

Halbjahresbericht (Ungeprüft)

Legg Mason

Global Funds Plc

Ein Dachfonds mit getrennter
Haftung zwischen den Teilfonds

Für die sechs Monate bis 31. August 2021

Das Angebot der Anteile der Teilfonds Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund, Legg Mason Brandywine Global - US High Yield Fund, Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund, Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund, Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund, Legg Mason ClearBridge Global SRI Equity Fund, Legg Mason ClearBridge Growth Fund, Legg Mason Emerging Markets Select Equity Fund, Legg Mason Japan Equity Fund, Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund, Legg Mason Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund, Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities 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, Legg Mason Multi-Asset Infrastructure Income Fund, Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund, Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, Legg Mason US Equity Fund, Legg Mason Western Asset Asian Income Fund, Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund, Legg Mason Western Asset Global Credit Absolute Return Fund, Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund, Legg Mason Western Asset Infrastructure Debt Fund, Legg Mason Western Asset Short-Dated High Yield Fund, Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund, Legg Mason Western Asset UK£ Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset UK£ Long Duration Fund, Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund, Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund, Legg Mason Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund und Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund wurde der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht nicht gemäß § 310 KAGB (Kapitalanlagegesetzbuch) gemeldet.

Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Informationen	3
Brief an die Anteilshaber	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 US Core Plus Bond Fund	32
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	52
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	56
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	60
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	65
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	70
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	73
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	76
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	80
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	82
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	84
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	88
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Global Credit Fund [^]	94
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	99
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	101
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	112
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	124
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	130
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	138
Anlagenportfolio – Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	141
Anlagenportfolio – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	149
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	154
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	157
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]	159
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	162
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]	165
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	167
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	172
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	174
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	176
Anlagenportfolio – Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	178
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge Value Fund	180
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	182
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	183
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	184
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	185
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	187
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]	188
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	189
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	191
Anlagenportfolio – Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^]	192
Anlagenportfolio – Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	193
Anlagenportfolio – Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	196
Anlagenportfolio – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund	198
Anlagenportfolio – Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	200
Anlagenportfolio – Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]	202
Anlagenportfolio – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund	203
Anlagenportfolio – Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	204
Anlagenportfolio – Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	205
Anlagenportfolio – Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	206
Anlagenportfolio – Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	207
Anlagenportfolio – Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	208
Bilanz – Legg Mason Global Funds Plc	208
Gesamtergebnisrechnung – Legg Mason Global Funds Plc	228
Entwicklung des den Inhabern von einlösaren Beteiligungsanteilen zurechenbaren Nettovermögens – Legg Mason Global Funds Plc	238
Erläuterungen zum Abschluss – Legg Mason Global Funds Plc	265
Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios - TER) – Legg Mason Global Funds Plc	286
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	293
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	293
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	294
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	294
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	294
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	295
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	295
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	295
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	296
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	297
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	297
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	298
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	298
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	298
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Global Credit Fund [^]	299
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	299

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	299
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	300
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	300
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	301
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	301
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	301
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	302
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	302
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	302
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]	303
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	303
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]	-2
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	303
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	304
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	304
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	305
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	305
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge Value Fund	305
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	306
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	306
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	307
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	307
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	307
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]	308
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	308
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	309
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^]	309
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	309
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	310
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund	310
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	311
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]	311
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund	311
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	312
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]	312
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	313
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	313
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	313
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	314
Anhang: EU-Verordnung zur Erhöhung der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTR-Verordnung)	315

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Allgemeine Informationen

Verwaltungsrat

Joseph Carrier (Vereinigte Staaten)
 Fionnuala Doris (Irland) (unabhängig)
 William Jackson (Großbritannien)
 Joseph Keane (Irland) (unabhängig)
 Joseph LaRocque (Vereinigte Staaten)
 Jaspal Saggar (Großbritannien)
 Jane Trust (Vereinigte Staaten)

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

Franklin Distributors, LLC
 (mit Wirkung zum 9. August 2021)
 One Franklin Parkway
 San Mateo, CA 94403
 Vereinigte Staaten

Legg Mason Investor Services, LLC
 (bis zum 9. August 2021)
 100 International Drive
 Baltimore, Maryland 21202
 Vereinigte Staaten

Weitere Vertriebs- und Informationsstellen

Franklin Templeton International Services S.à r.l.
 8A, rue Albert Borschette
 L-1246 Luxemburg
 Großherzogtum Luxemburg

Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc.
 (mit Wirkung zum 7. August 2021)
 8F, No. 87
 Abschn. 4, Zhong Xiao E. Rd., Taipeh
 Taiwan

Legg Mason Investments (Europe) Limited
 (am 7. August 2021 eingestellt)
 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 Anteilhaber)

Britische Anteilhaber können auf der Berichtsfondsliste von HM Revenue and Customs auf der Website [://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds](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 finden Sie im Nachtragsprospekt für Investoren aus dem Vereinigten Königreich, oder kontaktieren Sie Franklin Templeton International Services S.à r.l.

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 LLP
 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

Franklin Templeton International Services S.à r.l.
 8A, rue Albert Borschette
 L-1246 Luxemburg
 Großherzogtum Luxemburg

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset Asian Income Fund**		<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 Vereinigte Staaten</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p>
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^*	11. Januar 2021	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 Vereinigte Staaten</p>
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund*	1. Oktober 2003	<p>Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 Vereinigte Staaten</p>
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^*	3. April 2012	<p>Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 Vereinigte Staaten</p>
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^*	30. November 2012	<p>Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 Vereinigte Staaten</p>
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund*	25. Juni 2010	<p>Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 Vereinigte Staaten</p>
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^*	10. Mai 2012 (Handel eingestellt am 25. Februar 2021)	<p>Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 Vereinigte Staaten</p>
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund^*	3. Juni 2013	<p>Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 Vereinigte Staaten</p>

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^{^*}	30. Juni 2014	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 Vereinigte Staaten
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 Vereinigte Staaten
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 Vereinigte Staaten
Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund^{^*^b}	30. Oktober 2017 (Handel eingestellt 29. Januar 2020)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 Vereinigte Staaten
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 Vereinigte Staaten
Legg Mason Brandywine Global – EM Macro Bond Fund^{^*^*}		Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 Vereinigte Staaten
Legg Mason ClearBridge Value Fund^{^**}	23. März 1998	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 Vereinigte Staaten
Legg Mason ClearBridge Growth Fund^{^*^*^b}	25. Februar 2004 (Handel eingestellt am 15. Februar 2019)	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 Vereinigte Staaten
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^{^*^*^b}	1. September 2006 (Handel eingestellt am 22. November 2019)	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 Vereinigte Staaten
Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund^{^*^*^b}	15. September 2014 (Handel eingestellt am 22. Juli 2019)	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 Vereinigte Staaten
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund^{^**}	20. April 2007	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 Vereinigte Staaten
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 Vereinigte Staaten
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund^{^**}	20. April 2007	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 Vereinigte Staaten

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund**	3. Juni 2013	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 Vereinigte Staaten
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 Vereