16	3
–	–	–	–	–	1	3	7	2	7
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	15	–	6	24	19	150	108	98	89
–	91	–	38	1.291	1.591	8.128	7.699	4.315	7.242
–	(10)	–	(14)	–	–	–	(4)	–	–
–	81	–	24	1.291	1.591	8.128	7.695	4.315	7.242
–	**(1.767)**	**–**	**(51)**	**29.927**	**15.970**	**504.689**	**93.466**	**50.051**	**(36.735)**
–	(4)	–	(60)	(44)	(67)	(3)	–	(419)	(1.197)
–	**(1.771)**	**–**	**(111)**	**29.883**	**15.903**	**504.686**	**93.466**	**49.632**	**(37.932)**
–	(71)	–	(18)	(484)	(580)	(1.919)	(1.639)	(849)	(1.660)
$ –	**$ (1.842)**	**$ –**	**$ (129)**	**$ 29.399**	**$ 15.323**	**$ 502.767**	**$ 91.827**	**$ 48.783**	**$(39.592)**

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund		Legg Mason PCM US Equity Fund^		Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund	
Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
$ 44	$ 53	$ 1.603	$ 2.551	$ 590	$ 655	$ –	$ –	€ 1.051	€ 2.025
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	(3)	(5)	–	–	(6)	(49)
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
(10)	(39)	(32.502)	(29.422)	(2.825)	3	–	–	(3.180)	(1.870)
(321)	(40)	53.129	(36.642)	4.294	(5.002)	–	–	(441)	16
(287)	(26)	22.230	(63.513)	2.056	(4.349)	–	–	(2.576)	122
12	16	2.096	3.707	400	581	–	–	193	308
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
4	2	129	218	23	29	–	–	15	18
2	2	373	605	76	111	–	–	20	37
–	–	10	4	–	–	–	–	–	–
10	13	20	21	14	14	–	–	19	19
–	–	15	75	2	9	–	–	1	4
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	1	–
–	–	1	4	–	1	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
6	12	54	44	14	13	–	–	10	10
34	45	2.698	4.678	529	758	–	–	259	396
(18)	(25)	(1)	(2)	(3)	(2)	–	–	(8)	(6)
16	20	2.697	4.676	526	756	–	–	251	390
(303)	**(46)**	**19.533**	**(68.189)**	**1.530**	**(5.105)**	**–**	**–**	**(2.827)**	**(268)**
(8)	(9)	–	–	(64)	(64)	–	–	(247)	(498)
(311)	**(55)**	**19.533**	**(68.189)**	**1.466**	**(5.169)**	**–**	**–**	**(3.074)**	**(766)**
(4)	(5)	(417)	(626)	91	(101)	–	–	(117)	(165)
$ (315)	**$ (60)**	**$ 19.116**	**$(68.815)**	**$ 1.557**	**$ (5.270)**	**$ –**	**$ –**	**€ (3.191)**	**€ (931)**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung– *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund		Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	$ 1.651	$ 2.690	$ –	$ –	$ 226	$ 287	$ 399	$ 487
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	(14)	7	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(3.445)	(1.008)	–	–	(670)	(50)	(520)	217
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	708	(6.299)	–	–	916	(785)	(86)	(353)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	(1.100)	(4.610)	–	–	472	(548)	(207)	351
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	250	426	–	–	30	36	78	97
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	20	28	–	–	7	6	7	6
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	50	90	–	–	1	1	8	10
Anwaltsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Prüfungsgebühren	10	17	–	–	14	17	14	14
Druckgebühren	2	6	–	–	–	1	1	1
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	17	29	–	–	11	21	8	12
Gesamtaufwendungen	349	596	–	–	63	82	116	140
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(10)	(17)	–	–	(24)	(35)	(11)	(10)
Nettoaufwendungen insgesamt	339	579	–	–	39	47	105	130
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**(1.439)**	**(5.189)**	**–**	**–**	**433**	**(595)**	**(312)**	**221**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(452)	(791)	–	–	(2)	(2)	(78)	(85)
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	**(1.891)**	**(5.980)**	**–**	**–**	**431**	**(597)**	**(390)**	**136**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(152)	(270)	–	–	(26)	(35)	(62)	(66)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ (2.043)**	**$ (6.250)**	**$ –**	**$ –**	**$ 405**	**$ (632)**	**$ (452)**	**$ 70**

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^		Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund^		Legg Mason Martin Currie North American Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	$ –	$ 248	¥ –	¥ 22.395	$ –	$ –	$ 245	$ 215
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	(1)	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	243	–	(264.891)	–	–	228	296
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	138	–	157.788	–	–	10.713	1.277
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	–	628	–	(84.708)	–	–	11.186	1.788
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	121	–	9.515	–	–	135	55
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	7	–	456	–	–	19	10
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	28	–	2.202	–	–	7	1
Anwaltsgebühren	–	–	–	12	–	–	–	–
Prüfungsgebühren	–	11	–	1.415	–	–	7	7
Druckgebühren	–	1	–	61	–	–	1	2
Dividendenaufwand	–	–	–	16.459	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	1.194	–	–	1	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	–	16	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	–	10	–	–	–	–	9	9
Gesamtaufwendungen	–	178	–	31.330	–	–	179	84
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	(21)	–	(1.585)	–	–	(2)	(9)
Nettoaufwendungen insgesamt	–	157	–	29.745	–	–	177	75
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	**–**	**471**	**–**	**(114.453)**	**–**	**–**	**11.009**	**1.713**
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	**–**	**471**	**–**	**(114.453)**	**–**	**–**	**11.009**	**1.713**
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	(26)	–	(3.582)	–	–	(29)	(24)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ –**	**$ 445**	**¥ –**	**¥(118.035)**	**$ –**	**$ –**	**$ 10.980**	**$ 1.689**

Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USDK/0 EUR/0 JPY/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 JPY/1.000 GBP.

Gewinne und Verluste stammen ausschließlich aus fortgeführten Geschäftsbereichen. Es gab keine sonstigen Gewinne oder Verluste außer den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten.

Die Euro-Beträge für den Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^, Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ und den Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^ wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum bis zum 31. August 2020 zum USD.EUR-Wechselkurs von 0,8912 umgerechnet (31. August 2019: 0,8912).

Britische Pfund-Beträge für den Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2020 zum USD/GBP-Wechselkurs von 0,7965 in US-Dollar umgerechnet (31. August 2019: 0,7870).

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Congruix Japan Equity Fund^		Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^	
Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
¥ –	¥ –	$ 1.568	$ 4.872	$ –	$ 49	€ 1.098	€ 1.887	$ –	$ –
–	–	–	–	–	–	1	–	–	–
–	–	(304)	(101)	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	(5.944)	(2.787)	–	363	(8.672)	7.809	–	–
–	–	10.343	(9.000)	–	(531)	(4.584)	4.425	–	–
–	–	5.663	(7.016)	–	(119)	(12.157)	14.121	–	–
–	–	502	1.204	–	21	950	1.746	–	–
–	–	–	–	–	–	–	22	–	–
–	–	40	83	–	1	49	79	–	–
–	–	145	363	–	5	167	292	–	–
–	–	1	1	–	–	1	1	–	–
–	–	7	9	–	6	12	12	–	–
–	–	5	17	–	–	6	19	–	–
–	–	–	–	–	–	1.232	3.824	–	–
–	–	–	–	–	–	368	568	–	–
–	–	–	1	–	–	–	1	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	19	30	–	25	23	23	–	–
–	–	719	1.708	–	58	2.808	6.587	–	–
–	–	(115)	(273)	–	(32)	(63)	(95)	–	–
–	–	604	1.435	–	26	2.745	6.492	–	–
–	**–**	**5.059**	**(8.451)**	**–**	**(145)**	**(14.902)**	**7.629**	**–**	**–**
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	**–**	**5.059**	**(8.451)**	**–**	**(145)**	**(14.902)**	**7.629**	**–**	**–**
–	–	(64)	(233)	–	(4)	(187)	(259)	–	–
¥ –	**¥ –**	**$ 4.995**	**$ (8.684)**	**$ –**	**$ (149)**	**€ (15.089)**	**€ 7.370**	**$ –**	**$ –**

Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund		Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund^		Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^		Legg Mason Global Funds Plc	
Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
$ 215	$ 184	$ 375	$ 443	$ –	$ 58	€ 35	€ 39	$ 400.345	$ 553.668
–	–	–	–	–	–	–	–	27	14
–	–	–	–	–	–	–	–	(7.074)	(783)
–	–	–	–	–	–	–	–	2	–
(677)	245	(955)	(326)	–	14	21	21	652.304.129	354.884
75	32	5.288	(520)	–	176	553	197	(651.546.859)	(692.366)
(387)	461	4.708	(403)	–	248	609	257	1.150.570	215.417
17	15	97	81	–	17	19	17	85.028	93.248
–	–	–	–	–	–	–	–	–	25
6	4	13	10	–	3	5	2	7.366	7.743
4	3	5	3	–	5	2	2	6.748	8.040
–	–	–	–	–	–	–	–	123	120
10	11	6	7	–	7	6	6	755	912
–	–	1	2	–	–	–	–	887	1.910
–	–	–	–	–	–	–	–	1.384	4.442
–	–	–	–	–	–	1	–	670	698
–	–	–	–	–	–	–	–	46	124
–	–	–	–	–	–	–	–	2	–
9	16	12	25	–	22	3	18	2.481	1.950
46	49	134	128	–	54	36	45	105.490	119.212
(19)	(15)	(10)	(24)	–	(29)	(10)	(23)	(1.910)	(966)
27	34	124	104	–	25	26	22	103.580	118.246
(414)	**427**	**4.584**	**(507)**	**–**	**223**	**583**	**235**	**1.046.990**	**97.171**
(58)	(48)	–	–	–	(49)	–	–	(76.519)	(104.887)
(472)	**379**	**4.584**	**(507)**	**–**	**174**	**583**	**235**	**970.471**	**(7.716)**
(20)	(13)	(42)	(45)	–	(8)	(4)	(4)	(17.403)	(21.389)
$ (492)	**$ 366**	**$ 4.542**	**$ (552)**	**$ –**	**$ 166**	**€ 579**	**€ 231**	**$ 953.068**	**$ (29.105)**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund		Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund		Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund		Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigen Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ (249)**	**$ 1.136**	**$ 10.004**	**$ 11.680**	**$ 56.345**	**$ 92.599**	**€ 1.078**	**€ 9.835**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	949.579	746.639	128.400	35.861	528.001	513.072	200	853
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	987	6.911	472	367	784	512	–	2
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(861.293)	(783.057)	(142.462)	(12.558)	(419.042)	(183.863)	(15.109)	(1.191)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**89.273**	**(29.507)**	**(13.590)**	**23.670**	**109.743**	**329.721**	**(14.909)**	**(336)**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	89.024	(28.371)	(3.586)	35.350	166.088	422.320	(13.831)	9.499
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	997.244	949.105	316.407	154.486	1.534.643	927.310	124.128	114.498
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	**$ 1.086.268**	**$ 920.734**	**$ 312.821**	**$ 189.836**	**$ 1.700.731**	**$ 1.349.630**	**€ 110.297**	**€ 123.997**

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund		Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund		Legg Mason Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigen Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ 515**	**$ 34**	**$ 27.794**	**$ (18.210)**	**$ 1.693**	**$ 4.402**	**$ 643**	**$ 125**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	8.109	1.727	43.659	38.991	72.138	43.717	2.860	1.441
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	265	279	742	812	1.364	1.864	153	287
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(3.247)	(4.014)	(135.805)	(98.357)	(61.107)	(46.558)	(4.225)	(4.803)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**5.127**	**(2.008)**	**(91.404)**	**(58.554)**	**12.395**	**(977)**	**(1.212)**	**(3.075)**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	5.642	(1.974)	(63.610)	(76.764)	14.088	3.425	(569)	(2.950)
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	21.041	23.160	734.170	731.259	169.193	151.256	18.805	24.193
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	**$ 26.683**	**$ 21.186**	**$ 670.560**	**$ 654.495**	**$ 183.281**	**$ 154.681**	**$ 18.236**	**$ 21.243**

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund		Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigen Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ 20**	**$ 1.735**	**$ 1.635**	**$ (396)**	**$ –**	**$ 131**	**$ –**	**$ 5**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	3.015	2.550	29.673	27.981	–	2.736	–	66
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	807	969	233	332	–	14	–	1
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(8.983)	(6.361)	(45.463)	(47.438)	–	(1.261)	–	(5.276)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**(5.161)**	**(2.842)**	**(15.557)**	**(19.125)**	**–**	**1.489**	**–**	**(5.209)**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(5.141)	(1.107)	(13.922)	(19.521)	–	1.620	–	(5.204)
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	42.544	37.502	107.743	120.810	–	13.243	–	5.204
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	**$ 37.403**	**$ 36.395**	**$ 93.821**	**$ 101.289**	**$ –**	**$ 14.863**	**$ –**	**$ –**

	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund		Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund		Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		Legg Mason Western Asset Global Credit Absolute Return Fund^		Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
	$ 1.388	**$ 1.035**	**$ 5.817**	**$ 15.274**	**$ 22.348**	**$ (8.856)**	**$ –**	**$ –**	**$ 6.831**	**$ 13.877**
	477	680	82.406	116.884	147.666	120.176	–	–	54.950	35.679
	48	12	131	164	13	2	–	–	–	–
	(2.877)	(3.834)	(110.584)	(122.395)	(40.976)	(6.982)	–	–	(71.816)	(38.587)
	(2.352)	**(3.142)**	**(28.047)**	**(5.347)**	**106.703**	**113.196**	**–**	**–**	**(16.866)**	**(2.908)**
	(964)	(2.107)	(22.230)	9.927	129.051	104.340	–	–	(10.035)	10.969
	47.508		573.934	501.640	276.535	100.381	–	–	263.958	249.893
	–		–	–	–	–	–	–	–	–
	$ 46.544	$	**$ 551.704**	**$ 511.567**	**$ 405.586**	**204.721**	$ **–**	$ **–**	**$ 253.923**	**$ 260.862**

	Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^		Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
	$ 2.879	**$ 6.534**	**$ (711)**	**$ 2.589**	**$ 363.843**	**$ (105.969)**	**$ –**	**$ (470)**	**$ 34.758**	**$ (31.589)**
	$ 8.541	**4.560**	**6**	**773**	**911.311**	**1.076.921**	**–**	**–**	**136.410**	**43.347**
	–	–	182	241	748	1.361	–	69	–	–
	(14.799)	(3.002)	(3.050)	(10.272)	(1.858.012)	(1.362.468)	–	–	(34.806)	(2.877)
	(6.258)	**1.558**	**(2.862)**	**(9.258)**	**(945.953)**	**(284.186)**	**–**	**69**	**101.604**	**40.470**
	(3.379)	8.092	(3.573)	(6.669)	(582.110)	(390.155)	–	(401)	136.362	8.881
	79.161	68.916	57.103	76.139	7.637.950	6.981.869	–	35.483	871.997	729.516
	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
	$ 75.782	**$ 77.008**	**$ 53.530**	**$ 69.470**	**$ 7.055.840**	**$ 6.591.714**	**$ –**	**$ 35.082**	**$ 1.008.359**	**$ 738.397**

	Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^		Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^		Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^		Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
	$ –	**$ 1.935**	**$ (262.248)**	**$ 54.706**	**$ 5.759**	**$ 45.456**	**£ 2.352**	**£ 7.790**	**$ 7.335**	**$ 926**
	–	3.653	168.646	387.455	624	1.829	–	18.000	2.101	17.749
	–	–	13	16	–	–	–	–	–	–
	–	(1.974)	(668.702)	(72.277)	(282.043)	(559)	–	–	(7.671)	(23.532)
	–	**1.679**	**(500.043)**	**315.194**	**(281.419)**	**1.270**	**–**	**18.000**	**(5.570)**	**(5.783)**
	–	3.614	(762.291)	369.900	(275.660)	46.726	2.352	25.790	1.765	(4.857)
	–	49.474	1.921.028	1.176.879	1.076.665	893.938	113.272	85.167	123.718	116.682
	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
	$ –	**$ 53.088**	**$ 1.158.737**	**$ 1.546.779**	**$ 801.005**	**$ 940.664**	**£ 115.624**	**£ 110.957**	**$ 125.483**	**$ 111.825**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^		Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigen Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ 17.068**	**$ (4.772)**	**$ 84.355**	**$ (68.702)**	**$ 588**	**$ 2.307**	**$ 36.211**	**$ 750**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	69.491	315.128	16.795	114.459	30	1.698	69.899	53.413
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	197	298	263	747	2	5	43	479
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(426.096)	(435.003)	(156.237)	(250.625)	(51)	(84.751)	(57.412)	(125.953)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**(356.408)**	**(119.577)**	**(139.179)**	**(135.419)**	**(19)**	**(83.048)**	**12.530**	**(72.061)**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(339.340)	(124.349)	(54.824)	(204.121)	569	(80.741)	48.741	(71.311)
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	930.667	1.060.603	834.603	1.208.431	10.656	97.564	548.932	651.830
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	**591.327**	**$ 936.254**	**$ 779.779**	**$ 1.004.310**	**$ 11.225**	**$ 16.823**	**$ 597.673**	**$ 580.519**

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^		Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^		Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigen Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ (61.014)**	**$ (32.125)**	**$ 9.055**	**$ 3.462**	**$ (4.605)**	**$ 1.724**	**$ 534**	**$ (507)**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	11.409	93.498	75.784	16.193	12.523	4.012	–	–
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	46	18	–	–	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(905.623)	(328.989)	(26.109)	(25.423)	(4.869)	(7.227)	–	–
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**(894.214)**	**(235.491)**	**49.721**	**(9.212)**	**7.654**	**(3.215)**	**–**	**–**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(955.228)	(267.616)	58.776	(5.750)	3.049	(1.491)	534	(507)
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	1.590.814	1.946.410	71.029	102.616	43.385	43.824	10.534	10.925
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	**$ 635.586**	**$ 1.678.794**	**$ 129.805**	**$ 96.866**	**$ 46.434**	**$ 42.333**	**$ 11.068**	**$ 10.418**

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund^		Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^		Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^		Legg Mason ClearBridge Value Fund	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigen Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ –**	**$ 26**	**$ 24.332**	**$ (58.898)**	**$ 217**	**$ (97)**	**$ 22.605**	**$ 5.122**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	–	–	8.635	76.412	–	–	32.856	17.888
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	–	–	–	1
Kosten für zurückgekaufte Anteile	–	(2)	(12.721)	(616)	(1.997)	(1.304)	(43.348)	(22.095)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**–**	**(2)**	**(4.086)**	**75.796**	**(1.997)**	**(1.304)**	**(10.492)**	**(4.206)**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	–	24	20.246	16.898	(1.780)	(1.401)	12.113	916
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	–	28.137	382.082	352.883	3.301	4.731	325.900	342.500
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	**$ –**	**$ 28.161**	**$ 402.328**	**$ 369.781**	**$ 1.521**	**$ 3.330**	**$ 338.013**	**$ 343.416**

	Legg Mason ClearBridge Growth Fund^		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^		Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund^		Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
	$ –	**$ –**	**$ –**	**$ (1.842)**	**$ –**	**$ (129)**	**$ 29.399**	**$ 15.323**	**$ 502.767**	**$ 91.827**
	–	–	–	983	–	25	11.634	21.164	380.639	312.496
	–	–	–	2	–	33	8	5	–	–
	–	–	–	(15.620)	–	(4.339)	(38.802)	(28.130)	(493.886)	(524.770)
	–	**–**	**–**	**(14.635)**	**–**	**(4.281)**	**(27.160)**	**(6.961)**	**(113.247)**	**(212.274)**
	–	–	–	(16.477)	–	(4.410)	2.239	8.362	389.520	(120.447)
	–	–	–	32.059	–	4.410	193.438	200.451	1.521.006	1.452.635
	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
	$ –	**$ –**	**$ –**	**$ 15.582**	**$ –**	**$ –**	**$ 195.677**	**$ 208.813**	**$ 1.910.526**	**$ 1.332.188**

	Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund		Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^		Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^		Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
	$ 48.783	**$ (39.592)**	**$ 1.133**	**$ 2.269**	**$ 29.066**	**$ 899**	**$ 2.024**	**$ 384**	**€ (87.328)**	**€ 23.909**
	38.317	83.853	1.797	2.678	166.315	3.678	61	–	229.906	158.009
	–	114	19	11	1	1	–	–	–	16
	(285.247)	(460.807)	(4.406)	(11.653)	(35.377)	(591)	(713)	–	(254.916)	(85.537)
	(246.930)	**(376.840)**	**(2.590)**	**(8.964)**	**130.939**	**3.088**	**(652)**	**–**	**(25.010)**	**72.488**
	(198.147)	(416.432)	(1.457)	(6.695)	160.005	3.987	1.372	384	(112.338)	96.397
	945.826	1.530.684	39.784	51.047	49.672	8.993	8.463	5.011	773.938	398.764
	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
	$ 747.679	**$ 1.114.252**	**$ 38.327**	**$ 44.352**	**$ 209.677**	**$ 12.980**	**$ 9.835**	**$ 5.395**	**€ 661.600**	**€ 495.161**

	Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund		Legg Mason PCM US Equity Fund^		Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
	$ (315)	**$ (60)**	**$ 19.116**	**$ (68.815)**	**$ 1.557**	**$ (5.270)**	**$ –**	**$ –**	**€ (3.191)**	**€ (931)**
	7	5	110.126	53.817	4.976	2.707	–	–	1.654	3.589
	1	1	–	–	–	–	–	–	–	–
	–	–	(139.424)	(356.949)	(12.466)	(17.230)	–	–	(6.187)	(11.947)
	8	**6**	**(29.298)**	**(303.132)**	**(7.490)**	**(14.523)**	**–**	**–**	**(4.533)**	**(8.358)**
	(307)	(54)	(10.182)	(371.947)	(5.933)	(19.793)	–	–	(7.724)	(9.289)
	2.686	2.805	448.058	883.020	68.057	93.468	–	–	40.774	53.197
	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
	$ 2.379	**$ 2.751**	**$ 437.876**	**$ 511.073**	**$ 62.124**	**$ 73.675**	**$ –**	**$ –**	**€ 33.050**	**€ 43.908**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

(in Tsd.)	Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund		Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigen Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ (2.043)**	**$ (6.250)**	**$ –**	**$ –**	**$ 405**	**$ (632)**	**$ (452)**	**$ 70**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	7.725	23.731	–	–	28	73	125	633
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	93	100	–	–	1	2	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(32.487)	(28.761)	–	–	(160)	(86)	(642)	(1.076)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**(24.669)**	**(4.930)**	**–**	**–**	**(131)**	**(11)**	**(517)**	**(443)**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(26.712)	(11.180)	–	–	274	(643)	(969)	(373)
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	64.036	86.466	–	–	12.185	13.306	13.469	13.371
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	**$ 37.324**	**$ 75.286**	**$ –**	**$ –**	**$ 12.459**	**$ 12.663**	**$ 12.500**	**$ 12.998**

(in Tsd.)	Legg Mason Congruix Japan Equity Fund^		Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigen Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**¥ –**	**¥ –**	**$ 4.995**	**$ (8.684)**	**$ –**	**$ (149)**	**€ (15.089)**	**€ 7.370**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	–	–	5.611	2.389	–	53	11.929	22.772
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	–	–	(113.000)	(4.526)	–	(2.807)	(82.082)	(75.325)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**–**	**–**	**(107.389)**	**(2.137)**	**–**	**(2.754)**	**(70.153)**	**(52.553)**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	–	–	(102.394)	(10.821)	–	(2.903)	(85.242)	(45.183)
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	164.718	254.638	–	2.903	189.847	274.976
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	**¥ –**	**¥ –**	**$ 62.324**	**$ 243.817**	**$ –**	**$ –**	**€ 104.605**	**€ 229.793**

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^		Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund^		Legg Mason Martin Currie North American Fund^	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigen Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 445**	**¥ –**	**¥ (118.035)**	**$ –**	**$ –**
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	–	–	–	75	–	351.570	–	–
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	–	–	–	(298)	–	(5.402.833)	–	–
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	**–**	**–**	**–**	**(223)**	**–**	**(5.051.263)**	**–**	**–**
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	–	–	–	222	–	(5.169.298)	–	–
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	–	15.839	–	5.169.298	–	–
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 16.061**	**¥ –**	**¥ –**	**$ –**	**$ –**

	Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
	$ 10.980	**$ 1.689**	**$ (492)**	**$ 366**
	28.717	1.409	2.239	152
	–	–	10	12
	(7.271)	(144)	(196)	(960)
	21.446	**1.265**	**2.053**	**(796)**
	32.426	2.954	1.561	(430)
	34.180	23.230	8.241	6.337
	–	–	–	–
	$ 66.606	**$ 26.184**	**$ 9.802**	**$ 5.907**

	Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund^	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
	$ 4.542	**$ (552)**	**$ –**	**$ 166**
	3.025	1.740	–	37
	–	–	–	6
	(1.017)	(694)	–	–
	2.008	**1.046**	**–**	**43**
	6.550	494	–	209
	29.421	26.193	–	3.053
	–	–	–	–
	$ 35.971	**$ 26.687**	**$ –**	**$ 3.262**

	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^		Legg Mason Global Funds Plc	
	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2020	Für die sechs Monate bis zum 31. August 2019
	€ 579	**€ 231**	**$ 953.068**	**$ (29.105)**
	325	2.774	4.607.569	4.662.326
	–	–	7.648	16.098
	(637)	–	(7.967.224)	(5.815.983)
	(312)	**2.774**	**(3.352.007)**	**(1.137.559)**
	267	3.005	(2.398.939)	(1.166.664)
	6.138	2.800	26.557.820	25.769.136
	–	**–**	**97.333**	**(46.157)**
	€ 6.405	**€ 5.805**	**$ 24.256.214**	**$ 24.556.315**

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

Als „–" angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USDK/0 EUR/0 YEN/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 YEN/1.000 GBP.

Alle Euro-Zahlen, mit Ausnahme des Nettovermögens zu Beginn des Jahres, das den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteilen zuzurechnen ist, für den Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, den Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, den Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^, den Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund, den Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ und den Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^ wurden für die Berechnung der Gesamtsumme des am 31. August 2020 zu Ende gegangenen Berichtszeitraum im Legg Mason Global Funds Plc unter Verwendung des USD/EUR-Wechselkurs von 0,8912 (31. August 2019: 0,8912) in US-Dollar umgerechnet.

Das Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist, für den Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, den Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, den Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^. den Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund, den Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ und den Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^ wurde zur Berechnung des Gesamtbetrags unter Verwendung der Gesamtergebnisrechnung zum USD/EUR-Wechselkurses am 29. Februar 2020 von 0,9058 (28. Februar 2019: 0,8792) in US-Dollar umgerechnet.

Alle Yen-Beträge, mit Ausnahme des Nettovermögens zu Beginn des Berichtszeitraums, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist, wurden für den Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund^ zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc für den am 31. August 2019 endenden Berichtszeitraum unter Verwendung der Gesamtergebnisrechnung zu einem USD-JPY-Wechselkurs von 109,1769 in US-Dollar umgerechnet .

Das Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist, wurde für den Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund^ zur Berechnung des Gesamtbetrags der Bilanz unter Verwendung des USD/JPY-Wechselkurses zum 28. Februar 2019 von 111,4650 in US-Dollar umgerechnet.

Alle britischen Pfund-Beträge, mit Ausnahme des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens zum Beginn des Geschäftsjahrs für den Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020 unter Verwendung des USD/GBP-Wechselkurses von 0,7965 (31. August 2019: 0,7870) in US-Dollar umgerechnet.

Das Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist, wurde für den Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ zur Berechnung des Gesamtbetrags der Bilanz unter Verwendung des USD/GBP-Wechselkurses zum 29. Februar 2020 von 0,7799 (28. Februar 2019: 0,7539) in US-Dollar umgerechnet.

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	939	671
Eingelöst	(1.017)	(576)
Nettozunahme/(-abnahme)	(78)	95
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	588.008	541.232
Eingelöst	(498.009)	(705.837)
Nettozunahme/(-abnahme)	89.999	(164.605)
Klasse B USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(51)
Nettoabnahme	–	(51)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	4	–
Eingelöst	(4)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	515	1
Eingelöst	(370)	(60)
Nettozunahme/(-abnahme)	145	(59)
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	274.235	142.057
Eingelöst	(266.399)	(16.845)
Nettozunahme	7.836	125.212
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	3
Eingelöst	(120)	(15)
Nettoabnahme	(119)	(12)
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(96)	(189)
Nettoabnahme	(96)	(187)
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	288	37
Eingelöst	(508)	(14)
Nettozunahme/(-abnahme)	(220)	23
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	143	194
Eingelöst	(426)	(127)
Nettozunahme/(-abnahme)	(283)	67
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	21	21
Eingelöst	(10)	(8)
Nettozunahme	11	13
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	45	8
Eingelöst	(15)	(2)
Nettozunahme	30	6
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	29	5
Nettozunahme	29	5
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	248	72
Eingelöst	(54)	(11)
Nettozunahme	194	61
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	94	30
Eingelöst	(10)	(5)
Nettozunahme	84	25
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	6	6
Eingelöst	(3)	(1)
Nettozunahme	3	5

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	104	–
Eingelöst	(73)	–
Nettozunahme	31	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	17	4
Nettozunahme	17	4
Klasse GA USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	507	675
Eingelöst	(230)	(123)
Nettozunahme	277	552
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	129	173
Eingelöst	(113)	(109)
Nettozunahme	16	64
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	246	35
Eingelöst	(18)	(45)
Nettozunahme/(-abnahme)	228	(10)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	26	68
Eingelöst	(7)	(32)
Nettozunahme	19	36
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	63	16
Eingelöst	(29)	(2)
Nettozunahme	34	14
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	71	33
Eingelöst	(25)	(15)
Nettozunahme	46	18
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	32	14
Eingelöst	(10)	(5)
Nettozunahme	22	9
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	93	58
Eingelöst	(31)	(22)
Nettozunahme	62	36
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	903	1.514
Eingelöst	(1.060)	(352)
Nettozunahme/(-abnahme)	(157)	1,162
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	83	22
Eingelöst	(61)	–
Nettozunahme	22	22
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	73	198
Eingelöst	(71)	(27)
Nettozunahme	2	171
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	19	3
Nettozunahme	19	3
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	34	–
Eingelöst	(7)	–
Nettozunahme	27	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	1.300	955
Eingelöst	(777)	(360)
Nettozunahme	523	595

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – (Fortsetzung)		
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(442)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(442)	1
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	156	265
Eingelöst	(250)	(430)
Nettoabnahme	(94)	(165)
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(3)	(2)
Nettoabnahme	(3)	–
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	(2)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	–	(2)
Nettozunahme	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	5
Eingelöst	–	(7)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	3
Nettozunahme	1	3
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Eingelöst	(137)	(1)
Nettoabnahme	(137)	(1)
Klasse GA EUR, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse GE EUR, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	26	5
Eingelöst	(4)	(4)
Nettozunahme	22	1
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	3	4
Eingelöst	(8)	(13)
Nettoabnahme	(5)	(9)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Eingelöst	(1)	(5)
Nettoabnahme	(1)	(5)
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	5
Eingelöst	(2)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	5
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Eingelöst	(2)	(51)
Nettoabnahme	(2)	(51)
Klasse B USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	18	–
Eingelöst	(5)	(4)
Nettozunahme/(-abnahme)	13	(4)
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	(5)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(4)	2
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	12	–
Eingelöst	(2)	–
Nettozunahme	10	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	–
Nettozunahme	4	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	(2)	(7)
Nettoabnahme	(1)	(5)
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	15	63
Eingelöst	(54)	(66)
Nettoabnahme	(39)	(3)
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	12	40
Eingelöst	(38)	(44)
Nettoabnahme	(26)	(4)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	9	2
Eingelöst	(10)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	2
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	3	8
Eingelöst	(6)	(11)
Nettoabnahme	(3)	(3)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(2)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(2)	2
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	11
Eingelöst	(6)	(9)
Nettozunahme/(-abnahme)	(3)	2
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Eingelöst	(2)	–
Nettoverringerung	(2)	–
Klasse A Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	14
Eingelöst	(3)	(16)
Nettoabnahme	(3)	(2)
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	175	91
Eingelöst	(233)	(339)
Nettoabnahme	(58)	(248)

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)		
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	2	4
Eingelöst	(4)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	(2)	3
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	1	9
Eingelöst	(11)	(12)
Nettoabnahme	(10)	(3)
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	3	12
Eingelöst	(12)	(24)
Nettoabnahme	(9)	(12)
Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	9	75
Eingelöst	(9)	(48)
Nettozunahme	–	27
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	1	3
Eingelöst	(2)	(4)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	3
Eingelöst	–	(5)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	3
Eingelöst	(1)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	2
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	7	1
Eingelöst	(2)	(19)
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(18)
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	9	11
Eingelöst	(18)	(11)
Nettoabnahme	(9)	–
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	2	1
Eingelöst	(10)	(1)
Nettoabnahme	(8)	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	68	21
Eingelöst	(410)	(51)
Nettoabnahme	(342)	(30)
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	164	60
Eingelöst	(194)	(232)
Nettoabnahme	(30)	(172)
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(264)
Nettoabnahme	–	(264)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	7	11
Eingelöst	(6)	(8)
Nettozunahme	1	3
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	(25)	–
Nettoabnahme	(25)	–
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)		
Eingelöst	(8)	(5)
Nettoabnahme	(8)	(5)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(22)	(14)
Nettoabnahme	(21)	(13)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	26	46
Eingelöst	(39)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(13)	46

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	39	27
Eingelöst	(108)	(46)
Nettoabnahme	(69)	(19)
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	69	126
Eingelöst	(67)	(121)
Nettozunahme	2	5
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	87	72
Eingelöst	(69)	(79)
Nettozunahme/(-abnahme)	18	(7)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	84	10
Eingelöst	(10)	(4)
Nettozunahme	74	6
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	4	4
Eingelöst	(7)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	(3)	3
Klasse A Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	15
Eingelöst	–	(9)
Nettozunahme	–	6
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	165	327
Eingelöst	(54)	(383)
Nettozunahme/(-abnahme)	111	(56)
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(2)	(3)
Nettoabnahme	(1)	(3)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	1	14
Eingelöst	(7)	(6)
Nettozunahme/(-abnahme)	(6)	8
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	10	5
Eingelöst	(11)	(11)
Nettoabnahme	(1)	(6)
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(4)	(4)
Nettoabnahme	(3)	(3)
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(15)	(3)
Nettoabnahme	(15)	(2)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	10	2
Eingelöst	(5)	(1)
Nettozunahme	5	1
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(10)	(1)
Nettoabnahme	(9)	–
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	232	82
Eingelöst	(189)	(49)
Nettozunahme	43	33
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	3
Nettozunahme	–	3

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – (Fortsetzung)^		
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	37	–
Nettozunahme	37	–
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	9	13
Eingelöst	(100)	(84)
Nettoabnahme	(91)	(71)
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(2)	(4)
Nettoabnahme	(1)	(3)
Klasse L (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(2)	(4)
Nettoabnahme	(2)	(2)
Klasse GF USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(13)
Nettoabnahme	–	(13)
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	14	4
Eingelöst	(7)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	7	(1)
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	2	1
Eingelöst	(2)	(2)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	1	3
Eingelöst	(3)	(5)
Nettoabnahme	(2)	(2)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A Euro, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	50	40
Eingelöst	(184)	(26)
Nettozunahme/(-abnahme)	(134)	14
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	4
Eingelöst	–	(5)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(3)	(4)
Nettoabnahme	(2)	(3)
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(8)	(3)
Nettoabnahme	(7)	(3)
Klasse F USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(5)
Nettoabnahme	–	(5)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(2)	(1)
Nettoverringerung	(2)	–
Klasse L (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	4
Eingelöst	(7)	(4)
Nettoabnahme	(6)	–
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	38	36
Eingelöst	(94)	(65)
Nettoabnahme	(56)	(29)
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	22	76
Eingelöst	(41)	(118)
Nettoabnahme	(19)	(42)
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	17	5
Eingelöst	(44)	(21)
Nettoabnahme	(27)	(16)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	4	14
Eingelöst	(19)	(16)
Nettoabnahme	(15)	(2)
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	5	8
Eingelöst	(30)	(20)
Nettoabnahme	(25)	(12)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	12	7
Eingelöst	(33)	(24)
Nettoabnahme	(21)	(17)
Klasse A EUR, thesaurierend		
Eingelöst	(3)	(2)
Nettoabnahme	(3)	(2)
Klasse A Euro, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Verkauft	5	9
Eingelöst	(5)	(6)
Nettozunahme	–	3
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	9.654	1.710
Eingelöst	(1.376)	(1.123)
Nettozunahme	8.278	587
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(2)	(1)
Nettoverringerung	(2)	–
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	(6)	(7)
Nettoabnahme	(5)	(5)
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	1	4
Eingelöst	(4)	(6)
Nettoabnahme	(3)	(2)

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)		
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	(2)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(5)	(2)
Nettoabnahme	(5)	–
Klasse X USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	5	6
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	4	6
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Verkauft	3	4
Nettozunahme	3	4
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	82	17
Eingelöst	(114)	(23)
Nettoverringerung	(32)	(6)
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	23
Eingelöst	(23)	(67)
Nettoabnahme	(23)	(44)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	28
Eingelöst	(8)	(46)
Nettoabnahme	(4)	(18)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Eingelöst	–	(14)
Nettoabnahme	–	(12)
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(1)	(3)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	(3)	(3)
Nettoabnahme	(2)	(1)
Klasse L (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	4
Eingelöst	(3)	(5)
Nettoabnahme	(3)	(1)
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	–	6
Eingelöst	–	(2)
Nettozunahme	–	4
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(4)
Nettoabnahme	–	(4)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	21
Eingelöst	–	(3)
Nettozunahme	–	18
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(4)
Nettoabnahme	–	(3)
Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(41)
Nettoabnahme	–	(40)
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(6)
Nettoverringerung	–	(6)
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	1	2
Eingelöst	(17)	(5)
Nettoabnahme	(16)	(3)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	4	6
Eingelöst	(18)	(23)
Nettoabnhame	(14)	(17)
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	(4)
Nettoabnahme	(1)	(4)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	369	–
Eingelöst	(250)	–
Nettozunahme	119	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	56	103
Eingelöst	(120)	(241)
Nettoabnahme	(64)	(138)
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	6	16
Eingelöst	(11)	(20)
Nettoabnahme	(5)	(4)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	218	384
Eingelöst	(311)	(232)
Nettozunahme/(-abnahme)	(93)	152
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	29	94
Eingelöst	(92)	(60)
Nettozunahme/(-abnahme)	(63)	34
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	111	218
Eingelöst	(143)	(84)
Nettozunahme/(-abnahme)	(32)	134

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	57	846
Eingelöst	(645)	(217)
Nettozunahme/(-abnahme)	(588)	629
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	7
Eingelöst	(1)	(7)
Nettozunahme	2	–
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	4	13
Eingelöst	(8)	(7)
Nettozunahme/(-abnahme)	(4)	6
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	265	905
Eingelöst	(466)	(1.413)
Nettoabnahme	(201)	(508)
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	22	360
Eingelöst	(257)	(975)
Nettoabnahme	(235)	(615)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	6,170	232
Eingelöst	(4.234)	(242)
Nettozunahme/(-abnahme)	1.936	(10)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	2.474	830
Eingelöst	(5.779)	(25)
Nettozunahme/(-abnahme)	(3.305)	805
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	(2)	–
Nettoverringerung	(2)	–
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	(4)	(3)
Nettoabnahme	(4)	(3)
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	1	1
Eingelöst	–	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(1)
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	37	3
Eingelöst	(34)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(2)
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	8	–
Eingelöst	(3)	–
Nettozunahme	5	–
Klasse X USD, ausschüttend (M)		
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(6)
Nettoverringerung	–	(6)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(9)
Nettoabnahme	–	(9)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	50	11
Eingelöst	(26)	(44)
Nettozunahme/(-abnahme)	24	(33)
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	116	134
Eingelöst	(117)	(182)
Nettoabnahme	(1)	(48)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5	29
Eingelöst	(4)	(45)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(16)
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	12	130
Eingelöst	–	(130)
Nettozunahme	12	–
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	14	29
Nettozunahme	14	29
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	23	–
Eingelöst	(16)	–
Nettozunahme	7	–
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	72	2
Eingelöst	(14)	(2)
Nettozunahme	58	–
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	45	–
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	45	(1)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	51	4
Eingelöst	(2)	–
Nettozunahme	49	4
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	–	3
Eingelöst	–	(3)
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	7	–
Eingelöst	(2)	(4)
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(4)
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(9)
Nettoabnahme	–	(9)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	13	–
Nettozunahme	13	–
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	3	–
Nettozunahme	3	–
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	7	–
Nettozunahme	7	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	135	4
Eingelöst	(23)	(4)
Nettozunahme	112	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	174	5
Eingelöst	(55)	–
Nettozunahme	119	5
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1
Klasse Premier GBP, ausschÃ¼ttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	2	1
Eingelöst	–	(3)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(2)
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	98	60
Eingelöst	(5)	(2)
Nettozunahme	93	58

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – (Fortsetzung)		
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	12	20
Eingelöst	(10)	–
Nettozunahme	2	20
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	573	892
Eingelöst	(225)	(42)
Nettozunahme	348	850
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	27	–
Nettozunahme	27	–
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	–	12
Nettozunahme	–	12
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	227	81
Eingelöst	(254)	(241)
Nettoabnahme	(27)	(160)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	127	15
Eingelöst	(269)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	(142)	13
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	27	–
Nettozunahme	27	–
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	4	88
Eingelöst	(1)	(64)
Nettozunahme	3	24
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	188
Nettozunahme	–	188
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	60	33
Eingelöst	(71)	(7)
Nettozunahme/(-abnahme)	(11)	26
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(16)
Nettoabnahme	–	(16)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Eingelöst	(28)	–
Nettoabnahme	(28)	–
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund		
Klasse A Euro, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(2)	(2)
Nettoverringerung	(2)	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	5
Eingelöst	(4)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(4)	5
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Eingelöst	(12)	(58)
Nettoabnahme	(12)	(58)
Klasse LM EUR, ausschüttend (Q)		
Verkauft	2	2
Eingelöst	(6)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(4)	2
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	780	1,105
Eingelöst	(1.911)	(2.095)
Nettoabnahme	(1.131)	(990)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	415	964
Eingelöst	(1.627)	(921)
Nettozunahme/(-abnahme)	(1.212)	43
Klasse A USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	775	72
Eingelöst	(561)	(555)
Nettozunahme/(-abnahme)	214	(483)
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	32
Eingelöst	(22)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	(18)	31
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	52	249
Eingelöst	(209)	(40)
Nettozunahme/(-abnahme)	(157)	209
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	9	6
Eingelöst	(23)	(23)
Nettoabnhame	(14)	(17)
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2	4
Eingelöst	(18)	(129)
Nettoabnahme	(16)	(125)
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	61	12
Eingelöst	(76)	(7)
Nettozunahme/(-abnahme)	(15)	5
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	987	577
Eingelöst	(1.603)	(1.230)
Nettoabnahme	(616)	(653)
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	13	29
Eingelöst	(59)	(16)
Nettozunahme/(-abnahme)	(46)	13
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	22	321
Eingelöst	(172)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(150)	321
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)		
Verkauft	11	20
Eingelöst	(99)	(68)
Nettoabnahme	(88)	(48)
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	295
Eingelöst	(483)	(19)
Nettozunahme/(-abnahme)	(479)	276
Klasse A GBP, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	(4)
Nettoabnahme	–	(4)
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	14	75
Eingelöst	(73)	(9)
Nettozunahme/(-abnahme)	(59)	66
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	108	121
Eingelöst	(796)	(288)
Nettoabnahme	(688)	(167)
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	9.733	23.417
Eingelöst	(27.498)	(33.458)
Nettoabnahme	(17.765)	(10.041)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	5.870	52.564
Eingelöst	(38.644)	(11.666)
Netto (Abnahme)/Zunahme	(32.774)	40.898
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	122	–
Eingelöst	(113)	–
Nettozunahme	9	–
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	39	65
Eingelöst	(118)	(136)
Nettoabnahme	(79)	(71)
Klasse C USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	2	5
Eingelöst	(24)	(24)
Nettoabnahme	(22)	(19)
Klasse A NOK, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	83	34
Eingelöst	(28)	(15)
Nettozunahme	55	19
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	7	62
Eingelöst	(73)	(78)
Nettoabnahme	(66)	(16)
Klasse E USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(14)	(9)
Nettoabnahme	(13)	(8)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2	10
Eingelöst	(14)	(10)
Nettoabnahme	(12)	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	180	290
Eingelöst	(435)	(237)
Nettozunahme/(-abnahme)	(255)	53
Klasse F USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	13	28
Eingelöst	(42)	(44)
Nettoabnahme	(29)	(16)
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	305	468
Eingelöst	(409)	(488)
Nettoabnahme	(104)	(20)
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	23	87
Eingelöst	(309)	(69)
Nettozunahme/(-abnahme)	(286)	18
Klasse X USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	12	34
Eingelöst	(45)	(29)
Nettozunahme/(-abnahme)	(33)	5
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	10	22
Eingelöst	(21)	(31)
Nettoabnahme	(11)	(9)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	306	327
Eingelöst	(435)	(447)
Nettoabnahme	(129)	(120)
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	3	52
Eingelöst	(11)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	(8)	50
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	10	19
Eingelöst	(16)	(26)
Nettoabnahme	(6)	(7)
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	2	–
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	1	–
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	67	116
Eingelöst	(137)	(140)
Nettoabnahme	(70)	(24)
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	6	9
Eingelöst	(6)	(3)
Nettozunahme	–	6

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	6	18
Eingelöst	(17)	(9)
Nettozunahme/(-abnahme)	(11)	9
Klasse X SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	793	2.161
Eingelöst	(407)	(618)
Nettozunahme	386	1.543
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	847	1.111
Eingelöst	(2.118)	(1.561)
Nettoabnahme	(1.271)	(450)
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	118	350
Eingelöst	(250)	(106)
Nettozunahme/(-abnahme)	(132)	244
Klasse Premier AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5	41
Eingelöst	(2)	(41)
Nettozunahme	3	–
Klasse Premier AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)		
Verkauft	37	142
Eingelöst	(39)	(211)
Nettoabnahme	(2)	(69)
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	561	–
Eingelöst	(896)	(445)
Nettoabnahme	(335)	(445)
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	42	43
Eingelöst	(62)	(112)
Nettoabnahme	(20)	(69)
Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)		
Verkauft	3	1
Eingelöst	(25)	(13)
Nettoabnahme	(22)	(12)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	790	910
Eingelöst	(1.137)	(1.436)
Nettoabnahme	(347)	(526)
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	138	51
Eingelöst	(42)	(2)
Nettozunahme	96	49
Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)		
Verkauft	294	121
Eingelöst	(94)	(100)
Nettozunahme	200	21
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	127	378
Eingelöst	(685)	(619)
Nettoabnahme	(558)	(241)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)		
Verkauft	271	1.348
Eingelöst	(553)	(651)
Nettozunahme/(-abnahme)	(282)	697
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	7	21
Eingelöst	(160)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	(153)	19
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	16	28
Eingelöst	(57)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(41)	28
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	13	60
Eingelöst	(448)	(41)
Nettozunahme/(-abnahme)	(435)	19
Klasse S USD, thesaurierend		
Eingelöst	(105)	(97)
Nettoabnahme	(105)	(97)
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	17	19
Eingelöst	(10)	(167)
Nettozunahme/(-abnahme)	7	(148)

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)		
Verkauft	260	115
Eingelöst	(147)	(255)
Nettozunahme/(-abnahme)	113	(140)
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(2)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	(2)	1
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^		
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	15	–
Nettozunahme	15	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	10	9
Eingelöst	(4)	–
Nettozunahme	6	9
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)		
Verkauft	3	–
Nettozunahme	3	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	19	–
Eingelöst	(16)	–
Nettozunahme	3	–
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	21	–
Eingelöst	(13)	–
Nettozunahme	8	–
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	395	155
Eingelöst	(95)	–
Nettozunahme	300	155
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	12	212
Eingelöst	(13)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	212
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	677	646
Eingelöst	(159)	(618)
Nettozunahme	518	28
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	–	32
Eingelöst	–	(7)
Nettozunahme	–	25
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	3
Eingelöst	–	(5)
Nettoabnahme	–	(2)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^		
Klasse D EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2	5
Eingelöst	(5)	(8)
Nettoabnahme	(3)	(3)
Klasse D EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	16
Eingelöst	(2)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(2)	16
Klasse D USD, thesaurierend		
Verkauft	–	10
Eingelöst	(94)	(55)
Nettoabnahme	(94)	(45)
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	90	–
Nettozunahme	90	–
Klasse D USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	283	11
Eingelöst	(59)	(54)
Nettozunahme/(-abnahme)	224	(43)
Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5	5
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme	5	4
Klasse F USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	(42)
Nettoabnahme	(1)	(42)
Klasse M USD, thesaurierend		
Verkauft	8	–
Nettozunahme	8	–
Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	244	865
Eingelöst	(3.378)	(170)
Nettozunahme/(-abnahme)	(3.134)	695
Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)		
Verkauft	–	18
Eingelöst	(19)	(3)
Nettozunahme/(-abnahme)	(19)	15
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	457	1.817
Eingelöst	(1.448)	(269)
Nettozunahme/(-abnahme)	(991)	1.548
Klasse Premier EUR ausschüttend (Q) (abgesichert)		
Verkauft	27	73
Eingelöst	(12)	(9)
Nettozunahme	15	64
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)		
Verkauft	14	62
Eingelöst	(266)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	(252)	57
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	500	–
Nettozunahme	500	–
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	4	9
Eingelöst	(670)	(8)
Nettozunahme/(-abnahme)	(666)	1
Legg Mason Western Asset US Mortgage – Backed Securities Fund^		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	3
Eingelöst	–	(3)
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	2	2
Nettozunahme	2	2
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	10
Eingelöst	(1)	(1)
Nettozunahme	3	9

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset US Mortgage – Backed Securities Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(2.516)	(2)
Nettoabnahme	(2.516)	–
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^		
Klasse LM GBP, thesaurierend		
Verkauft	–	163
Nettozunahme	–	163
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	10	9
Eingelöst	(9)	(6)
Nettozunahme	1	3
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	7	160
Eingelöst	(72)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(65)	160
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	3
Nettozunahme	1	3
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(162)
Nettoabnahme	–	(162)
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	8	36
Eingelöst	(30)	(96)
Nettoabnahme	(22)	(60)
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	3	24
Eingelöst	(7)	(26)
Nettoabnahme	(4)	(2)
Klasse A USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	13	69
Eingelöst	(110)	(34)
Nettozunahme/(-abnahme)	(97)	35
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	1	18
Eingelöst	(15)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	(14)	16
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	7	302
Eingelöst	(59)	(75)
Nettozunahme/(-abnahme)	(52)	227
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	62
Eingelöst	(2)	(483)
Nettoabnahme	(2)	(421)
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	1	6
Eingelöst	(10)	(16)
Nettoabnahme	(9)	(10)
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	(4)	(5)
Nettoabnahme	(3)	(3)
Klasse A SGD, thesaurierend		
Verkauft	829	13.389
Eingelöst	(996)	(13.402)
Nettoabnahme	(167)	(13)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	5
Eingelöst	–	(5)
Nettozunahme	–	–

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse C USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	–	4
Eingelöst	(5)	(14)
Nettoabnahme	(5)	(10)
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(4)	(5)
Nettoabnahme	(4)	(4)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	3
Eingelöst	(4)	(8)
Nettoabnahme	(4)	(5)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	2	3
Eingelöst	(8)	(6)
Nettoabnahme	(6)	(3)
Klasse R USD, ausschüttend (S)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	8
Eingelöst	(1)	(11)
Nettoabnahme	(1)	(3)
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	2	29
Eingelöst	(61)	(68)
Nettoabnahme	(59)	(39)
Klasse X USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	–	4
Eingelöst	–	(5)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	43
Eingelöst	–	(79)
Nettoabnahme	–	(36)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	32
Eingelöst	(23)	(824)
Nettoabnahme	(19)	(792)
Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	14
Eingelöst	(3)	(23)
Nettoabnahme	(3)	(9)
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	2	18
Eingelöst	(39)	(18)
Nettoabnahme	(37)	–
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	65	46
Eingelöst	(88)	(17)
Nettozunahme/(-abnahme)	(23)	29
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	27	94
Eingelöst	(136)	(269)
Nettoabnahme	(109)	(175)
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	35	119
Eingelöst	(203)	(245)
Nettoabnahme	(168)	(126)
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)		
Verkauft	40	53
Eingelöst	(64)	(50)
Nettozunahme/(-abnahme)	(24)	3
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	194	504
Eingelöst	(606)	(504)
Nettoabnahme	(412)	–
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	–	184
Eingelöst	(54)	(165)
Nettozunahme/(-abnahme)	(54)	19
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	91	114
Eingelöst	(271)	(160)
Nettoabnahme	(180)	(46)

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	494
Eingelöst	(115)	(151)
Nettozunahme/(-abnahme)	(115)	343
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	14	84
Eingelöst	(71)	(175)
Nettoabnahme	(57)	(91)
Klasse Premier EUR, ausschüttend (S)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	–	(2)
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	51	29
Eingelöst	(489)	(43)
Nettoabnahme	(438)	(14)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	11	99
Eingelöst	(127)	(43)
Nettozunahme/(-abnahme)	(116)	56
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	91
Eingelöst	(965)	(64)
Nettozunahme/(-abnahme)	(965)	27
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	6	31
Eingelöst	(3)	(1)
Nettozunahme	3	30

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(202)	(10)
Nettoabnahme	(202)	(9)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	3	4
Eingelöst	(120)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	(117)	2
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	59	–
Eingelöst	(33)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	26	(5)
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	–
Eingelöst	(3)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A SGD, thesaurierend		
Verkauft	1.844	4.404
Eingelöst	(3.399)	(4.404)
Nettoabnahme	(1.555)	–
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse E USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1
Klasse F USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(7)
Nettoverringerung	–	(6)
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	6
Eingelöst	–	(3)
Nettozunahme	–	3
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	43	139
Eingelöst	(402)	(333)
Nettoabnahme	(359)	(194)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(81)	(2)
Nettoabnahme	(81)	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	20	13
Eingelöst	(260)	(369)
Nettoabnahme	(240)	(356)
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	19	19
Eingelöst	(259)	(107)
Nettoabnahme	(240)	(88)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	5	10
Eingelöst	(119)	(45)
Nettoabnahme	(114)	(35)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(365)
Nettoabnahme	–	(365)
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	995
Eingelöst	–	(889)
Nettozunahme	–	106
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(161)
Nettoabnahme	–	(161)

Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	–	6
Eingelöst	(1)	(3)
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	3
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	5
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme	–	4
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	5
Nettozunahme	–	5
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(13)
Nettoabnahme	–	(13)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(720)
Nettoabnahme	–	(720)

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	4	6
Eingelöst	(131)	(8)
Nettoabnahme	(127)	(2)
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	1	133
Eingelöst	(112)	(129)
Nettozunahme/(-abnahme)	(111)	4
Klasse A SGD, thesaurierend		
Verkauft	3.397	–
Eingelöst	(805)	–
Nettozunahme	2.592	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	–	11
Eingelöst	–	(13)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	4	2
Eingelöst	(1)	(3)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(1)
Klasse F USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme	–	–

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	4	–
Nettozunahme	4	–
Klasse Premier USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Eingelöst	(10)	–
Nettoabnahme	(10)	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	497	1.130
Eingelöst	(104)	(1.677)
Nettozunahme/(-abnahme)	393	(547)
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)		
Eingelöst	–	(86)
Nettoabnahme	–	(86)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	18
Eingelöst	(2)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	(2)	17
Klasse LM USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(98)
Nettoabnahme	–	(98)
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Verkauft	2	8
Eingelöst	(11)	(4)
Nettozunahme/(-abnahme)	(9)	4
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	45	151
Eingelöst	(156)	(62)
Nettozunahme/(-abnahme)	(111)	89
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	5	–
Eingelöst	(17)	–
Nettoabnahme	(12)	–
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	1.000
Nettozunahme	–	1.000
Klasse BW LM GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Eingelöst	(1.311)	(1.031)
Nettoabnahme	(1.311)	(1.031)
Klasse BW LM GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Eingelöst	(4.407)	–
Nettoabnahme	(4.407)	–
Klasse BW Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	7	761
Eingelöst	(195)	(567)
Nettozunahme/(-abnahme)	(188)	194
Klasse BW Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	54	–
Eingelöst	(295)	(750)
Nettoabnahme	(241)	(750)
Klasse BW Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Eingelöst	(188)	–
Nettoabnahme	(188)	–
Klasse BW Premier USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Eingelöst	(48)	–
Nettoabnahme	(48)	–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	87	20
Eingelöst	(61)	(3)
Nettozunahme	26	17
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	26	3
Eingelöst	(13)	(81)
Nettozunahme/(-abnahme)	13	(78)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5	5
Eingelöst	(4)	(21)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(16)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	14	10
Eingelöst	(18)	(8)
Nettozunahme/(-abnahme)	(4)	2
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	33	15
Eingelöst	(16)	(28)
Nettozunahme/(-abnahme)	17	(13)
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	3	1
Eingelöst	(1)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(1)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	9.899	2.148
Eingelöst	(4.626)	(1.651)
Nettozunahme	5.273	497
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	10
Nettozunahme	–	10
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	59	1
Eingelöst	(30)	–
Nettozunahme	29	1
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	13
Eingelöst	(1)	(14)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(5)	(9)
Nettoabnahme	(4)	(8)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	5	–
Nettozunahme	5	–
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	18	33
Eingelöst	(10)	(34)
Nettozunahme/(-abnahme)	8	(1)
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	7
Eingelöst	(2)	(12)
Nettoabnahme	(2)	(5)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	280	188
Eingelöst	(118)	(392)
Nettozunahme/(-abnahme)	162	(204)
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	352	–
Nettozunahme	352	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	14
Eingelöst	(10)	(11)
Nettozunahme/(-abnahme)	(10)	3
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	3	14
Eingelöst	(3)	–
Nettozunahme	–	14

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Eingelöst	(7)	–
Nettoabnahme	(7)	–
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	106	–
Eingelöst	(5)	(3)
Nettozunahme/(-abnahme)	101	(3)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	14	23
Eingelöst	(41)	(47)
Nettoabnahme	(27)	(24)
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(99)
Nettoabnahme	–	(99)
Klasse S BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	103
Nettozunahme	–	103
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^		
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	10.120	–
Eingelöst	(15.084)	–
Nettoabnahme	(4.964)	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	33	31
Eingelöst	(52)	(6)
Nettozunahme/(-abnahme)	(19)	25
Klasse LM SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	96.246
Eingelöst	(117)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(117)	96.246
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^		
Klasse A USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse S USD, thesaurierend		
Eingelöst	(16)	–
Nettoabnahme	(16)	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(6)
Nettoverringerung	–	(6)
Legg Mason ClearBridge Value Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	12	63
Eingelöst	(33)	(52)
Nettozunahme/(-abnahme)	(21)	11
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	6	4
Eingelöst	(12)	(13)
Nettoabnahme	(6)	(9)
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	10
Eingelöst	–	(22)
Nettoabnahme	–	(12)
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	90	5
Eingelöst	(40)	(56)
Nettozunahme/(-abnahme)	50	(51)
Klasse A SGD, thesaurierend		
Verkauft	71	405
Eingelöst	(312)	(541)
Nettoabnahme	(241)	(136)
Klasse B USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	(5)	(2)
Nettoabnahme	(5)	(2)
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	(6)	(1)
Nettoabnahme	(6)	(1)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse F USD ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	6	–
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	6	(1)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	183	47
Eingelöst	(218)	(51)
Nettoabnahme	(35)	(4)
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(2)
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^	**Klasse Premier USD, thesaurierend**	
Verkauft	–	9
Eingelöst	–	(148)
Nettoabnahme	–	(139)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(6)
Nettoverringerung	–	(6)
Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund^		
Klasse A USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Eingelöst	–	(6)
Nettoverringerung	–	(6)
Klasse A USD, ausschüttend (Q)		
Eingelöst	–	(5)
Nettoabnahme	–	(5)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(4)
Nettoabnahme	–	(4)
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Eingelöst	–	(5)
Nettoabnahme	–	(5)
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Eingelöst	–	(6)
Nettoverringerung	–	(6)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(4)
Nettoabnahme	–	(4)
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Eingelöst	–	(4)
Nettoabnahme	–	(4)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(9)
Nettoabnahme	–	(9)
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	10	28
Eingelöst	(42)	(30)
Nettoabnahme	(32)	(2)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	3	3
Eingelöst	(11)	(16)
Nettoabnahme	(8)	(13)

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(6)	(8)
Nettoabnahme	(6)	(7)
Klasse B USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse B USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	8	9
Eingelöst	(20)	(17)
Nettoabnahme	(12)	(8)
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(7)	(33)
Nettoabnahme	(6)	(32)
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	6	10
Eingelöst	(9)	(9)
Nettozunahme/(-abnahme)	(3)	1
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	16	50
Eingelöst	(7)	(47)
Nettozunahme	9	3
Klasse F USD ausschüttend (A)		
Verkauft	2	3
Eingelöst	(2)	(1)
Nettozunahme	–	2
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(7)	(10)
Nettoabnahme	(7)	(9)
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	1	5
Eingelöst	(38)	(3)
Nettozunahme/(-abnahme)	(37)	2
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	(2)	(1)
Nettoabnahme	(2)	(1)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	10	53
Eingelöst	(9)	(1)
Nettozunahme	1	52
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	2
Eingelöst	(4)	(2)
Nettoabnahme	(3)	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	(3)
Nettoabnahme	(1)	(2)
Klasse L (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	(5)	(1)
Nettoabnahme	(5)	(1)
Klasse GA USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse GA EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme	–	–

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	155	188
Eingelöst	(217)	(241)
Nettoabnahme	(62)	(53)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	17	26
Eingelöst	(25)	(39)
Nettoabnahme	(8)	(13)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	13	13
Eingelöst	(22)	(31)
Nettoabnahme	(9)	(18)
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	56	57
Eingelöst	(52)	(64)
Nettozunahme/(-abnahme)	4	(7)
Klasse B USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	27	14
Eingelöst	(23)	(21)
Nettozunahme/(-abnahme)	4	(7)
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	4	10
Eingelöst	(11)	(115)
Nettoabnahme	(7)	(105)
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	17	48
Eingelöst	(46)	(32)
Nettozunahme/(-abnahme)	(29)	16
Klasse E USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	6
Eingelöst	(3)	(10)
Nettoabnahme	(3)	(4)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	233	173
Eingelöst	(270)	(145)
Nettozunahme/(-abnahme)	(37)	28
Klasse F USD ausschüttend (A)		
Verkauft	8	26
Eingelöst	(23)	(16)
Nettozunahme/(-abnahme)	(15)	10
Klasse U USD, thesaurierend		
Verkauft	187	268
Eingelöst	(399)	(1.407)
Nettoabnahme	(212)	(1.139)
Klasse U EUR, thesaurierend		
Verkauft	437	157
Eingelöst	(343)	(55)
Nettozunahme	94	102
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	19	46
Eingelöst	(144)	(86)
Nettoabnahme	(125)	(40)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	20	97
Eingelöst	(30)	(48)
Nettozunahme/(-abnahme)	(10)	49
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	4	19
Eingelöst	(16)	(4)
Nettozunahme/(-abnahme)	(12)	15
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	20	6
Eingelöst	(9)	(2)
Nettozunahme	11	4
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	398	269
Eingelöst	(547)	(567)
Nettoabnahme	(149)	(298)
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	15	–
Eingelöst	(10)	–
Nettozunahme	5	–
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	444	16
Nettozunahme	444	16

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund – (Fortsetzung)		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	86	233
Eingelöst	(203)	(179)
Nettozunahme/(-abnahme)	(117)	54
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	103	93
Eingelöst	(24)	(4)
Nettozunahme	79	89
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	12	–
Eingelöst	(3)	–
Nettozunahme	9	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	46	1
Eingelöst	(36)	(7)
Nettozunahme/(-abnahme)	10	(6)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	42	31
Eingelöst	(51)	(135)
Nettoabnahme	(9)	(104)
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse L (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	34	50
Eingelöst	(121)	(290)
Nettoabnahme	(87)	(240)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	4	11
Eingelöst	(22)	(53)
Nettoabnahme	(18)	(42)
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	19	20
Eingelöst	(30)	(48)
Nettoabnahme	(11)	(28)
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(2)	(2)
Nettoverringerung	(2)	–
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	12	–
Eingelöst	(12)	(13)
Nettoabnahme	–	(13)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	41	107
Eingelöst	(239)	(25)
Nettozunahme/(-abnahme)	(198)	82
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	3
Eingelöst	(17)	(13)
Nettoabnahme	(16)	(10)
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(4)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse A GBP, thesaurierend		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(1)	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse A HKD, thesaurierend		
Verkauft	24	286
Eingelöst	(83)	(281)
Nettozunahme/(-abnahme)	(59)	5
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	344	54
Eingelöst	(304)	(467)
Nettozunahme/(-abnahme)	40	(413)
Klasse B USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse B USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	–	(4)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	2	1
Eingelöst	(6)	(14)
Nettoabnahme	(4)	(13)
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	2	8
Eingelöst	(21)	(78)
Nettoabnahme	(19)	(70)
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	1	4
Eingelöst	(12)	(18)
Nettoabnahme	(11)	(14)
Klasse E USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	(4)
Nettoabnahme	(1)	(3)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	6	9
Eingelöst	(14)	(33)
Nettoabnahme	(8)	(24)
Klasse F USD ausschüttend (A)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(1)	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	7	43
Eingelöst	(33)	(103)
Nettoabnahme	(26)	(60)
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(4)	(30)
Nettoabnahme	(4)	(28)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(20)	(10)
Nettoabnahme	(20)	(8)
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	25	15
Eingelöst	(41)	(100)
Nettoabnahme	(16)	(85)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	40	154
Eingelöst	(466)	(190)
Nettoabnahme	(426)	(36)
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	(3)	(1)
Nettoabnahme	(3)	(1)
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	3	3
Eingelöst	(2)	(54)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(51)

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund – (Fortsetzung)		
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	15
Eingelöst	(66)	(24)
Nettoabnahme	(65)	(9)
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	–	17
Eingelöst	(3)	(446)
Nettoabnahme	(3)	(429)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	3	61
Eingelöst	(188)	(649)
Nettoabnahme	(185)	(588)
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	10	2
Eingelöst	(5)	(11)
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(9)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	–	3
Eingelöst	–	(20)
Nettoabnahme	–	(17)
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(4)	(12)
Nettoabnahme	(4)	(10)
Klasse L (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(4)	(4)
Nettoabnahme	(4)	(2)
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	1	4
Eingelöst	(4)	(6)
Nettoabnahme	(3)	(2)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	5	4
Eingelöst	(19)	(52)
Nettoabnahme	(14)	(48)
Klasse A USD, ausschüttend (Q)		
Verkauft	–	8
Nettozunahme	–	8
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	3	7
Eingelöst	(7)	(40)
Nettoabnahme	(4)	(33)
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	9	2
Eingelöst	(1)	(1)
Nettozunahme	8	1
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	2	54
Eingelöst	(60)	(174)
Nettoabnahme	(58)	(120)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	790	55
Eingelöst	(975)	(739)
Nettoabnahme	(185)	(684)
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	(3)	–
Nettoabnahme	(3)	–
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse C USD, ausschüttend (Q)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	–	3
Eingelöst	(7)	(22)
Nettoabnahme	(7)	(19)
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^		
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	–	1
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	–
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	2	–
Klasse A SEK, thesaurierend		
Verkauft	5.323	–
Eingelöst	(155)	–
Nettozunahme	5.168	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	4	–
Nettozunahme	4	–
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	13	–
Nettozunahme	13	–
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	3	2
Eingelöst	(10)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(7)	2
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	23	–
Eingelöst	(24)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	21	–
Eingelöst	(15)	–
Nettozunahme	6	–
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	29	4
Eingelöst	(9)	–
Nettozunahme	20	4
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	104	–
Nettozunahme	104	–
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	3
Eingelöst	(2)	(3)
Nettoverringerung	(2)	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	(2)	–
Nettoverringerung	(2)	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	4	–
Eingelöst	(2)	–
Nettozunahme	2	–
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	213	64
Eingelöst	(93)	(47)
Nettozunahme	120	17
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	300	–
Eingelöst	(39)	–
Nettozunahme	261	–
Klasse S GBP, thesaurierend		
Verkauft	108	–
Eingelöst	(28)	–
Nettozunahme	80	–
Klasse S GBP, ausschüttend (Q)		
Verkauft	12	–
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	11	–

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^		
Klasse A USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Eingelöst	(5)	–
Nettoabnahme	(5)	–
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^		
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1.566	1.389
Eingelöst	(3.482)	(486)
Nettozunahme/(-abnahme)	(1.916)	903
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	9	–
Nettozunahme	9	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	2.578	1.796
Eingelöst	(2.008)	(720)
Nettozunahme	570	1.076
Klasse A USD, ausschüttend (Q)		
Verkauft	115	145
Eingelöst	(213)	(109)
Nettozunahme/(-abnahme)	(98)	36
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	38	–
Eingelöst	(8)	–
Nettozunahme	30	–
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	1.207	–
Eingelöst	(784)	–
Nettozunahme	423	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)		
Verkauft	58	–
Eingelöst	(16)	–
Nettozunahme	42	–
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	2.509	2.018
Eingelöst	(2.797)	(3.434)
Nettoabnahme	(288)	(1.416)
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	201	122
Eingelöst	(123)	(66)
Nettozunahme	78	56
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	1.019	18
Eingelöst	(919)	(10)
Nettozunahme	100	8
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	24	11
Eingelöst	(3)	(11)
Nettozunahme	21	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	(5)	–
Nettoabnahme	(5)	–
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	60	–
Eingelöst	(55)	(40)
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(40)
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	18	68
Eingelöst	(71)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(53)	68
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	–	90
Eingelöst	(12)	(112)
Nettoabnahme	(12)	(22)
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	6	45
Eingelöst	(6)	–
Nettozunahme	–	45
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	2

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)		
Verkauft	176	–
Eingelöst	(212)	–
Nettoabnahme	(36)	–
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	3.873	113
Eingelöst	(3.528)	–
Nettozunahme	345	113
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)		
Verkauft	18	4
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	17	4
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	159	92
Eingelöst	(43)	(54)
Nettozunahme	116	38
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	179	90
Eingelöst	(115)	(30)
Nettozunahme	64	60
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)		
Verkauft	77	144
Eingelöst	(252)	(1.352)
Nettoabnahme	(175)	(1.208)
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) Plus (e)		
Verkauft	18	74
Eingelöst	–	(92)
Nettozunahme/(-abnahme)	18	(18)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)		
Verkauft	2.494	1.500
Eingelöst	(10)	–
Nettozunahme	2.484	1.500
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	3.859	2.336
Eingelöst	(6.834)	(566)
Netto (Abnahme)/-anstieg	(2.975)	1.770
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	7	101
Eingelöst	(4)	(130)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(29)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)		
Verkauft	619	297
Eingelöst	(602)	(262)
Nettozunahme	17	35
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)		
Verkauft	499	2,338
Eingelöst	(256)	(548)
Nettozunahme	243	1.790
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	121	424
Eingelöst	(28)	–
Nettozunahme	93	424
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	236	111
Eingelöst	(277)	(363)
Nettoabnahme	(41)	(252)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	11	3
Eingelöst	(31)	(22)
Nettoabnahme	(20)	(19)
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	46	36
Eingelöst	(36)	(39)
Nettozunahme/(-abnahme)	10	(3)
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	211	23
Eingelöst	(189)	(6)
Nettozunahme	22	17

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	11	3
Eingelöst	(21)	(36)
Nettoabnahme	(10)	(33)
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	10	10
Eingelöst	(17)	(33)
Nettoabnahme	(7)	(23)
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	2	–
Eingelöst	(2)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	(3)	(5)
Nettoabnahme	(3)	(5)
Klasse A GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	14	1
Eingelöst	(14)	(4)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5.392	857
Eingelöst	(1.696)	(638)
Nettozunahme	3.696	219
Klasse A SGD, thesaurierend		
Verkauft	1.617	27
Eingelöst	(1.533)	(424)
Nettozunahme/(-abnahme)	84	(397)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(2)	(12)
Nettoabnahme	(1)	(11)
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(2)	(2)
Nettoabnahme	(2)	(1)
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	–	5
Eingelöst	(1)	(10)
Nettoabnahme	(1)	(5)
Klasse E USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse E EUR, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	3	2
Eingelöst	(7)	(14)
Nettoabnahme	(4)	(12)
Klasse F USD ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	22	25
Eingelöst	(45)	(79)
Nettoabnahme	(23)	(54)
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(4)	(3)
Nettoabnahme	(4)	(2)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	35
Eingelöst	(12)	(100)
Nettoabnahme	(11)	(65)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	80	2
Eingelöst	(15)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	65	(3)
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	10	7
Eingelöst	(27)	(43)
Nettoabnahme	(17)	(36)
Klasse X GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	131	37
Eingelöst	(140)	(692)
Nettoabnahme	(9)	(655)
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	–
Eingelöst	(5)	–
Nettoverringerung	(2)	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	7	45
Eingelöst	(10)	(99)
Nettoabnahme	(3)	(54)
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	10	5
Eingelöst	(2)	(15)
Nettozunahme/(-abnahme)	8	(10)
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	28	27
Eingelöst	(113)	(248)
Nettoabnahme	(85)	(221)
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	19	8
Eingelöst	(17)	(22)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(14)
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	17	23
Eingelöst	(28)	(54)
Nettoabnahme	(11)	(31)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	6
Eingelöst	(4)	(9)
Nettoabnahme	(3)	(3)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	3	1
Eingelöst	(1)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(1)
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(1)	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(2)	(4)
Nettoabnahme	(1)	(4)
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	(2)	(3)
Nettoabnahme	(2)	(3)
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	(2)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse E USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	–

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund – (Fortsetzung)		
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	2	3
Eingelöst	(3)	(6)
Nettoabnahme	(1)	(3)
Klasse R USD, thesaurierend		
Eingelöst	(2)	(3)
Nettoabnahme	(2)	(3)
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	3	2
Eingelöst	(27)	(6)
Nettoabnahme	(24)	(4)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(6)	(30)
Nettoabnahme	(6)	(28)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	8
Eingelöst	(1)	(9)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	2
Eingelöst	(2)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(3)	(5)
Nettoabnahme	(3)	(4)
Klasse A USD thesaurierend		
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	5	2
Eingelöst	(34)	(19)
Nettoabnahme	(29)	(17)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	2	5
Eingelöst	(3)	(37)
Nettoabnahme	(1)	(32)
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Eingelöst	(10)	–
Nettoabnahme	(10)	–
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(3)	(14)
Nettoabnahme	(3)	(13)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	117	1.720
Eingelöst	(182)	(1.770)
Nettoabnahme	(65)	(50)
Klasse B USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	(7)	(1)
Nettoabnahme	(7)	(1)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	4
Eingelöst	–	(4)
Nettozunahme	–	–
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	4
Eingelöst	(4)	(4)
Nettoabnahme	(4)	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Nettozunahme	–	2
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	2	–
Eingelöst	(5)	–
Nettoabnahme	(3)	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	5
Eingelöst	(1)	(4)
Nettozunahme	2	1
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	5	9
Eingelöst	(2)	(19)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(10)
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Verkauft	2	3
Eingelöst	(4)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	(2)	2
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse GA EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	8
Eingelöst	(3)	(13)
Nettoabnahme	(3)	(5)
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	1	35
Eingelöst	(15)	(12)
Nettozunahme/(-abnahme)	(14)	23
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	32	46
Eingelöst	(34)	(47)
Nettoabnahme	(2)	(1)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	4	39
Eingelöst	(47)	(42)
Nettoabnahme	(43)	(3)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	4	20
Eingelöst	(12)	(47)
Nettoabnahme	(8)	(27)
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	6	5
Eingelöst	(15)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(9)	5
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	16	99
Eingelöst	(95)	(286)
Nettoabnahme	(79)	(187)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	88	13
Eingelöst	(84)	(32)
Nettozunahme/(-abnahme)	4	(19)
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fonds – (Fortsetzung)		
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(1)	(2)
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	–	4
Eingelöst	–	(4)
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	–
Eingelöst	(2)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(5)
Klasse S USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(23)
Nettoabnahme	–	(23)
Klasse GA USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(2)	(4)
Nettoabnahme	(2)	(3)
Klasse LM SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	(27.864)	(43)
Nettoabnahme	(27.864)	(43)
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(1)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	–	4
Eingelöst	(1)	(5)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Eingelöst	(4)	–
Nettoabnahme	(4)	–
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(3)	(13)
Nettoabnahme	(2)	(13)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	58	–
Eingelöst	(27)	(30)
Nettozunahme/(-abnahme)	31	(30)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse GA USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse GA EUR, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^		
Klasse M GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	92	58
Eingelöst	(3.115)	(202)
Nettoabnahme	(3.023)	(144)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse M USD ausschüttend (A)		
Verkauft	–	28
Eingelöst	(2)	(3)
Nettozunahme/(-abnahme)	(2)	25
Klasse M EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	24	40
Eingelöst	(1.595)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1.571)	40
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	10	–
Nettozunahme	10	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	19	–
Eingelöst	(173)	–
Nettoabnahme	(154)	–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^		
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(197)
Nettoabnahme	–	(196)
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	–	(8)
Nettoverringerung	–	(6)
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^		
Klasse A (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	172	4
Eingelöst	(250)	(196)
Nettoabnahme	(78)	(192)
Klasse A (PF) EUR, thesaurierend		
Verkauft	2	9
Eingelöst	(16)	(22)
Nettoabnahme	(14)	(13)
Klasse A (PF) EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	(322)	(360)
Nettoabnahme	(321)	(358)
Klasse A (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	(16)	(3)
Nettoabnahme	(16)	(3)
Klasse J (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	(20)	–
Nettoabnahme	(20)	–
Klasse J (PF) JPY, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(555)	(95)
Nettoabnahme	(555)	(94)
Klasse M (PF) USD ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	–	19
Eingelöst	(19)	(143)
Nettoabnahme	(19)	(124)
Klasse M (PF) EUR, thesaurierend		
Verkauft	6	46
Eingelöst	(82)	(219)
Nettoabnahme	(76)	(173)
Klasse M (PF) EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	632	1.039
Eingelöst	(1.671)	(2.203)
Nettoabnahme	(1.039)	(1.164)
Klasse M (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	4	1
Eingelöst	(37)	(222)
Nettoabnahme	(33)	(221)
Klasse M (PF) NOK, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	–	(7)
Nettoabnahme	–	(7)
Klasse M (PF) SEK, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	–	(48)
Nettoabnahme	–	(48)
Klasse Premier (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	18	31
Eingelöst	(42)	(6)
Nettozunahme/(-abnahme)	(24)	25

Entwicklung des den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zurechenbaren Nettovermögens Gewinnberechtigte Anteile – *(Fortsetzung)*

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse Premier (PF) BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	–
Nettozunahme	4	–
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^		
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	–	(9)
Nettoabnahme	–	(7)
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund^		
Klasse A (PF) Euro, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	–	(36)
Nettoabnahme	–	(36)
Klasse A (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	–	(6)
Nettoverringerung	–	(6)
Klasse M (PF) USD ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	–	252
Eingelöst	–	(476)
Nettoabnahme	–	(224)
Klasse M (PF) EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	–	(3.160)
Nettoabnahme	–	(3.160)
Klasse M (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(72)
Nettoabnahme	–	(71)
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^		
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	26	–
Eingelöst	(17)	–
Nettozunahme	9	–
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	1
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	2	1
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	–	1
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	85	4
Eingelöst	(22)	–
Nettozunahme	63	4
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2	2
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	1	2
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	4	–
Nettozunahme	4	–
Klasse S GBP, thesaurierend		
Verkauft	38	–
Nettozunahme	38	–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	7	54
Eingelöst	(48)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	(41)	53
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	5	–
Nettozunahme	5	–
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	1.232	–
Nettozunahme	1.232	–

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	**31. August 2019 Anteile (in Tsd.)**
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	5	–
Nettozunahme	5	–
Klasse D USD, thesaurierend		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse X AUD, thesaurierend		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse X USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse LM AUD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(11)
Nettoabnahme	–	(11)
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^		
Klasse A USD, thesaurierend		
Verkauft	15	2
Eingelöst	(4)	–
Nettozunahme	11	2
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	7	–
Eingelöst	(2)	–
Nettozunahme	5	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	4	16
Eingelöst	(1)	(1)
Nettozunahme	3	15
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	3	1
Eingelöst	(2)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(4)
Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund^		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^		
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse S EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	28
Eingelöst	(6)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(5)	28

Als „–" angegebenen Beträge belaufen sich auf 0 oder auf weniger als 1.000.

Es sind nur Klassen angegeben, für die im Berichtszeitraum Transaktionen erfolgt sind.

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.*

Erläuterungen zum Abschluss

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

Die bei der Erstellung dieses Abschlusses verwendeten wesentlichen Rechnungslegungs- und Schätzungsmethoden sind mit denen konform, die die Gesellschaft im Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2020 verwendet hat.

Übereinstimmungserklärung

Der Abschluss für den Berichtszeitraum zum 31. August 2020 wurde im Einklang mit Financial Reporting Standard („FRS") 104: „Interim Financial Reporting", den European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations XX 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) (die „OGAW-Verordnungen") und dem Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48 (1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „OGAW-Verordnungen der Zentralbank") erstellt. Der verkürzte Abschluss sollte in Verbindung mit dem geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2020 gelesen werden, der gemäß FRS 102: „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and the Republic of Ireland" [Der in Großbritannien und in der Republik Irland geltende Standard zur Finanzberichterstattung] erstellt wurde.

Grundlagen der Erstellung

Der Abschluss wurde auf der Grundlage der Fortführung der Geschäftstätigkeit der Gesellschaft nach dem Prinzip der historischen Kosten erstellt, das durch die Neubewertung von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten werden, modifiziert wurde. Die Abschlüsse von Legg Mason Western Asset US ShortTerm Government Fund^, Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^, Legg Mason Western Asset Global Credit Absolute Return 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 – US High Yield Fund^, Legg Mason ClearBridge Growth Fund^, Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^, Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund^, Legg Mason PCM US Equity Fund^, Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^, Legg Mason Congruix Japan Equity Fund^, Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^, Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^, Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^, Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund^, Legg Mason Martin Currie North American Fund^ und Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund^ wurden nicht unter der Annahme der Fortführung der Geschäftstätigkeiten erstellt, da diese Fonds während der vorherigen Berichtszeiträume geschlossen wurden.

Das Format und bestimmte Formulierungen des Abschlusses wurden an die im Companies Act von 2014 enthaltenen angepasst, so dass sie nach Ansicht der Verwaltungsratsmitglieder die Art der Geschäftstätigkeiten als Investmentfonds besser widerspiegeln.

Die Gesellschaft hat von der Ausnahmeregelung, die offenen Anlagefonds gemäß Section 7 „Statement of Cash Flows" [Kapitalflussrechnung] von FRS 102 eingeräumt wird, Gebrauch gemacht und keine Kapitalflussrechnung erstellt. Dies basiert darauf, dass im Wesentlichen alle Anlagen der Gesellschaft hochgradig liquide sind und zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen werden und die Gesellschaft eine Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist, bereitstellt.

2. Effiziente Portfolioverwaltung

Vorbehaltlich der Bedingungen und innerhalb der Grenzen, die gelegentlich von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank") festgelegt werden, und sofern die Anlageziele und Anlagepolitik eines Fonds keine abweichende Regelung vorsehen, können die Anlagemanager und/oder Unteranlageverwalter Investmentmethoden und -instrumente wie Futures, Optionen, Devisenterminkontrakte und sonstige Derivate für die Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung verwenden. Außerdem werden eventuell neue Methoden und Instrumente entwickelt, die künftig für einen Fonds geeignet sein können, und ein Fonds kann diese Methoden und Instrumente einsetzen, wenn dies vorher genehmigt wurde und alle Beschränkungen der Zentralbank eingehalten werden.

Für OGAW, die Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung angewendet haben, sind gemäß den OGAW-Bestimmungen der Zentralbank Offenlegungen erforderlich. Ein OGAW ist verpflichtet, die Erträge aus Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung für den gesamten Berichtszeitraum zusammen mit den direkten und indirekten Betriebskosten und den angefallenen Gebühren auszuweisen. Siehe dazu die nachstehenden Tabellen.

Einzelheiten zu offenen derivativen Finanzinstrumenten am Ende des Berichtszeitraums werden in der Vermögensaufstellung der Fonds offengelegt. Alle realisierten Gewinne und Verluste, die aus der Verwendung derivativer Kontrakte für eine effiziente Portfolioverwaltung entstehen, sind in Nettogewinnen/(-verlusten) zu finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert durch Gewinn oder Verlust der Gesamtergebnisrechnung enthalten.

Im Laufe des Berichtszeitraums wurden Pensionsgeschäfte für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung abgeschlossen. Einzelheiten zu allen Wertpapierpensionsgeschäften am Ende des Berichtszeitraums sind in der Vermögensaufstellung aufgeführt.

Umgekehrte Rückkaufvereinbarungen

Ein Teil des Vermögens jedes Fonds kann in anderen liquiden Mitteln gehalten werden. Für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung kann jeder Fonds Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen.

Die nachstehende Tabelle enthält die im Berichtszeitraum zum 31. August 2020 mit umgekehrten Pensionsgeschäften erzielten Erträge:

Fondsname	31. August 2020 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	$ 124
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	$ 30
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	$–

Als „–" angegebenen Beträge belaufen sich auf 0 oder auf weniger als 1.000.

Es wurden keine Transaktionskosten für die Käufe und Verkäufe von umgekehrten Pensionsgeschäften erhoben.

Wertpapierleihgeschäfte

Bestimmte Fonds können für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung wie oben dargelegt auch Wertpapierleihgeschäfte abschließen. Im Rahmen solcher Transaktionen kann der Fonds seine Wertpapiere vorübergehend an einen Entleiher übertragen, wobei sich der Entleiher verpflichtet, zu einem vorab vereinbarten Zeitpunkt gleichwertige Wertpapiere an den Fonds zurückzugeben. Beim Abschluss solcher Transaktionen wird sich der Fonds bemühen, die Renditen auf sein Wertpapierportfolio zu erhöhen, indem er für die Bereitstellung seiner Wertpapiere für den Entleiher eine Gebühr erhebt. Keiner der Fonds hat im Berichtszeitraum zum 31. August 2020 Wertpapierleihgeschäfte getätigt.

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien

Gemäß dem Verwaltungsvertrag zwischen der Gesellschaft und der Legg Mason Investments (Ireland) Limited (der „Verwalter") steht dem Verwalter eine Verwaltungsgebühr aus dem Vermögen des jeweiligen Fonds für seine Anlageverwaltungs- und Vertriebsleistungen zu, die an jedem Handelstag aufläuft und jeden Monat rückwirkend gezahlt wird (die „Verwaltungsgebühren"). Die Gesellschaft ist ferner für die umgehende Zahlung bzw. Rückerstattung von Geldern an den Verwalter verantwortlich, die dieser als Provisionen, Übertragungsgebühren, Registrierungsgebühren, Steuern und ähnliche Verbindlichkeiten sowie Kosten und Spesen zu zahlen bzw. ausgelegt hat.

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	
Klasse A	0,800 %
Klasse B	1,050 %
Klasse C	1,300 %
Klasse E	1,400 %
Klasse X	0,600 %
Klasse Premier	0,300 %
Klasse LM	Keine
Klasse A (G)	0,800 %
Klasse L (G)	0,800 %
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	
Klasse A	0,950 %
Klasse B	1,200 %
Klasse C	1,450 %
Klasse E	1,550 %
Klasse F	0,550 %
Klasse R	0,550 %
Klasse X	0,475 %
Klasse Premier	0,300 %
Klasse S	0,200 %
Klasse LM	Keine
Klasse GA	0,820 %
Klasse GE	1,420 %

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	
Klasse A	1,150 %
Klasse B	1,400 %
Klasse C	1,650 %
Klasse E	1,750 %
Klasse F	0,550 %
Klasse R	0,750 %
Klasse X	0,575 %
Klasse Premier	0,300 %
Klasse LM	Keine
Klasse A (G)	1,150 %
Klasse B (G)	1,650 %
Klasse L (G)	1,650 %
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
Klasse A	1,000 %
Klasse B	1,250 %
Klasse C	1,500 %
Klasse E	1,600 %
Klasse F	0,550 %
Klasse R	0,600 %
Klasse X	0,500 %
Klasse Premier	0,300 %
Klasse S	0,200 %
Klasse LM	Keine
Klasse GA	0,820 %
Klasse GE	1,420 %

Erläuterungen zum Abschluss *(Fortsetzung)*

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Die maximale Verwaltungsgebühr für jede Anteilsklasse (als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des jeweiligen Fonds, der auf diese Klasse entfällt) ist zum 31. August 2020 wie folgt:

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	
Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,850 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,600 %
Klasse Premier	0,600 %
Klasse S	0,550 %
Klasse LM	Keine
Klasse A (G)	1,200 %
Klasse B (G)	1,700 %
Klasse L (G)	1,700 %
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	
Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,650 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,550 %
Klasse Premier	0,400 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	
Klasse A	1,150 %
Klasse B	1,400 %
Klasse C	1,650 %
Klasse E	1,750 %
Klasse F	0,700 %
Klasse R	0,750 %
Klasse X	0,575 %
Klasse Premier	0,450 %
Klasse LM	Keine
Klasse A (G)	1,150 %
Klasse L (G)	1,650 %
Klasse GF	0,950 %
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,750 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	0,800 %
Klasse R	1,100 %
Klasse X	0,750 %
Klasse Premier	0,550 %
Klasse S	0,450 %
Klasse LM	Keine
Klasse A (G)	1,250 %
Klasse B (G)	1,750 %
Klasse L (G)	1,750 %
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,750 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	0,800 %
Klasse R	1,100 %
Klasse X	0,750 %
Klasse Premier	0,550 %
Klasse S	0,450 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	
Klasse A	1,250 %
Klasse B	1,500 %
Klasse C	1,750 %
Klasse E	1,850 %
Klasse F	0,700 %
Klasse R	0,850 %
Klasse X	0,625 %
Klasse Premier	0,450 %
Klasse LM	Keine
Klasse A (G)	1,250 %
Klasse L (G)	1,750 %
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	
Klasse A	0,900 %
Klasse B	1,150 %
Klasse C	1,400 %
Klasse E	1,500 %
Klasse F	0,600 %
Klasse R	0,550 %
Klasse X	0,450 %
Klasse Premier	0,350 %
Klasse S	0,250 %
Klasse LM	Keine
Klasse A (G)	1,100 %
Klasse L (G)	1,600 %
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	
Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,850 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,600 %
Klasse Premier	0,600 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	
Klasse A	0,850 %
Klasse B	1,100 %
Klasse C	1,350 %
Klasse E	1,450 %
Klasse F	0,600 %
Klasse R	0,450 %
Klasse X	0,425 %
Klasse Premier	0,350 %
Klasse S	0,250 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	
Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,650 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,550 %
Klasse Premier	0,400 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	
Klasse A	1,050 %
Klasse B	1,300 %
Klasse C	1,550 %
Klasse E	1,650 %
Klasse F	0,600 %
Klasse R	0,650 %
Klasse X	0,525 %
Klasse Premier	0,350 %
Klasse S	0,250 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	
Klasse A	1,150 %
Klasse B	1,400 %
Klasse C	1,650 %
Klasse E	1,750 %
Klasse F	0,700 %
Klasse R	0,750 %
Klasse X	0,575 %
Klasse Premier	0,450 %
Klasse S	0,350 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,750 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,100 %
Klasse X	1,000 %
Klasse Y	1,000 %
Klasse Premier	1,000 %
Klasse S	0,600 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Western Asset MultiAsset Credit Fund^	
Klasse A	1,250 %
Klasse B	1,500 %
Klasse C	1,750 %
Klasse E	1,850 %
Klasse F	0,800 %
Klasse R	0,750 %
Klasse X	0,625 %
Klasse Premier	0,600 %
Klasse S	0,400 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^	
Klasse D	1,200 %
Klasse F	1,200 %
Klasse M	0,600 %
Klasse Premier	0,600 %
Klasse LM	Keine

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason Western Asset US MortgageBacked Securities Fund^	
Klasse A	1,000 %
Klasse B	1,250 %
Klasse C	1,500 %
Klasse E	1,600 %
Klasse F	0,550 %
Klasse R	0,600 %
Klasse X	0,500 %
Klasse Premier	0,300 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^	
Klasse A	0,800 %
Klasse R	0,500 %
Klasse X	0,400 %
Klasse Premier	0,300 %
Klasse S	0,200 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	
Klasse A	0,800 %
Klasse R	0,500 %
Klasse X	0,400 %
Klasse Premier	0,300 %
Klasse S	0,200 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	
Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,850 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,600 %
Klasse Premier	0,600 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	
Klasse A	1,350 %
Klasse B	1,600 %
Klasse C	1,850 %
Klasse E	1,950 %
Klasse F	1,100 %
Klasse J	0,900 %
Klasse R	0,950 %
Klasse X	0,900 %
Klasse Premier	0,900 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^	
Klasse A	1,100 %
Klasse F	0,750 %
Klasse X	0,550 %
Klasse Premier	0,550 %
Klasse S	0,450 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
Klasse A	1,150 %
Klasse B	1,400 %
Klasse C	1,650 %
Klasse E	1,750 %
Klasse F	0,900 %
Klasse R	0,750 %
Klasse X	0,650 %
Klasse Premier	0,650 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^	
Klasse A	1,600 %
Klasse B	1,850 %
Klasse C	2,100 %
Klasse E	2,350 %
Klasse F	1,350 %
Klasse R	0,900 %
Klasse X	0,800 %
Klasse BW Premier	0,350 %
Klasse Premier	0,800 %
Klasse BW LM	Keine
Klasse LM	Keine
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^	
Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,800 %
Klasse J	0,450 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,550 %
Klasse Premier	0,550 %
Klasse S	0,450 %
Klasse LM	Keine

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	
Klasse A	1,650 %
Klasse B	1,900 %
Klasse C	2,150 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,300 %
Klasse J	0,750 %
Klasse R	1,250 %
Klasse X	1,150 %
Klasse Premier	1,150 %
Klasse S	0,750 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	
Klasse A	1,050 %
Klasse B	1,300 %
Klasse C	1,550 %
Klasse E	1,650 %
Klasse F	0,700 %
Klasse X	0,525 %
Klasse Premier	0,525 %
Klasse S	0,400 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	
Klasse A	2,000 %
Klasse U	1,000 %
Klasse X	1,150 %
Klasse Premier	1,150 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	
Klasse A	1,200 %
Klasse E	1,950 %
Klasse F	0,950 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,600 %
Klasse Premier	0,600 %
Klasse S	0,500 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason ClearBridge Value Fund	
Klasse A	1,350 %
Klasse B	1,850 %
Klasse C	1,850 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	1,100 %
Klasse R	0,850 %
Klasse X	0,675 %
Klasse Premier	0,675 %
Klasse LM	Keine
Klasse Galleon	0,850 %
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	
Klasse A	1,250 %
Klasse B	1,750 %
Klasse C	1,750 %
Klasse E	2,000 %
Klasse F	1,000 %
Klasse R	0,750 %
Klasse X	0,625 %
Klasse Premier	0,625 %
Klasse LM	Keine
Klasse A (G)	1,250 %
Klasse B (G)	1,750 %
Klasse L (G)	1,750 %
Klasse GA	1,420 %
Klasse GE	2,170 %
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Klasse A	1,250 %
Klasse B	1,750 %
Klasse C	1,750 %
Klasse E	2,000 %
Klasse F	1,000 %
Klasse R	0,750 %
Klasse U	0,525 %
Klasse X	0,625 %
Klasse Premier	0,625 %
Klasse LM	Keine
Klasse A (G)	1,250 %
Klasse L (G)	1,750 %
Klasse GA	1,420 %
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
Klasse A	1,300 %
Klasse B	1,800 %
Klasse C	1,800 %
Klasse E	2,050 %
Klasse F	1,050 %
Klasse R	0,800 %
Klasse X	0,650 %
Klasse Premier	0,650 %
Klasse LM	Keine

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund – (Fortsetzung)	
Klasse A (G)	1,300 %
Klasse B (G)	1,800 %
Klasse L (G)	1,800 %
Klasse GA	1,420 %
Klasse GE	2,170 %
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	
Klasse A	1,250 %
Klasse B	1,750 %
Klasse C	1,750 %
Klasse E	2,000 %
Klasse F	1,000 %
Klasse R	0,800 %
Klasse X	0,625 %
Klasse Premier	0,625 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	
Klasse A	1,200 %
Klasse B	1,700 %
Klasse C	1,700 %
Klasse E	1,950 %
Klasse F	0,950 %
Klasse R	0,700 %
Klasse X	0,600 %
Klasse Premier	0,600 %
Klasse S	0,400 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^	
Klasse A	1,300 %
Klasse B	1,800 %
Klasse C	1,800 %
Klasse E	2,050 %
Klasse F	1,050 %
Klasse R	0,800 %
Klasse X	0,650 %
Klasse Premier	0,650 %
Klasse S	0,550 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,850 %
Klasse Premier	0,850 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^	
Klasse A	1,650 %
Klasse B	2,150 %
Klasse C	2,150 %
Klasse E	2,400 %
Klasse F	1,400 %
Klasse R	1,150 %
Klasse X	1,000 %
Klasse Premier	1,000 %
Klasse S	0,600 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,750 %
Klasse Premier	0,750 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,750 %
Klasse Premier	0,750 %
Klasse LM	Keine
Klasse A (G)	1,250 %
Klasse L (G)	1,750 %

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund	
Klasse A	1,350 %
Klasse B	1,850 %
Klasse C	1,850 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	1,100 %
Klasse R	0,850 %
Klasse X	0,675 %
Klasse Premier	0,675 %
Klasse S	0,500 %
Klasse LM	Keine
Klasse A (G)	1,350 %
Klasse B (G)	1,850 %
Klasse L (G)	1,850 %
Klasse GA	1,420 %
Klasse GE	2,170 %
Klasse GP	0,850 %
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
Klasse A	1,350 %
Klasse B	1,850 %
Klasse C	1,850 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	1,100 %
Klasse R	0,850 %
Klasse X	0,675 %
Klasse Premier	0,675 %
Klasse S	0,500 %
Klasse LM	Keine
Klasse GA	1,620 %
Klasse GE	2,370 %
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund	
Klasse A	1,000 %
Klasse B	1,500 %
Klasse C	1,500 %
Klasse E	1,750 %
Klasse F	0,750 %
Klasse R	0,650 %
Klasse X	0,500 %
Klasse Premier	0,500 %
Klasse S	0,400 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund	
Klasse A	1,350 %
Klasse B	1,850 %
Klasse C	1,850 %
Klasse E	2,100 %
Klasse F	1,100 %
Klasse R	0,850 %
Klasse X	0,675 %
Klasse Premier	0,675 %
Klasse S	0,500 %
Klasse LM	Keine
Klasse GA	1,420 %
Klasse GE	2,170 %
Legg Mason Martin Currie Asia LongTerm Unconstrained Fund^	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %
Klasse M	1,000 %
Klasse R	1,000 %
Klasse Premier	0,750 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	
Klasse A (PF)	2,000 %
Klasse E (PF)	2,750 %
Klasse F (PF)	1,750 %
Klasse J (PF)	1,000 %
Klasse M (PF)	1,500 %
Klasse R (PF)	1,500 %
Klasse Premier (PF)	1,500 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Martin Currie Global LongTerm Unconstrained Fund^	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,750 %
Klasse Premier	0,750 %
Klasse S	0,650 %
Klasse LM	Keine

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %
Klasse D	1,100 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,750 %
Klasse Premier	0,750 %
Klasse S	0,440 %
Klasse LM	Keine
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %
Klasse J	0,650 %
Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,750 %
Klasse Premier	0,750 %
Klasse S	0,650 %
Klasse LM	Keine

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^	
Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,750 %
Klasse Premier	0,750 %
Klasse S	0,650 %
Klasse LM	Keine

Die in den obenstehenden Tabellen angegebenen Verwaltungsgebühren für die einzelnen Fonds gelten für alle in der jeweiligen Spalte aufgeführten Anteilsklassen, die der Fonds anbietet. Es werden nicht alle Anteilsklassen von jedem Fonds angeboten und zum 31. August 2020 waren nicht alle Anteilsklassen in Umlauf. Welche Anteilsklassen die einzelnen Fonds anbieten, ist im Verkaufsprospekt angegeben, der von Zeit zu Zeit geändert oder ersetzt werden kann.

Gemäß jedem Anlageverwaltungsvertrag ist der Verwalter für die Zahlung der Gebühren und Auslagen des betreffenden Anlageverwalters verantwortlich.

Der Verwalter hat sich freiwillig bereit erklärt, teilweise auf seine Gebühren zu verzichten und/oder bestimmte Kosten zu erstatten, sodass die Gesamtkosten gewisse freiwillige Kostengrenzen, die für die Fonds festgelegt wurden, nicht überschreiten. Dem Verwalter steht es frei, den freiwilligen Verzicht und/oder die Kostenerstattungen in eigenem Ermessen jederzeit zu überprüfen oder zu beenden.

Für den Zeitraum zum 31. August 2020 wurden folgende Verwaltungsgebühren verzichtet oder erstattet und sonstige Ausgaben wiederhergestellt:

	31. August 2020 in (in Tsd.)	
Fondsname	Verwaltungsgebühr, die verzichtet wird	Verwaltungsgebühr, die erstattet wird, und sonstige Ausgaben, die wiederhergestellt werden
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	$1.403	$28
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	$3	$–
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	$3	$–
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	$25	$–
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^	$19	$–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^	$1	$–
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	$8	$5
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	$20	$2
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	$4	$16
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	$7	$–
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^	$10	$–
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^	€1	€–
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^	$11	$5
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund	€2	€–
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	$–	$2
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund	$23	$–
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund	$3	$–
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	$1	$–
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	€3	€–
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	$2	$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	$3	$11
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	$9	$–
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^	€8	€–

Jedem Anlageverwaltungsvertrag zufolge hat jeder Anlageverwalter Anspruch auf eine Anlageverwaltungsgebühr und jeder Anlageverwalter ist dafür verantwortlich, die Gebühren und Spesen von Unteranlageverwaltern aus seiner eigenen Anlageverwaltungsgebühr (die die „Performancegebühr" umfassen kann) zu zahlen.

Gemäß den Bestimmungen des Hauptvertriebsstellenvertrags zwischen der Gesellschaft und Legg Mason Investor Services, LLC („LMIS") ist LMIS ermächtigt, Anteile der Gesellschaft zu vermarkten, zu bewerben, anzubieten und deren Verkauf und Rücknahme zu arrangieren (zusammen als „Vertriebsleistungen" bezeichnet). Zudem ist LMIS berechtigt, auf ihre eigenen Kosten und Aufwendungen einen oder mehrere Vertriebshändler zu beauftragen, die sie bei der Erfüllung ihrer Pflichten aus dem Vertrag unterstützen sollen, sofern die Ernennungen solcher Firmen gemäß den Anforderungen der Regeln der Zentralbank erfolgen. Gemäß den Bestimmungen des Rahmenanlageverwaltungsvertrags zwischen dem Anlageverwalter, der Gesellschaft und LMIS haftet LMIS in solchen Fällen gegenüber dem Verwalter für die Erfüllung seiner Aufgaben gemäß dem betreffenden Vertrag. Dementsprechend hat LMIS LMI Europe als zusätzlichen Vertriebshändler der Fonds ernannt. Ähnlich ist LMI Europe gemäß den Bedingungen des Vertriebsvertrags mit LMIS berechtigt, auf ihre eigenen Kosten und Aufwendungen einen oder mehrere Vertriebshändler zu beauftragen, die sie bei der Erfüllung ihrer Pflichten aus dem Vertrag unterstützen sollen, sofern die Ernennungen solcher Firmen gemäß den Anforderungen der Regeln der Zentralbank erfolgen. Gemäß den Bedingungen der Vertriebsvereinbarung zwischen LMIS und LMI Europe haftet LMI Europe in solchen Fällen gegenüber LMIS für die Erfüllung seiner Verpflichtungen gemäß dieser Vereinbarung. Legg Mason Investments (Europe) Limited hat gemäß dem Vertriebsvertrag mit LMIS und im Einklang mit den Anforderungen der Zentralbank Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited und Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited and Legg Mason Investments (Taiwan) Limited als zusätzliche Vertriebshändler der Fonds bestellt.

Die Gesellschaft ist ferner für die umgehende Zahlung bzw. Rückerstattung von Geldern an den Verwalter verantwortlich, die dieser als Provisionen, Übertragungsgebühren, Registrierungsgebühren, Steuern und ähnliche Verbindlichkeiten sowie Kosten und Spesen zu zahlen bzw. ausgelegt hat.

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Informationsstellengebühr

Gemäß dem Verwaltungsvertrag zwischen der Gesellschaft und dem Verwalter steht dem Verwalter eine Informationsstellengebühr aus dem Vermögen des jeweiligen Fonds für seine Dienstleistungen zu, die an jedem Handelstag aufläuft und jeden Monat rückwirkend gezahlt wird (die „Informationsstellengebühr"). Die Informationsstellengebühren laufen an jedem Handelstag auf und werden rückwirkend monatlich gezahlt. Im Rahmen des Master-Informationsstellenvertrags zwischen dem Verwalter, der Gesellschaft und LMIS hat LMIS für seine Dienste als Informationsstelle Anspruch auf den Erhalt einer vom Verwalter aus bestimmten Anteilsklassen zu zahlenden Informationsstellengebühr.

Der Verwalter und die Gesellschaft haben LMIS zur Hauptinformationsstelle der Gesellschaft bestellt. Gemäß den Bestimmungen des Hauptinformationsstellenvertrags ist LMIS berechtigt, auf ihre eigenen Kosten und Aufwendungen eine oder mehrere Parteien zu bestellen, die sie bei der Erfüllung ihrer Pflichten aus dem Vertrag unterstützen sollen, wobei LMIS der Gesellschaft gegenüber weiterhin für die Erfüllung ihrer Verpflichtungen aus diesem Vertrag haftet. In diesem Rahmen hat LMIS die Legg Mason Investments (Europe) Limited („LMI Europe") als zusätzliche Informationsstelle bestellt. In gleicher Weise ist LMI Europe gemäß den Bestimmungen des Informationsstellenvertrags mit LMIS berechtigt, auf ihre eigenen Kosten und Aufwendungen eine oder mehrere Parteien zu bestellen, die sie bei der Erfüllung ihrer Pflichten aus dem Vertrag unterstützen sollen, wobei LMI Europe dem Verwalter und LMIS gegenüber weiterhin für die Erfüllung ihrer Verpflichtungen aus diesem Vertrag haftet. Gemäß diesem Vertrag hat LMI Europe Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited, Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited und Legg Mason Investments (Taiwan) Limited als Informationsstelle der Gesellschaft ernannt.

Der Gesamtbetrag der von jeder Aktienklasse gezahlten Informationsstellengebühren entspricht oder hat folgendem entsprochen:

(i) 0,15 Prozent p.a. des Nettoinventarwerts des Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund, Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund, Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund, Legg Mason Western Asset US High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Cor-porate Bond Fund, Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund, Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund, Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^, Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^, Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^, Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^, Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^, Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^, Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^, Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^, Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund, Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^, Legg Mason Brandywine Global Income Op-timiser Fund^, Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^, Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ und Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^; und

(ii) 0,35 Prozent p.a. des Nettoinventarwerts des Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^, Legg Mason ClearBridge Value Fund, Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund, Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund, Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund, Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, Legg Mason ClearBridge US Equity Sus-tainability Leaders Fund^, Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^, Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund, Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund, Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund, Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund, Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^, Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund^, Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^, Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund, Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^, Legg Mason Mar-tin Currie European Unconstrained Fund^, Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ und Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^.

Die Informationsstellengebühren müssen für alle Anteilsklassen bezahlt werden, außer für die Anteilsklassen F, J, U, Y, Premier, LM, Grandfathered und Galleon (jeweils gemäß Definition im Verkaufsprospekt) sowie alle Anteilsklassen des Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund.

In Berichtszeitraum zum 31. August 2020 wurde auf folgende Informationsstellengebühren verzichtet:

Fondsname	Entfallene Informationsstellengebühr Stand 31. August 2020 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	$9
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	$8
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	$2
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	$1
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^	$4
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	$1
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	$8
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	$16
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^	$1
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^	€1
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^	$2
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	$1
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	$3
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund	€6
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	$8
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund	$1
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund	$8
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	$114
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	€60
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	$5
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	$1
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^	€2

Verbundene Parteien

Jane Trust, Joseph Carrier, Jaspal Sagger und Victoria Rock (bis zu ihrem Ausscheiden am 30. September 2020) waren bzw. sind Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft und waren bzw. sind auch Verwaltungsratsmitglieder und/oder Führungskräfte bestimmter verbundener Unternehmen des Verwalters, des Anlageverwalters, der Vertriebs- und Informationsstellen. Abgesehen von den oben genannten Ausnahmen hat keiner der Verwaltungsratsmitglieder eine direkte oder indirekte Beteiligung an einem Vertrag oder einer Vereinbarung, der/die zum Zeitpunkt dieses Dokuments besteht und der/die in Bezug auf das Geschäft der Gesellschaft von Bedeutung ist.

Zum 31. August 2020 hielten die in der nachfolgenden Tabelle aufgelisteten Fonds Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen, die denselben Verwalter, Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter wie der Fonds oder eine verbundene Partei dieses Anlageverwalters oder Unteranlageverwalters bestellt haben.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Die nachstehende Tabelle enthält die prozentualen Beteiligungen der solchen vom Unternehmen gehaltenen Organismen für gemeinsame Anlagen:

			31. August 2020
Fondsname	**Zugrunde liegender Organismus für gemeinsame Anlagen**	**%**	**Wert (in Tsd.)**
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,77%	$17.331
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Legg Mason China Funds Western Asset China Bond – Klasse M	12,73%	$25.601
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,16%	€3.127
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Legg Mason China Funds Western Asset China Bond – Klasse M	6,45%	$12.982
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Legg Mason Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD thesaurierend	24,50%	$7.872
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc Western Asset European Loan Fund – Klasse LM USD, thesaurierend	11,02%	$6.867
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,13%	$2.975
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc Western Asset European Loan Fund – Klasse LM USD, thesaurierend	1,71%	$1.067
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,07%	$1.693
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Legg Mason Western Asset Asian Bond Trust – Klasse A (SGD), thesaurierend	24,99%	$5.198
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,49%	$11.023
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,75%	$16.999
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Legg Mason China Funds Western Asset China Bond – Klasse M	8,74%	$17.579
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,01%	$284
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,02%	€336
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Legg Mason China Funds Western Asset China Bond – Klasse M	13,62%	$27.396
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc Western Asset European Loan Fund – Klasse LM USD, thesaurierend	23,45%	$14.608
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	3,31%	$74.912
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc Western Asset European Loan Fund – Klasse LM USD, thesaurierend	16,17%	$10.076
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	2,29%	$51.853
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	3,09%	$69.893
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,10%	$2.187
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,57%	$12.833
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,03%	$616

Die Kapitalanlagen werden in den Finanzabschlüssen in Anmerkung 13 über die Fondsgeschäfte hinweg ausgewiesen.

Transaktionen mit verbundenen Personen

Gemäß Verordnung 43(1) der OGAW-Verordnungen der Zentralbank muss eine „verantwortliche Person sicherstellen, dass jede Transaktion zwischen einem OGAW und einer verbundenen Person (a) zu marktüblichen Bedingungen und (b) im besten Interesse der Anteilinhaber des OGAW ausgeführt wird". Gemäß den Anforderungen von Verordnung 81(4) der OGAW-Verordnungen der Zentralbank hat sich der Verwaltungsrat davon überzeugt, dass (a) durch schriftliche Verfahren belegte Vorkehrungen getroffen wurden, um sicherzustellen, dass die durch Verordnung 43(1) vorgeschriebenen Verpflichtungen auf alle Geschäfte mit verbundenen Personen angewendet werden und (b) alle Geschäfte mit verbundenen Personen, die während des Berichtszeitraums abgeschlossen wurden, den durch die Verordnung 43(1) vorgeschriebenen Verpflichtungen entsprachen.

Performancegebühr

Zusätzlich zu den oben beschriebenen Anlageverwaltungsgebühren kann der Anlageverwalter berechtigt sein, in Abhängigkeit von der Wertentwicklung der Anteile der Anteilsklasse PF eine erfolgsabhängige Gebühr („Performancegebühr") zu erheben (Performancegebührenklassen enthalten ein „(PF)" im Namen der Anteilsklasse).

Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^

Beim Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ wird die Performancegebühr für jede Anteilsklasse PF in der Regel (oder wurde in der Regel, wie zutreffend) in Bezug auf jeden zwölfmonatigen Zeitraum, der am letzten Handelstag jedes Geschäftsjahres endet, berechnet („Berechnungszeitraum") . Für jede Anteilsklasse PF ist der erste Berechnungszeitraum der Zeitraum, der an dem Geschäftstag beginnt, der unmittelbar auf den Börsentag folgt, an dem der Nettoinventarwert für die Anteilsklasse erstmals berechnet wird (der „erste Handelstag"), und der am letzten Handelstag des Geschäftsjahrs endet, in dem der erste Handelstag eintritt (der „erste Berechnungszeitraum").

Für jeden Berechnungszeitraum hat der Anlageverwalter für jeden Anteil der Anteilsklasse PF ggf. Anspruch auf eine Performancegebühr in Höhe von 20 Prozent des Betrags, um den die Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil während dieses Zeitraums die High Water Mark (wie nachfolgend definiert) zum Ende des vorausgehenden Berechnungszeitraums übersteigt. Bei ausschüttenden Anteilsklassen werden alle während des jeweiligen Zeitraums ausgezahlten Ausschüttungen zwecks Ermittlung der Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil während eines Berechnungszeitraums dem Nettoinventarwert zugerechnet. Für alle Anteilsklassen PF gilt, dass die für einen Berechnungszeitraum fällige Performancegebühr nicht von Verlusten berührt wird, die die Fonds oder die Anteilsklasse PF in späteren Berechnungszeiträumen erleiden. Die Performancegebühr fällt an jedem Handelstag an und wird normalerweise innerhalb von 21 Tagen nach dem Ende des jeweiligen Berechnungszeitraums nach Prüfung durch die Depotbank gezahlt. Wenn der Anlageverwaltungsvertrag vor dem letzten Handelstag eines Geschäftsjahres endet, wird bei der Berechnung und Zahlung der Performancegebühr für jede Anteilsklasse PF in Bezug auf den laufenden Berechnungszeitraum davon ausgegangen, dass das Datum des Vertragsendes das Ende des Berechnungszeitraums ist. Sofern ein Anteilsinhaber seine Anteile der Anteilsklasse PF vor dem Ende eines Berechnungszeitraums einlöst, wird die aufgelaufene und diesen Anteilen zurechenbare Performancegebühr herauskristallisiert und dem Anlageverwalter gezahlt.

Die High Water Mark in Bezug auf jede PF-Anteilsklasse von Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ meint den höchsten folgender Werte: (i) Erstausgabepreis je Anteil; (ii) höchster Nettoinventarwert je Anteil unmittelbar nach dem Ende eines vorausgehenden Berechnungszeitraums; und (iii) wenn die Anteilsklasse PF über eine Einbringung einer Anteilsklasse in einen anderen vom Unteranlageverwalter verwalteten Fonds erfolgt, die High-Water-Mark für diese Anteilsklasse am Datum der Einbringung entsprechend der Berechnung des relevanten Angebotsdokuments für diesen anderen Fonds.

Der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ führt keine Ausgleichskonten für Anteilsinhaber in Bezug auf die aufgelaufenen Performancegebühren.

Im Berichtszeitraum zum 31. August 2020 wurden keine Performance-Gebühren erhoben.

Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren

Die Bank of New York Mellon SA/NV, die Niederlassung von Dublin, fungiert nach der Fusion als Depotstelle (die „Depotbank") und das Unternehmen BNY Mellon Fund Services (Irland) Designated Activity Company agiert als Administrator (der „Administrator") für alle Fonds im Unternehmen. Sie erhalten für Verwaltungs-, Rechnungslegungs-, Informationsstellen-, Treuhänder- und Verwahrstellendienste von den Fonds insgesamt eine Gebühr von bis zu 0,15 % des Nettoinventarwerts jedes Fonds.

Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrats

Die sich auf den Berichtszeitraum zum 31. August 2020 beziehenden erfolgswirksam in der Gesamtergebnisrechnung erfassten Honorare und Auslagen der Mitglieder des Verwaltungsrats beliefen sich auf 46.000 USD.

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Andere Transaktionen mit verbundenen Parteien

Die nachstehende Tabelle enthält die prozentualen Beteiligungen der wesentlichen Anteilsinhaber, die mehr als 20 % des umlaufenden Anteilskapitals des Fonds halten:

Fondsname	% Beteiligung 31. August 2020
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	82,18
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	96,24
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	21,91
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	28,01
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	25,56
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	24,60
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	22,65
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	70,35
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	88,32
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	62,69
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	51,89
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	96,58
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	26,33
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	24,84
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	21,58
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	60,72
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^	37,12
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	99,42
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^	100,00
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	79,14
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	59,88
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	38,08
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^	94,01
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	34,75
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	20,67
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^	72,74
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	24,49
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	20,46
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	20,28
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	99,88
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	94,67
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	100,00
Legg Mason ClearBridge Value Fund	31,43
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	29,56
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	57,39
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	25,85
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^	72,77
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^	98,15
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	43,40
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund	40,01
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	27,16
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund	86,65
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund	42,45
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	92,73
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	22,89
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	23,23
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	22,07
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	65,35
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	23,42
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	70,04
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^	51,22
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^	42,94

4. Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen

Ausschüttende Anteilsklassen

Der hinter dem Namen jeder ausschüttenden Anteilsklasse in Klammern angegebene Buchstabe gibt an, in welchen Abständen die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführten Dividenden erklärt und gezahlt werden.

Bezeichnung der ausschüttenden Anteilsklasse	Häufigkeit der Dividendenerklärungen	Häufigkeit der Dividendenzahlungen
(D)	Täglich	Monatlich
(M)	Monatlich	Monatlich
(Q)	Vierteljährlich	Vierteljährlich (März, Juni, September, Dezember)
(S)	Halbjährlich	Halbjährlich (März, September)
(A)	Jährlich	Jährlich (März)

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes festverzinslichen Fonds (festverzinslich gemäß Definition auf Seite 15) zum Zeitpunkt jeder Dividendenerklärung gilt: (1) Etwaige Nettoerträge werden ganz oder teilweise als Dividende erklärt; und (2) realisierte und nicht realisierte Kapitalgewinne können abzüglich der realisierten und nicht realisierten Kapitalverluste ganz oder teilweise als Dividende festgesetzt werden, wobei dies nicht zwingend ist.

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Aktienfonds (wie auf Seite 15 definiert) wird zum Zeitpunkt der Dividendenerklärung der gesamte oder ein Teil eines etwaigen Nettoanlageertrags als Dividende erklärt. Sofern der Anteilsinhaber nichts anderes verlangt, erfolgen die Ausschüttungen an jeden Anteilsinhaber der einzelnen ausschüttenden Anteilsklassen in der Währung, in der der Anteilsinhaber die Anteile gezeichnet hat.

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Mischfonds (wie auf Seite 15 definiert) wird zum Zeitpunkt der Dividendenerklärung der gesamte oder ein Teil eines etwaigen Nettoanlageertrags als Dividende erklärt. Sofern der Anteilsinhaber nichts anderes verlangt, erfolgen die Ausschüttungen an jeden Anteilsinhaber der einzelnen ausschüttenden Anteilsklassen in der Währung, in der der Anteilsinhaber die Anteile gezeichnet hat.

Die ausschüttenden Plus-Anteilsklassen können Ausschüttungen aus dem Kapital erklären und zahlen. Anleger in diesen Anteilsklassen sollten wissen, dass Dividendenzahlungen aus Kapitalbeträgen an eine Rendite oder Rücknahme des ursprünglichen Investitionsvermögens oder der Kapitalgewinne eines Investors zurückzuführen sind, das dieser ursprünglichen Investition zuzuschreiben ist, und dass solche Ausschüttungen zu einer entsprechenden unmittelbaren Verringerung des Nettoinventarwerts pro Anteil der Anteilsklasse führen. Die Zahlung von Ausschüttungen aus dem Kapital führt entsprechend zu Kapitalerosion und kann durch Verzicht auf das Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erzielt werden.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

4. Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen – (Fortsetzung)

Während des Zeitraums haben die folgenden Fonds die Kapitalausschüttung bei ausschüttenden Plus-Anteilsklassen ausgezahlt:

	Ausschüttungen aus dem Kapital für den Zeitraum zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – Class A US$ Distributing (M) Plus	$95
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	$67
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Class A US$ Distributing (M) Plus	$2
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	$–
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Class A HKD Distributing (M) Plus	$3
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Class A US$ Distributing (M) Plus	$17
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	$1
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Class A HKD Distributing (M) Plus	$1
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	$11
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Class A ZAR Distributing (M) (Hedged) Plus	$58
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – Class A US$ Distributing (M) Plus	$28
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	$2
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – Class A US$ Distributing (M) Plus	$–
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	$–
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Class A US$ Distributing (M) Plus	$37
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	$104
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	$37
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Class A US$ Distributing (M) Plus	$571
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	$306
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Class A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	$193
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Class A HKD Distributing (M) Plus	$176
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	$26
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Class A SGD Distributing (M) Plus	$15
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Class A HKD Distributing (M) Plus	$11
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ – Class D US$ Distributing (M) Plus	$48
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ – Class D AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	$–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	$9
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – Class A HKD Distributing (M) Plus	$–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – Class A US$ Distributing (M) Plus	$2
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	$14
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Class A US$ Distributing (M) Plus	$42
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	$19
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Class A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	$2
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Class A HKD Distributing (M) Plus	$12
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	$4
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Class A US$ Distributing (M) (Hedged) Plus	€633
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	€5
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Class A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	€53
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Class A Euro Distributing (M) Plus	€18
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	€12
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund – Class A US$ Distributing (M) (Hedged) Plus	€36
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund – Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	€13
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund – Class A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	€2
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund – Class A Euro Distributing (M) Plus	€–
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund – Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	€2
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Class A US$ Distributing (M) Plus	$27
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	$12
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Class A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	$1
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Class A HKD Distributing (M) Plus	$10
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	$–
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund – Class A US$ Distributing (M) Plus	$6
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund – Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	$4
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund – Class A HKD Distributing (M) Plus	$6
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund – Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Class A US$ Distributing (M) Plus	$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Class A AUD Distributing (M) Plus	$3
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Class A AUD Distributing (M) Plus (Hedged)	$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Class A HKD Distributing (M) Plus	$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Class A SGD Distributing (M) Plus	$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Class D AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	$1
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Class D CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Class D HKD Distributing (M) Plus	$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Class D SGD Distributing (M) (Hedged)Plus	$1
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Class D US$ Distributing (M) Plus	$1

Als „–" angegebenen Beträge belaufen sich auf 0 oder auf weniger als 1.000.

Die von bestimmten Fonds angebotenen ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen können bestimmte Gebühren und Aufwendungen auf das Kapital statt den Ertrag berechnen. Das Berechnen aller oder eines Teils der Gebühren und Aufwendungen auf das Kapital führt zu einem höheren Ertrag zur Ausschüttung. Das Kapital, das diesen ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen für Investitionen in der Zukunft zur Verfügung steht, und Kapitalwachstum kann reduziert werden. Die Anteilsinhaber sollten beachten, dass ein erhöhtes Risiko besteht, dass sie bei der Rücknahme von Anteilen der ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen nicht den vollen investierten Betrag zurückerhalten. Für Investoren in den ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen kann dies ungeachtet der Wertentwicklung des jeweiligen Fonds zur Erosion der Kapitalinvestitionen der Anleger oder Kapitalgewinne, die dieser ursprünglichen Investition zugeordnet sind, führen, wodurch der Wert zukünftiger Renditen möglicherweise verringert wird. Die erhöhte Dividendenauszahlung infolge der Berechnung von Gebühren und Aufwendungen auf das Kapital führt zu einer Rendite oder einer Rücknahme der ursprünglichen Kapitalinvestitionen eines Investors oder der Kapitalgewinne, die dieser ursprünglichen Investition zuzuschreiben sind. Die höhere Dividendenausschüttung unter diesem Ladesystem führt zu einer entsprechenden unmittelbaren Verringerung des Nettoinventarwerts der Anteilsklassen am Ex-Dividendendatum. Die Anteilsinhaber sollten beachten, dass in dem Ausmaß, in dem die Aufwendungen dem Kapital berechnet werden, einige oder alle der Ausschüttungen, die von den ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen vorgenommen werden, als Form der Kapitalerstattung betrachtet werden sollten. Sämtliche Aufwendungen der ausschüttenden Anteilsklassen Plus (e) wurden vermögenswirksam erfasst.

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

4. Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen – (Fortsetzung)

Im Geschäftsjahr haben die folgenden Fonds bei ausschüttenden Anteilsklassen Plus (e) Gebühren und Aufwendungen vom Kapital abgezogen:

	Gebühren und Aufwendungen, die dem Kapital für den Zeitraum zum 31. August 2020 (in Tsd.) belastet wurden
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Class A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$2
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Premier Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$1
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Premier Class US$ Distributing (M) Plus (e)	$1
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Class US$ Distributing (M) Plus (e)	$24
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Class AUD Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$–
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Class Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$5
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$377
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Class A US$ Distributing (M) Plus (e)	$2.249
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$361
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Class A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$31
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Class A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$154
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Class A GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$197
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Class A HKD Distributing (M) Plus (e)	$–
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Class A JPY Distributing (M) Plus (e)	$1
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$534
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Class A SGD Distributing (M) Plus (e)	$–
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Class X US$ Distributing (M) Plus (e)	$216
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Class X GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$46
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Premier Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$1.484
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ – Class A US$ Distributing (M) Plus (e)	$–
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ – Premier Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$3
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^ – Class A US$ Distributing (M) Plus (e)	$–
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^ – Class X GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$–
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^ – S Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$–
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ – Premier Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$24
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ – Class A US$ Distributing (M) Plus (e)	$–
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^ – Class A US$ Distributing (M) Plus (e)	$–
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^ – Premier Class US$ Distributing (M) Plus (e)	$–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Class A US$ Distributing (M) Plus (e)	$33
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Class A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$69
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Class A GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$4
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Class X US$ Distributing (M) Plus (e)	$9
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Class X Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$12
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Class X GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$4
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Premier Class US$ Distributing (M) Plus (e)	$3
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Premier Class Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$3
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – Premier Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – S Class Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$9
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ – S Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$3
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ – Class A US$ Distributing (M) Plus (e)	$–
Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund^ – Class A US$ Distributing (M) Plus (e)	$–
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ – Class X GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$–
Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund^ – Class A US$ Distributing (M) Plus (e)	$–
Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund^ – Class A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$–
Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund^ – Premier Class US$ Distributing (M) Plus (e)	$–
Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund^ – Premier Class Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$–
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Class A US$ Distributing (M) Plus (e)	$1
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Class A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$2
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Class X US$ Distributing (M) Plus (e)	$–
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Class X Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	$–
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Premier Class US$ Distributing (M) Plus (e)	$–
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Premier Class CAD Distributing (Q) Plus (e)	€19
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Premier Class CAD Distributing (Q) (Hedged) (PH) Plus (e)	€79
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Premier Class GBP Distributing (A) (Hedged) (PH) Plus (e)	€–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Class A US$ Distributing (M) Plus (e)	$4
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Class A Euro Distributing (M) Plus (e)	$4
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – S Class GBP Distributing (M) Plus (e)	$1

Als „–“ angegebenen Beträge belaufen sich auf 0 oder auf weniger als 1.000.

Thesaurierende Anteilsklassen

In Bezug auf thesaurierende Anteilsklassen ist vorgesehen, dass im normalen Geschäftsverlauf keine Ausschüttungen beschlossen werden und dass die den thesaurierenden Anteilsklassen zuzurechnenden Nettoanlageerträge täglich im Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Anteilsklasse kumuliert werden.

5. Grundkapital und rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile

Grundkapital

Die Gesellschaft wurde mit einem anfänglichen Grundkapital in Höhe von 39.000 EUR (in Form von 39.000 Zeichneranteilen ohne Nennwert) gegründet. Bis auf drei hat die Gesellschaft alle Zeichneranteile zurückgekauft. Die Inhaber dieser drei Zeichneranteile sind berechtigt, an allen Versammlungen der Gesellschaft teilzunehmen und dort abzustimmen, sie sind jedoch nicht berechtigt, an den Dividenden bzw. dem Nettovermögen eines Fonds oder der Gesellschaft zu partizipieren.

Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile

Das Grundkapital der Gesellschaft entspricht zu jeder Zeit dem Nettoinventarwert. Die Mitglieder des Verwaltungsrats sind ermächtigt, bis zu 500 Milliarden Anteile der Gesellschaft ohne Nennwert zum Nettoinventarwert je Anteil und zu den ihnen angemessen erscheinenden Bedingungen auszugeben. Bei der Emission von Anteilen an der Gesellschaft besteht kein Vorkaufsrecht.

Jeder Anteil berechtigt den Anteilsinhaber dazu, gleichberechtigt auf anteilsmäßiger Basis an den Dividenden und gegebenenfalls dem Reinvermögen des Fonds zu partizipieren, für den die Anteile ausgegeben wurden, mit Ausnahme von Dividenden, die beschlossen wurden, bevor dieser Anteilsinhaber seine Anteile kaufte.

Der Erlös aus der Ausgabe von Anteilen wird in den Büchern der Gesellschaft dem betreffenden Fonds zugeschrieben und im Namen des Fonds zum Erwerb von Vermögenswerten verwendet, in die der Fonds investieren kann. Die Unterlagen und Bücher der einzelnen Fonds werden getrennt geführt.

Jeder Fonds bietet unterschiedliche Anteilsklassen an. Diese sind im Verkaufsprospekt der Gesellschaft angegeben. Die verschiedenen Anteilsklassen unterscheiden sich hauptsächlich durch ihre Ausgabeaufschläge, Kosten, Gebührensätze, Ausschüttungspolitik und Währungsbezeichnung. Anleger können je nach Anlagebetrag und Anlagehorizont somit wählen, welche Anteilsklasse für ihre Anlagebedürfnisse am besten geeignet ist. Dabei ist die Höhe der Investition und der erwartete Beteiligungszeitraum in Betracht zu ziehen.

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

5. Grundkapital und rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile – (Fortsetzung)

Anteilsklassen werden in ausschüttend und thesaurierend unterschieden. Thesaurierende Anteilsklassen schütten keinen Nettoertrag und keine realisierten oder nicht realisierten Nettokapitalgewinne aus. Ausschüttende Anteilsklassen schütten indes, wie in Erläuterung 4 zu den Ausschüttungen oben erklärt, in bestimmten zeitlichen Abständen einen Ertrag aus. Diese Abstände sind unterschiedlich und hängen davon ab, welcher Buchstabe in Klammern hinter der ausschüttenden Anteilsklasse angegeben ist. Darüber hinaus befinden sich Zeichneranteile der Gesellschaft in Umlauf. Die Zeichneranteile vermitteln deren Inhaber jedoch keinen Anspruch auf eine Beteiligung am Vermögen eines Fonds.

Jeder Fonds kann Anteilsklassen anbieten, die auf andere Währungen als die Basiswährung des Fonds lauten. Sofern der Name der Anteilsklasse nicht das Wort „(abgesichert)" enthält, wendet der Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter bei keiner solchen Anteilsklasse Methoden an, um das Risiko der Anteilsklasse in Bezug auf Änderungen der Wechselkurse zwischen der Basiswährung des Fonds und der Währung der Anteilsklasse abzusichern.

Anteile der Klasse A sind allen Anlegern zugänglich. Provisionen/Rabattzahlungen können von Verwaltern an Händler oder andere Anleger, die eine Vereinbarung mit einem Vertriebshändler haben, in Bezug auf solche Aktien erfolgen. Anteile der Klasse B, C, D und E sind für alle Anleger verfügbar, die Kunden von Händlern sind, die von einem Vertriebshändler in Bezug auf diese Aktien beauftragt werden. Provisionszahlungen können von Vertriebshändler an Händler oder andere Anleger, die eine Vereinbarung mit einem Vertriebshändler haben, in Bezug auf solche Aktien erfolgen. Anteile der Klasse F stehen professionellen Anlegern und Anlegern mit einer diskretionellen Anlagevereinbarung mit einem Händler zur Verfügung, der vom Vertriebshändler im Hinblick auf diese Aktien beauftragt wurde. Provisionen/Rabattzahlungen können von Verwaltern an Händler oder andere Anleger, die eine Vereinbarung mit dem Vertriebshändler haben, in Bezug auf solche Aktien erfolgen. Anteile der Klasse J sind für den japanische Vertrieb nach Ermessen der Direktoren oder Vertriebshändler bestimmt. Anteile der Klasse M sind für professionelle Anleger und Anleger mit einer diskretionären Anlagevereinbarung mit einem Händler oder einer anderen von einem Vertriebshändler im Hinblick auf diese Aktien beauftragten Stelle verfügbar. Anteile der Klasse R sind für alle Anleger verfügbar, die eine gebührenbasierte Vereinbarung mit einem Vermittler haben, von dem sie eine persönliche Empfehlung in Bezug auf ihre Anlage in die Fonds erhalten haben. Anteile der Klasse X sind für Händler, Portfoliomanager oder Plattformen verfügbar, denen es gemäß den behördlichen Bestimmungen oder auf Grundlage von Gebührenverträgen mit ihren Kunden, nicht gestattet ist, die Vertriebsprovisionen von Unternehmen anzunehmen und einzubehalten sowie für institutionelle Anleger (für Anleger in der Europäischen Union bezieht sich das auf „geeignete Gegenparteien", wie unter MIFID II definiert), die auf eigene Rechnung investieren. Anteile der Klassen U, Y und S sind im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für institutionelle Anleger verfügbar. Die BW LM-Anteilsklassen sind im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für sich qualifizierende Investoren verfügbar, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe oder von Kunden solcher Mitglieder sind. LM-Anteilsklassen sind nach Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für sich qualifizierende Anleger erhältlich, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe, von Pensionsplänen und ähnlichen Anlagen sind, die von Mitgliedern der Legg Mason-Gruppe oder Kunden solcher Mitglieder gefördert werden. Für Anleger, die in der Europäischen Union ansässig sind, stehen BW Premier-Anteilsklassen im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für „geeignete Gegenparteien" gemäß Definition im Rahmen von MIFID II zur Verfügung. Für Anleger außerhalb der Europäischen Union sind die BW Premier-Anteilsklassen für institutionelle Anleger verfügbar - im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler oder für sich qualifizierende Investoren, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe oder Kunden dieser Mitglieder sind. Für Anleger, die in der Europäischen Union ansässig sind, stehen die Premier-Anteilsklassen für „geeignete Gegenparteien" zur Verfügung, die unter MIFID II definiert sind. Für Anleger, die außerhalb der Europäischen Union ansässig sind, stehen die Premier Share Klassen für institutionelle Anleger zur Verfügung.

Für Anteilsklassen, in deren Namen nach der Währungsbezeichnung das Wort „(abgesichert)" enthalten ist, ist beabsichtigt, dass solche Anteilsklassen gegen Schwankungen der Wechselkurse zwischen der Währung der Anteilsklasse und der Basiswährung des jeweiligen Fonds abgesichert werden. Bestimmte Anteilsklassen in Fonds, die von Brandywine Global Investment Management, LLC verwaltet werden, werden im Verhältnis zu einem Index abgesichert, wie durch die ein „(IH)" im Namen der Anteilsklasse angegeben. Der von ClearBridge RARE Infrastructure Pty Limited verwaltete Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund bietet Portfolio-abgesicherte Anteilsklassen, wie durch die Angabe von „(PH)" im Namen der Anteilsklasse erkennbar. Bestimmte Fonds bieten Anteilsklassen, die ggf. eine Leistungsgebühr entrichten, was durch „(PF)" im Namen der Anteilsklasse angegeben wird.

Bestimmte Fonds haben auch Anteile von Grandfathered-Anteilsklassen ausgegeben, wie durch die Angabe von „GA", „GE", „GP" oder „(G)" im Namen der Anteilsklasse erkennbar. Die Grandfathered-Anteilsklassen sind nur für Anteilseigner der verbundenen Fonds verfügbar. Die Grandfathered-Klassen sind für nachfolgende Zeichnungen sowohl durch bestehende Anteilsinhaber in der Anteilsklasse als auch durch Neuanleger geschlossen, wobei Anteile jedoch noch wie folgt erworben werden können: durch (1) Wiederanlage von Dividenden, (2) automatische Umwandlung der Anteilsklasse B (G) eines Fonds in die Anteilsklasse A (G) des gleichen Fonds und (3) Umtausch von Anteilen einer Grandfathered-Anteilsklasse mit derselben Gattungsbezeichnung. Ungeachtet der vorstehenden Bestimmungen können bestimmte Grandfathered-Anteilsklassen für bestimmte Fonds, die in den Fondsumgebungen angegeben sind, für nachfolgende Zeichnungen von bestehenden Anteilseignern im alleinigen Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder zur Verfügung gestellt werden.

Galleon des Legg Mason Capital Management Value Fund, der sich durch die Mindestzeichnungsbeträge, Ausgabeaufschläge oder Gebührensätze von anderen Anteilsklassen unterscheidet, wird nicht mehr zur Zeichnung angeboten.

6. Besteuerung

Gemäß aktuellem Recht und aktueller Praxis in Irland erfüllt die Gesellschaft die Voraussetzungen für einen Investmentfonds gemäß Abschnitt 739B des Taxes Consolidation Act von 1997 (in seiner jeweils gültigen Fassung). Auf dieser Basis sind die Erträge und Gewinne der Gesellschaft außer bei Eintreten eines Steuertatbestandes in Irland generell nicht steuerpflichtig. Ein Steuertatbestand tritt im Allgemeinen bei der Ausschüttung, Rücknahme, dem Rückkauf, der Einziehung oder Übertragung von Anteilen oder am Ende des „relevanten Zeitraums" auf. Dieser bezeichnet den achtjährigen Zeitraum, der mit dem Kauf der Anteile durch die Anteilsinhaber beginnt, und jeden nachfolgenden achtjährigen Zeitraum, der sich unmittelbar an den vorherigen relevanten Zeitraum anschließt.

Die Gesellschaft ist in Irland bei Eintritt eines Steuertatbestands in den folgenden Fällen nicht steuerpflichtig:

(i) ein Anteilsinhaber zum Zeitpunkt des Steuertatbestands steuerlich weder in Irland ansässig ist noch seinen gewöhnlichen Wohnsitz dort hat, sofern eine gültige angemessene Erklärung vorliegt oder sofern der Gesellschaft von Irish Revenue gestattet wurde, Bruttozahlungen zu leisten, wenn keine angemessenen Erklärungen vorliegen; und

(ii) es sich um bestimmte in Irland steuerlich ansässige, aber steuerbefreite Anteilsinhaber handelt, die der Gesellschaft die erforderlichen unterschriebenen vorschriftsmäßigen Erklärungen vorgelegt haben.

Darüber hinaus stellen jegliche Transaktionen (bei denen es sich andernfalls um einen Steuertatbestand handeln könnte) in Bezug auf Anteile, die in einem laut Verordnung des irischen Finanzamts anerkannten Clearingsystem gehalten werden, keinen Steuertatbestand dar.

Sofern keine entsprechende Erklärung vorliegt, ist die Gesellschaft bei Eintreten eines Steuertatbestands in Irland steuerpflichtig.

Erhaltene Kapitalerträge, Dividenden und Zinsen können im Herkunftsland Steuern, einschließlich Quellensteuern, unterliegen und der Fonds oder seine Anteilsinhaber bekommen diese Steuern eventuell nicht erstattet.

7. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente

Das Barguthaben der Fonds wird bei der Bank of New York Mellon SA/NV und einer beliebigen Unterdepotbank gehalten. Zahlungsmittel und andere Zahlungsmitteläquivalente werden zum Nennwert und gegebenenfalls unter Berücksichtigung aufgelaufener Zinsen bewertet.

8. Verpflichtungen und Eventualverbindlichkeiten

Zum 31. August 2020 bestanden keine wesentlichen Verpflichtungen oder Eventualverbindlichkeiten.

9. Soft-Commission-Vereinbarungen

Die Gesellschaft hat Richtlinien entwickelt, die sicherstellen sollen, dass ihre Dienstleister im besten Interesse der Fonds handeln, wenn sie Handelsentscheidungen im Auftrag dieser Fonds im Rahmen des Portfoliomanagements umsetzen. Zu diesem Zweck und um bestmögliche Ergebnisse für die Fonds zu erzielen, müssen unter Berücksichtigung von Preis, Kosten, Geschwindigkeit, Wahrscheinlichkeit der Ausführung und Abwicklung, Auftragsvolumen und -art und sonstigen für die Auftragsausführung relevanten Überlegungen alle angemessenen Maßnahmen getroffen werden. Eventuell erhaltene Barrückvergütungen von einem Makler oder Händler für an diesen Makler oder Händler gerichtete Fonds-Maklergeschäfte werden vom Anlageverwalter, dem Unteranlageverwalter oder mit diesen verbundenen Personen nicht einbehalten. Die Gesellschaft trägt nicht die Kosten externer Analysen für den Anlageverwalter und den Unteranlageverwalter. Derartige Kosten werden vom entsprechenden Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter getragen. Informationen zu den Richtlinien für Auftragsausführungen der Fonds sind für Anteilsinhaber auf Anfrage kostenlos erhältlich.

Im Laufe des Berichtszeitraums zum 31. August 2020 ging Royce & Associates, LP („Royce") und ClearBridge Investments, LLC („ClearBridge")„Soft Commission"-Vereinbarungen mit Brokern ein, erstattete jedoch die entsprechenden Fonds für alle im Rahmen dieser Vereinbarungen entstandenen Forschungskosten.

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

10. Wechselkurse

In diesem Abschluss wurden für die jeweiligen auf US-Dollar, Euro, britisches Pfund und japanischer Yen lautenden Fonds die Beträge in Fremdwährungen anhand folgender Wechselkurse jeweils in US-Dollar, Euro, britisches Pfund und japanischen Yen umgerechnet:

Auf USD lautende Fonds	**Währung**	**Wechselkurs am 31. August 2020**
	Malaysischer Ringgit	4,1655
	Mexikanischer Peso	21,8820
	Neuseeländischer Dollar	1,4846
	Norwegische Krone	8,7357
	Pakistanische Rupie	165,6250
	Peruanischer Nuevo Sol	3,5431
	Philippinischer Peso	48,4850
	Polnischer Zloty	3,6829
	Qatari Riyal	3,6410
	Russischer Rubel	74,0725
	Singapur-Dollar	1,3606
	Südafrikanischer Rand	16,9513
	Südkoreanischer Won	1.187,9000
	Schwedische Krone	8,6498
	Schweizer Franke	0,9040
	Taiwan-Dollar	29,3415
	Thailändischer Baht	31,1225
	Türkische Lira	7,3410
	Vereinigte Arab. Emirate Dirham	3,6732

Auf EUR lautende Fonds	**Währung**	**Wechselkurs am 31. August 2020**
	Australischer Dollar	1,6180
	Britisches Pfund	0,8927
	Kanadischer Dollar	1,5565
	Dänische Krone	7,4437
	Ungarischer Forint	355,5603
	Japanischer Yen	126,3938
	Neuseeländischer Dollar	1,7716
	Norwegische Krone	10,4248
	Polnischer Zloty	4,3950
	Singapur-Dollar	1,6236
	Südafrikanischer Rand	20,2288
	Schwedische Krone	10,3222
	Schweizer Franke	1,0787
	Türkische Lira	8,7604
	US-Dollar	1,1934

Auf GBP lautende Fonds	**Währung**	**Wechselkurs am 31. August 2020**
	Euro	1,1202
	US-Dollar	1,3368

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts

Die Gesellschaft hat die Bewertungen zum Marktwert im Rahmen einer Marktwerthierarchie klassifiziert, die die Bedeutung von Inputs wiederspiegelt, die bei einer Bewertung zum Marktwert herangezogenen werden. Die Marktwerthierarchie kennt folgende Stufen:

Eingabewerte der Stufe 1 sind unbereinigte notierte Kurse in aktiven Märkten für gleichartige Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten, welche dem Unternehmen am Bewertungstag zugänglich sind.

Eingabewerte der Stufe 2 sind andere notierte Kurse als die in aktiven Märkten der Stufe 1, welche für die betreffenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten direkt oder indirekt beobachtbar sind (d. h. unter Verwendung von Marktdaten entwickelt werden).

Eingabewerte der Stufe 3 sind nicht beobachtbare Parameter für die Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten (d. h., es sind keine Marktdaten verfügbar).

Jede Kapitalanlage wird insgesamt stets der Stufe 1, 2 oder 3 zugeordnet. In bestimmten Fällen kann zur Bewertung des beizulegenden Zeitwerts einer Kapitalanlage eine Reihe verschiedener Parameter verschiedener Stufen der Bewertungshierarchie herangezogen werden. In diesen Fällen richtet sich die Stufe der Kapitalanlage nach der geringsten Bewertungsstufe der Eingabewerte, die für die Berechnung des beizulegenden Zeitwerts herangezogen werden. Die Beurteilung der Bedeutsamkeit eines bestimmten Eingabewerts für die Bewertung zum beizulegenden Zeitwert erfordert Urteilsvermögen und ist anlagenspezifisch.

Die Eingabewerte oder die verwendete Methode zur Bewertung der Wertpapiere sind nicht unbedingt ein Hinweis auf die Risiken, die mit einer Anlage in diesen Wertpapieren verbunden sind.

Die folgende Tabelle schlüsselt die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum 31. August 2020 gemäß den Bewertungsstufen auf:

	Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	**Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)**	**Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)**	**Legg Mason Western Asset EUR Core Plus Bond Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)**	**Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)**
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	€ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	234
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	307	5.724	183	11
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(586)	(4.957)	(111)	–
	–	**(279)**	**767**	**72**	**245**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	$ 943.072	$ 300.866	$ 1.690.814	€ 100.445	$ 24.899
Geldmarktinstrumente	198.855	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	17.331	25.601	3.127	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	549	14.854	209	17
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(455)	(7.080)	(150)	(12)
	1.141.927	**318.291**	**1.724.189**	**103.631**	**24.904**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ 267	$ 5.210	€ –	$ 451
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	267	5.210	–	451
Anlagen insgesamt	**$ 1.141.927**	**$ 318.279**	**$ 1.730.166**	**€ 103.703**	**$ 25.600**

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund zum zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US High Yield Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	218	1.639	–	–	164
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	184	12	2	4	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(132)	–	–	(1)	(331)
	270	**1.651**	**2**	**3**	**(167)**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	$ 538.392	$ 173.637	$ 16.407	$ 36.657	$ 81.463
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	64.243	2.975	1.778	–	7.223
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	11.434	93	43	6	536
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(2.188)	(86)	(29)	(4)	(166)
	611.881	**176.619**	**18.199**	**36.659**	**89.056**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	$ 1.919	$ 1.452	$ –	$ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	47	134	–	–	128
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	1.966	1.586	–	–	128
Anlagen insgesamt	**$ 614.117**	**$ 179.856**	**$ 18.201**	**$ 36.662**	**$ 89.017**

	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	92	–	399	273	61
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(71)	(939)	(91)	(232)	(78)
	21	**(939)**	**308**	**41**	**(17)**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	$ 43.818	$ 519.956	$ 376.805	$ 219.004	$ 74.654
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	1.693	16.221	16.999	17.579	284
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	62	1.948	7.327	3.509	24
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(352)	(59)	(3.744)	(2.457)	(1.162)
	45.221	**538.066**	**397.387**	**237.635**	**73.800**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	$ 2	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	2	–
Anlagen insgesamt	**$ 45.242**	**$ 537.127**	**$ 397.695**	**$ 237.678**	**$ 73.783**

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	952	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	84.234	1.453	1.182	279
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(184.415)	(1.598)	(1.174)	(507)
	–	**(100.181)**	**807**	**8**	**(228)**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	€ 50.218	$ 6.272.656	$ 943.109	$ 1.036.742	$ 818.354
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	336	116.916	19.257	51.853	69.893
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	7	237.156	29.350	4.327	33
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(90)	(123.488)	(6.031)	(1.031)	–
	50.471	**6.503.240**	**985.685**	**1.091.891**	**888.280**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	$ 11.353	$ 4.732	$ 60.901	$ 2.022
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	11.353	4.732	60.901	2.022
Anlagen insgesamt	**€ 50.471**	**$ 6.414.412**	**$ 991.224**	**$ 1.152.800**	**$ 890.074**

	Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global US High Yield Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	48	159	2.527	3.295	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(4)	–	–	–	–
	44	**159**	**2.527**	**3.295**	**–**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	£ 111.292	$ 120.880	$ 526.673	$ 714.003	$ 10.225
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	2.187	48.104	38.857	455
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	106	2.433	18.935	41.180	488
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(6)	(119)	(14.304)	(24.822)	(48)
	111.392	**125.381**	**579.408**	**769.218**	**11.120**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	**£ 111.436**	**$ 125.540**	**$ 581.935**	**$ 772.513**	**$ 11.120**

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	1.143	58	89	43	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(320)	–	–	–	–
	823	**58**	**89**	**43**	**–**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	$ 548.956	$ 591.088	$ 113.448	$ 42.510	$ 10.220
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	31.583	–	7.299	3.787	386
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	11.954	40.825	4.618	823	321
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(7.385)	(34.462)	(761)	(435)	(47)
	585.108	**597.451**	**124.604**	**46.685**	**10.880**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	**$ 585.931**	**$ 597.509**	**$ 124.693**	**$ 46.728**	**$ 10.880**

	Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Value Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	1.487	333.521	195.927	1.885.174
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	3.859	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(663)	–	–	–	–
	3.196	**1.487**	**333.521**	**195.927**	**1.885.174**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	$ 329.585	$ –	$ –	$ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	15.733	24	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	23.833	12	2	–	1.042
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(11.780)	–	–	–	(1.024)
	357.371	**36**	**2**	**–**	**18**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	**$ 360.567**	**$ 1.523**	**$ 333.523**	**$ 195.927**	**$ 1.885.192**

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	744.254	37.380	194.320	9.816	652.813
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	744.254	**37.380**	**194.320**	**9.816**	**652.813**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ 678	$ –	$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	470	63	960	1	1.011
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(27)	(2)	(13)	–	(1.655)
	443	**739**	**947**	**1**	**(644)**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	**$ 744.697**	**$ 38.119**	**$ 195.267**	**$ 9.817**	**€ 652.169**

	Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	€ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	2.256	426.482	61.624	32.499	36.763
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	2.256	**426.482**	**61.624**	**32.499**	**36.763**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	€ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	12.833	616	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	16	449	1	27	162
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(158)	–	(60)	–
	16	**13.124**	**617**	**(33)**	**162**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	€ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	**$ 2.272**	**$ 439.606**	**$ 62.241**	**€ 32.466**	**$ 36.925**

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	€ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	12.072	12.451	59.977	68.617	65.485
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	19	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	12.091	**12.451**	**59.977**	**68.617**	**65.485**
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	€ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	11.041	–
Eigenkapitalinstrumente	199	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	21	29	4.754	29
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(9)	–	(2.306)	–
	199	**12**	**29**	**13.489**	**29**
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	$ –	€ –	$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	5	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	5	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	**$ 12.295**	**$ 12.463**	**$ 60.006**	**€ 82.106**	**$ 65.514**

	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^ zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Stufe 1			
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	9.659	35.159	6.087
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–
	9.659	**35.159**	**6.087**
Stufe 2			
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	17	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–
	17	**–**	**–**
Stufe 3			
Anleihen und Schuldtitel	$ –	$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–
	–	–	–
Anlagen insgesamt	**$ 9.659**	**$ 35.159**	**€ 6.087**

12. Wertpapiersicherheiten

Dem Kreditrisiko begegnet man durch diversifizierten Einsatz von Gegenparteien und Emittenten und durch Mindestratings für einzelne Wertpapiere und Durchschnittsratings für die Portfolios. Der jeweilige Anlagemanager und/oder Unteranlageverwalter kann Portfoliobeschränkungen festlegen und auf der Grundlage interner Parameter mit gemeinsam bei Auflegung des Fonds vereinbarten Beschränkungen anlegen, wozu Beschränkungen für Emissionen und Emittenten, Mindestbonität sowie durchschnittliche Bonität zählen. Das Konto wird dabei laufend überwacht, um sicherzustellen, dass es diese Parameter weiterhin erfüllt. Darüber hinaus können vor dem Kauf strenge unabhängige Analysen aller Anleihepapiere durchgeführt werden, unter anderem Finanzmodellierung, Szenarioanalysen sowie die Überwachung von Veränderungen des Risikoprofils. Generell dürfen zum Zeitpunkt des Kaufs maximal 5 % des Portfolios in ein und dasselbe emittierende Unternehmen angelegt sein.

Der Bewertungsausschuss trifft sich mindestens einmal monatlich und wenn die Umstände dies erfordern, um Fragen der Bewertung zu erörtern und unter anderem auch das Kreditrisiko zu prüfen. Der jeweilige Anlagemanager und/oder Unteranlageverwalter legt dem Verwaltungsrat und dem Ausschuss halbjährlich Risikoanalysen vor.

Die Gesellschaft überwacht ihr Risiko, indem sie die Bonität und die Finanzpositionen der Gegenparteien, mit denen die Fonds Geschäfte abschließen, regelmäßig überprüft. Die Fonds dürfen nur mit genehmigten Gegenparteien handeln.

Für eine effiziente Portfolioverwaltung kann jeder Fonds gemäß den Bestimmungen und Beschränkungen der OGAW-Vorschriften der irischen Zentralbank Wertpapierpensionsgeschäfte, umgekehrte Wertpapierpensionsgeschäfte sowie Wertpapierleihverträge abschließen.

Bis zum Ablauf der Wertpapierpensionsgeschäfte, der umgekehrten Wertpapierpensionsgeschäfte sowie der Wertpapierleihgeschäfte muss die im Rahmen eines solchen Vertrags oder Geschäfts erhaltene Sicherheit:

(i) täglich neu bewertet werden;

(ii) jederzeit dem Wert des angelegten Betrags oder der geliehenen Wertpapiere entsprechen oder darüber liegen;

(iii) auf den Treuhänder oder seinen Beauftragten übertragen werden; und

(iv) dem Fonds sofort und ohne Rückgriff auf die Gegenpartei zur Verfügung stehen, falls dieses Rechtssubjekt in Verzug gerät.

Jede von der Gesellschaft erhaltene unbare Sicherheit kann nicht verkauft oder weiterverpfändet werden, sondern muss zum Kreditrisiko der Gegenpartei gehalten und von einer von der Gegenpartei unabhängigen Stelle ausgegeben werden.

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

12. Wertpapiersicherheiten – (Fortsetzung)

Im Wesentlichen werden alle von den Fonds gehaltenen Barmittel und Wertpapiere über die Depotbank gehalten, die eine Bonität von AA- (28. Februar 2019: AA-) hat. Die Rechte der Fonds an den von der Verwahrstelle gehaltenen Barmitteln können durch Konkurs oder Zahlungsunfähigkeit der Verwahrstelle verzögert oder eingeschränkt werden. Die Bonität der Verwahrstelle wird von renommierten Ratingagenturen als erstklassig eingestuft. Sollte sich die Bonität oder finanzielle Lage der Verwahrstelle erheblich verschlechtern, kann der jeweilige Anlagemanager und/oder Unteranlageverwalter den Barmittelbestand auf eine andere Bank übertragen.

Sämtliche als Sicherheit platzierte Wertpapiere sind im Anlageportfolio aufgeführt. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente, die auf den Depotbank- und Margin-Konten gehalten werden und die Barmittel sind, werden in der Rechnung der Finanzlage ausgewiesen.

Sofern Transaktionen für einen Fonds zu großen nicht realisierten Gewinnen führen, kann es für einen Fonds erforderlich sein, eine von einem Makler erhaltene Sicherheit zu halten. In diesem Fall reduziert sich das Kreditrisiko des Fonds um den Wert der gehaltenen Sicherheit. Sollte der Makler Konkurs anmelden, so ist die in Verbindung mit bestimmten derivativen Finanzinstrumenten eingebrachte Sicherheit in den USA (wobei sich die Vorschriften in den verschiedenen Rechtssystemen unterscheiden können) von der bei Aufnahme des Konkursverfahrens angewandten automatischen Aussetzung ausgenommen. Diese Ausnahme für Derivate würde es einem Fonds erlauben, die von der zahlungsunfähigen Partei eingebrachte Sicherheit sofort zwangsvollstrecken zu lassen, um die Forderungen gegen die zahlungsunfähige Partei zu befriedigen.

Der Wert der als Sicherheit erhaltenen Basiswerte für gehandelte und von den folgenden Fonds gehaltenen Derivate betrug am 31. August 2020:

Fonds	Broker	Marktwert der Sicherheiten zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Citi	$354
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Goldman Sachs	$608
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	JP Morgan	$298
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	BNP Paribas	$732
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Goldman Sachs	$52.484
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	Citi	$215
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	Goldman Sachs	$583
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	JP Morgan	$482

Es wird eine Liste genehmigter Gegenparteien geführt. Ergänzungen dieser Listen werden vierteljährlich überprüft und jedes Jahr wird eine sorgfältige Neubewertung aller Gegenparteien vorgenommen. Die Überprüfung schließt die Analyse der Eigenkapitalausstattung, der Rentabilität, der Liquidität und anderer maßgeblicher Faktoren der Gegenpartei ein.

Wenn ein Fonds eine Sicherheit bei einer Gegenpartei hinterlegt hat, so kann der Fonds bei Insolvenz der Gegenpartei gemäß den Handelsverträgen mit der Gegenpartei berechtigt sein, diese Sicherheit zurückzufordern. In der Praxis kann der Fonds jedoch bestrebt sein, alle der Gegenpartei geschuldeten Beträge zu reduzieren, um alle noch offenen Geschäfte durch Verrechnung der geschuldeten Beträge gegen die eingebrachte Sicherheit zu verrechnen. Wenn der Fonds nach Verrechnung der geschuldeten Beträge Anspruch auf Rückzahlung einer Sicherheit hätte (wenn z.B. die Fondsposition überbesichert war), dann hätte der Fonds im Insolvenzverfahren wahrscheinlich eine unbesicherte Forderung gegen die Gegenpartei über den Betrag, der den ihm geschuldeten Betrag übersteigt.

Zur Reduzierung des Gegenparteikausfallrisikos werden bestimmte außerbörsliche Derivate über zentrale Clearingstellen abgewickelt. Im Rahmen dieser Vereinbarung werden mit Gegenparteien abgeschlossene Transaktionen an Clearingstellen abgetreten, die nach der Annahme effektiv die Gegenpartei für die Risikoaspekte der Transaktion ersetzen.

Die folgende Tabelle weist den Marktwert der Wertpapiere aus, die in Bezug auf den Handel mit Derivaten zum 31. August 2020 als Sicherheit bei Brokern platziert wurden:

Fonds	Broker	Marktwert der Sicherheiten zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Citi	$79
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	JP Morgan	$584
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Citi	$2.654
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	JP Morgan	$2.810

13. Angaben zu gegenseitigen Anlagen durch die Fonds innerhalb der Gesellschaft

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Der Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund hielt zum Ende des Berichtszeitraums 145,199, 82,997 bzw. 74,291 Anteile am Legg Mason Western Asset US High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund bzw. Legg Mason Western Asset EUR High Yield Fund. Im Berichtszeitraum durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset US High Yield Fund Für den Zeitraum zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund Für den Zeitraum zum 31. August 2020 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund Für den Zeitraum zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	$452	$173	$–
Rücknahme von Anteilen	(5.610)	–	–
Realisierter Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(900)	–	–
Erhaltene Ausschüttungen	452	173	–
Anschaffungskosten	12.488	8.562	12.045
Beizulegender Zeitwert	12.531	8.455	15.536
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	**$43**	**$(107)**	**$3.491**

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund hielt zum Ende des Berichtszeitraums 17,451 Anteile am Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund. Im Berichtszeitraum durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund Für den Zeitraum zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	$37
Rücknahme von Anteilen	(56)
Realisierter Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	–
Erhaltene Ausschüttungen	37
Anschaffungskosten	1.612
Beizulegender Zeitwert	1.778
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	**$166**

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

13. Angaben zu gegenseitigen Anlagen durch die Fonds innerhalb der Gesellschaft – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Der Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund hielt zum Ende des Berichtszeitraums 6,373 bzw. 26,331 Anteile am Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund bzw. am Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund. Im Berichtszeitraum durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	**Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund**
	Für den Zeitraum zum 31. August 2020 (in Tsd.)	**Für den Zeitraum zum 31. August 2020 (in Tsd.)**
Ausgabe von Anteilen	$2.995	$–
Rücknahme von Anteilen	(7.157)	–
Realisierter Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(413)	–
Erhaltene Ausschüttungen	45	–
Anschaffungskosten	637	4.299
Beizulegender Zeitwert	649	5.507
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	**$12**	**$1.208**

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Der Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ hielt zum Ende des Berichtszeitraums 90,119 Anteile am Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund. Im Berichtszeitraum durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund
	Für den Zeitraum zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	$188
Rücknahme von Anteilen	–
Realisierter Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	–
Erhaltene Ausschüttungen	188
Anschaffungskosten	8.772
Beizulegender Zeitwert	9.181
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	**$409**

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ hielt zum Ende des Berichtszeitraums 87,846 Anteile an Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^. Im Berichtszeitraum durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^
	Für den Zeitraum zum 31. August 2020 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	$0
Rücknahme von Anteilen	–
Realisierter Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	–
Erhaltene Ausschüttungen	–
Anschaffungskosten	10.311
Beizulegender Zeitwert	10.313
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	**$2**

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – *(Fortsetzung)*

14. Bedeutende Ereignisse

Am 28. April 2020 wurde von der Gesellschaft aktualisierte Haupt- und Fachprospekte herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt. Die wichtigsten Änderungen sind:

- Revision der Offenlegung zur Bereitstellung aktueller Biographien für die Direktoren des Unternehmens und den Verwalter;
- Für jeden Fonds wurde gegebenenfalls die Offenlegung über den Benchmark-Index hinzugefügt;
- Liste der regulierten Märkte wurde aktualisiert, um die Börse von Tadawul (Saudi-Börse) und Katar einzubeziehen;
- Eine schwedische Nachhaltigkeitsoffenlegung wurde aufgelistet, die Informationen zu der Frage enthält, inwieweit die Anlageverwalter Nachhaltigkeitsfragen im Rahmen des Fondmanagements berücksichtigen;
- Die Informationen zu diesen Optionen werden überarbeitet, unter anderem die Verpflichtung, dass die Index-Put-Optionen nur verkauft werden können, wenn sich mit hinreichender Gewissheit erwarten lässt, dass sich die Anlagen des Fonds bezogen auf die Kursbewegungen in gleicher Weise wie die Optionskontrakte verhalten werden;
- Informationen werden für zusätzliche Länder hinzugefügt, die besagen, dass die Fonds nicht für den öffentlichen Verkauf notiert sind, und die Beschränkungen für das Angebot und den Verkauf des Fonds in diesen Ländern erläutern;
- Die Informationen werden zur Beschreibung des Bond Connect hinzugefügt – einem Handelslink, mit dessen Hilfe nicht-chinesische Anleger Anleihen im chinesischen Interbankenanleihemarkt handeln können;
- Das Berechnen der Marketingkostenrückstellungen wurde gelöscht;
- Änderungen wurden an bestimmten Anlagerichtlinien, Risiken, Benchmarks und Vermögenswerten von Fonds vorgenommen, wie in Anhang B der Aktionärsmitteilung vom 10. März 2020 beschrieben, sowie zusätzliche Ernennungen von Unteranlageverwaltern, die bestimmten Fonds zugewiesen wurden.
- Die Handelsfrist und der Bewertungszeitpunkt für den Fonds, der von Martin Currie Investment Management Ltd verwaltet wird, hat sich von 12 Uhr mittags in London auf 16 Uhr New Yorker Zeit (Ostküstenzeit) in den Vereinigten Staaten verschoben. Nach Ende des Berichtszeitraums breitete sich COVID-19 weiter aus und hat die Weltwirtschaft und die Finanzmärkte stark beeinträchtigt. Es ist noch zu früh, die möglichen Auswirkungen von COVID-19 zu beurteilen. Die Länge und das Ausmaß des Abschwungs sowie seine Auswirkungen auf die Finanzmärkte werden von einer Reihe von Faktoren bestimmt, darunter Bemühungen, die Kurve durch öffentliche Lockdowns, Quarantänen und räumliche Distanzierung „abzuflachen". In der Zwischenzeit wurden weltweit aggressive geld- und haushaltspolitische Maßnahmen ergriffen.

Am 29. Juni 2020 genehmigte die Zentralbank die Änderungen der Namen für den Legg Mason RARE Emerging Markets Infrastructure Fund, den Legg Mason RARE Global Infrastructure Income Fund bzw. den Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund zum Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund, den Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Fund, bzw. den Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund.

Am 31. Juli 2020 schloss Franklin Resources, Inc., eine globale Investmentorganisation, die als Franklin Templeton firmiert, die Übernahme von Legg Mason, Inc. ab.

In dieser Zeit hat der Ausbruch der Atemwegserkrankung COVID-19 (allgemein als „Coronavirus" bezeichnet) sich weiterhin rasch auf der Welt verbreitet, was zu einer erheblichen Unsicherheit für die Weltwirtschaft und die Finanzmärkte geführt hat. Die letztendlichen wirtschaftlichen Folgen der Pandemie und die langfristigen Auswirkungen auf Volkswirtschaften, Märkte, Branchen und einzelne Emittenten sind nicht bekannt. Die COVID-19-Pandemie könnte sich negativ auf den Wert und die Liquidität der Anlagen eines Fonds auswirken, die Fähigkeit eines Fonds beeinträchtigen, Rücknahmeanträge zu erfüllen, und sich negativ auf die Performance eines Fonds auswirken. Darüber hinaus könnten der Ausbruch von COVID-19 und die Maßnahmen, die zur Abfederung seiner Auswirkungen ergriffen wurden, zu Unterbrechungen der Dienstleistungen führen, die einem Fonds durch seine Dienstleister bereitgestellt werden.

Während des Berichtszeitraums zum 31. August 2020 fanden keine weiteren bedeutenden Ereignisse statt.

15. Getrennte Haftung

Die Gesellschaft ist ein Dachfonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds. Gemäß irischem Recht haften das Vermögen der einzelnen Fonds nicht für die Verbindlichkeiten der übrigen Fonds der Gesellschaft. Ungeachtet dessen kann nicht garantiert werden, dass die getrennte Haftung der Teilfonds im Fall einer Klage gegen die Gesellschaft vor Gerichten einer anderen Gerichtsbarkeit Bestand hat.

16. Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Mit Wirkung zum 30. September 2020 trat Victoria Rock als Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft zurück.

Nach Ende des Berichtszeitraums breitete sich COVID-19 weiter aus und hat die Weltwirtschaft und die Finanzmärkte stark beeinträchtigt. Es ist noch zu früh, die möglichen Auswirkungen von COVID-19 zu beurteilen. Die Länge und das Ausmaß des Abschwungs sowie seine Auswirkungen auf die Finanzmärkte werden von einer Reihe von Faktoren bestimmt, darunter Bemühungen, die Kurve durch öffentliche Lockdowns, Quarantänen und räumliche Distanzierung „abzuflachen". In der Zwischenzeit wurden weltweit aggressive geld- und haushaltspolitische Maßnahmen ergriffen.

Es gab keine sonstigen wichtigen Ereignisse nach dem Bilanzstichtag, die im Abschluss offengelegt werden müssten.

17. Vergleichszahlen aus dem letzten Berichtszeitraum

Die Vergleichszahlen aus dem Vorjahr für die Bilanz entsprechen dem Stand vom 29. Februar 2020. Die Vergleichszahlen aus dem Vorjahr für die Gesamtergebnisrechnung und die Aufstellung der Änderungen des auf die Inhaber rücknahme- und gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens beziehen sich auf das Geschäftsjahr zum 31. August 2019.

18. Genehmigung der Berichte

Der Halbjahresbericht und der ungeprüfte Zwischenabschluss wurden am 13. Oktober 2020 dem Verwaltungsrat vorgelegt und von diesem zur Kenntnis genommen und zur Einreichung bei der irischen Zentralbank sowie zur Verteilung an die Anteilsinhaber genehmigt.

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER)

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	0,51
Klasse A USD, ausschüttend (D)	0,50
Klasse B USD, thesaurierend	0,76
Klasse C USD, thesaurierend	0,89
Klasse C USD, ausschüttend (D)	0,69
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,39
Klasse A (G) USD, thesaurierend	0,51
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)$0,54	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	0,58
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,20
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,20
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,48
Klasse C USD, thesaurierend	1,70
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,70
Klasse E USD, thesaurierend	1,80
Klasse F USD, thesaurierend	0,66
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,66
Klasse X USD, thesaurierend	0,73
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,73
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,41
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,41
Klasse GA USD, thesaurierend	0,92
Klasse GE USD, thesaurierend	1,52
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,39
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,39
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,38
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,39
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,39
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,64
Klasse C USD, thesaurierend	1,88
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,88
Klasse E USD, thesaurierend	1,98
Klasse F USD, thesaurierend	0,64
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,64
Klasse X USD, thesaurierend	0,81
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,81
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,81
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,39
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	0,39
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,39
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,09
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,09
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,24
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,24
Klasse B (G) USD, ausschüttend (D)	1,75
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,74
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,74
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,26
Klasse A EUR, ausschüttend (D)	1,26
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,76
Klasse F EUR, ausschüttend (Q)	0,62
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,41
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,11
Klasse GA EUR, thesaurierend	0,93
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	0,93
Klasse GE EUR, thesaurierend	1,53
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,39
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,39
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,39
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,39
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,38
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,39
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,39
Klasse B USD, thesaurierend	1,63
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,64
Klasse C USD, thesaurierend	1,89
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,89
Klasse F USD, thesaurierend	1,00
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,75
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,49
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,49
Klasse B (G) USD, ausschüttend (D)	2,00
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,99
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,99

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,34
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,34
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,34
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,34
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,34
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,34
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,34
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,34
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,34
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34
Klasse B USD, thesaurierend	1,59
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,59
Klasse C USD, thesaurierend	1,84
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,84
Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34
Klasse E USD, thesaurierend	1,94
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,94
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,94
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,94
Klasse F USD, thesaurierend	0,74
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,74
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,79
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,79
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,49
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	0,49
Klasse Premier CHF, thesaurierend (Abgesichert)	0,49
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,49
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,49
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,49
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,49
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	0,49
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert)	0,55
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,49
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,09
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,09
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,42
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,42
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,42
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,42
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,42
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,42
Klasse B USD, thesaurierend	1,66
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,67
Klasse C USD, thesaurierend	1,92
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,92
Klasse E USD, thesaurierend	2,02
Klasse E USD, ausschüttend (D)	2,01
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,02
Klasse F USD, thesaurierend	0,82
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,81
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,86
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,57
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,57
Klasse LM USD, thesaurierend	0,12
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,12
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,12
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,27
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,27
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,77
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,77
Klasse GF USD, thesaurierend	1,07

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) – *(Fortsetzung)*

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,79
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,79
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,79
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,77
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,79
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,78
Klasse A GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,79
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,78
Klasse C USD, thesaurierend	2,28
Klasse C USD, ausschüttend (D)	2,28
Klasse E USD, ausschüttend (D)	2,56
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,56
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	2,56
Klasse F USD, thesaurierend	1,09
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,22
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,87
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert)	0,87
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,55
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,56
Klasse L (G) USD, thesaurierend	2,06
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	2,06
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,91
Klasse A USD, ausschüttend (M)	2,03
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,72
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,16
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,54
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,54
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,55
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,55
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,55
Klasse A EUR, thesaurierend	1,54
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,55
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,55
Klasse B USD, thesaurierend	1,79
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,79
Klasse C USD, thesaurierend	2,04
Klasse C USD, ausschüttend (D)	2,04
Klasse E USD, thesaurierend	2,14
Klasse E USD, ausschüttend (D)	2,15
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	2,15
Klasse F USD, thesaurierend	0,85
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,85
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,92
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,92
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,60
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,60
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert)	0,60
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,40
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,40
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,90
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,90
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,19
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,19
Klasse B USD, thesaurierend	1,44
Klasse C USD, ausschüttend (A)	1,69
Klasse LM USD, thesaurierend	0,17
Klasse A (G) USD, thesaurierend	0,99
Klasse A (G) USD, ausschüttend (A)	0,99
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,49
Klasse L (G) USD, ausschüttend (A)	1,50

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,34
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,34
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,34
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,34
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,34
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34
Klasse A EUR, thesaurierend	1,34
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,33
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,34
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,34
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,34
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	1,34
Klasse B USD, thesaurierend	1,59
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,59
Klasse C USD, thesaurierend	1,84
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,84
Klasse E USD, thesaurierend	1,94
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,94
Klasse F USD, thesaurierend	0,92
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,94
Klasse X USD, thesaurierend	0,84
Klasse X USD, ausschüttend (M)	0,84
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,69
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,69
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,69
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,69
Klasse Premier Euro, ausschüttend (M)	0,69
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M)	0,69
Klasse LM USD, thesaurierend	0,09
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,10
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,10
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,09
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	0,86
Klasse A SEK, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,86
Klasse B USD, thesaurierend	1,35
Klasse C USD, thesaurierend	1,60
Klasse C USD, ausschüttend (M)	1,60
Klasse E USD, thesaurierend	1,70
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,70
Klasse F USD, thesaurierend	0,69
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,69
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,67
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,45
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,45
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,45
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,45
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,45
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,35
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,35
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,35
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,34
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,36
Klasse X USD, thesaurierend	0,80
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,51
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,51
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert)	0,51
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	0,11
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,33
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,33
Klasse LM USD, thesaurierend	0,13
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	
Klasse A EUR, ausschüttend (D)	1,43
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,58
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,59
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,14
Klasse LM EUR, ausschüttend (Q)	0,14

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) – *(Fortsetzung)*

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	
Klasse A USD, thesaurierend	1,73
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,73
Klasse A USD, ausschüttend (S)	1,73
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,73
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,73
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,73
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	1,73
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,73
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,73
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,73
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,73
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,73
Klasse A GBP, thesaurierend	1,73
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,73
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,73
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,73
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,73
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,73
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,73
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,76
Klasse B USD, thesaurierend	1,98
Klasse C USD, thesaurierend	2,23
Klasse C USD, ausschüttend (S)	2,23
Klasse A JPY, ausschüttend (M) Plus (e)	1,70
Klasse A NOK, thesaurierend (abgesichert)	1,73
Klasse E USD, thesaurierend	2,33
Klasse E USD, ausschüttend (S)	2,33
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,33
Klasse F USD, thesaurierend	1,33
Klasse F USD, ausschüttend (S)	1,33
Klasse X USD, thesaurierend	1,23
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,23
Klasse X USD, ausschüttend (S)	1,23
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)	1,23
Klasse X EUR, thesaurierend	1,23
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,23
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,23
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,23
Klasse X GBP, thesaurierend	1,23
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,23
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,23
Klasse X SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,23
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,08
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	1,08
Klasse Premier AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,08
Klasse Premier AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,08
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	1,11
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,08
Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,08
Klasse Premier EUR, thesaurierend	1,08
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,08
Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,08
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,08
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,08
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	1,08
Klasse Premier JPY, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,08
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	1,08
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,08
Klasse S USD, thesaurierend	0,68
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,68
Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	0,08
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,08
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	
Klasse A USD, thesaurierend	1,49
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,55
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,48
Klasse C USD, thesaurierend	2,05
Klasse F USD, thesaurierend	0,89
Klasse X CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,86
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,69
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	0,69
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,49
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,49
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,09
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,09
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,09

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^	
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,44
Klasse D EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,44
Klasse D EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,44
Klasse D USD, thesaurierend	1,44
Klasse D USD, ausschüttend (M)	1,44
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	1,44
Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)	0,84
Klasse M GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,84
Klasse F USD, thesaurierend	1,28
Klasse M USD, thesaurierend	0,84
Klasse M USD, ausschüttend (M)	0,84
Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,84
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,69
Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)	0,69
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,69
Klasse Premier Euro, ausschüttend (Q) (abgesichert)	0,69
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,68
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	0,70
Klasse LM USD, thesaurierend	0,09
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,23
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,39
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,39
Klasse LM USD, thesaurierend	0,09
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^	
Klasse A GBP, thesaurierend	1,10
Klasse LM GBP, thesaurierend	0,10
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,06
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,41
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,41
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,11
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,34
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,34
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,35
Klasse A USD, ausschüttend (S)	1,34
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,34
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	1,34
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,34
Klasse A EUR, ausschüttend (S)	1,34
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1,34
Klasse A GBP, thesaurierend	1,34
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,34
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1,34
Klasse A SGD, thesaurierend	1,34
Klasse B USD, thesaurierend	1,59
Klasse B USD, ausschüttend (S)	1,59
Klasse C USD, thesaurierend	1,84
Klasse C USD, ausschüttend (S)	1,84
Klasse E USD, thesaurierend	1,94
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,94
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	1,94
Klasse F USD, thesaurierend	0,94
Klasse F USD, ausschüttend (S)	0,94
Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,93
Klasse X USD, thesaurierend	0,84
Klasse X USD, ausschüttend (S)	0,84
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,84
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,84
Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,84
Klasse X GBP, thesaurierend	0,84
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,84
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,84
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)	0,84
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,84
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,69
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	0,69
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,69
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,69
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,69
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,69
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,69
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,09

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) – *(Fortsetzung)*

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	
Klasse A USD, thesaurierend	1,58
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,58
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,59
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,55
Klasse C USD, thesaurierend	2,08
Klasse E USD, thesaurierend	2,18
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,18
Klasse F USD, thesaurierend	1,18
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,18
Klasse X USD thesaurierend	1,13
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,13
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,13
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,98
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,98
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,98
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,98
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,98
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	0,98
Klasse Premier SGD, thesaurierend (abgesichert)	0,98
Klasse LM USD, thesaurierend	0,08
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,09
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^	
Klasse A USD, thesaurierend	1,39
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,36
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,73
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,73
Klasse S CAD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,58
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,39
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,39
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,45
Klasse A SGD, thesaurierend	1,39
Klasse C USD, thesaurierend	1,89
Klasse E USD, thesaurierend	1,99
Klasse F USD, thesaurierend	0,99
Klasse F USD, ausschüttend (M)	0,99
Klasse X USD thesaurierend	0,89
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,89
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	0,90
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,74
Klasse Premier USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,74
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	0,74
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,74
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,09
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,09
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^	
Klasse A USD, thesaurierend	1,83
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,83
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,09
Klasse BW LM GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,08
Klasse BW Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,44
Klasse BW Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,43
Klasse BW Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,43
Klasse BW Premier USD, thesaurierend	0,50
Klasse BW Premier USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,44
Klasse X USD, thesaurierend	1,10
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,88
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,88

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^	
Klasse A USD, thesaurierend	1,39
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,40
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,40
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,39
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,39
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,39
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,39
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,39
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,39
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,90
Klasse E USD, thesaurierend	1,99
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,98
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,94
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,84
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,84
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,84
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,84
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,68
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,69
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,69
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,69
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	0,69
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	0,69
Klasse S USD, thesaurierend	0,48
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,55
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,53
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,55
Klasse LM AUD, ausschüttend (Q) (abgesichert)	0,15
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	
Klasse A USD, thesaurierend	1,95
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,92
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,29
Klasse LM USD, thesaurierend	0,14
Klasse S SGD, thesaurierend (abgesichert)	0,69
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,34
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,55
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	
Klasse A USD, thesaurierend	2,24
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	2,24
Klasse X USD, thesaurierend	1,39
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,39
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,24
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,24
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,09
Klasse LM SGD, thesaurierend (abgesichert)	0,09
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	
Klasse A USD, thesaurierend	1,70
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,75
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,50
Legg Mason ClearBridge Value Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,80
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,80
Klasse A EUR, thesaurierend	1,80
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,80
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	1,80
Klasse A SGD, thesaurierend	1,80
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,80
Klasse C USD, thesaurierend	2,29
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,29
Klasse F USD, thesaurierend	1,20
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,20
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,12
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,77
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,77
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,77

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) – *(Fortsetzung)*

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,70
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,70
Klasse A EUR, thesaurierend	1,70
Klasse B USD, thesaurierend	2,20
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,20
Klasse C USD, thesaurierend	2,20
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,20
Klasse E USD, thesaurierend	2,45
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,45
Klasse F USD, thesaurierend	1,11
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,11
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,08
Klasse X EUR, thesaurierend	1,08
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,73
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,73
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,73
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,11
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,36
Klasse B (G) USD, thesaurierend	2,35
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,86
Klasse GA USD, thesaurierend	1,53
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,53
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,53
Klasse GE USD, thesaurierend	2,27
Klasse GE EUR, thesaurierend	2,28
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,69
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,69
Klasse A EUR, thesaurierend	1,69
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,69
Klasse B USD, thesaurierend	2,19
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,19
Klasse C USD, thesaurierend	2,19
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,19
Klasse E USD, thesaurierend	2,44
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,43
Klasse F USD, thesaurierend	1,09
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,09
Klasse U USD, thesaurierend	0,61
Klasse U EUR, thesaurierend	0,61
Klasse X USD thesaurierend	1,06
Klasse X EUR, thesaurierend	1,06
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,06
Klasse X GBP, thesaurierend	1,06
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,71
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,72
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,74
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,71
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,71
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,72
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,72
Klasse LM USD, thesaurierend	0,09
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,09
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,34
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,84
Klasse GA USD, thesaurierend	1,51
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,51

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,74
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,74
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A EUR, thesaurierend	1,74
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,74
Klasse A GBP, thesaurierend	1,74
Klasse A HKD, thesaurierend	1,74
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse B USD, thesaurierend	2,24
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,24
Klasse C USD, thesaurierend	2,24
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,24
Klasse E USD, thesaurierend	2,49
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,49
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,49
Klasse F USD, thesaurierend	1,14
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,14
Klasse X USD thesaurierend	1,09
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,09
Klasse X EUR, thesaurierend	1,09
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,08
Klasse X GBP, thesaurierend	1,09
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,74
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,74
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,74
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,74
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,74
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,74
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	0,74
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,74
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,09
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,39
Klasse B (G) USD, thesaurierend	1,89
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,89
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,51
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,51
Klasse GE USD, thesaurierend	2,26
Klasse GE EUR, thesaurierend	2,26
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,74
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,74
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,74
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,74
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	1,74
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,74
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,74
Klasse A EUR, thesaurierend	1,74
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,75
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,74
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,74
Klasse B USD, thesaurierend	2,23
Klasse C USD, thesaurierend	2,24
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,24
Klasse C USD, ausschüttend (Q)	2,24
Klasse F USD, thesaurierend	1,14
Klasse F EUR, thesaurierend	1,14
Klasse F EUR, ausschüttend (A)	1,14
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,12
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,12

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) – *(Fortsetzung)*

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	
Klasse A USD, thesaurierend	1,70
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,67
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,66
Klasse A SEK, thesaurierend	1,50
Klasse F USD, thesaurierend	1,04
Klasse X USD thesaurierend	1,04
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,07
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,05
Klasse X GBP, thesaurierend	1,06
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,06
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,69
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,73
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,73
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,71
Klasse S USD, thesaurierend	0,23
Klasse S EUR, thesaurierend	0,55
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,55
Klasse S GBP, thesaurierend	0,24
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,34
Klasse S GBP, ausschüttend (Q)	0,26
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,80
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,80
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,94
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	1,94
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,94
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	1,94
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,94
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,94
Klasse A EUR, thesaurierend	1,94
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	1,94
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	1,94
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,94
Klasse C USD, thesaurierend	2,44
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)	2,44
Klasse E USD, thesaurierend	2,69
Klasse F USD, thesaurierend	1,34
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)	1,34
Klasse X USD thesaurierend	1,04
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,04
Klasse X EUR, thesaurierend	1,05
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	1,05
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,85
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,87
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	0,84
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) Plus (e)	0,84
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,84
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	0,85
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,84
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,84
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	0,84
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)	0,85
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert)	0,10
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	2,15
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	2,15
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,35
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	1,35
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,15

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,94
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,94
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,94
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	1,95
Klasse A EUR, thesaurierend	1,94
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,94
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,94
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,94
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	1,94
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,94
Klasse A SGD, thesaurierend	1,94
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,95
Klasse B USD, thesaurierend	2,44
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,44
Klasse C USD, thesaurierend	2,44
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,44
Klasse E USD, thesaurierend	2,69
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,69
Klasse E EUR thesaurierend	2,69
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,69
Klasse F USD, thesaurierend	1,34
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,34
Klasse R EUR thesaurierend	1,44
Klasse X USD thesaurierend	1,19
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,19
Klasse X EUR, thesaurierend	1,20
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,19
Klasse X GBP, thesaurierend	1,19
Klasse X GBP, ausschüttend (A)	1,19
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,84
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,84
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,85
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,84
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,84
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,84
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,98
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,99
Klasse A EUR, thesaurierend	1,99
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,99
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	2,00
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	1,99
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,99
Klasse C USD, thesaurierend	2,48
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,49
Klasse E USD, thesaurierend	2,73
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,75
Klasse E EUR thesaurierend	2,74
Klasse F USD, thesaurierend	1,39
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,40
Klasse R USD, thesaurierend	1,49
Klasse X USD thesaurierend	1,24
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,89
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,89
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	0,89
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,15
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,39
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,89

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) – *(Fortsetzung)*

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,84
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	1,84
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,84
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,84
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,84
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,84
Klasse A EUR, thesaurierend	1,84
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,84
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	1,84
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,84
Klasse B USD, thesaurierend	2,34
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,34
Klasse C USD, thesaurierend	2,34
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,34
Klasse F USD, thesaurierend	1,24
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,83
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,84
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,84
Klasse LM USD, thesaurierend	0,22
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,22
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,57
Klasse B (G) USD, thesaurierend	2,08
Klasse L (G) USD, thesaurierend	2,07
Klasse GA USD, thesaurierend	1,64
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,63
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,64
Klasse GE USD, thesaurierend	2,39
Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,83
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,83
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,83
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,83
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,83
Klasse A EUR, thesaurierend	1,83
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,83
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,83
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,33
Klasse C USD, thesaurierend	2,33
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,33
Klasse E USD, thesaurierend	2,60
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,61
Klasse F USD, thesaurierend	1,26
Klasse X EUR, thesaurierend	1,16
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,84
Klasse GA USD, thesaurierend	1,78
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,78
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,78
Klasse GE USD, thesaurierend	2,53
Klasse GE EUR, thesaurierend	2,52
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,53
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,53
Klasse A EUR, thesaurierend	1,55
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	1,53
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,04
Klasse C USD, thesaurierend	2,02
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,03
Klasse E USD, thesaurierend	2,28
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,63
Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund	
Klasse A USD, thesaurierend	1,83
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,83
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,83
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,84
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,84
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,82
Klasse GA USD, thesaurierend	1,84
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,84
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,84
Klasse GE USD, thesaurierend	2,59
Klasse GE EUR, thesaurierend	2,59

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,98
Klasse M GBP, ausschüttend (A)	1,20
Klasse F USD, thesaurierend	1,40
Klasse M USD, ausschüttend (A)	1,20
Klasse M EUR ausschüttend (A)	1,20
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,76
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,76
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^* **	
Klasse A (PF) USD, thesaurierend	2,48
Klasse A (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	2,45
Klasse A (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)	2,36
Klasse A (PF) EUR, thesaurierend	2,46
Klasse A (PF) EUR, ausschüttend (A)	2,29
Klasse A (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)	2,35
Klasse F (PF) USD, thesaurierend	2,01
Klasse F (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	2,01
Klasse J (PF) NOK, thesaurierend (abgesichert)	1,10
Klasse M (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,82
Klasse M (PF) EUR, thesaurierend	1,96
Klasse M (PF) EUR ausschüttend (M)	1,80
Klasse M (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,80
Klasse M (PF) NOK, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,79
Klasse M (PF) SEK, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,80
Klasse Premier (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	1,65
Klasse Premier (PF) BRL, thesaurierend (abgesichert)	1,87
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,97
Klasse A EUR, thesaurierend	1,98
Klasse E USD, thesaurierend	2,75
Klasse X EUR, thesaurierend	1,25
Klasse X GBP, thesaurierend	1,23
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,23
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,89
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,89
Klasse S USD, thesaurierend	0,79
Klasse S GBP, thesaurierend	0,54
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	2,00
Klasse A AUD, ausschüttend (M) Plus	2,00
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus (e)	2,00
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	2,00
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,60
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,60
Klasse D HKD, ausschüttend (M) Plus	1,60
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,60
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	1,60
Klasse D USD, thesaurierend	1,60
Klasse X AUD, thesaurierend	1,25
Klasse X USD thesaurierend	1,25
Klasse S GBP, thesaurierend	0,57
Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)	0,57
Klasse LM AUD, thesaurierend	0,15
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	
Klasse A USD thesaurierend	1,99
Klasse E USD, thesaurierend	2,75
Klasse F USD, thesaurierend	1,40
Klasse X USD thesaurierend	1,24
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,89
Klasse S USD, thesaurierend	0,69
Klasse S EUR, thesaurierend	0,69
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,98
Klasse X EUR, thesaurierend	1,23
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,88
Klasse S EUR, thesaurierend	0,48

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) – *(Fortsetzung)*

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) für das Geschäftsjahr zum 31. August 2020**
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	
Klasse A (PF) USD, thesaurierend	0,00
Klasse A (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	0,00
Klasse A (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,07
Klasse A (PF) EUR, thesaurierend	0,00
Klasse A (PF) EUR, ausschüttend (A)	0,00
Klasse A (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,06
Klasse F (PF) USD, thesaurierend	0,00
Klasse F (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	0,00
Klasse J (PF) JPY, thesaurierend (abgesichert)	0,00
Klasse M (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,02
Klasse M (PF) EUR, thesaurierend	0,00
Klasse M (PF) EUR ausschüttend (M)	0,00
Klasse M (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,00
Klasse M (PF) NOK, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,00
Klasse M (PF) SEK, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,00
Klasse Premier (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	0,04
Klasse Premier (PF) BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,24

Die Berechnungsmethode für die Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) ist auf der Website der Swiss Funds and Asset Management Association (SFAMA) (www.sfama.ch) beschrieben.

(1) WE = Währungseinheiten in der Rechnungslegungswährung des Fonds.

** Für Zeiträume unter einem Jahr auf das Jahr hochgerechnet

*** TER einschließlich der Leistungsgebühr

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands

Für den Zeitraum zum 31. August 2020

Gemäß den OGAW-Verordnungen wird eine Aufstellung über die wichtigsten Veränderungen in der Zusammensetzung des Anlageportfolios jedes Fonds während des Berichtszeitraums vorgelegt, um zu gewährleisten, dass die Anteilsinhaber die Veränderungen in den Anlagen der einzelnen Fonds erkennen können. Diese bestehen aus den Gesamtankäufen und -verkäufen einer Investition (einschließlich der Fälligkeiten und ausschließlich der Rückkaufvereinbarungen, Diskontanleihen und Termingeldanlagen, die von einem Tag auf den anderen getätigt werden und die hauptsächlich dazu dienen, die Portfolios effizient zu verwalten), die 1,00 % des Gesamtwertes der Ankäufe und Verkäufe für das Geschäftsjahr übersteigen. Es werden mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe aufgeführt. Hat ein Fonds während des Berichtszeitraums weniger als zwanzig Käufe oder Verkäufe getätigt, sind alle Transaktionen aufgeführt.

Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 14.07.2020	159.774
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 09.06.2020	137.305
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 21.07.2020	122.902
Federal Home Loan Bank Discount Note, Null-Coupon, fällig 09.03.2020	96.742
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 12.05.2020	73.465
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 05.03.2020	65.742
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 16.07.2020	64.931
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 17.09.2020	64.604
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 03.09.2020	59.913
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 27.08.2020	57.655
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 07.07.2020	57.361
Federal National Mortgage Association Discount Notes, Null-Coupon, fällig 29.07.2020	54.556
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 22.09.2020	50.271
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 04.06.2020	50.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 07.05.2020	50.000
Federal Home Loan Mortgage Corporation Discount Note, Null-Coupon, fällig 20.08.2020	49.986
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 04.09.2020	49.981
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 25.02.2021	49.970
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 18.02.2021	49.970
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 28.05.2020	48.731
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 19.05.2020	48.593
Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 16.11.2020	48.493
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 18.06.2020	47.387
Federal Home Loan Mortgage Corporation Discount Note, Null-Coupon, fällig 12.08.2020	45.312
Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 08.03.2020	44.995
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 24.09.2020	44.995
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 18.06.2020	40.664
Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 02.07.2020	37.631
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 01.10.2020	35.001
Federal National Mortgage Association Floating Rate Note, fällig 05.06.2020	34.380
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 16.03.2020	31.690
Federal Home Loan Banks, 0,130%, fällig 03.03.2021	30.000
Federal Home Loan Banks, Series 0, 0,135%, fällig 24.06.2021	30.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 23.07.2020	30.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 27.10.2020	29.987
United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 15.12.2020	29.980
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 21.01.2021	29.980
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 20.08.2020	29.519
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 11.06.2020	28.028

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 14.07.2020	159.782
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 09.06.2020	137.315
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 21.07.2020	122.917
Federal Home Loan Bank Discount Note, Null-Coupon, fällig 09.03.2020	96.750
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 12.05.2020	73.469
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 05.03.2020	65.746
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 04.06.2020	65.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 16.07.2020	64.935
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 27.08.2020	57.665
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 07.07.2020	57.368
Federal National Mortgage Association Discount Notes, Null-Coupon, fällig 29.07.2020	54.575
Federal Home Loan Mortgage Corp, 1,580%, fällig 13.04.2020	50.000
Federal Home Loan Mortgage Corporation Discount Note, Null-Coupon, fällig 20.08.2020	50.000
Federal National Mortgage Association, 1,680%, fällig 30.04.2020	50.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 14.04.2020	50.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 23.04.2020	50.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 07.05.2020	50.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 28.05.2020	48.734
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 19.05.2020	48.596
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 18.08.2020	47.389
Federal Home Loan Mortgage Corporation Discount Note, Null-Coupon, fällig 12.08.2020	45.360
Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 08.03.2020	45.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 02.03.2020	42.606
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 18.06.2020	40.660
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 17.04.2020	38.352
Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 10.07.2020	38.104
Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 02.07.2020	37.636
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 08.05.2020	37.000
Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 21.08.2020	35.000
Federal National Mortgage Association Floating Rate Note, fällig 05.06.2020	34.386
Freddie Mac Discount Notes, Series RB, Null-Coupon, fällig 30.04.2020	33.800
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 16.03.2020	31.693
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 23.07.2020	30.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 20.08.2020	29.519
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 11.06.2020	28.030
Federal Home Loan Mortgage Corporation Discount Note, Null-Coupon, fällig 19.08.2020	26.057

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	114.452
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	25.599
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000%	25.477
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500%	24.321
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	19.812
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	16.671
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	15.838
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500%	11.200
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000%	9.875
United States Treasury Note/Bond, 2,000%, fällig 15.02.2050	8.410
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000%	7.955
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	7.253
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	7.134
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	6.925
United States Treasury Note/Bond, 0,500%, fällig 30.06.2027	6.255
United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 15.05.2050	5.731
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 2,000%	5.047
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000%	4.970
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000%	4.899
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500%	4.845

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	125.351
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	26.361
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000%	25.478
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500%	24.344
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	22.019
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	19.848
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	16.742
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500%	11.154
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000%	9.875
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500%	7.892
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	7.283
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	7.160
United States Treasury Note/Bond, 1,500%, fällig 30.09.2024	7.031
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	6.924
Fannie Mae Pool 'CA4807', 3,500%, fällig 01.12.2049	6.485
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 2,000%	5.045
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000%	4.971
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,250%, fällig 15.02.2050	4.948
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000%	4.911
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000%	4.863

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 0,250%, fällig 31.05.2025	157.070
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500%	100.003
Fannie Mae, 30 year, TBA, 2,500%	85.143
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500%	74.415
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,000%	69.737
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500%	66.793
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500%	61.171
Fannie Mae, 30 year, TBA, 2,500%	60.121
Fannie Mae, 15 year, TBA, 2,500%	56.020
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,500%	54.790
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,000%	46.629
Fannie Mae, 15 year, TBA, 2,000%	39.961
Fannie Mae, 15 year, TBA, 2,000%	39.680
Fannie Mae, 15 year, TBA, 2,000%	39.625
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,500%	35.685
United States Treasury Note/Bond, 2,000%, fällig 15.02.2050	32.434
Fannie Mae, 30 year, TBA, 2,000%	32.419
United States Treasury Note/Bond, 0,500%, fällig 30.06.2027	31.596
Fannie Mae, 15 year, TBA, 2,500%	28.003
Fannie Mae, 15 year, TBA, 2,500%	27.544
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,000%	24.121

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500%	104.247
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500%	94.169
Fannie Mae, 30 year, TBA, 2,500%	85.355
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500%	74.913
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,000%	69.739
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,500%	61.171
Fannie Mae, 30 year, TBA, 2,500%	60.087
Fannie Mae, 15 year, TBA, 2,500%	56.020
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,500%	54.790
United States Treasury Note/Bond, 3,000%, fällig 15.02.2048	54.311
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,000%	46.648
Fannie Mae, 15 year, TBA, 2,000%	40.030
Fannie Mae, 15 year, TBA, 2,000%	39.749
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,500%	35.709
United States Treasury Note/Bond, 2,250%, fällig 15.08.2049	31.982
Fannie Mae, 15 year, TBA, 2,500%	27.997
Fannie Mae, 15 year, TBA, 2,500%	27.655
United States Treasury Note/Bond, 3,000%, fällig 15.02.2049	25.479
United States Treasury Note/Bond, 3,125%, fällig 15.05.2048	25.332
Fannie Mae, 30 year, TBA, 3,500%	25.198
Fannie Mae, 30 year, TBA, 4,000%	24.121
Freddie Mac, 2,500%, fällig 01.08.2050	21.868

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	7.110
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250%, fällig 15.02.2027	4.324
Indonesia Government International Bond, 4,200%, fällig 15.10.2050	2.048
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 144A, 1,800%, fällig 25.07.2040	1.459
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,250%, fällig 15.02.2050	897
Abu Dhabi Government International Bond, 3,875%, fällig 16.04.2050	539
Kuwait International Government Bond, 3,500%, fällig 20.03.2027	526
Qatar Government International Bond, 4,625%, fällig 02.06.2046	518
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 98, 4,750%, fällig 04.07.2028	476
AbbVie Inc, 144A, 1,250%, fällig 01.06.2024	428
Barclays Plc, 3,375%, fällig 02.04.2025	359
Coca-Cola Co/The, 4,200%, fällig 25.03.2050	273
Boeing Co/The, 5,150%, fällig 01.05.2030	267
CSC Holdings LLC, 144A, 4,125%, fällig 01.12.2030	260
Credit Suisse Group AG, 3,250%, fällig 02.04.2026	229
Morgan Stanley, 3,622%, fällig 01.04.2031	208
Home Depot Inc/The, 3,350%, fällig 15.04.2050	207
Bayer AG, 2,375%, fällig 12.11.2079	191
Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250%, fällig 15.05.2029	165
Virgin Media Secured Finance Plc, 5,000%, fällig 15.04.2027	163

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
European Financial Stability Facility, 0,750%, fällig 03.05.2027	4.832
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	4.575
Republic of Poland Government Bond, Series 0428, 2,750%, fällig 25.04.2028	4.071
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500%, fällig 15.04.2024	3.526
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,000%, fällig 01.12.2025	2.754
Sweden Government Bond, Series 1053, 3,500%, fällig 30.03.2039	1.672
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,186%, fällig 26.05.2020	1.401
Norway Government Bond, Series 481, 144A, 1,750%, fällig 06.09.2029	1.326
General Electric Co, 0,375%, fällig 17.05.2022	1.181
Bank of Nova Scotia/The, 0,221%, fällig 05.10.2022	1.136
Nykredit Realkredit A/S, 0,145%, fällig 02.06.2022	906
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0,046%, fällig 03.06.2020	900
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,250%, fällig 01.09.2046	837
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,850%, fällig 25.07.2027	742
Spain Government Bond, 144A, 2,900%, fällig 31.10.2046	734
Toronto-Dominion Bank/The, 0,375%, fällig 27.04.2023	614
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4,500%, fällig 01.03.2024	584
Spain Government Bond, 0,450%, fällig 31.10.2022	541
European Stability Mechanism, Series EUR, 0,750%, fällig 05.09.2028	528
Kingdom of Belgium Government Bond, Series 71, 3,750%, fällig 22.06.2045	513
Spain Government Bond, 144A, 1,300%, fällig 31.10.2026	511
French Republic Government Bond OAT, 3,250%, fällig 25.05.2045	498
Landwirtschaftliche Rentenbank, 0,050%, fällig 18.12.2029	449
Allergan Funding SCS, 1,250%, fällig 01.06.2024	428

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Altice France SA/France, 144A, 7,375%, fällig 01.05.2026	426
Century Communities Inc, 5,875%, fällig 15.07.2025	288
Delta Air Lines Inc, 2,900%, fällig 28.10.2024	264
Tenet Healthcare Corp, 6,750%, fällig 15.06.2023	248
Tenet Healthcare Corp, 8,130%, fällig 01.04.2022	243
Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,250%, fällig 01.07.2025	216
Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500%, Perpetual	213
Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303%, fällig 30.05.2024	210
UBS Group AG, 144A, 7,000%, Perpetual	210
EQM Midstream Partners LP, 4,000%, fällig 01.08.2024	207
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017%, fällig 26.06.2024	203
Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500%, fällig 15.01.2026	201
Clear Channel International BV, 144A, 6,625%, fällig 01.08.2025	200
Ford Motor Credit Co LLC, 5,125%, fällig 16.06.2025	200
Sands China Ltd, 144A, 3,800%, fällig 08.01.2026	200
Vertical US Newco Inc, 144A, 5,250%, fällig 15.07.2027	200
Delta Air Lines Inc, 7,375%, fällig 15.01.2026	191
Ford Motor Credit Co LLC, 3,087%, fällig 09.01.2023	178
Western Midstream Operating LP, 4,100%, fällig 01.02.2025	166
Greif Inc, 144A, 6,500%, fällig 01.03.2027	147

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu, 5,331%, fällig 15.07.2021	310
Tenet Healthcare Corp, 6,750%, fällig 15.06.2023	277
Tenet Healthcare Corp, 8,130%, fällig 01.04.2022	264
Virgin Media Finance Plc, 5,750%, fällig 15.01.2025	257
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2004-AR7, Series 2004 AR7, Class A2, 1,035%, fällig 25.09.2034	231
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125%, fällig 31.01.2025	215
Rockies Express Pipeline LLC, 5,625%, fällig 15.04.2020	211
Fannie Mae Pool 'CA5227', 3,000%, fällig 01.02.2050	209
Trivium Packaging Finance BV, 5,500%, fällig 15.08.2026	205
Service Corp International/US, 5,375%, fällig 15.05.2024	204
CSC Holdings Llc, 5,375%, fällig 15.07.2023	203
Alcoa Nederland Holding BV, 6,750%, fällig 30.09.2024	199
Valvoline Inc, 5,500%, fällig 15.07.2024	187
Match Group Inc, 6,375%, fällig 01.06.2024	186
MGM Resorts International, 6,000%, fällig 15.03.2023	180
Cleaver-Brooks Inc, 7,875%, fällig 01.03.2023	149
Sysco Corporations, 5,950%, fällig 01.04.2030	145
1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 3,875%, fällig 15.01.2028	138
Centene Corp, 4,250%, fällig 15.12.2027	137
CIT Group Inc, 4,750%, fällig 16.02.2024	135
Centene Corp, 6,125%, fällig 15.02.2024	134
Ally Financial Inc, 7,500%, fällig 15.09.2020	132
GFL Environmental Inc, 5,375%, fällig 01.03.2023	123
Caesars Entertainment Inc, 144A, 5,750%, fällig 01.07.2025	121

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Wesco Distributions Inc, 7,125%, fällig 15.06.2025	117
Newell Brands Inc, 4,875%, fällig 01.06.2025	116
Four Seasons Hotels Ltd, 3,645%, fällig 30.11.2023	108
Kraft Heinz Foods Co, 3,875%, fällig 15.05.2027	106
XPO Logistics Inc, 6,750%, fällig 15.08.2024	104
Standard Industries Inc/NJ, 5,375%, fällig 15.11.2024	103
Montage Resources Corp, 8,875%, fällig 15.07.2023	102
Four Seasons Hotels Ltd, 2,161%, fällig 30.11.2023	101
RR Donnelley & Sons Co, 6,500%, fällig 15.11.2023	101

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Ac-cumulating	6.392
BNP Paribas SA, 7,375%, Perpetual	3.693
Republic of South Africa Government International Bond, 5,750%, fällig 30.09.2049	3.604
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6225, 7,250%, fällig 10.05.2034	3.542
Ford Motor Co, 8,500%, fällig 21.04.2023	3.160
Qatar Government International Bond, 3,400%, fällig 16.04.2025	3.130
Abu Dhabi Government International Bond, 2,500%, fällig 16.04.2025	3.006
UBS Group AG, 7,000%, Perpetual	2.696
Bertelsmann SE & Co KGaA, 3,000%, fällig 23.04.2075	2.399
Egypt Government International Bond, 5,750%, fällig 29.05.2024	2.330
Mercialys SA, 4,625%, fällig 07.07.2027	2.214
Israel Government International Bond, 3,875%, fällig 03.07.2050	2.210
Diversified Healthcare Trust, 9,750%, fällig 15.06.2025	2.210
EC Finance Plc, 2,375%, fällig 15.11.2022	2.154
Fiat Chrysler Automobiles NV, 3,875%, fällig 05.01.2026	2.022
Novafives SAS, 5,000%, fällig 15.06.2025	1.818
Saga Plc, 3,375%, fällig 12.05.2024	1.817
Coca-Cola Co/The, 4,200%, fällig 25.03.2050	1.810
3M Co, 3,700%, fällig 15.04.2050	1.807
NVIDIA Corp, 3,500%, fällig 01.04.2050	1.791
Cooperatieve Rabobank UA, 6,625%, Perpetual	1.759
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250%, fällig 15.08.2027	1.728
Wells Fargo & Co, 5,013%, fällig 04.04.2051	1.724
Bristol-Myers Squibb Co, 5,000%, fällig 15.08.2045	1.704
Ivory Coast Government International Bond, 5,250%, fällig 22.03.2030	1.681
Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000%, fällig 01.05.2025	1.680
Intesa Sanpaolo SpA, 5,500%, Perpetual	1.653
UniCredit SpA, 5,459%, fällig 30.06.2035	1.630
Boeing Co/The, 4,875%, fällig 01.05.2025	1.580
Centene Corp, 4,625%, fällig 15.12.2029	1.560
VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 4,625%, fällig 01.12.2029	1.536
Argentina Treasury Bond BONCER, Series CER, 1,000%, fällig 05.08.2021	1.515
AbbVie Inc, 144A, 4,850%, fällig 15.06.2044	1.484
Republic of South Africa Government Bond, Series 2037, 8,500%, fällig 31.01.2037	1.477
Bank Of America Corp, Variable Rate, fällig 31.03.2029	1.465
Romanian International Government Bond, 2,000%, fällig 28.01.2032	1.457
Verizon Communications Inc, 4,000%, fällig 22.03.2050	1.404
Peruvian Government International Bond, 2,392%, fällig 23.01.2026	1.400
NCL Corp Ltd, 144A, 10,250%, fällig 01.02.2026	1.390

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 2,250%, fällig 15.11.2024	32.523
United States Treasury Note/Bond, 1,750%, fällig 31.03.2022	23.298
United States Treasury Note/Bond, 2,875%, fällig 31.10.2023	18.774
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212, 7,050%, fällig 19.01.2028	9.026
United States Treasury Note/Bond, 3,000%, fällig 15.11.2045	8.140
United States Treasury Note/Bond, 2,250%, fällig 15.08.2046	8.009
Colombia Government International Bond, 5,625%, fällig 26.02.2044	6.354
Mexican Bonos, Series M 20, 7,500%, fällig 03.06.2027	6.051
Fannie Mae Pool 'CA5227', 3,000%, fällig 01.02.2050	5.995
Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset US High Yield Fund – LM Class US$ Distributing (M)	5.610
United States Treasury Note/Bond, 2,875%, fällig 15.11.2046	5.321
Lone Star Portfolio Trust 2015-LSP, Series 2015 LSP, Class F, 144A, 8,809%, fällig 15.09.2028	4.778
Freeport-McMoRan Inc, 5,450%, fällig 15.03.2043	3.173
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6225, 7,250%, fällig 10.05.2034	3.157
Mexican Bonos, Series M, 7,750%, fällig 13.11.2042	3.105
Telecom Italia Finance SA, 7,750%, fällig 24.01.2033	3.074
Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,125%, fällig 15.11.2022	2.703
CVS Health Corp, 4,100%, fällig 25.03.2025	2.696
Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 7,000%, fällig 30.09.2026	2.646
Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 4,875%, fällig 19.06.2024	2.317
Mexican Bonos, Series M, 6,500%, fällig 09.06.2022	2.268

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	64.707
Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250%, fällig 15.02.2029	1.630
Tenet Healthcare Corp, 144A, 4,625%, fällig 15.06.2028	1.223
Kraft Heinz Foods Co, 144A, 5,500%, fällig 01.06.2050	1.158
Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500%, fällig 20.06.2027	1.077
Delta Air Lines Inc, 5,750%, fällig 29.04.2023	1.003
Sysco Corporation, 5,950%, fällig 01.04.2030	958
Lamb Weston Holdings Inc, 144A, 4,875%, fällig 01.11.2026	955
Delta Air Lines Inc, 7,375%, fällig 15.01.2026	947
Ball Corp, 2,875%, fällig 15.08.2030	920
International Game Technology Plc, 144A, 5,250%, fällig 15.01.2029	888
Vertical US Newco Inc, 144A, 5,250%, fällig 15.07.2027	881
VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 4,125%, fällig 15.08.2030	871
SunOpta Foods Inc, 144A, 9,500%, fällig 09.10.2022	839
Ford Motor Co, 9,000%, fällig 22.04.2025	829
Ford Motor Credit Co LLC, 3,087%, fällig 09.01.2023	828
Diversified Healthcare Trust, 9,750%, fällig 15.06.2025	820
United Airlines, 6,250%, fällig 25.06.2027	794
Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500%, fällig 15.09.2024	792
Bausch Health Cos Inc, 144A, 9,000%, fällig 15.12.2025	784

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	68.985
HCA Inc, 5,625%, fällig 01.09.2028	1.697
Freeport-McMoRan Inc, 5,450%, fällig 15.03.2043	1.620
Fidelity & Guaranty Life Holdings Inc, 144A, 5,500%, fällig 01.05.2025	1.141
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,125%, fällig 01.05.2023	1.074
Sysco Corporation, 5,950%, fällig 01.04.2030	1.066
Freeport-McMoRan Inc, 3,550%, fällig 01.03.2022	966
Centene Corp, 144A, 4,625%, fällig 15.12.2029	881
Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,250%, fällig 30.01.2030	865
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500%, fällig 01.04.2025	829
Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250%, fällig 01.04.2026	798
GFL Environmental Inc, 144A, 5,375%, fällig 01.03.2023	780
Service Corp International/US, 5,125%, fällig 01.06.2029	770
Colt Merger Sub Inc, 5,750%, fällig 01.07.2025	767
VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 4,625%, fällig 01.12.2029	762
ADT Security Corp/The, 4,125%, fällig 15.06.2023	752
Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500%, fällig 15.05.2029	716
Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,125%, fällig 15.11.2022	695
CDK Global Inc, 5,875%, fällig 15.06.2026	686
Bausch Health Cos Inc, 144A, 9,000%, fällig 15.12.2025	683

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Colombia Telecommunications SA, 4,950%, fällig 17.07.2030	460
Panama Government International Bond, 4,500%, fällig 01.04.2056	460
Arab Republic of Egypt, 8,875%, fällig 29.05.2050	400
Egypt Government International Bond, 7,625%, fällig 29.05.2032	400
Paraguay Government International Bond, 4,950%, fällig 28.04.2031	400
Petronas Capital Ltd, 4,800%, fällig 21.04.2060	400
State of Israel Government International Bond, 2,750%, fällig 03.07.2030	400
State of Israel Government International Bond, 4,500%, fällig 03.04.2120	400
Qatar Government International Bond, 3,750%, fällig 16.04.2030	399
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA, 4,700%, fällig 07.05.2050	395
Republic of Belarus, 5,875%, fällig 24.02.2026	395
Banco Santander Mexico SA, 5,375%, fällig 17.04.2025	370
Hutama Karya Persero PT, 3,750%, fällig 11.05.2030	302
Fibra Uno Trust 6,390%, fällig 15.01.2050	285
Republic of Peru, 2,783%, fällig 23.01.2031	270
Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064%, fällig 19.08.2050	250
MDGH – GMTN BV, 3,950%, fällig 21.05.2050	250
Prosus NV, 2,031%, fällig 03.08.2032	234
Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 3,125%, fällig 16.04.2030	226
Ukraine Government International Bond, 8,994%, fällig 01.02.2024	217
Country Garden Holdings Co Ltd, 4,750%, fällig 28.09.2023	205
Formento Economico Mexicano SAB, 3,500%, fällig 16.01.2050	205
Abu Dhabi Government International Bond, 2,700%, fällig 02.09.2070	200
Bahrain Government International Bond, 7,375%, fällig 14.05.2030	200
Banco Nacional de Panama, 2,500%, fällig 11.08.2030	200
Cemex SAB de CV, 7,375%, fällig 05.06.2027	200
Egypt Government International Bond, 5,750%, fällig 29.05.2024	200
Elect Global Investments Ltd, 4,850%, Perpetual	200
Finance Department Government of Sharjah, 4,000%, fällig 28.07.2050	200
Guatemala Government Bond, 5,375%, fällig 24.04.2032	200
Industrias Penoles SAB, 4,750%, fällig 06.08.2050	200
Kimberly-Clark De Mexico SA de CV, 2,431%, fällig 01.07.2031	200
MEGlobal Inc, 5,000%, fällig 18.05.2025	200
MEGlobal Canada ULC, 5,875%, fällig 18.05.2030	200
Petronas Capital Ltd, 4,550%, fällig 21.04.2050	200
Prosus NV, 4,027%, fällig 03.08.2050	200
Qatar Government International Bond, 4,400%, fällig 16.04.2050	200
Republic of Guatemala, 144A, 6,125%, fällig 01.06.2050	200
Republic of Guatemala, 6,125%, fällig 01.06.2050	200
State of Israel Government International Bond, 3,875%, fällig 03.07.2050	200
Ukraine Government International Bond, 7,253%, fällig 15.03.2033	200
VTR Comunicaciones SpA, 5,125%, fällig 15.01.2028	200
VTR Finance NV, 6,375%, fällig 15.07.2028	200
Abu Dhabi Government International Bond, 3,125%, fällig 16.04.2030	199
Brazilian Government International Bond, 2,875%, fällig 06.06.2025	199
Fibra Uno Trust 4,869%, fällig 15.01.2030	199
HTA Group Ltd, 7,000%, fällig 18.12.2025	199
Nexa Resources Peru SA, 6,500%, fällig 18.01.2028	199
Qatar Government International Bond, 3,400%, fällig 16.04.2025	199
REC Ltd, 4,750%, fällig 19.05.2023	199
Republic of Armenia International Bond, 3,950%, fällig 26.09.2029	199
Abu Dhabi Government International Bond, 2,500%, fällig 16.04.2025	198
Brazilian Government International Bond, 3,875%, fällig 12.06.2025	198
Ecopetrol SA, 6,875%, fällig 29.04.2030	198
Empresas Public Medellin, 4,375%, fällig 15.02.2021	198
Grupo Energia Bogota SA ESP, 4,875%, fällig 15.05.2030	198
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, 4,750%, fällig 15.05.2025	198
Indonesia Government International Bond, 4,450%, fällig 15.04.2070	198
Mexico Government International Bond, 3,900%, fällig 27.04.2025	198
Oleoducto Central SA, 4,000%, fällig 14.07.2027	198
Eskom Holdings SOC Ltd, 6,350%, fällig 10.08.2028	197
Petronas Capital Ltd, 3,500%, fällig 21.04.2030	197
Dominican Republic International Bond, 4,500%, fällig 30.01.2030	196
Mexico Government International Bond, 4,750%, fällig 27.04.2032	196
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, 5,450%, fällig 15.05.2030	195
Abu Dhabi Government International Bond, 3,875%, fällig 16.04.2050	192
OmGrid Funding Ltd, 5,196%, fällig 16.05.2027	190
Petroleos Mexicanos, 4,625%, fällig 21.09.2023	189
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, 5,800%, fällig 15.05.2050	186
Mexico Government International Bond, 5,000%, fällig 27.04.2051	185
Costa Rica Government International Bond, 6,125%, fällig 19.02.2031	184

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Colombia Telecommunications SA, 4,950%, fällig 17.07.2030	463
First Abu Dhabi Bank PJSC, 5,250%, Perpetual	450
Qatar Government International Bond, 4,817%, fällig 14.03.2049	425
State of Israel Government International Bond, 4,500%, fällig 03.04.2120	415
Qatar Government International Bond, 3,750%, fällig 16.04.2030	406
Arab Republic of Egypt, 8,875%, fällig 29.05.2050	404
State of Israel Government International Bond, 2,750%, fällig 03.07.2030	403
Paraguay Government International Bond, 4,950%, fällig 28.04.2031	401
Republic of Belarus, 5,875%, fällig 24.02.2026	382
Banco Santander Mexico SA, 5,375%, fällig 17.04.2025	371
Transportadora de Gas Internacional SA ESP, 5,550%, fällig 01.11.2028	342
GNL Quintero SA, 144A, 4,634%, fällig 31.07.2029	320
Indonesia Government International Bond, 3,500%, fällig 11.01.2028	310
Republic of Peru, 2,783%, fällig 23.01.2031	292
Fibra Uno Trust 6,390%, fällig 15.01.2050	285
Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 4,875%, fällig 23.04.2030	253
Country Garden Holdings Co Ltd, 7,500%, fällig 09.03.2020	240
Prosus NV, 2,031%, fällig 03.08.2032	237
Export Credit Bank of Turkey, 5,000%, fällig 23.09.2021	228
Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 3,125%, fällig 16.04.2030	225
State of Israel Government International Bond, 3,875%, fällig 03.07.2050	224
Formento Economico Mexicano SAB, 3,500%, fällig 16.01.2050	223
Eskom Holdings SOC Ltd, 6,350%, fällig 10.08.2028	219
Petronas Capital Ltd, 4,800%, fällig 21.04.2060	218
Qatar Government International Bond, 3,400%, fällig 16.04.2025	214
Panama Government International Bond, 4,500%, fällig 01.04.2056	213
Abu Dhabi Government International Bond, 2,500%, fällig 16.04.2025	212
UniCredit SpA, 7,296%, fällig 02.04.2034	212
KazTransGas JSC, 4,375%, fällig 26.09.2027	211
Petronas Capital Ltd, 4,550%, fällig 21.04.2050	210
MDGH – GMTN BV, 3,000%, fällig 19.04.2024	209
Banco del Estado de Chile, 2,704%, fällig 09.01.2025	208
Republic of Guatemala, 6,125%, fällig 01.06.2050	206
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA, 4,700%, fällig 07.05.2050	205
Industrias Penoles SAB, 4,750%, fällig 06.08.2050	205
Republic of Guatemala, 144A, 6,125%, fällig 01.06.2050	205
Bahrain Government International Bond, 7,375%, fällig 14.05.2030	204
DP World Plc, 5,625%, fällig 25.09.2048	204
Nexa Resources Peru SA, 6,500%, fällig 18.01.2028	204
Sri Lanka Government International Bond, 5,875%, fällig 25.07.2022	204
Kimberly-Clark De Mexico SA de CV, 2,431%, fällig 01.07.2031	203
Cemex SAB de CV, 7,375%, fällig 05.06.2027	202
Mersin Uluslararasi Liman Isletmeciligi AS, 5,375%, fällig 15.11.2024	202
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, 5,450%, fällig 15.05.2030	201
Prosus NV, 4,027%, fällig 03.08.2050	201
Ukraine Government International Bond, 7,253%, fällig 15.03.2033	201
VTR Finance NV, 6,375%, fällig 15.07.2028	201
Egypt Government International Bond, 5,750%, fällig 29.05.2024	200
HTA Group Ltd, 7,000%, fällig 18.12.2025	200
MEGlobal Inc, 5,000%, fällig 18.05.2025	200
Abu Dhabi Government International Bond, 3,125%, fällig 16.04.2030	199
Brazilian Government International Bond, 2,875%, fällig 06.06.2025	199
Egypt Government International Bond, 7,625%, fällig 29.05.2032	199
Fibra Uno Trust 4,869%, fällig 15.01.2030	199
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, 4,750%, fällig 15.05.2025	199
Abu Dhabi Government International Bond, 3,875%, fällig 16.04.2050	198
Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT, 4,200%, fällig 23.01.2025	198
Brazilian Government International Bond, 3,875%, fällig 12.06.2025	198
Ecopetrol SA, 6,875%, fällig 29.04.2030	198
Empresas Public Medellin, 4,375%, fällig 15.02.2021	198
Indonesia Government International Bond, 4,450%, fällig 15.04.2070	198
Mexico Government International Bond, 3,900%, fällig 27.04.2025	198
Mexico Government International Bond, 4,750%, fällig 27.04.2032	198
Petronas Capital Ltd, 3,500%, fällig 21.04.2030	198
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, 5,800%, fällig 15.05.2050	193
Sands China Ltd, 5,125%, fällig 08.08.2025	193
TC Ziraat Bankasi AS, 5,125%, fällig 03.05.2022	191
Egypt Government International Bond, 7,053%, fällig 15.01.2032	190
Mexico Government International Bond, 5,000%, fällig 27.04.2051	188
Ghana Government International Bond, 6,375%, fällig 11.02.2027	186

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Banco Santander SA, 5,375%, fällig 17.04.2025	780
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV, 2,431%, fällig 01.07.2031	600
Republic of Paraguay Government Bond,, 4,950%, fällig 28.04.2031	600
Ecopetrol SA, 6,875%, fällig 29.04.2030	595
Trust Fibra Uno, 6,390%, fällig 15.01.2050	591
Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 3,125%, fällig 16.04.2030	564

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Banco Santander SA, 5,375%, fällig 17.04.2025	783
Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 4,875%, fällig 23.04.2030	632
Republic of Paraguay Government Bond,, 4,950%, fällig 28.04.2031	601
Trust Fibra Uno, 6,390%, fällig 15.01.2050	591
Republic of Panama Government Bond, 4,500%, fällig 01.04.2056	541
Qatar Government Bond, 3,750%, fällig 16.04.2030	508

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – (continued)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Republic of Panama Government Bond, 4,500%, fällig 01.04.2056	510
Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064%, fällig 19.08.2050	500
Qatar Government Bond, 3,750%, fällig 16.04.2030	499
Colombia Telecommunication, 4,950%, fällig 17.07.2030	460
HTA Group Ltd, 7,000%, fällig 12.18.2025	418
Fomento Economico Mexicano SAB de CV, 3,500%, fällig 16.01.2050	410
Petronas Capital Ltd, 4,800%, fällig 21.04.2060	400
Republic of Egypt Government Bond, 8,875%, fällig 29.05.2050	400
Egypt Government International Bond, 7,625%, fällig 29.05.2032	400
State of Israel Government Bond, 4,500%, fällig 04.03.2120	400
State of Israel Government Bond, 2,750%, fällig 03.07.2030	400
VTR Comunicaciones SpA, 5,125%, fällig 15.01.2028	400
Industrias Penoles SAB de CV, 4,750%, fällig 06.08.2050	400
Guatemala Government Bond, 6,125%, fällig 01.06.2050	400
Banco Nacional de Panama, 2,500%, fällig 11.08.2030	400
Abu Dhabi Government International Bond, 3,125%, fällig 16.04.2030	398
Brazilian Government Bond, 2,875%, fällig 06.06.2025	398
Nexa Resources Peru SAA, 6,500%, fällig 18.01.2028	397
Abu Dhabi Government International Bond, 2,500%, fällig 16.04.2025	397
Oleoducto Central SA, 4,000%, fällig 14.07.2027	397
Empresa De Transport, 4,700%, fällig 07.05.2050	395
Prosus NV, 2,031%, fällig 03.08.2032	351
CEMEX SAB DE CV, 7,375%, fällig 05.06.2027	300
Republic of Egypt Government Bond, 5,750%, 29.05.2024	300
Ukraine Government International Bond, 7,253%, fällig 15.03.2033	300
Qatar Government Bond, 3,400%, fällig 16.04.2025	299
Qatar Government Bond, 3,400%, fällig 16.04.2025	299
Republic of Indonesia, 4,450%, fällig 05.15.2070	297
Mexico ST, 4,750%, fällig 27.04.2032	293
Tengizchevroil, 3,250%, fällig 15.08.2030	287
Peru Government Bond, 2,783%, fällig 23.01.2031	270
MDGH – GMTN BV, 3,950%, fällig 21.05.2050	250
Mexico ST, 3,900%, fällig 27.04.2025	247

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Colombia Telecommunication, 4,950%, fällig 17.07.2030	464
Qatar Government International Bond, 5,103%, fällig 23.04.2048	452
Petronas Capital Ltd, 4,800%, fällig 21.04.2060	444
HTA Group Ltd, 7,000%, fällig 12.18.2025	421
Industrias Penoles SAB de CV, 4,750%, fällig 06.08.2050	414
State of Israel Government Bond, 4,500%, fällig 04.03.2120	414
Guatemala Government Bond, 6,125%, fällig 01.06.2050	412
Empresa De Transport, 4,700%, fällig 07.05.2050	410
Nexa Resources Peru SAA, 6,500%, fällig 18.01.2028	409
Republic of Egypt Government Bond, 8,875%, fällig 29.05.2050	406
State of Israel Government Bond, 2,750%, fällig 03.07.2030	403
Ecopetrol SA, 6,875%, fällig 29.04.2030	402
Abu Dhabi Government International Bond, 2,500%, fällig 16.04.2025	401
Brazilian Government Bond, 2,875%, fällig 06.06.2025	401
Abu Dhabi Government International Bond, 3,125%, fällig 16.04.2030	399
Western Midstream Operating LP, 5,250%, fällig 01.02.2050	372
Prosus NV, 2,031%, fällig 03.08.2032	355
Fomento Economico Mexicano SAB de CV, 3,500%, fällig 16.01.2050	349
Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 3,125%, fällig 16.04.2030	340
United States Treasury Note/Bond, 1,750%, fällig 31.12.2024	330
Country Garden Holdings Co Ltd, 7,500%, fällig 09.03.2020	310
CEMEX SAB DE CV, 7,375%, fällig 05.06.2027	309
Qatar Government Bond, 3,400%, fällig 16.04.2025	305
Teva Pharmaceutical Finance IV BV, 3,650%, fällig 10.11.2021	304
ICBCIL Finance Co Ltd, 3,250%, fällig 17.03.2020	300
Republic of Egypt Government Bond, 5,750%, 29.05.2024	300
Qatar Government Bond, 3,400%, fällig 16.04.2025	299
Republic of Indonesia, 4,450%, fällig 05.15.2070	297
Mexico ST, 4,750%, fällig 27.04.2032	296
Petrobras Global Finance BV, 6,900%, fällig 19.03.2049	293
Tengizchevroil, 3,250%, fällig 15.08.2030	288

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US$ Distributing (M)	2.995
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500%, fällig 01.05.2032	2.401
United States Treasury Note/Bond, 1,500%, fällig 31.01.2027	1.812
United States Treasury Note/Bond, 2,500%, fällig 15.01.2022	1.297
Delta Air Lines Inc, 5,750%, fällig 29.04.2023	1.199
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, fällig 01.10.2026	1.076
Delta Air Lines Inc, 3,625%, fällig 15.03.2022	1.037
United States Treasury Note/Bond, 1,750%, fällig 31.03.2022	1.031
United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 31.05.2021	1.013
United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 31.01.2021	1.011
Petroleos Mexicanos, 6,625%, fällig 15.06.2035	1.008
Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Ac-cumulating	993
Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000%, fällig 01.05.2025	806
United States Treasury Note/Bond, 0,250%, fällig 30.06.2025	749
United States Treasury Note/Bond, 0,500%, fällig 31.05.2027	738
CSC Holdings LLC, 144A, 4,125%, fällig 01.12.2030	693
Cemex SAB de CV, 144A, 7,375%, fällig 05.06.2027	670
United Airlines Holdings Inc, 4,250%, fällig 01.10.2022	620
United States Treasury Note/Bond, 2,250%, fällig 30.04.2021	613
Argentina Treasury Bond BONCER, Series CER, 1,000%, fällig 05.08.2021	596
Egypt Government International Bond, 144A, 5,577%, fällig 21.02.2023	595
Petroleos Mexicanos, 6,875%, fällig 04.08.2026	578
Aercap Ireland Capital DAC, 3,950%, fällig 01.02.2022	554
TransDigm Inc, 144A, 8,000%, fällig 15.12.2025	554
Ford Motor Credit Co LLC, 4,125%, fällig 17.08.2027	546
Boise Cascade Co, 144A, 4,875%, fällig 01.07.2030	540

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US$ Distributing (M)	7.157
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800%, fällig 21.07.2023	2.257
Brazilian Government International Bond, 4,250%, fällig 07.01.2025	2.103
United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 31.05.2021	2.021
Indonesia Government International Bond, 144A, 4,125%, fällig 15.01.2025	1.796
Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 2,125%, fällig 30.09.2024	1.745
PetSmart Inc, 5,660%, fällig 11.03.2022	1.607
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,413%, fällig 01.02.2024	1.606
Colombia Government International Bond, 4,000%, fällig 26.02.2024	1.337
United States Treasury Note/Bond, 2,500%, fällig 15.01.2022	1.294
United States Treasury Note/Bond, 1,750%, fällig 31.03.2022	1.029
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710%, fällig 15.01.2026	1.021
United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 31.03.2021	1.007
Delta Air Lines Inc, 3,625%, fällig 15.03.2022	991
United States Treasury Note/Bond, 1,500%, fällig 30.11.2021	967
United States Treasury Note/Bond, 0,500%, fällig 31.05.2027	755
Netflix Inc, 144A, 4,875%, fällig 15.06.2030	747
Transportadora de Gas del Peru SA, 144A, 4,250%, fällig 30.04.2028	735
United States Treasury Note/Bond, 1,750%, fällig 30.11.2021	716
Charter Communications Operating LLC, 3,400%, fällig 30.04.2025	715

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 14.07.2020	159.774
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 09.06.2020	137.305
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 21.07.2020	122.902
Federal Home Loan Bank Discount Note, Null-Coupon, fällig 09.03.2020	96.742
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 12.05.2020	73.465
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 05.03.2020	65.742
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 16.07.2020	64.931
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 17.09.2020	64.604
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 03.09.2020	59.913
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 27.08.2020	57.655
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 07.07.2020	57.361

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 14.07.2020	159.782
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 09.06.2020	137.315
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 21.07.2020	122.917
Federal Home Loan Bank Discount Note, Null-Coupon, fällig 09.03.2020	96.750
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 12.05.2020	73.469
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 05.03.2020	65.746
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 04.06.2020	65.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 16.07.2020	64.935
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 27.08.2020	57.665
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 07.07.2020	57.368

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund – (continued)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Federal National Mortgage Association Discount Notes, Null-Coupon, fällig 29.07.2020	54.556
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 22.09.2020	50.271
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 04.06.2020	50.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 07.05.2020	50.000
Federal Home Loan Mortgage Corporation Discount Note, Null-Coupon, fällig 20.08.2020	49.986
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 04.09.2020	49.981
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 25.02.2021	49.970
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 18.02.2021	49.970
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 28.05.2020	48.731
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 19.05.2020	48.593
Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 16.11.2020	48.493
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 18.06.2020	47.387
Federal Home Loan Mortgage Corporation Discount Note, Null-Coupon, fällig 12.08.2020	45.312
Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 08.03.2020	44.995
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 24.09.2020	44.995
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 18.06.2020	40.664
Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 02.07.2020	37.631
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 01.10.2020	35.001
Federal National Mortgage Association Floating Rate Note, fällig 05.06.2020	34.380
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 16.03.2020	31.690
Federal Home Loan Banks, 0,130%, fällig 03.03.2021	30.000
Federal Home Loan Banks, Series 0, 0,135%, fällig 24.06.2021	30.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 23.07.2020	30.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 27.10.2020	29.987
United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 15.12.2020	29.980
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 21.01.2021	29.980
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 20.08.2020	29.519
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 11.06.2020	28.028

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Federal National Mortgage Association Discount Notes, Null-Coupon, fällig 29.07.2020	54.575
Federal Home Loan Mortgage Corp, 1,580%, fällig 13.04.2020	50.000
Federal Home Loan Mortgage Corporation Discount Note, Null-Coupon, fällig 20.08.2020	50.000
Federal National Mortgage Association, 1,680%, fällig 30.04.2020	50.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 14.04.2020	50.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 23.04.2020	50.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 07.05.2020	50.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 28.05.2020	48.734
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 19.05.2020	48.596
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 18.08.2020	47.389
Federal Home Loan Mortgage Corporation Discount Note, Null-Coupon, fällig 12.08.2020	45.360
Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 08.03.2020	45.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 02.03.2020	42.606
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 18.06.2020	40.660
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 17.04.2020	38.352
Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 10.07.2020	38.104
Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 02.07.2020	37.636
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 08.05.2020	37.000
Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 21.08.2020	35.000
Federal National Mortgage Association Floating Rate Note, fällig 05.06.2020	34.386
Freddie Mac Discount Notes, Series RB, Null-Coupon, fällig 30.04.2020	33.800
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 16.03.2020	31.693
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 23.07.2020	30.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 20.08.2020	29.519
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 11.06.2020	28.030
Federal Home Loan Mortgage Corporation Discount Note, Null-Coupon, fällig 19.08.2020	26.057

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	135.068
Korea Treasury Bond, Series 2912, 1,375%, fällig 10.12.2029	42.538
Thailand Government Bond, 3,300%, fällig 17.06.2038	25.104
China Government Bond, Series INBK, 3,390%, fällig 16.03.2050	17.618
Korea Treasury Bond, Series 3909, 1,125%, fällig 10.09.2039	10.222
Export-Import Bank of China/The, Series 1910, 3,860%, fällig 20.05.2029	4.500
Guotai Junan International Holdings Ltd, 2,900%, fällig 12.05.2021	3.603
AIMS APAC REIT, 5,650%, Perpetual	2.922
China SCE Group Holdings Ltd, 5,875%, fällig 10.03.2022	1.588
REC Ltd, 4,750%, fällig 19.05.2023	798
United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 15.05.2050	491

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	139.324
Thailand Government Bond, 3,850%, fällig 12.12.2025	19.227
Singapore Government Bond, 2,750%, fällig 01.03.2046	17.120
Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class M	12.770
India Government Bond, 8,150%, fällig 24.11.2026	10.430
Thailand Government Bond, 2,125%, fällig 17.12.2026	5.767
India Government Bond, 7,170%, fällig 08.01.2028	5.733
Malaysia Government Bond, Series 0118, 3,882%, fällig 14.03.2025	5.447
China Government Bond, 3,380%, fällig 21.11.2024	5.116
Hubei Science & Technology Investment Group Hong Kong Ltd, 4,375%, fällig 05.03.2021	5.043
Indonesia Treasury Bond, Series FR56, 8,375%, fällig 15.09.2026	5.028
HBIS Group Hong Kong Co Ltd, 4,250%, fällig 07.04.2020	5.000
Pelabuhan Indonesia II PT, 5,375%, fällig 05.05.2045	4.984
Monetary Authority of Singapore Bill, Series 84, Null-Coupon, fällig 08.05.2020	4.661
Radiant Access Ltd, 4,600%, Perpetual	4.296
India Government Bond, 7,610%, fällig 09.05.2030	4.099
Tsinghua Unic Ltd, 4,750%, fällig 31.01.2021	4.029
Bank Mandiri Persero Tbk PT, 3,750%, fällig 11.04.2024	3.996
Bank of East Asia Ltd/The, 5,500%, Perpetual	1.995
Chinalco Capital Holdings Ltd, 4,250%, fällig 21.04.2022	1.834

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	159.813
United States Treasury Note/Bond, 1,750%, fällig 31.03.2022	25.997
United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 15.02.2023	11.625
United States Treasury Note/Bond, 1,500%, fällig 15.02.2030	10.054
Inter-American Development Bank, 0,500%, fällig 15.09.2026	7.992
Exxon Mobil Corp, 0,142%, fällig 26.06.2024	6.624
NIKE Inc, 2,400%, fällig 27.03.2025	5.403
Credit Suisse AG/New York NY, 2,800%, fällig 08.04.2022	4.100
Visa Inc, 1,900%, fällig 15.04.2027	3.989
ABN AMRO Bank NV, 0,875%, fällig 15.01.2024	3.479
Westpac Banking Corp, 0,625%, fällig 22.11.2024	3.465
Home Depot Inc/The, 2,500%, fällig 15.04.2027	3.047
UBS Group AG, 2,125%, fällig 04.03.2024	2.705
Comcast Corp, 3,100%, fällig 01.04.2025	2.639
Microsoft Corp, 2,400%, fällig 08.08.2026	2.606
Chevron Corp, 1,554%, fällig 11.05.2025	2.458
Exxon Mobil Corp, 2,992%, fällig 19.03.2025	2.395
Prologis International Funding II SA, 1,750%, fällig 15.03.2028	2.319
Prudential Financial Inc, 1,500%, fällig 10.03.2026	2.111
Caterpillar Inc, 2,600%, fällig 09.04.2030	2.104

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	150.767
United States Treasury Note/Bond, 1,750%, fällig 31.03.2022	25.233
United States Treasury Note/Bond, 2,125%, fällig 31.03.2024	12.285
Credit Agricole SA, 1,250%, fällig 02.10.2024	3.327
Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000%, fällig 13.04.2028	2.238
Credit Suisse AG/New York NY, 2,800%, fällig 08.04.2022	2.007
Bristol-Myers Squibb Co, 144A, 2,900%, fällig 26.07.2024	1.996
AT&T Inc, 3,400%, fällig 15.05.2025	1.891
Boeing Co/The, 3,100%, fällig 01.05.2026	1.606
Diageo Finance Plc, 0,125%, fällig 12.10.2023	1.191
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1,000%, fällig 06.09.2027	891
HSBC Holdings Plc, 1,645%, fällig 18.04.2026	633
American Express Co, 2,650%, fällig 02.12.2022	548
ABB Finance USA Inc, 2,800%, fällig 03.04.2020	450
Estee Lauder Cos Inc/The, 2,600%, fällig 15.04.2030	435
AbbVie Inc, 3,600%, fällig 14.05.2025	400
Airbus Finance BV, 2,375%, fällig 02.04.2024	398
Diageo Finance Plc, 1,500%, fällig 22.10.2027	286
Electricite de France SA, 2,750%, fällig 10.03.2023	254
Caterpillar Inc, 2,600%, fällig 09.04.2030	230

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	16.875
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250%, fällig 15.02.2029	10.456
Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class M	8.595
United States Treasury Note/Bond, 2,500%, fällig 31.01.2021	8.305
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500%	7.459
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	6.944
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	6.394
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	5.694
Japan Government Thirty Year Bond, Series 66, 0,400%, fällig 20.03.2050	5.150
United States Treasury Note/Bond, 1,500%, fällig 30.11.2024	4.755
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	4.570
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, fällig 31.12.2049	3.982
Indonesia Government International Bond, 4,200%, fällig 15.10.2050	3.817
United States Treasury Note/Bond, 2,375%, fällig 15.08.2024	3.708
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	3.318
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,250%, fällig 15.02.2050	3.181
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000%	3.104
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, fällig 31.12.2049	2.860
United States Treasury Note/Bond, 2,875%, fällig 15.05.2049	2.827
French Republic Government Bond OAT, 1,000%, fällig 25.05.2027	2.812
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500%	2.797
Fannie Mae, 3,500%, fällig 01.05.2049	2.707

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	20.963
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500%, fällig 15.04.2024	9.002
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500%	8.194
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	7.754
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500%	7.457
United States Treasury Note/Bond, 2,500%, fällig 31.01.2021	7.202
United States Treasury Note/Bond, 1,625%, fällig 15.08.2022	7.155
Republic of Poland Government Bond, Series 0428, 2,750%, fällig 25.04.2028	6.875
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	6.402
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	5.701
Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class M	5.616
Legg Mason Qualified Investor Funds (II) plc – Legg Mason Western Asset India Bond Fund – LM Class US$ Accumulating	5.201
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	5.143
United States Treasury Note/Bond, 3,000%, fällig 15.11.2045	5.039
Japan Government Ten Year Bond, Series 341, 0,300%, fällig 20.12.2025	4.687
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	4.654
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,250%, fällig 01.09.2046	4.417
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, fällig 31.12.2049	3.989
United States Treasury Note/Bond, 1,625%, fällig 15.11.2022	3.376
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	3.337
United States Treasury Note/Bond, 2,875%, fällig 15.05.2049	3.181
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, fällig 31.12.2049	2.905
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,850%, fällig 25.07.2027	2.834
Norway Government Bond, Series 481, 144A, 1,750%, fällig 06.09.2029	2.815
Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500%, fällig 28.02.2041	2.683
Fannie Mae, 3,500%, fällig 01.05.2049	2.681
United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 31.01.2021	2.622

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	19.507
United States Treasury Note/Bond, 6,250%, fällig 31.03.2027	3.299
United States Treasury Note/Bond, 2,000%, fällig 15.02.2050	1.849
United States Treasury Note/Bond, 1,500%, fällig 15.02.2030	1.770
Autozone Inc, 4,000%, fällig 15.04.2030	1.599
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500%, fällig 15.02.2026	980
United States Treasury Note/Bond, 0,625%, fällig 15.05.2030	914
Isreal State Government Bond, 3,875%, fällig 03.07.2050	890
AbbVie Inc, 144A, 3,200%, fällig 21.11.2029	817
Logicor Financing Sarl, 1,625%, fällig 15.07.2027	782
Lowe's Companies Inc, 4,000%, fällig 15.04.2025	778
Vonovia Finance BV, 2,250%, fällig 07.04.2030	764
United States Treasury Note/Bond, 2,375%, fällig 15.11.2049	748
Comcast Corp, 3,100%, fällig 01.04.2025	710
Airbus SE, 1,375%, fällig 09.06.2026	658
Wells Fargo & Co, 1,338%, fällig 04.05.2025	638
Cigna Corp, 2,400%, fällig 15.03.2030	585
Pepsico Inc, 2,500%, fällig 19.03.2025	564
United States Treasury Note/Bond, 0,375%, fällig 30.04.2025	500
Volkswagen Financial Services NV, 4,250%, fällig 09.10.2025	493

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	19.775
United States Treasury Note/Bond, 6,250%, fällig 31.03.2027	3.287
United States Treasury Note/Bond, 1,500%, fällig 15.02.2030	2.038
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500%, fällig 15.02.2026	1.698
Autozone Inc, 4,000%, fällig 15.04.2030	1.644
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 2007, 4,250%, fällig 04.07.2039	1.406
United States Treasury Note/Bond, 2,000%, fällig 15.02.2050	1.365
Freddie Mac Pool 'QA3734', 3,000%, fällig 01.10.2049	1.134
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, fällig 15.08.2026	1.110
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,218%, fällig 07.03.2022	1.093
Isreal State Government Bond, 3,875%, fällig 03.07.2050	1.027
United States Treasury Note/Bond, 2,375%, fällig 15.11.2049	1.023
Freddie Mac Pool 'QA0245', 3,500%, fällig 01.06.2049	969
Ginnie Mae II Pool 'MA4509', 3,000%, fällig 20.06.2047	961
Lowe's Companies Inc, 4,000%, fällig 15.04.2025	853
United States Treasury Note/Bond, 0,625%, fällig 15.05.2030	838
Indonesia Government International Bond, 5,250%, fällig 17.01.2042	738
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250%, fällig 15.02.2029	724
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250%, fällig 15.02.2027	712
Airbus SE, 1,375%, fällig 09.06.2026	686

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR
Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250%, fällig 15.05.2029	1.654
FCE Bank Plc, 0,869%, fällig 13.09.2021	1.030
Altice France Holding SA, 8,000%, fällig 15.05.2027	1.007
doValue SpA, 5,000%, fällig 04.08.2025	989
Petroleos Mexicanos, 2,750%, fällig 21.04.2027	667
Faurecia SE, 3,750%, fällig 15.06.2028	500
Rebecca Bidco GmbH, 5,750%, fällig 15.07.2025	500
Verisure Holding AB, 3,875%, fällig 15.07.2026	500
PVH Corp, 3,625% fällig 15.07.2024	498
Bertelsmann SE & Co KGaA, 3,000%, fällig 23.04.2075	493
HT Troplast GmbH, 9,250%, fällig 15.07.2025	460
B&M European Value Retail SA, 3,625%, fällig 15.07.2025	333
Fiat Chrysler Automobiles NV, 3,875%, fällig 05.01.2026	330
Novafives SAS, 5,000%, fällig 15.06.2025	303
Gamma Bidco SpA, 6,250%, fällig 15.07.2025	250
Motion Finco SARL, 7,000%, fällig 15.05.2025	250
Parts Europe SA, 6,500%, fällig 16.07.2025	250
Pinnacle Bidco Plc, 6,375%, fällig 15.02.2025	242
Carnival Corp, 10,125%, fällig 01.02.2026	240
TalkTalk Telecom Group Plc, 3,875%, fällig 20.02.2025	233
Mercialys SA, 4,625%, fällig 07.07.2027	197

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Virgin Media Secured Finance Plc, 5,000%, fällig 15.04.2027	1.640
IQVIA INC, 3,250%, fällig 15.03.2025	1.013
YPSO Finance Bis-Anleihe, 8,000%, fällig 15.05.2027	1.007
Kronos International Inc, 3,750%, fällig 15.09.2025	788
Ziggo BV, 4,250%, fällig 15.01.2027	775
Hercule Debtco SARL, 6,750%, fällig 30.06.2024	724
Grifols SA, 1,6250%, fällig 15.02.2025	666
Eurofins Scientific SE, 4,875%, Perpetual	627
PVH Corp, 3,625% fällig 15.07.2024	511
Telecom ITALIA SPA/MILANO, 3,000%, fällig 30.09.2025	510
LKQ European Holdings BV, 3,625%, fällig 01.04.2026	503
Netflix Inc, 3,625%, fällig 15.06.2030	475
Burger King France SAS, 5,249%, fällig 05.01.2023	452
Europcar Mobility Group, 4,000%, fällig 30.04.2026	343
McLaren Finance PLC, 5,000%, fällig 01.08.2022	340
Motion Finco SARL, 7,000%, fällig 15.05.2025	263
Saga Plc, 3,375%, fällig 12.05.2024	262
Pinnacle Bidco Plc, 6,375%, fällig 15.02.2025	254
IDH Finance PLC, 6,250%, fällig 15.08.2022	252
Primo Water Corp, 5,500%, fällig 01.07.2024	230
Telecom Italia Finance SA, 7,750%, fällig 24.01.2033	198

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund – (continued)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR
Synlab BondCO PLC, 4,749%, fällig 01.07.2025	178
Miller Homes Group Holdings Plc, 5,500%, fällig 15.10.2024	159
PLT VII Finance Sarl, 4,625%, fällig 05.01.2026	140
ELM BV for Firmenich International SA, 3,750%, Perpetual	139
Nokia OYJ, 2,375%, fällig 15.05.2025	130
Vertical Midco GmbH, 4,375%, fällig 15.07.2027	120

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Adler Pelzer Holdings GMBH, 4,125%, fällig 01.04.2024	186
Synlab BondCO PLC, 4,749%, fällig 01.07.2025	182
Promontoria HOLDING 264 BV, 6,750%, fällig 15.08.2023	181
Burger King France SAS, 6,000%, fällig 01.05.2024	141
Nokia OYJ, 2,375%, fällig 15.05.2025	132

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	2.185.343
United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 15.05.2050	874.089
United States Treasury Note/Bond, 0,625%, fällig 31.03.2027	660.262
United States Treasury Note/Bond, 0,375%, fällig 31.07.2027	557.820
United States Treasury Note/Bond, 0,500%, fällig 31.05.2027	495.752
United States Treasury Note/Bond, 0,625%, fällig 15.05.2030	336.982
United States Treasury Note/Bond, 0,250%, fällig 30.06.2025	289.388
United States Treasury Note/Bond, 2,000%, fällig 15.02.2050	276.392
United States Treasury Note/Bond, 0,500%, fällig 30.06.2027	246.304
United States Treasury Note/Bond, 0,625%, fällig 15.08.2030	180.639
United States Treasury Note/Bond, 1,500%, fällig 15.02.2030	153.811
United States Treasury Note/Bond, 0,500%, fällig 31.08.2027	101.827
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,850%, fällig 01.09.2049	91.919
United States Treasury Note/Bond, 0,500%, fällig 30.04.2027	91.563
United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 15.08.2050	81.483
Amazon.com Inc, 2,700%, fällig 03.06.2060	77.560
China Government Bond, Series INBK, 3,390%, fällig 16.03.2050	67.470
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6230, 7,700%, fällig 16.03.2039	51.851
Mexican Bonos, Series M, 8,000%, fällig 07.11.2047	51.642
Australia Government Bond, Series 150, 3,000%, fällig 21.03.2047	49.694

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	2.126.754
United States Treasury Note/Bond, 2,375%, fällig 15.11.2049	1.090.272
United States Treasury Note/Bond, 0,625%, fällig 31.03.2027	663.210
United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 15.05.2050	648.812
United States Treasury Note/Bond, 0,375%, fällig 31.07.2027	558.619
United States Treasury Note/Bond, 0,500%, fällig 31.05.2027	497.071
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000%, fällig 15.02.2049	322.984
United States Treasury Note/Bond, 0,250%, fällig 30.06.2025	290.076
United States Treasury Note/Bond, 0,625%, fällig 15.05.2030	270.528
United States Treasury Note/Bond, 0,500%, fällig 30.06.2027	247.394
United States Treasury Note/Bond, 2,000%, fällig 15.02.2050	237.401
United States Treasury Note/Bond, 0,625%, fällig 15.08.2030	180.047
United States Treasury Note/Bond, 1,500%, fällig 15.02.2030	155.400
United States Treasury Note/Bond, 2,250%, fällig 15.08.2049	132.358
United States Treasury Note/Bond, 1,125%, fällig 28.02.2027	105.362
Japanese Government CPI Linked Bond, Series 24, 0,100%, fällig 10.03.2029	104.028
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000%, fällig 01.01.2021	95.641
United States Treasury Note/Bond, 0,500%, fällig 30.04.2027	91.709
United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 15.08.2050	66.056
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,750%, fällig 15.02.2045	57.382

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 31.01.2022	31.557
Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Ac-cumulating	9.379
CWGS Group LLC, 3,500%, fällig 08.11.2023	6.110
Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 3,375%, fällig 31.08.2027	3.710
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA3, Class M3, 5,175%, fällig 25.12.2028	3.696
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Series 2018 WPT, Class FFL, 144A, 3,057%, fällig 05.07.2033	3.696
Sprint Capital Corp, 8,750%, fällig 15.03.2032	3.435
Blackstone Mortgage Trust Inc, 4,375%, fällig 05.05.2022	3.354
American News Co LLC, 144A, 8,500%, fällig 01.09.2026	3.335
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250%, fällig 01.04.2023	3.227
Occidental Petroleum Corp, 7,150%, fällig 15.05.2028	3.197
Ball Corp, 2,875%, fällig 15.08.2030	3.040
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05, Class 1B1, 4,425%, fällig 25.01.2031	3.025
Comstock Resources Inc, 9,750%, fällig 15.08.2026	3.002
Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,750%, fällig 15.04.2025	2.979
Range Resources Corp, 144A, 9,250%, fällig 01.02.2026	2.731
Wynn Resorts Finance LLC, 144A, 7,750%, fällig 15.04.2025	2.683
Altice France Holding SA, 144A, 10,500%, fällig 15.05.2027	2.682
JetBlue Airways Corp, 6,250%, fällig 17.06.2024	2.674
VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 4,125%, fällig 15.08.2030	2.642

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 31.01.2022	31.533
United States Treasury Note/Bond, 1,625%, fällig 15.03.2020	17.561
Fannie Mae Pool 'BM5520', 3,500%, fällig 01.02.2047	6.393
Egypt Treasury Bills, Series 273D, Null-Coupon, fällig 06.10.2020	5.852
GFL Environmental Inc, 144A, 5,375%, fällig 01.03.2023	4.405
Bristol-Myers Squibb Co, 144A, 4,250%, fällig 26.10.2049	3.616
Indonesia Government International Bond, 5,250%, fällig 17.01.2042	3.367
Comstock Resources Inc, 144A, 7,500%, fällig 15.05.2025	3.292
VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 4,625%, fällig 01.12.2029	3.232
Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,125%, fällig 15.11.2022	2.763
Altice Luxembourg SA, 144A, 10,500%, fällig 15.05.2027	2.683
Ypso Finance Bis SA, 144A, 10,500% fällig 05.15.2027	2.682
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500%, fällig 01.04.2025	2.660
Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER, 4,000%, fällig 06.03.2020	2.649
Terrier Media Buyer Inc, 6,148%, fällig 12.12.2026	2.368
Univision Communications Inc, 144A, 5,125%, fällig 15.05.2023	2.310
Fox Corp, 144A, 4,709%, fällig 25.01.2029	2.297
Pioneer Natural Resources Co, 144A, 0,250%, fällig 15.05.2025	2.293
Egypt Treasury Bills, Null-Coupon, fällig 17.03.2020	2.286
Boeing Co/The, 1,650%, fällig 30.10.2020	2.279

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	260.394
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Series 2020 SBT1, Class 1M2, 144A, 3,825%, fällig 25.02.2040	7.500
Citigroup Mortgage Loan Trust 2018-C, Series 2018 C, Class A1, 144A, 4,125%, fällig 25.03.2059	5.684
Credit Suisse European Mortgage Capital, 0,000%, fällig 09.08.2024	5.000
CSWF 2018-TOP, Series 2018 TOP, Class H, 144A, 3,575%, fällig 15.08.2035	4.773
Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3, Series 2017 BNK3, Class E, 144A, 4,686%, fällig 15.02.2050	4.019
Magnolia Finance XI DAC, Series 2019 2, Class A, 144A, 2,925%, fällig 31.07.2021	1.850
Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class D, 144A, 3,662%, fällig 15.11.2027	520
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class D, 144A, 4,544%, fällig 15.08.2036	233

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	365.486
Sunrun Atlas Issuer 2019-2 LLC, Series 2019 2, Class A, 144A, 3,610%, fällig 01.02.2055	14.934
Credit Suisse European Mortgage Capital Ltd, Series 2019 1OTF, Class A, 144A, 4,670%, fällig 09.08.2024	13.582
Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-2, Series 2018 2, Class M, 4,750%, fällig 25.11.2057	12.585
Sonic Capital LLC, Series 2020 1A, Class A2I, 144A, 3,845%, fällig 20.01.2050	12.099
Magnolia Finance XI DAC, Series 2019 2, Class A, 144A, 2,925%, fällig 31.07.2021	11.913
EFS Volunteer No 2 LLC, Series 2012 1, Class A2, 144A, 2,977%, fällig 25.03.2036	10.774
FREMF 2016-K55 Mortgage Trust, Series 2016 K55, Class B, 144A, 4,163%, fällig 25.04.2049	10.625
Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3, Series 2018 3, Class M, 144A, 4,750%, fällig 25.08.2057	10.365

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ – (continued)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-NNN MZ, Series 2020 NNNZ, Class M, 144A, 8,542%, fällig 16.01.2037	175
Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Series 2015 R4, Class 4A3, 144A, 9,101%, fällig 27.01.2030	172
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class E, 144A, 4,544%, fällig 15.08.2036	84
Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Series 2006 1, Class M1, 0,545%, fällig 25.04.2036	53
BCAP LLC 2011-RR4-I Trust, Series 2011 RR4, Class 1A6, 144A, 3,752%, fällig 26.03.2036	41
Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Series 2015 4R, Class 4A7, 144A, 3,642%, fällig 26.03.2037	34
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-2, Series 2005 2, Class M2, 5,717%, fällig 25.04.2035	10
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series 2004-AR5, Series 2004 AR5, Class CB2, 3,662%, fällig 25.06.2034	9
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-5, Series 2005 5, Class MV2, 0,805%, fällig 25.11.2035	9
BCAP LLC 2014-RR2, Series 2014 RR2, Class 10A2, 144A, 0,592%, fällig 26.07.2046	7
Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, Series 2005 9XS, Class M2, 0,825%, fällig 25.06.2035	4

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2007-BC3, Series 2007 BC3, Class 2A4, 1,887%, fällig 25.05.2047	9.800
Motel 6 Trust 2017-MTL6, Series 2017 MTL6, Class B, 144A, 2,849%, fällig 15.08.2034	9.705
CHT 2017-COSMO Mortgage Trust, Series 2017 CSMO, Class B, 144A, 3,059%, fällig 15.11.2036	9.587
BXMT 2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2, Class A, 144A, 2,560%, fällig 16.02.2037	9.396
BCAP LLC 2011-RR4-I Trust, Series 2011 RR4, Class 1A6, 144A, 3,752%, fällig 26.03.2036	9.094
CIT Mortgage Loan Trust 2007-1, Series 2007 1, Class 1M1, 144A, 3,127%, fällig 25.10.2037	9.000
Banc of America Funding 2015-R2 Trust, Series 2015 R2, Class 3A3, 144A, 2,790%, fällig 29.04.2037	8.851
FREMF 2015-K49 Mortgage Trust, Series 2015 K49, Class B, 144A, 3,721%, fällig 25.10.2048	8.293
Connecticut Avenue Securities Trust 2018-R07, Series 2018 R07, Class 1M2, 144A, 4,027%, fällig 25.04.2031	7.976
FREMF 2018-K732 Mortgage Trust, Series 2018 K732, Class B, 144A, 4,055%, fällig 25.05.2025	7.671
Multifamily Connecticut Avenue Securities Trust 2019-01, Series 2019 01, Class M10, 144A, 4,877%, fällig 15.10.2049	7.431

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	156.058
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	131.239
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000%	108.624
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	50.192
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000%	45.255
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	33.464
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500%	32.325
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 2,000%	32.217
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	26.190
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000%	25.000
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	23.130
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000%	22.585
Fannie Mae Pool 'BM5793', 3,000%, fällig 01.04.2049	21.162
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500%	20.675
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500%	20.663
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000%	20.149
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000%	20.111
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500%	19.325
Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000%, fällig 01.10.2046	17.844
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 1,500%	16.042
Fannie Mae Pool, 3,000%, fällig 01.06.2049	15.551
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	15.297
Fannie Mae Pool 'MA3670', 3,000%, fällig 01.05.2049	14.714

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	182.025
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	139.270
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000%	108.646
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500%	75.169
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	33.568
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500%	32.325
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	26.278
Fannie Mae Pool 'BP1661', 3,000%, fällig 01.02.2050	25.994
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000%	25.070
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500%	23.672
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	23.078
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000%	22.929
Fannie Mae Pool, 3,000%, fällig 01.04.2049	21.160
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500%	20.708
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000%	20.327
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000%	20.184
Fannie Mae Pool 'CA5120', 3,000%, fällig 01.02.2050	17.775
Fannie Mae Pool, 3,000%, fällig 01.06.2049	15.545
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	15.297
Fannie Mae Pool 'BD9284', 3,000%, fällig 01.11.2046	14.737

Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) GBP
Bank of America Corp, 6,125%, fällig 15.09.2021	1.257
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Null-Coupon, fällig 15.02.2030	584
Heathrow Funding LTD, 1,500%, fällig 11.02.2030	569
United Kingdom Gilt, 4,250%, fällig 07.12.2040	558
Upjohn Finance BV, 1,908%, fällig 23.06.2032	537
Barclays Plc, 3,375%, fällig 02.04.2025	532
National Grid Electricity Transmission Plc, 2,000%, fällig 17.04.2040	532
Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2,850%, fällig 25.05.2037	511
Assura Financing Plc, 3,000%, fällig 19.07.2028	508
Credit Suisse Group AG, 2,250%, fällig 09.06.2028	498
Guinness Partnership Ltd/The, 2,000%, fällig 22.04.2055	457
United Kingdom Gilt, 1,750%, fällig 07.09.2037	438
United Utilities Water Finance Plc, 1,875%, fällig 03.06.2042	365
Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,750%, fällig 27.04.2030	329
Grainger Plc, 3,000%, fällig 03.07.2030	328
Legal & General Group Plc, 4,500%, fällig 01.11.2050	289
Sanctuary Capital Plc, 2,375%, fällig 14.04.2050	285
Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,000%, fällig 02.06.2040	277
Infineon Technologies AG, 2,000%, fällig 24.06.2032	264
United Kingdom Gilt, 2,000%, fällig 07.09.2025	233
Direct Line Insurance Group, 4,000%, fällig 05.06.2032	199
Experian Finance Plc, 3,250%, fällig 07.04.2032	169
United States Treasury Note/Bond, 2,000%, fällig 15.02.2050	147
Pearson Funding PLC, 3,750%, fällig 04.06.2030	139
CVS Health Corp, 4,125%, fällig 01.04.2040	121
Optivo Finance Plc, 2,857%, fällig 07.10.2035	120

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) GBP
United Kingdom Gilt, 2,750%, fällig 07.09.2024	1.610
European Investment Bank, 5,375%, fällig 07.06.2021	1.005
United Kingdom Gilt, 4,250%, fällig 07.12.2040	841
GE Capital UK Funding Unlimited Co, 5,875%, fällig 04.11.2020	832
Electricite de France SA, 5,500%, fällig 17.10.2041	605
ABN AMRO Bank NV, 1,000%, fällig 30.06.2020	600
Electricite de France SA, 5,500%, fällig 27.03.2037	572
Heathrow Funding LTD, 1,500%, fällig 11.02.2030	563
Upjohn Finance BV, 1,908%, fällig 23.06.2032	551
Wellcome Trust Finance Plc, 4,625%, fällig 25.07.2036	526
Telefonica Emisiones SA, 5,597%, fällig 12.03.2020	500
Infineon Technologies AG, 2,000%, fällig 24.06.2032	271
Legal & General Group Plc, 5,375%, fällig 27.10.2045	248
HCA Inc, 5,250%, fällig 15.06.2049	212
Direct Line Insurance Group, 4,000%, fällig 05.06.2032	203
Clydesdale Bank Plc, 2,250%, fällig 21.04.2020	191
Great Rolling Stock Co Ltd/The, 6,250%, fällig 27.07.2020	156
Pearson Funding PLC, 3,750%, fällig 04.06.2030	143
Home Depot INC, 3,300%, fällig 15.04.2040	28
Home Depot INC, 3,350%, fällig 15.04.2050	19

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	23.672
United States Treasury Note/Bond, 0,625%, fällig 15.05.2030	3.477
United States Treasury Note/Bond, 1,500%, fällig 15.02.2030	1.721
United States Treasury Note/Bond, 2,000%, fällig 15.02.2050	1.415
United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 15.08.2050	1.000
United States Treasury Note/Bond, 1,125%, fällig 28.02.2025	931
Marriott International Inc, 4,625%, fällig 15.06.2030	855
Barclays Plc, 6,125%, Perpetual	840
Credit Suisse Group AG, 144A, 5,250%, Perpetual	840
Huntington Bancshares Inc, 4,450%, fällig 15.01.2169	840
Truist Financial Corp, 4,950%, fällig 01.12.2168	840
United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 15.05.2050	765
United States Treasury Note/Bond, 2,375%, fällig 15.11.2049	751
Alcon Finance Corp, 2,600%, fällig 27.05.2030	669
Broadcom Inc, 5,000%, fällig 15.04.2030	627
Broadcom Inc, 5,000%, fällig 15.04.2030	627
United States Treasury Note/Bond, 0,250%, fällig 31.07.2025	591
Wells Fargo & Co, 5,013%, fällig 04.04.2051	576
Astrazeneca Plc, 2,125%, fällig 06.08.2050	538
Aercap Ireland Capital DAC, 6,500%, fällig 15.07.2025	514

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	21.584
United States Treasury Note/Bond, 0,625%, fällig 15.05.2030	3.169
United States Treasury Note/Bond, 1,500%, fällig 15.02.2030	1.728
United States Treasury Note/Bond, 2,000%, fällig 15.02.2050	1.386
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 2,193%, fällig 25.02.2025	1.174
AbbVie Inc, 144A, 2,300%, fällig 21.11.2022	1.153
United States Treasury Note/Bond, 1,125%, fällig 28.02.2025	929
Marriott International Inc, 4,625%, fällig 15.06.2030	878
Truist Financial Corp, 4,950%, fällig 01.12.2168	846
Huntington Bancshares Inc, 4,450%, fällig 15.01.2169	844
United States Treasury Note/Bond, 2,375%, fällig 15.11.2049	745
Bristol-Myers Squibb Co, 144A, 3,400%, fällig 26.07.2029	721
Alcon Finance Corp, 2,600%, fällig 27.05.2030	678
Royal Bank of Scotland Group Plc, 8,625%, Perpetual	675
American Express Co, 2,500%, fällig 30.07.2024	637
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,200%, fällig 21.07.2021	628
Broadcom Inc, 5,000%, fällig 15.04.2030	627
Santander UK Plc, 144A, 5,000%, fällig 07.11.2023	601
Synchrony Financial, 2,850%, fällig 25.07.2022	567
Prudential Financial Inc, 3,000%, fällig 10.03.2040	566

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	548.778
United States Treasury Floating Rate Note, 0,219%, fällig 30.04.2022	208.538
United Kingdom Gilt, 1,500%, fällig 22.01.2021	115.982
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CAC, 144A, 2,450%, fällig 01.09.2050	40.287
New Zealand Government Bond, 6,000%, fällig 15.05.2021	37.590
Spain Government Bond, 2,700%, fällig 31.10.2048	37.556
United Kingdom Gilt, 2,000%, fällig 22.07.2020	30.287
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4,100%, fällig 15.02.2045	22.207
United States Treasury Floating Rate Note, 0,254%, fällig 31.01.2022	21.777
Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000%, fällig 15.03.2029	20.744
United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 15.05.2050	14.933
Chile Government International Bond, 3,500%, fällig 25.01.2050	14.104
Republic of Poland Government Bond, Series 1020, 5,250%, fällig 25.10.2020	13.010
Australia Government Bond, Series 162, 1,750%, fällig 21.06.2051	11.201
Indonesia Treasury Bond, Series FR68, 8,375%, fällig 15.03.2034	7.792
Peruvian Government International Bond, 2,783%, fällig 23.01.2031	7.099
Philippine Government International Bond, 2,457%, fällig 05.05.2030	4.575
Chile Government International Bond, 2,450%, fällig 31.01.2031	2.999

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	511.980
United States Treasury Floating Rate Note, 0,219%, fällig 30.04.2022	139.747
United States Treasury Floating Rate Note, 1,811%, fällig 31.10.2021	128.957
United States Treasury Floating Rate Note, 1,650%, fällig 30.04.2021	98.803
United Kingdom Gilt, 2,000%, fällig 22.07.2020	96.865
Norway Government Bond, Series 474, 144A, 3,750%, fällig 25.05.2021	53.695
United States Treasury Note/Bond, 2,375%, fällig 15.11.2049	49.730
United States Treasury Floating Rate Note, 1,731%, fällig 31.07.2021	49.578
Spain Government Bond, 2,700%, fällig 31.10.2048	43.251
New Zealand Government Bond, 6,000%, fällig 15.05.2021	38.744
European Bank for Reconstruction & Development, 6,450%, fällig 13.12.2022	31.637
Inter-American Development Bank, 0,155%, fällig 009.10.2020	31.007
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 4,100%, fällig 15.02.2045	26.413
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CAC, 144A, 2,450%, fällig 01.09.2050	22.196
United States Treasury Floating Rate Note, 0,254%, fällig 31.01.2022	21.802
Republic of Poland Government Bond, Series 1020, 5,250%, fällig 25.10.2020	17.805
Republic of Poland Government Bond, Series 0420, 1,500%, fällig 25.04.2020	14.676
United States Treasury Note/Bond, 3,000%, fällig 15.02.2049	13.925
Colombian TES, Series B, 6,000%, fällig 28.04.2028	13.219
Mexican Bonos, Series M, 7,750%, fällig 13.11.2042	11.611

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	414.672
United States Treasury Floating Rate Note, 0,219%, fällig 30.04.2022	112.914
United States Treasury Floating Rate Note, 0,259%, fällig 31.01.2022	45.206
Bank of America Corp, 4,083%, fällig 20.03.2051	18.120
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000%, fällig 01.01.2027	17.427
Bank of Montreal, 0,772%, fällig 10.03.2023	15.870
Australia Government Bond, Series 162, 1,750%, fällig 21.06.2051	12.935
United States Treasury Floating Rate Note, 0,160%, fällig 31.07.2022	11.425
Petroleos Mexicanos, 6,750%, fällig 21.09.2047	7.975
Wells Fargo & Co, 4,478%, fällig 04.04.2031	7.720
Angel Oak Mortgage Trust 2019-6, Series 2019 6, Class A1, 144A, 2,620%, fällig 25.11.2059	7.582
Oracle Corp, 3,600%, fällig 01.04.2050	7.484
General Motors Co, 5,950%, fällig 01.04.2049	7.448
Anglo American Capital Plc, 144A, 5,625%, fällig 01.04.2030	7.338
Southwest Airlines Co, 5,125%, fällig 15.06.2027	7.289
Oracle Corp, 3,850%, fällig 01.04.2060	6.854
Steel Dynamics Inc, 3,250%, fällig 15.01.2031	5.394
Wells Fargo & Co, 5,013%, fällig 04.04.2051	5.290
COMM 2017-PANW Mortgage Trust, Series 2017 PANW, Class D, 144A, 4,343%, fällig 10.10.2029	5.164
Exxon Mobil Corp, 3,452%, fällig 15.04.2051	5.088

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	390.185
United States Treasury Floating Rate Note, 0,259%, fällig 31.01.2022	102.369
United States Treasury Floating Rate Note, 1,650%, fällig 30.04.2021	58.262
United States Treasury Floating Rate Note, 1,731%, fällig 31.07.2021	46.989
United States Treasury Floating Rate Note, 1,811%, fällig 31.10.2021	45.205
General Motors Financial Co Inc, 2,778%, fällig 13.04.2020	26.080
NBCUniversal Enterprise Inc, 144A, 2,309%, fällig 01.04.2021	25.569
United States Treasury Note/Bond, 2,375%, fällig 15.11.2049	22.330
Republic of Poland Government Bond, Series 0420, 1,500%, fällig 25.04.2020	20.727
Mexican Bonos, Series M 20, 8,500%, fällig 31.05.2029	18.253
BMW US Capital LLC, 144A, 2,280%, fällig 06.04.2020	17.721
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000%, fällig 01.01.2021	17.433
National Australia Bank Ltd, 144A, 2,193%, fällig 22.05.2020	15.813
Wells Fargo & Co, 1,270%, fällig 26.07.2021	12.541
Daimler Finance North America LLC, 144A, 0,706%, fällig 22.02.2021	10.691
Goldman Sachs Group Inc/The, 1,006%, fällig 23.02.2023	8.351
American Express Co, 0,849%, fällig 05.11.2021	4.763
Kimberly-Clark Corp, 3,100%, fällig 26.03.2030	4.576
Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000%, fällig 15.03.2029	4.454
Colombian TES, Series B, 6,000%, fällig 28.04.2028	4.246

Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	4.053
Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 6,750%, Perpetual	386
Petrobras Global Finance BV, 5,600%, fällig 03.01.2031	241
Sunac China Holdings Ltd, 8,350%, fällig 19.04.2023	215
Cemex SAB de CV, 7,750%, fällig 16.04.2026	210

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	4.078
BRF SA, 144A, 3,950%, fällig 22.05.2023	263
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 5,125%, fällig 01.05.2027	258
Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu, 5,125%, fällig 15.07.2023	249

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^ – (continued)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 7,625%, fällig 15.06.2025	208
DISH Network Corp, 3,375%, fällig 15.08.2026	205
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250%, fällig 15.08.2027	202
AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375%, fällig 31.05.2030	200
Braskem Netherlands Finance BV, 8,500%, fällig 23.01.2081	200
Ukraine Government International Bond, 7,253%, fällig 15.03.2033	200
Credicorp Ltd, 2,750%, fällig 17.06.2025	199
China Evergrande Group, 6,250%, fällig 28.06.2021	195
Petroleos Mexicanos, 6,950%, fällig 28.01.2060	184
T-Mobile USA Inc, 3,875%, fällig 15.04.2030	184
Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 6,125%, Perpetual	182
Ford Motor Co, 8,500%, fällig 21.04.2023	180
Geopark Ltd, 144A, 5,500%, fällig 17.01.2027	174
Cleveland-Cliffs Inc, 5,875%, fällig 01.06.2027	159
VMware Inc, 4,700%, fällig 15.05.2030	115

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
CSC Holdings LLC, 5,250%, fällig 01.06.2024	247
Univision Communications Inc, 144A, 5,125%, fällig 15.05.2023	247
AES Corp/VA, 4,000%, fällig 15.03.2021	233
Tenet Healthcare Corp, 5,125%, fällig 01.11.2027	212
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 6,000%, fällig 15.02.2025	209
Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 5,250%, fällig 01.12.2021	208
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 144A, 7,125%, fällig 31.01.2025	207
CommScope Inc, 144A, 6,000%, fällig 01.03.2026	206
Credicorp Ltd, 2,750%, fällig 17.06.2025	204
Banco Bradesco SA/Cayman Islands, 144A, 2,850%, fällig 27.01.2023	203
DPL Inc, 7,250%, fällig 15.10.2021	195
Encompass Health Corp, 5,750%, fällig 01.11.2024	193
Perrigo Finance Unlimited Co, 3,900%, fällig 15.12.2024	192
Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 6,750%, Perpetual	190
T-Mobile USA Inc, 3,875%, fällig 15.04.2030	189
AK Steel Corp, 7,500%, fällig 15.07.2023	161
Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 5,875%, fällig 01.06.2027	159
Service Corp International/US, 5,125%, fällig 01.06.2029	145
NortonLifeLock Inc, 144A, 5,000%, fällig 15.04.2025	133
DaVita Inc, 5,000%, fällig 01.05.2025	128
VMware Inc, 4,700%, fällig 15.05.2030	126
Scientific Games International Inc, 6,625%, fällig 15.05.2021	125
ViaSat Inc, 144A, 5,625%, fällig 15.04.2027	124
Iron Mountain US Holdings Inc, 144A, 5,375%, fällig 01.06.2026	122
Steel Dynamics Inc, 5,250%, fällig 15.04.2023	121
Navios South American Logistics Inc / Navios Logistics Finance US Inc, 144A, 7,250%, fällig 01.05.2022	120
Qorvo Inc, 5,500%, fällig 15.07.2026	120

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
United States Treasury Floating Rate Note, fällig 30.04.2022	122.428
United Kingdom Gilt, 1,500%, fällig 22.01.2021	107.851
United Kingdom Gilt, 2,000%, fällig 22.07.2020	35.115
Norway Government Bond, Series 474, 144A, 3,750%, fällig 25.05.2021	23.448
New Zealand Government Bond, 6,000%, fällig 15.05.2021	22.708
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CAC, 144A, 2,450%, fällig 01.09.2050	16.089
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000%, fällig 01.01.2027	11.411
Republic of Poland Government Bond, Series 1020, 5,250%, fällig 25.10.2020	11.301
Bank of America Corp, 4,083%, fällig 20.03.2051	11.257
Bank of Montreal, 0,772%, fällig 10.03.2023	10.665
Spain Government Bond, 144A, 1,000%, fällig 31.10.2050	10.406
Australia Government Bond, Series 162, 1,750%, fällig 21.06.2051	10.158
United States Treasury Floating Rate Note, 1,665%, fällig 31.01.2022	9.765
United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 15.05.2050	9.752
General Electric Co, 4,350%, fällig 01.05.2050	7.607
Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500%, fällig 01.06.2050	5.743
Southwest Airlines Co, 5,125%, fällig 15.06.2027	5.742
FedEx Corp, 5,250%, fällig 15.05.2050	5.284
Wells Fargo & Co, 4,478%, fällig 04.04.2031	4.730
Oracle Corp, 3,600%, fällig 01.04.2050	4.719

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Floating Rate Note, fällig 30.04.2022	122.472
United Kingdom Gilt, 2,000%, fällig 22.07.2020	62.323
United States Treasury Floating Rate Note, 1,731%, fällig 31.07.2021	52.247
United States Treasury Note/Bond, 2,375%, fällig 15.11.2049	47.060
United States Treasury Floating Rate Note, 1,665%, fällig 31.01.2022	34.805
United States Treasury Floating Rate Note, 1,811%, fällig 31.10.2021	31.292
Norway Government Bond, Series 474, 144A, 3,750%, fällig 25.05.2021	29.088
New Zealand Government Bond, 6,000%, fällig 15.05.2021	23.510
United States Treasury Floating Rate Note, 1,650%, fällig 30.04.2021	15.387
Australia Government Bond, Series 128, 5,750%, fällig 15.07.2022	12.891
General Motors Financial Co Inc, 2,778%, fällig 13.04.2020	12.320
Kommunalbanken AS, 144A, 2,224%, fällig 16.06.2020	11.566
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000%, fällig 01.01.2021	11.402
Republic of Poland Government Bond, Series 0420, 1,500%, fällig 25.04.2020	10.523
United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 15.05.2050	9.302
Wells Fargo & Co, 2,819%, fällig 26.07.2021	8.616
United States Treasury Note/Bond, 3,000%, fällig 15.02.2049	8.226
Spain Government Bond, 144A, 1,000%, fällig 31.10.2050	7.488
Queensland Treasury Corp, Series 21, 5,500%, fällig 21.06.2021	6.838
American Express Co, 2,341%, fällig 05.11.2021	6.291
Western Australian Treasury Corp, Series 21, 7,000%, fällig 15.07.2021	6.040
Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 2,146%, fällig 13.01.2023	5.974

Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	506.099
United States Treasury Floating Rate Note, 0,219%, fällig 30.04.2022	81.960
United States Treasury Floating Rate Note, 0,160%, fällig 31.07.2022	39.665
United Kingdom Gilt, 1,500%, fällig 22.01.2021	39.503
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6228, 7,650%, fällig 10.04.2030	36.848
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,850%, fällig 01.09.2049	31.853
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CAC, 144A, 2,450%, fällig 01.09.2050	27.348
Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000%, fällig 15.03.2029	24.505
Spain Government Bond, 1,000%, fällig 31.10.2050	24.124
Corp Nacional del Cobre de Chile, 3,700%, fällig 30.01.2050	23.441
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000%, fällig 01.01.2027	23.299
Petrobras Global Finance BV, 6,900%, fällig 19.03.2049	18.363
Malaysia Government Bond, Series 0111, 4,160%, fällig 15.07.2021	17.925
Hungary Government Bond, Series 30/A, 3,000%, fällig 21.08.2030	14.645
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750%, fällig 28.02.2048	12.607
United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 15.05.2050	11.047
Peruvian Government International Bond, 2,783%, fällig 23.01.2031	10.927
Australia Government Bond, Series 162, 1,750%, fällig 21.06.2051	10.804

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	548.728
United States Treasury Floating Rate Note, 1,650%, fällig 30.04.2021	280.402
United Kingdom Gilt, 2,000%, fällig 22.07.2020	141.457
United States Treasury Note/Bond, 2,375%, fällig 15.11.2049	132.496
United States Treasury Floating Rate Note, 1,731%, fällig 31.07.2021	82.634
Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000%, fällig 15.03.2029	77.296
Mexican Bonos, Series M, 8,000%, fällig 07.11.2047	57.263
Mexican Bonos, Series M 30, 8,500%, fällig 18.11.2038	45.853
United States Treasury Floating Rate Note, 0,259%, fällig 31.01.2022	41.595
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000%, fällig 01.01.2023	37.604
United States Treasury Floating Rate Note, 0,219%, fällig 30.04.2022	34.657
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,850%, fällig 01.09.2049	30.846
Spain Government Bond, 1,000%, fällig 31.10.2050	28.222
Mexican Bonos, Series M, 7,750%, fällig 13.11.2042	28.038
Australia Government Bond, Series 128, 5,750%, fällig 15.07.2022	27.770
United States Treasury Floating Rate Note, 1,811%, fällig 31.10.2021	25.740
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000%, fällig 01.01.2021	23.332
United States Treasury Floating Rate Note, 1,626%, fällig 31.01.2021	22.820

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^ – (continued)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Corp Nacional del Cobre de Chile, 144A, 3,750%, fällig 15.01.2031	7.940
Petrobras Global Finance BV, 5,600%, fällig 03.01.2031	6.535

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480%, fällig 15.03.2023	22.204
Colombian TES, Series B, 10,000%, fällig 24.07.2024	21.478
Colombian TES, Series B, 7,500%, fällig 26.08.2026	20.763
Indonesia Treasury Bond, Series FR68, 8,375%, fällig 15.03.2034	20.700
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6228, 7,650%, fällig 10.04.2030	20.690

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	57.348
United States Treasury Floating Rate Note, 0,219%, fällig 30.04.2022	8.356
Hungary Government Bond, Series 30/A, 3,000%, fällig 21.08.2030	2.881
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 144A, 4,100%, fällig 15.02.2045	2.765
Petrobras Global Finance BV, 5,600%, fällig 03.01.2031	2.647
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000%, fällig 01.01.2023	2.397
DISH Network Corp, 3,375%, fällig 15.08.2026	2.290
Australia Government Bond, Series 162, 1,750%, fällig 21.06.2051	2.035
Amdocs Ltd, 2,538%, fällig 15.06.2030	1.847
Spain Government Bond, Series 30Y, 144A, 2,700%, fällig 31.10.2048	1.731
Blackstone / GSO Secured Lending Fund, 144A, 3,650%, fällig 14.07.2023	1.714
Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 6,125%, Perpetual	1.689
Ford Motor Co, 8,500%, fällig 21.04.2023	1.624
Petroleos Mexicanos, 144A, 6,950%, fällig 28.01.2060	1.528
Bank of America Corp, 4,083%, fällig 20/03/51	1.447
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,850%, fällig 01.09.2049	1.402
General Motors Financial Co Inc, 2,700%, fällig 20.08.2027	1.252
Block Financial LLC, 3,875%, fällig 15.08.2030	1.245
Dow Chemical Co/The, 2,100%, fällig 15.11.2030	1.245
Braskem Netherlands Finance BV, 5,875%, fällig 31.01.2050	1.239

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	51.487
United States Treasury Floating Rate Note, 0,219%, fällig 30.04.2022	4.164
Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 144A, 4,100%, fällig 15.02.2045	4.040
Spain Government Bond, Series 30Y, 144A, 2,700%, fällig 31.10.2048	2.791
Sequoia Mortgage Trust 2017-CH2, Series 2017 CH2, Class A10, 144A, 4,000%, fällig 25.12.2047	2.150
Thornburg Mortgage Securities Trust 2004-2, Series 2004 2, Class A1, 0,795%, fällig 25.06.2044	1.613
Bank of America Corp, 4,083%, fällig 20.03.2051	1.553
Apple Inc, 1,700%, fällig 11.09.2022	1.495
Sprint Corp, 7,250%, fällig 15.09.2021	1.451
Egypt Treasury Bills, Null-Coupon, fällig 31.03.2020	1.448
Mondelez International Holdings Netherlands BV, 144A, 2,125%, fällig 19.09.2022	1.436
Kraft Heinz Foods Co, 3,500%, fällig 06.06.2022	1.417
New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B, Series 2005 B, Class A2D, 0,575%, fällig 25.10.2035	1.269
General Electric Co, 3,150%, fällig 07.09.2022	1.243
Macquarie Bank Ltd, 144A, 2,100%, fällig 17.10.2022	1.175
NortonLifeLock Inc, 144A, 5,000%, fällig 15.04.2025	1.035
Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375%, fällig 15.04.2050	1.010
JPMorgan Chase & Co, 3,200%, fällig 25.01.2023	1.008
Citigroup Inc, 3,500%, fällig 15.05.2023	990
Wells Fargo & Co, 2,625%, fällig 22.07.2022	967

Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	10.368
FREMF 2017-K63 Mortgage Trust, Series 2017 K63, Class C, 144A, 4,004%, fällig 25.02.2050	2.586
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC15, Series 2013 GC15, Class C, 5,386%, fällig 10.09.2046	2.230
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05, Class 1B1, 4,425%, fällig 25.01.2031	2.174
Santander Drive Auto Receivable, 3,350%, fällig 17.07.2023	1.991
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC22, Series 2015 LC22, Class XA, 0,924%, fällig 15.09.2058	1.917
CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC, Series 2017 BIOC, Class B, 144A, 1,132%, fällig 15.07.2032	1.861
Drive Auto Receivables Trust 2020-1, Series 2020 1, Class D, 2,700%, fällig 17.05.2027	1.620
Freddie Mac STACR Trust 2019-HQA2, Series 2019 HQA2, Class M2, 144A, 2,225%, fällig 25.04.2049	1.609
Drive Auto Receivables Trust 2019-3, Series 2019 3, Class D, 3,180%, fällig 15.10.2026	1.602
GS Mortgage Securities Trust 2017-GS5, Series 2017 GS5, Class XA, 0,955%, fällig 10.03.2050	1.544
DISH Network Corp, 3,375%, fällig 15.08.2026	936
Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA2, Series 2019 DNA2, Class M2, 144A, 2,625%, fällig 25.03.2049	844
COMM 2017-PANW Mortgage Trust, Series 2017 PANW, Class D, 144A, 4,343%, fällig 10.10.2029	793
Braskem Netherlands Finance BV, 5,875%, fällig 31.01.2050	690
Angel Oak Mortgage Trust, 2,593%, fällig 25.10.2049	472
Tencent Holdings Ltd, 3,240%, fällig 03.06.2050	470
Hungary Government Bond, Series 30/A, 3,000%, fällig 21.08.2030	347
General Motors Co, 6,750%, fällig 01.04.2046	339
CommScope Inc, 144A, 8,250%, fällig 01.03.2027	330

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	7.850
Santander Drive Auto Receivable, 3,350%, fällig 17.07.2023	2.003
Wells Fargo Re-REMIC Trust 2013-FRR1, Series 2013 FRR1, Class BK20, 144A, 0,000%, fällig 27.05.2045	1.414
Egypt Treasury Bills, Null-Coupon, fällig 17.03.2020	1.276
Bancaja 10 FTA 10, Class C, 0,090%, fällig 22.05.2050	1.275
Egypt Treasury Bills, Series 273D, Null-Coupon, fällig 10.03.2020	1.275
Sprint Corp, 7,250%, fällig 15.09.2021	1.241
TDA 27 FTA 27, Class A3, 0,000%, fällig 28.12.2050	1.178
COMM 2015-LC21 Mortgage Trust, Series 2015 LC21, Class D, 4,305%, fällig 10.07.2048	1.170
Towd Point Mortgage Trust 2017-4, Series 2017 4, Class A1, 144A, 2,750%, fällig 25.06.2057	1.092
COMM 2015-CCRE26 Mortgage Trust, Series 2015 CR26, Class AM, 4,085%, fällig 10.10.2048	1.060
Egypt Treasury Bills, Series 273D, Null-Coupon, fällig 21.04.2020	1.024
Towd Point Mortgage Trust 2017-5, Series 2017 5, Class A1, 144A, 0,775%, fällig 25.02.2057	898
COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust, Series 2014 CR15, Class B, 4,696%, fällig 10.02.2047	859
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C9, Series 2013 C9, Class D, 144A, 4,122%, fällig 15.05.2046	824
RMAC Securities No 1 Plc, Series 2006 NS1X, Class B1C, 0,529%, fällig 12.06.2044	727
Egypt Treasury Bills, Null-Coupon, fällig 31.03.2020	699
COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust, Series 2014 CR15, Class D, 144A, 4,746%, fällig 10.02.2047	655
COMM 2017-COR2 Mortgage Trust, Series 2017 COR2, Class AM, 3,803%, fällig 10.09.2050	544
Angel Oak Mortgage Trust, 2,593%, fällig 25.10.2049	473
Tencent Holdings Ltd, 3,240%, fällig 03.06.2050	460
LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5, Series 2017 5, Class AS, 144A, 4,021%, fällig 10.03.2050	360
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C33, Series 2015 C33, Class AS, 4,023%, fällig 15.12.2048	314
Petroleos Mexicanos, 7,690%, fällig 23.01.2050	307

Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	4.274
Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 6,750%, Perpetual	386
Petrobras Global Finance BV, 5,600%, fällig 03.01.2031	232
Sunac China Holdings Ltd, 8,350%, fällig 19.04.2023	215
Cemex SAB de CV, 7,750%, fällig 16.04.2026	210

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	4.577
Sprint Corp, 7,250%, fällig 15.09.2021	261
Fiat Chrysler Automobiles NV, 5,250%, fällig 15.04.2023	260
Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu, 144A, 5,125%, fällig 15.07.2023	218
Banco Bradesco SA/Cayman Islands, 144A, 2,850%, fällig 27.01.2023	203

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ – (continued)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 4,125%, fällig 15.08.2026	201
AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375%, fällig 31.05.2030	200
Braskem Netherlands Finance BV, 8,500%, fällig 23.01.2081	200
Ukraine Government International Bond, 7,253%, fällig 15.03.2033	200
China Evergrande Group, 6,250%, fällig 28.06.2021	195
Petroleos Mexicanos, 6,950%, fällig 28.01.2060	180
Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 6,125%, Perpetual	178
Ford Motor Co, 8,500%, fällig 21.04.2023	175
Geopark Ltd, 144A, 5,500%, fällig 17.01.2027	174
T-Mobile USA Inc, 3,875%, fällig 15.04.2030	174
Cleveland-Cliffs Inc, 5,875%, fällig 01.06.2027	135
VMware Inc, 4,700%, fällig 15.05.2030	110
Blackstone / GSO Secured Lending Fund, 3,650%, fällig 14.07.2023	100
Wyndham Destinations Inc, 5,750%, fällig 01.04.2027	99
ViaSat Inc, 144A, 5,625%, fällig 15.09.2025	98

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
First Quantum Minerals Ltd, 7,250%, fällig 15.05.2022	196
Perrigo Finance Unlimited Co, 3,900%, fällig 15.12.2024	192
Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 6,750%, Perpetual	190
DPL Inc, 7,250%, fällig 15.10.2021	189
Tenet Healthcare Corp, 5,125%, fällig 01.11.2027	187
T-Mobile USA Inc, 3,875%, fällig 15.04.2030	178
Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 5,250%, fällig 01.12.2021	162
Univision Communications Inc, 144A, 5,125%, fällig 15.05.2023	161
CSC Holdings LLC, 5,250%, fällig 01.06.2024	158
AK Steel Corp, 7,500%, fällig 15.07.2023	150
AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5,625%, fällig 20.05.2024	150
NortonLifeLock Inc, 144A, 5,000%, fällig 15.04.2025	146
AES Corp/VA, 4,000%, fällig 15.03.2021	144
Encompass Health Corp, 5,750%, fällig 01.11.2024	137
Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 5,875%, fällig 01.06.2027	135
VMware Inc, 4,700%, fällig 15.05.2030	121
Qorvo Inc, 5,500%, fällig 15.07.2026	115
DaVita Inc, 5,000%, fällig 01.05.2025	108
Steel Dynamics Inc, 5,250%, fällig 15.04.2023	106
Kohl's Corp, 9,500%, fällig 15.05.2025	105

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	85.840
United States Treasury Floating Rate Note, 0,219%, fällig 30.04.2022	37.881
United States Treasury Floating Rate Note, 1,665%, fällig 31.01.2022	18.615
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6228, 7,650%, fällig 10.04.2030	13.621
Bank of America Corp, 4,083%, fällig 20.03.2051	6.910
Australia Government Bond, Series 162, 1,750%, fällig 21.06.2051	6.430
Spain Government Bond, 144A, 1,000%, fällig 31.10.2050	6.402
United States Treasury Floating Rate Note, 0,160%, fällig 31.07.2022	5.350
Southwest Airlines Co, 5,125%, fällig 15.06.2027	3.632
Mexican Bonos, Series M, 7,750%, fällig 13.11.2042	3.464
Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000%, fällig 15.03.2029	3.354
Wells Fargo & Co, 4,478%, fällig 04.04.2031	2.895
Petrobras Global Finance BV, 6,750%, fällig 03.06.2050	2.664
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000%, fällig 01.01.2023	2.510
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750%, fällig 28.02.2048	2.337
Apple Inc, 2,650%, fällig 11.05.2050	2.153
Total Capital International SA, 3,127%, fällig 29.05.2050	2.020
General Motors Co, 6,250%, fällig 02.10.2043	1.984
Wells Fargo & Co, 5,013%, fällig 04.04.2051	1.980
Amgen Inc, 3,150%, fällig 21.02.2040	1.971

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	83.957
United States Treasury Floating Rate Note, 1,811%, fällig 31.10.2021	49.246
United States Treasury Floating Rate Note, 0,219%, fällig 30.04.2022	30.854
United States Treasury Floating Rate Note, 1,665%, fällig 31.01.2022	26.560
United States Treasury Floating Rate Note, 1,650%, fällig 30.04.2021	24.385
United States Treasury Floating Rate Note, 1,731%, fällig 31.07.2021	9.647
Australia Government Bond, Series 128, 5,750%, fällig 15.07.2022	6.852
Mexican Bonos, Series M, 7,750%, fällig 13.11.2042	4.513
Spain Government Bond, 144A, 1,000%, fällig 31.10.2050	4.307
Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000%, fällig 15.03.2029	4.282
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000%, fällig 01.01.2023	3.467
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750%, fällig 28.02.2048	3.273
Colombian TES, Series B, 6,000%, fällig 28.04.2028	1.765
Malaysia Government Bond, Series 0117, 3,882%, fällig 10.03.2022	1.734
Mexican Bonos, Series M 20, 8,500%, fällig 31.05.2029	1.418
Caterpillar Financial Services Corp, 0,543%, fällig 15.03.2021	1.386
Mexican Bonos, Series M, 8,000%, fällig 07.11.2047	1.250
Mexican Bonos, Series M 30, 8,500%, fällig 18.11.2038	979
Lowe's Companies Inc, 5,125%, fällig 15.04.2050	806
Coca-Cola Co/The, 4,200%, fällig 25.03.2050	550

Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	285
Citigroup Inc	70
iShares Russell 1000 Value ETF	67
Emerson Electric Co	62
Biogen Inc	58
Lowe's Cos Inc	53
Goldman Sachs Group Inc/The	47
Morgan Stanley	47
ConocoPhillips	45
T Rowe Price Group Inc	41
Target Corp	40
Bank of New York Mellon Corp/The	36
Bank of America Corp	34
Honeywell International Inc	34
Merck & Co Inc	34
Allstate Corp/The	31
American Express Co	31
DR Horton Inc	30
Walmart Inc	30
JP Morgan Chase & Co	28
Qualcomm Inc	27
CSX Corp	23
Cummins Inc	23
State Street Corp	23
Las Vegas Sands Corp	22
Lennar Corp	22
DaVita Inc	21

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	306
Apple Inc	193
Amgen Inc	130
Union Pacific Corp	115
Cisco Systems Inc	104
Illinois Tool Works Inc	103
Honeywell International Inc	101
Booking Holdings Inc	99
Intel Corp	94
CSX Corp	86
Wells Fargo & Co	85
Oracle Corp	81
Caterpillar Inc	79
Baxter International Inc	75
Walmart Inc	75
Texas Instruments Inc	74
iShares Russell 1000 Value ETF	72
eBay Inc	69
Johnson & Johnson	68
American Express Co	55
Bank of America Corp	54
International Business Machines Corp	54
O'Reilly Automotive Inc	54
Norfolk Southern Corp	51
Discover Financial Services	48
Best Buy Co Inc	46
Brown-Forman Corp	45
Synchrony Financial	42

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason ClearBridge Value Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Amazon.com Inc	10.056
DXC Technology Co	6.663
Sony Corp ADR	6.325
UnitedHealth Group Inc	5.815
Parsley Energy Inc 'A'	5.509
Baidu Inc ADR	5.263
TOTAL SE ADR	5.145
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	4.471
TJX Cos Inc/The	4.442
ViacomCBS Inc 'B'	4.338
OneMain Holdings Inc	4.182
Advance Auto Parts Inc	4.111
Medtronic Plc	3.965
American International Group Inc	3.932
Raytheon Technologies Corp	3.909
Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	3.741
Comcast Corp	3.519
General Electric Co	3.254
AbbVie Inc	2.908
Toll Brothers Inc	2.648
Western Digital Corp	2.603
Vail Resorts Inc	2.435
Six Flags Entertainment Corp	2.422
Charles Schwab Corp/The	2.359
Equitable Holdings Inc	2.340
EQT Corp	2.333
East Resources Acquisition Co	2.218
Arista Networks Inc	2.082
NXP Semiconductors NV	2.011
McKesson Corp	1.984
Wells Fargo & Co	1.792
Walt Disney Co/The	1.704
Howard Hughes Corp/The	1.639
Biogen Inc	1.525
Plains GP Holdings LP 'A'	1.493
Alexion Pharmaceuticals Inc	1.475
Valero Energy Corp	1.462

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Microsoft Corp	9.703
Bristol-Myers Squibb Co	9.554
Alphabet Inc	9.354
Kinder Morgan Inc/DE	8.549
Intercontinental Exchange Inc	7.965
Mondelez International Inc	5.586
QUALCOMM Inc	5.282
American Homes 4 Rent 'A'	5.171
Qorvo Inc	4.463
Anheuser-Busch InBev SA/NV ADR	3.944
Lennar Corp	3.915
Plains GP Holdings LP 'A'	3.835
Voya Financial Inc	3.773
Conagra Brands Inc	3.239
Capri Holdings Ltd	3.181
CVS Health Corp	3.091
Amazon.com Inc	3.064
Delta Air Lines Inc	2.996
Wheaton Precious Metals Corp	2.912
KeyCorp	2.837
Synchrony Financial	2.819
Corteva Inc	2.735
Royal Gold Inc	2.699
Owens Corning	2.514
ViacomCBS Inc 'B'	2.488
McKesson Corp	2.348
Facebook Inc 'A'	1.964
Newmont Corp	1.906
Suncor Energy Inc	1.835
Valero Energy Corp	1.768
Citigroup Inc	1.560

Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
T-Mobile US Inc	1.544
Fidelity National Information Services Inc	1.189
Canadian Pacific Railway Ltd	1.050
Ball Corp	915
Amgen Inc	863
Amazon.com Inc	731
Pinterest Inc	665
American International Group Inc	571
ArcelorMittal SA	382
AbbVie Inc	380
Becton Dickinson and Co	364
Toll Brothers Inc	323
Sempra Energy	308
Travelers Cos Inc/The	282
Mondelez International Inc	243
CVS Health Corp	178
Cognizant Technology Solutions Corp	170
3M Co	165
TJX Cos Inc/The	157
Arista Networks Inc	154
Sherwin-Williams Co/The	133
ASML Holding NV	125

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Microsoft Corp	3.528
Apple Inc	1.958
Wells Fargo & Co	1.579
Cisco Systems Inc	1.443
Adobe Inc	1.303
Walt Disney Co/The	1.090
McDonald's Corp	1.083
Bank of America Corp	1.029
Home Depot Inc/The	959
JPMorgan Chase & Co	847
UnitedHealth Group Inc	821
Thermo Fisher Scientific Inc	811
Automatic Data Processing Inc	810
United Parcel Service Inc 'B'	740
PNC Financial Services Group Inc/The	675
Phillips 66	673
Vulcan Materials Co	671
MetLife Inc	659
Visa Inc 'A'	654
Facebook Inc 'A'	600
Coca-Cola Co/The	587
American International Group Inc	557
Ecolab Inc	544
Comcast Corp	540
Becton Dickinson and Co	519
Corteva Inc	502
Amazon.com Inc	498
American Express Co	478
AT&T Inc	441
Johnson & Johnson	429
Illinois Tool Works Inc	423
Merck & Co Inc	420
Gilead Sciences Inc	418
Exxon Mobil Corp	409
Walmart Inc	406
Honeywell International Inc	376

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Amgen Inc	41.220
Ulta Beauty Inc	27.397
Monster Beverage Corp	21.661
Alcon Inc	19.268
salesforce.com Inc	13.896
Aptiv Plc	13.229
NXP Semiconductors NV	13.124
Facebook Inc 'A'	8.983
Visa Inc 'A'	8.319
Apple Inc	6.807
Fidelity National Information Services Inc	6.577
OTIS Worldwide Corp	5.800
UnitedHealth Group Inc	5.753
CH Robinson Worldwide Inc	5.191
QUALCOMM Inc	5.076
VMware Inc	4.501
Palo Alto Networks Inc	3.823
Amazon.com Inc	3.739
United Parcel Service Inc 'B'	3.451
Microsoft Corp	3.126
Home Depot Inc/The	3.053
Advance Auto Parts Inc	3.016
Booking Holdings Inc	2.989
Uber Technologies Inc	2.622

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Alphabet Inc	56.079
Johnson & Johnson	25.057
Charles Schwab Corp/The	23.998
Alphabet Inc 'A'	21.464
Oracle Corp	21.359
Amazon.com Inc	20.673
Microsoft Corp	16.986
Linde Plc	14.704
McCormick & Co Inc/MD	11.240
Pioneer Natural Resources Co	10.169
NVIDIA Corp	9.116
Home Depot Inc/The	6.535
Otis Worldwide Corp	6.482
Facebook Inc 'A'	6.257
Apple Inc	6.146
Walt Disney Co/The	6.049
Visa Inc 'A'	5.625
WW Grainger Inc	4.526
Adobe Inc	4.351
UnitedHealth Group Inc	4.229
Thermo Fisher Scientific Inc	3.558
Akamai Technologies Inc	3.553
Zoetis Inc	3.437

Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Guardant Health Inc	3.553
FireEye Inc	2.155
Voyager Therapeutics Inc	437

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Nuance Communications Inc	24.628
Autodesk Inc	22.959
Broadcom Inc	21.276
Biogen Inc	20.805
UnitedHealth Group Inc	16.955
Seagate Technology Plc	14.811
Vertex Pharmaceuticals Inc	13.135
Allergan Plc	10.253
Cree Inc	9.982
Comcast Corp	9.305
TE Connectivity Ltd	9.132
Liberty Broadband Corp	8.151
Liberty Broadband Corp	8.030
Amgen Inc	7.921
Twitter Inc	7.652
Freeport-McMoRan Inc	6.850
Ionis Pharmaceuticals Inc	5.222
Medtronic Plc	5.208
Nucor Corp	4.832
Johnson Controls International plc	4.496
National Oilwell Varco Inc	3.790
AT&T Inc	3.514
Ovintiv Inc	3.195
Citrix Systems Inc	2.971
Cerence Inc	2.657

Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
KKR & Co Inc, Series C	760
Air Products & Chemicals Inc	665
Equinix Inc	588
Broadcom Inc, Series A	567
Amgen Inc	471
DTE Energy Co	435
Carlyle Group Inc/The	431
CME Group Inc	425
TE Connectivity Ltd	369
Aptiv Plc, Series A	358
Oracle Corp	344
Otis Worldwide Corp	317
Barings BDC Inc	303
Boston Scientific Corp, Series A	275
Omeros Corp, 5,250%, fällig 15.02.2026	250
American Airlines Group Inc, 6,500%, fällig 01.07.2025	246
United Parcel Service Inc 'B'	203
Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250%, fällig 15.06.2023	180
Becton Dickinson and Co, Series B	179
NXP Semiconductors NV	176
Danaher Corp, Series B	170
Prologis Inc	159
Equity LifeStyle Properties Inc	155
ONEOK Inc	122

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Microsoft Corp	565
ONEOK Inc	564
Intel Corp	488
AT&T Inc	377
Starwood Property Trust Inc	368
Raytheon Technologies Corp	346
QUALCOMM Inc	301
Owl Rock Capital Corp	283
Coca-Cola Co/The	278
STORE Capital Corp	271
NextEra Energy Inc	248
Texas Instruments Inc	243
Pfizer Inc	220
Western Digital Corp	214
Crown Castle International Corp	212
Corteva Inc	192
Simon Property Group Inc	191
Paychex Inc	186
Carlyle Group Inc/The	180
Weyerhaeuser Co	180
Cisco Systems Inc	179
Oracle Corp	178
Enbridge Inc	174
Apollo Global Management Inc 'A'	172

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – (continued)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
NortonLifeLock Inc	120
Bank of America Corp	119
Edison International	113
QUALCOMM Inc	92

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Brookfield Infrastructure Partners LP, MLP	170
Golub Capital BDC Inc	160
Verizon Communications Inc	159
Dow Inc	147
DuPont de Nemours Inc	144
Apple Inc	139
AvalonBay Communities Inc	137
Bank of America Corp	134
Microchip Technology Inc	133
American Tower Corp	131
Blackstone Group Inc/The	124
Ares Capital Corp	119
CME Group Inc	119
Two Harbors Investment Corp	114
TPG RE Finance Trust Inc	112
Retail Properties of America Inc	110
Maxim Integrated Products Inc	105
Merck & Co Inc	105

Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Microsoft Corp	9.486
Apple Inc	7.904
Alphabet Inc 'A'	3.926
Costco Wholesale Corp	3.690
Ball Corp	3.551
Amgen Inc	3.411
Danaher Corp	3.408
Progressive Corp/The	3.326
BioMarin Pharmaceutical Inc	3.218
UnitedHealth Group Inc	3.177
Home Depot Inc/The	3.167
TE Connectivity Ltd	3.115
Synopsys Inc	2.984
Equinix Inc	2.880
Gilead Sciences Inc	2.857
Regal Beloit Corp	2.833
Unilever NV	2.832
Booking Holdings Inc	2.830
NIKE Inc	2.811
Hasbro Inc	2.716
Aptiv Plc	2.708
T-Mobile US Inc	2.707
Lam Research Corp	2.666
Trex Co Inc	2.640
Bank of America Corp	2.533
Comcast Corp	2.531
SolarEdge Technologies Inc	2.467
Ecolab Inc	2.441
Visa Inc 'A'	2.410
Becton Dickinson and Co	2.403
Trane Technologies Plc	2.317
Walt Disney Co/The	2.303
Hain Celestial Group Inc/The	2.279
Vestas Wind Systems A/S ADR	2.274
NextEra Energy Inc	2.229
Hartford Financial Services Group Inc/The	2.208
Autodesk Inc	2.040
BlackRock Inc	2.024
First Republic Bank/CA	2.019
Automatic Data Processing Inc	1.968
Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP	1.941
Keysight Technologies Inc	1.932
Rockwell Automation Inc	1.836
Enphase Energy Inc	1.706
Charles Schwab Corp/The	1.649
Starbucks Corp	1.637
Vail Resorts Inc	1.591
Ormat Technologies Inc	1.554
Herman Miller Inc	1.536

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Starbucks Corp	2.500
Apple Inc	2.471
Jones Lang LaSalle Inc	1.792
Merck & Co Inc	1.673
Alexion Pharmaceuticals Inc	1.623
Colgate-Palmolive Co	1.354
SolarEdge Technologies Inc	1.147
Xylem Inc/NY	780
BioMarin Pharmaceutical Inc	747
Vestas Wind Systems A/S ADR	667
Evoqua Water Technologies Corp	663
US Bancorp	623
Enphase Energy Inc	602
Unilever NV	523
Progressive Corp/The	453
Alphabet Inc 'A'	406
Danaher Corp	400
Visa Inc 'A'	332
Vail Resorts Inc	323
Ingersoll-Rand Plc	221

Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Alibaba Group Holding Ltd ADR	126
NextEra Energy Inc	121
Ecolab Inc	107
adidas AG ADR	105
Atlassian Corp Plc	105
Ulta Beauty Inc	98

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
NIKE Inc	123
Chewy Inc	117
Walt Disney Co/The	114
ICON Plc	113
SAP SE ADR	105
Tokyo Electron Ltd	102

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^ – (continued)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Brambles Ltd	95
Daiichi Sankyo Co Ltd	93
EDP – Energias de Portugal SA ADR	91
Procter & Gamble Co/The	90
T-Mobile US Inc	90
Tokyo Electron Ltd	88
Rentokil Initial Plc	82
Apple Inc	82
SolarEdge Technologies Inc	81
FANUC Corp ADR	80
Constellation Software Inc/Canada	80
Workday Inc 'A'	78
Amadeus IT Group SA	78
Nintendo Co Ltd	77
Tencent Holdings Ltd ADR	76
Just Eat Takeaway.com NV, 144A	76
Avantor Inc	74
Deutsche Boerse AG	74
TE Connectivity Ltd	72
Guardant Health Inc	70
IHS Markit Ltd	70
Amazon.com Inc	63
Ansell Ltd	59
TeamViewer AG, 144A	56
London Stock Exchange Group Plc	52
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	49
Ocado Group Plc	49
DexCom Inc	47
Kerry Group Plc	46
TechnoPro Holdings Inc	44
Legrand SA ADR	43
Microsoft Corp	43
Roche Holding AG	39
Trex Co Inc	39
Alexion Pharmaceuticals Inc	38

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Trex Co Inc	101
TechnoPro Holdings Inc	95
Gilead Sciences Inc	92
Charles Schwab Corp/The	87
Visa Inc 'A'	87
Linde Plc	85
Diageo Plc ADR	84
Euronext NV Eur1,6	84
Lightspeed POS Inc	81
Hain Celestial Group Inc/The	80
FANUC Corp ADR	80
FANUC Corp	78
Apple Inc	77
Truist Financial Corp	76
Novartis AG ADR	73
Roche Holding AG	71
Arco Platform Ltd 'A'	69
Coca-Cola Co/The	67
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE ADR	67
Hansa Biopharma AB	66
Legrand SA ADR	64
HDFC Bank Ltd ADR	63
Nintendo Co Ltd	62
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	59
Erste Group Bank AG	58
Kerry Group Plc	55
NVIDIA Corp	55
Tencent Music Entertainment Group ADR	48
Microsoft Corp	47
Adyen NV, 144A	45
Novo Nordisk A/S ADR	44
Amazon.com Inc	43
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	43
Guardant Health Inc	42
Palo Alto Networks Inc	42

Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR
Edison International	32.606
American Tower Corp	27.491
NextEra Energy Inc	27.304
Atlantia SpA	26.782
Getlink SE	24.706
CMS Energy Corp	21.311
Orsted A/S, 144A	21.118
TerraForm Power Inc	19.439
American Electric Power Co Inc	17.309
EDP – Energias de Portugal SA	13.746
Public Service Enterprise Group Inc	12.590
Sydney Airport	10.841
Aeroports de Paris	8.685
Transurban Group	8.116
Aena SME SA, 144A	7.671
Transmissora Alianca De Energia Eletrica S.A.	6.451
Exelon Corp	6.210
Vinci SA	6.039
Atlas Arteria Ltd	5.774
Pinnacle West Capital Corp	5.557
Sempra Energy	5.185
Severn Trent Plc	4.991
AltaGas Ltd	4.606
Union Pacific Corp	4.477
Red Electrica Corp SA	4.428
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	4.197
Cheniere Energy Inc	3.877

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
United Utilities Group Plc	31.632
Dominion Energy Inc	31.086
Hydro One Ltd, 144A	29.968
Norfolk Southern Corp	29.274
Red Electrica Corp SA	22.604
Enbridge Inc	20.870
National Grid Plc	18.960
Emera Inc	15.731
Williams Cos Inc/The	15.339
Union Pacific Corp	14.720
Severn Trent Plc	13.381
China Merchants Port Holdings Co Ltd	11.333
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	9.959
AltaGas Ltd	9.718
GMexico Transportes SAB de CV, 144A	8.418
Cheniere Energy Inc	7.488
Sempra Energy	7.265
CenterPoint Energy Inc	6.739
Transmissora Alianca De Energia Eletrica S.A.	6.568
Transurban Group	5.695
Vinci SA	5.108
Equatorial Energia SA	4.945
American Electric Power Co Inc	4.747
Crown Castle International Corp	4.727
Clearway Energy Inc 'C'	4.646
SSE Plc	4.629
Orsted A/S, 144A	3.998

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA	75
Electricity Generating PCL	53
Shenzhen Expressway Co Ltd	53
Tenaga Nasional Bhd	50
Jiangsu Expressway Co Ltd	43
Guangdong Investment Ltd	41
Ratch Group PCL	32
ENN Energy Holdings Ltd	31
Power Grid Corp of India Ltd	27
Malaysia Airports Holdings Bhd	25

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Mahanagar Gas Ltd	49
Cia Energetica de Sao Paulo	40
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	36
Indraprastha Gas Ltd	35
EcoRodovias Infraestrutura e Logistica SA	32
Electricity Generating PCL	29
Centrais Eletricas Brasileiras SA	23
Neoenergia SA	23
Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA	23
China Merchants Port Holdings Co Ltd	21

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^ – (continued)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Equatorial Energia SA	24
Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV 'B'	24
Gujarat Gas Ltd	16
Shanghai International Airport Co Ltd	14
China Everbright International Ltd	12
China Gas Holdings Ltd	8

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	19
Gujarat State Petronet Ltd	18
Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA	14
Canvest Environmental Protection Group Co Ltd	13
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	11
Equatorial Energia SA	4
CFE Capital S de RL de CV	2

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	49.499
JetBlue Airways Corp	2.582
Moelis & Co 'A'	2.476
Allegiant Travel Co 'A'	2.357
Ryman Hospitality Properties Inc	2.190
Alaska Air Group Inc	2.093
Pacira BioSciences Inc	2.013
Cavco Industries Inc	1.872
Chuy's Holdings Inc	1.735
Skyline Champion Corp	1.660
America's Car-Mart Inc/TX	1.621
Encore Wire Corp	1.531
Chefs' Warehouse Inc/The	1.485
MKS Instruments Inc	1.397
ADTRAN Inc	1.380
Winnebago Industries Inc	1.370
EnPro Industries Inc	1.366
Louisiana-Pacific Corp	1.363
Houlihan Lokey Inc 'A'	1.327
Hexcel Corp	1.3283

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	57.634
Emergent BioSolutions Inc	4.582
Generac Holdings Inc	3.961
MACOM Technology Solutions Holdings Inc	3.895
KEMET Corp	3.735
CoreLogic Inc/United States	3.228
II-VI Inc	2.878
Owens & Minor Inc	2.874
Lumber Liquidators Holdings Inc	2.270
Ameresco Inc	2.061
Lithia Motors Inc 'A'	1.804
LGI Homes Inc	1.525
Brooks Automation Inc	1.509
Mueller Water Products Inc 'A'	1.460
United Rentals Inc	1.458
Advanced Energy Industries Inc	1.397
Forterra Inc	1.375
CareDx Inc	1.320
Independent Bank Group Inc	1.305
Ciena Corp	1.239

Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	13.100
SPDR S&P 600 Small CapValue ETF – ETF	1.025
Miller Industries Inc/TN	997
ESCO Technologies Inc	909
iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	902
Vectrus Inc	793
John Bean Technologies Corp	701
Inter Parfums Inc	694
Comfort Systems USA Inc	684
Catalyst Pharmaceuticals Inc	615
J2 Global Inc	604
Wolverine World Wide Inc	596
Insight Enterprises Inc	568
Kennedy-Wilson Holdings Inc	559
Genworth MI Canada Inc	535
Natus Medical Inc	505
Air Lease Corp 'A'	496
MAXIMUS Inc	495
Quaker Chemical Corp	479
Meritor Inc	478
Cass Information Systems Inc	473
Heidrick & Struggles International Inc	473
Cabot Microelectronics Corp	472
Northwest Pipe Co	457
Pason Systems Inc	450
Korn Ferry	448
FBL Financial Group Inc	415
Forrester Research Inc	408

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	13.024
SPDR S&P 600 Small CapValue ETF – ETF	1.573
Simulations Plus Inc	1.141
iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	1.018
Insight Enterprises Inc	936
Meritor Inc	856
Patrick Industries Inc	750
LCI Industries	748
Cabot Microelectronics Corp	742
John Bean Technologies Corp	702
Arcosa Inc	689
Pfenex Inc	673
Bio-Techne Corp	656
Gibraltar Industries Inc	652
MasterCraft Boat Holdings Inc	636
Kadant Inc	617
Sterling Construction Co Inc	612
ProAssurance Corp	611
Nova Measuring Instruments Ltd	594
Minerals Technologies Inc	537
MKS Instruments Inc	518
NetScout Systems Inc	499
Houlihan Lokey Inc 'A'	490
Comfort Systems USA Inc	485
Tootsie Roll Industries Inc	481
Marcus & Millichap Inc	480
Landstar System Inc	476

Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR
Vodafone Group Plc	434
Unilever Plc	390
Hikma Pharmaceuticals Plc	371
Admiral Group Plc	363
Unilever NV	350
Wolters Kluwer NV	344
Banque Cantonale Vaudoise	341
Galenica AG, 144A	341
Sage Group Plc/The	255
Roche Holding AG	188
Novartis AG	116

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Sampo Oyj 'A'	566
H Lundbeck A/S	438
Enel SpA	428
Siemens AG	424
Rio Tinto Plc	423
HOCHTIEF AG	417
SCOR SE	408
Flughafen Zurich AG	375
Bankinter SA	343
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	342
Swiss Prime Site AG	332
Intrum AB	246

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund – (continued)

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Neste Oyj	236
Swedish Match AB	228
Orion Oyj	223
Safran SA	222
Pandora A/S	221
Swisscom AG	220
Hannover Rueck SE	211
WPP Plc	211
TAG Immobilien AG	192
MAN SE	179
DNB ASA	173
Royal Dutch Shell Plc	148
BHP Group Plc	126
ICA Gruppen AB	109
BP Plc	107
Skandinaviska Enskilda Banken AB	99

Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
iShares MSCI All Country Asia ex Japan ETF – ETF	7.447
AIA Group Ltd	973
Supreme Electronics Co Ltd	589
Uni-President China Holdings Ltd	547
Tingyi Cayman Islands Holding Corp	398
Synnex Technology International Corp	395
Fu Shou Yuan International Group Ltd	384
Poya International Co Ltd	357
EEKA Fashion Holdings Ltd	356
Select Harvest Ltd	327
Nan Kang Rubber Tire Co Ltd	295
Indiabulls Housing Finance Ltd	212
Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	111

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
iShares MSCI All Country Asia ex Japan ETF – ETF	7.595
Samsung Electronics Co Ltd	1.153
CTBC Financial Holding Co Ltd	984
TTW PCL, NVDR	980
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	918
Home Product Center PCL, NVDR	898
CP ALL PCL, NVDR	828
Dr Reddy's Laboratories Ltd	684
Sands China Ltd	662
Infosys Ltd	645
Coretronic Corp	619
CapitaLand Retail China Trust	616
Supreme Electronics Co Ltd	575
SCI Pharmtech Inc	570
Mega Financial Holding Co Ltd	568
CK Hutchison Holdings Ltd	536
First Financial Holding Co Ltd	527
Uni-President Enterprises Corp	446
China Vanke Co Ltd	441
Coal India Ltd	420
Hengan International Group Co Ltd	417
Bioteque Corp	412
Brickworks Ltd	397
Pruksa Holding PCL, NVDR	395
Shenzhen Expressway Co Ltd	384
Ascott Residence Trust	371
Coca-Cola Amatil Ltd	362
Asia Cement Corp	361

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
CNOOC Ltd	62
Central Retail Corp PCL, 144A	52
Formosa Petrochemical Corp	48
Mobile TeleSystems PJSC ADR	43
Hellenic Telecommunications Organization SA	41
Uni-President Enterprises Corp	41
Sberbank of Russia PJSC	36
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'A'	36
Meituan Dianping	34
Banco de Chile	34
Emaar Properties PJSC	33
Genting Bhd	31
PTT PCL	30
Petronas Chemicals Group Bhd	28
Chunghwa Telecom Co Ltd	27
BDO Unibank Inc	27
China Petroleum & Chemical Corp	26
Dialog Group Bhd	26
PLDT Inc	25
Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd	24

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Bidvest Group Ltd/The	99
Oriental Pearl Group Co Ltd	75
Aspen Pharmacare Holdings Ltd	68
BR Malls Participacoes SA	68
Huaxia Bank Co Ltd	68
MOL Hungarian Oil & Gas Plc	56
Notre Dame Intermedica Participacoes SA	52
Tencent Holdings Ltd	51
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	49
Fibra Uno Administracion SA de CV	48
Empresas COPEC SA	45
Celltrion Inc	44
BIM Birlesik Magazalar AS	39
Petroleo Brasileiro SA	39
Petroleo Brasileiro SA	39
Magazine Luiza SA	39
Astra International Tbk PT	39
CEZ AS	38
SACI Falabella	37
Central Retail Corp PCL, 144A	35

Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
General Mills Inc	136
NTT DOCOMO Inc	130
China Mobile Ltd	129
Clorox Co/The	126

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
iShares MSCI ACWI ETF – ETF	581
Salmar ASA	155
Mapletree Logistics Trust	143
Showa Denko KK	118

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund – (continued)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Kroger Co/The	122
Koninklijke Ahold Delhaize NV	118
Asia Cement Corp	117
Orion Oyj	116
Flowers Foods Inc	113
Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	112
Nintendo Co Ltd	89
Daito Trust Construction Co Ltd	35

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Toronto-Dominion Bank/The	108
Rio Tinto Plc	108
Royal Mail Plc	77
Air New Zealand Ltd	76
Persimmon Plc	65
Qantas Airways Ltd	65
BP Plc	64
Kohl's Corp	53
ComfortDelGro Corp Ltd	47
Southern Co/The	47
Austevoll Seafood ASA	40
Venture Corp Ltd	28
Nedbank Group Ltd	25
King Yuan Electronics Co Ltd	1
Enagas SA	–

Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Venture Corp Ltd	2.591
Techtronic Industries Co Ltd	2.384
Tata Consultancy Services Ltd	2.309
Shenzhou International Group Holdings Ltd	1.377
Orion Corp/Republic of Korea	1.229
Godrej Consumer Products Ltd	1.180
Samsung Electronics Co Ltd	1.016
HDFC Bank Ltd	655
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	637
Coway Co Ltd	448
Minth Group Ltd	443
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	363
United Overseas Bank Ltd	354
Guangdong Investment Ltd	257
Jardine Matheson Holdings Ltd	212
Tencent Holdings Ltd	183
Siam Commercial Bank PCL/The	168
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	142
Alibaba Group Holding Ltd ADR	114
LG Household & Health Care Ltd	97

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Tencent Holdings Ltd	10.555
Samsung Electronics Co Ltd	8.028
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	7.322
Alibaba Group Holding Ltd ADR	7.006
AIA Group Ltd	5.885
Tata Consultancy Services Ltd	5.430
ENN Energy Holdings Ltd	5.317
HSBC Holdings Plc	5.072
Guangdong Investment Ltd	4.826
Singapore Technologies Engineering Ltd	4.709
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	4.538
United Overseas Bank Ltd	4.378
HDFC Bank Ltd	4.285
Coway Co Ltd	4.259
Alibaba Group Holding Ltd	4.092
Jardine Matheson Holdings Ltd	3.963
Hero MotoCorp Ltd	3.919
TravelSky Technology Ltd	3.742
LG Household & Health Care Ltd	3.542
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	3.526
China Mobile Ltd	3.253
Minth Group Ltd	2.946
Siam Commercial Bank PCL/The	2.271
Techtronic Industries Co Ltd	2.245
Venture Corp Ltd	1.858

Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR
Novartis AG	5.219
Sika AG	4.378
Sanofi	4.321
Rio Tinto Plc	3.733
HeidelbergCement AG	3.025
JDE Peet's BV	2.776
Carlsberg AS	2.682
Volkswagen AG	2.437
Royal Unibrew A/S	2.356
Dassault Systemes SE	1.976
Societe Generale SA	1.646
Derwent London Plc	1.370
GN Store Nord A/S	1.152
Great Portland Estates Plc	1.149
Britvic Plc	1.048
CRH Plc	841
Temenos AG	760
Poste Italiane SpA, 144A	705
Cie de Saint-Gobain	697
STMicroelectronics NV	677
Greggs Plc	652
Sandvik AB	630
Bureau Veritas SA	569
Norilsk Nickel ADR	556
La Francaise des Jeux SAEM, 144A	499

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Wolters Kluwer NV	7.984
Greggs Plc	7.638
SGS SA	6.304
Arkema SA	6.243
Intermediate Capital Group Plc	5.960
La Francaise des Jeux SAEM, 144A	5.946
Novo Nordisk A/S	5.640
Taylor Wimpey Plc	4.456
Moncler SpA	4.420
STMicroelectronics NV	4.010
Persimmon Plc	3.921
Hargreaves Lansdown Plc	3.766
Rio Tinto Plc	3.330
Sika AG	3.249
Temenos AG	3.199
Trelleborg AB	3.188
Great Portland Estates Plc	3.089
Aalberts NV	3.003
SSAB AB 'A'	2.773
LafargeHolcim Ltd	2.715
Cie de Saint-Gobain	2.648
Vontobel Holding AG	2.599
Derwent London Plc	2.505
Sandvik AB	2.392
British Land Co Plc/The	2.239
OTP Bank Nyrt	2.200
Bureau Veritas SA	2.046
Royal Unibrew A/S	1.854
InterContinental Hotels Group Plc	1.839
Redrow Plc	1.837
Poste Italiane SpA, 144A	1.730
GN Store Nord A/S	1.644
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	1.556

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ – (continued)

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Network International Holdings Plc, 144A	1.487
JDE Peet's BV	1.435
Autoliv Inc	1.390

Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Network International Holdings Plc, 144A	1.487
JDE Peet's BV	1.435
Autoliv Inc	1.390
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	
MAJOR PURCHASES	COST
(in 000's) $	
ANSYS Inc	1.995
Veeva Systems Inc 'A'	1.558
Illumina Inc	1.418
Masimo Corp	1.298
Atlas Copco AB	1.189
Kerry Group Plc	1.110
L'Oreal SA	1.043
Microsoft Corp	1.026
Straumann Holding AG	1.006
Assa Abloy AB	988
Mettler-Toledo International Inc	960
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	934
ResMed Inc	933
Coloplast A/S	913
Mastercard Inc	884
Moncler SpA	864
Linde Plc	848
CSL Ltd	847
Kering SA	823
adidas AG	823
Ferrari NV	817
Tencent Holdings Ltd	786
Alibaba Group Holding Ltd ADR	786
Adobe Inc	762
AIA Group Ltd	732
Hexagon AB	601
Automatic Data Processing Inc	533
CyberArk Software Ltd	496
Accenture Plc 'A'	477
Starbucks Corp	442
Canadian National Railway Co	365

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Automatic Data Processing Inc	1.756
Spirax-Sarco Engineering Plc	951
Waters Corp	896
Beazley Plc	785
Align Technology Inc	705
Masimo Corp	80
Microsoft Corp	74
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	69
Coloplast A/S	66
Mastercard Inc	65
ResMed Inc	65
Linde Plc	61
CSL Ltd	60
Atlas Copco AB	59
Mettler-Toledo International Inc	56
Adobe Inc	56
Straumann Holding AG	56
Tencent Holdings Ltd	54
L'Oreal SA	54
AIA Group Ltd	53

Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Power Grid Corp of India Ltd	327
Link REIT	300
APA Group	278
Aurizon Holdings Ltd	224
Spark Infrastructure Group	217
Petronas Gas Bhd	216
Guangdong Investment Ltd	215
AusNet Services	173
NetLink NBN Trust	168
Waypoint REIT	155
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	148
Dexus	145
Digital Telecommunications Infrastructure Fund	142
Fortune Real Estate Investment Trust	137
Charter Hall Retail REIT	133
Mapletree Industrial Trust	127
Embassy Office Parks REIT	122
Transurban Group	104
Kiwi Property Group Ltd	103
Hui Xian Real Estate Investment Trust	99
Ascendas India Trust	93
CapitaLand Mall Trust	93
Keppel DC REIT	91
Shopping Centres Australasia Property Group	86
CapitaLand Commercial Trust	84
Contact Energy Ltd	82
NHPC Ltd	75
Manila Electric Co	66
AGL Energy Ltd	65

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
(in 000's) $	
Transurban Group	250
Vicinity Centres	247
Scentre Group	184
NHPC Ltd	163
AGL Energy Ltd	156
Keppel DC REIT	156
Aboitiz Power Corp	115
Mapletree Industrial Trust	103
IGB Real Estate Investment Trust	95
CapitaLand Mall Trust	81
Hui Xian Real Estate Investment Trust	80
Beijing Capital International Airport Co Ltd	71
Malaysia Airports Holdings Bhd	67
Westports Holdings Bhd	61
CLP Holdings Ltd	59
SPH REIT	49
Stockland	35
Sydney Airport	33
Shopping Centres Australasia Property Group	32
Contact Energy Ltd	27
Ascendas India Trust	22

Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Reliance Industries Ltd	786
Meituan Dianping	599
B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	437
NAVER Corp	415
Alibaba Group Holding Ltd ADR	295
Ping An Bank Co Ltd	271

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	462
Samsung Electronics Co Ltd	318
Itau Unibanco Holding SA	299
Alibaba Group Holding Ltd ADR	257
Industrial & Commercial Bank of China Ltd	245
Grupo Financiero Banorte SAB de CV	185

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – *(Fortsetzung)*

Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ – (continued)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	254
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	249
Samsung Electronics Co Ltd	200
Tencent Holdings Ltd	172
Odontoprev SA	147
China Gas Holdings Ltd	100
Itau Unibanco Holding SA	72
LUKOIL PJSC ADR	61
Prosus NV	59
EPAM Systems Inc	54
Industrial & Commercial Bank of China Ltd	47
AIA Group Ltd	46
OTP Bank Nyrt	45
SK Hynix Inc	44

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Cosan Ltd	181
SK Hynix Inc	147
IRB Brasil Resseguros S/A	117
Kotak Mahindra Bank Ltd	91
Credicorp Ltd	69
ICICI Bank Ltd	64
HDFC Bank Ltd	58
OTP Bank Nyrt	36
Sberbank of Russia PJSC ADR	31
Globalwafers Co Ltd	3

Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR
Dassault Systemes SE	219
Kerry Group Plc	119
Assa Abloy AB	83
Kering SA	50
Moncler SpA	48
Mettler-Toledo International Inc	45
adidas AG	34
Ferrari NV	33
ASML Holding NV	28
Straumann Holding AG	27
JDE Peet's BV	23
Atlas Copco AB	20
Hexagon AB	18
Linde Plc	18
L'Oreal SA	17
Infineon Technologies AG	14
Temenos AG	14
Spirax-Sarco Engineering Plc	14
Beazley Plc	13
EQT AB	13
Partners Group Holding AG	13
Coloplast A/S	11
Amadeus IT Group SA	10
CyberArk Software Ltd	10

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Spirax-Sarco Engineering Plc	202
Beazley Plc	175
Amadeus IT Group SA	129
Coloplast A/S	85
Mettler-Toledo International Inc	66
Hexagon AB	62
Atlas Copco AB	59
adidas AG	53
Straumann Holding AG	42
Ferrari NV	41
ASML Holding NV	36
Kering SA	36
Moncler SpA	34
EQT AB	31
L'Oreal SA	27
Linde Plc	21
Assa Abloy AB	20
Temenos AG	20
Infineon Technologies AG	20
Partners Group Holding AG	17
CyberArk Software Ltd	12

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

Anhang: EU-Verordnung zur Erhöhung der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTR-Verordnung)

In den folgenden Tabellen sind der Gesamt-Bruttonennwert für umgekehrte Rückkaufvereinbarungen, Total Return Swaps und Differenzkontrakte sowie der absolute beizulegende Zeitwert als Anteil des Nettoinventarwerts jedes Fonds, analysiert nach Gegenparteien, zum 31. August 2020 angegeben:

Umgekehrte Rückkaufvereinbarungen

Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund

Gegenpartei	Gründungsland	Brutto gesamt Nominalwert (in Tsd.) $	Absolut beizulegen Wert (in Tsd.) $	% des Netto Anlagewert
Canadian Imperial Bank of Commerce	Kanada	100.000	100.000	9,21
JP Morgan	USA	98.855	98.855	9,10
		198.855	198.855	18,31

Total Return Swaps

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

Gegenpartei	Gründungsland	Brutto gesamt Nominalwert (in Tsd.) $	Absolut beizulegen Wert (in Tsd.) $	% des Netto Anlagewert
Citi	USA	3.762	3.762	0,68
JP Morgan	USA	3.833	3.833	0,70
		7.595	7.595	1,38

Differenzkontrakte

Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^

Gegenpartei	Gründungsland	Brutto gesamt Nominalwert (in Tsd.) €	Absolut beizulegen Wert (in Tsd.) €	% des Netto Anlagewert
UBS	Schweiz	43.213	6.265	5,99
		43.213	6.265	5,99

In der folgenden Tabelle sind die zehn größten Emittenten von Sicherheiten basierend auf dem Wert der erhaltenen unbaren Sicherheiten und die Währung der erhaltenen unbaren Sicherheiten zum 31. August 2020 aufgeführt:

Fonds	Emittent der Sicherheit*	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	USA***	US Dollar	$202.833

*§Wenn zum 31. August 2020 weniger als zehn Emittenten von Sicherheiten vorhanden waren, wurden alle Emittenten aufgenommen.

**§Die zugrunde liegende Anleihe, die als Sicherheit gehalten wird, wird vom United States Treasury ausgegeben.

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Art und der QualitÃ¤t der erhaltenen unbaren Sicherheiten zum 31. August 2020:

Fonds	Art der Sicherheiten	Qualität der Sicherheiten	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen	Investment Grade	$202.833

Die nachfolgende Laufzeitanalyse basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitstermin der umgekehrten Rückkaufvereinbarungen, Total Return Swaps und Differenzkontrakte sowie der zugehörigen erhaltenen/(gestellten) Sicherheiten zum 31. August 2020.

Fonds	Art des Derivats/der Sicherheit	Weniger als 1 Tag (in Tsd.)	1 Tag bis 1 Woche (in Tsd.)	1 Woche bis 1 Monat (in Tsd.)	1 Monat bis 3 Monate (in Tsd.)	3 Monate bis 1 Jahr (in Tsd.)	Über 1 Jahr (in Tsd.)	Offene Laufzeit (in Tsd.)	Gesamt (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	Umgekehrte Rückkaufvereinbarungen	–	$198.855	–	–	–	–	–	$198.855
	Erhaltene unbare Sicherheiten	–	–	–	–	–	$202.833	–	$202.833
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Total Return Swaps	–	–	–	–	–	$7.595	–	$7.595
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	Differenzkontrakte	–	–	–	–	–	–	€2.917	€ 2.917
	Gestellte Barsicherheiten	€(3.115)	–	–	–	–	–	–	€ (3.115)

Umgekehrte Rückkaufvereinbarungen, die am Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund gehalten werden, sind Vereinbarungen mit Dritten. Die vom Fonds erhaltenen Sicherheiten in Bezug auf die offenen Rückkaufvereinbarungen zum 31. August 2020 werden in getrennten Konten bei The Bank of New York Mellon im Namen des Unternehmens gehalten. Erhaltene Sicherheiten werden nicht weiterverwendet.

Total Return Swaps und Differenzkontrakte werden bilateral abgewickelt. Es werden keine Sicherheiten bereitgestellt oder erhalten, um die Positionen der Total Return Swaps zum 31. August 2020 zu öffnen. And die Gegenpartei gestellte Sicherheiten in Bezug auf offene Differenzkontrakt-Positionen werden zum 31. August 2020 von der Gegenpartei auf getrennten Konten gehalten.

Alle Kosten und Renditen aus umgekehrten Rückkaufvereinbarungen, Total Return Swaps und Differenzkontrakten laufen in voller Höhe für den Fonds auf.

^ *In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.*

FRANKLIN
TEMPLETON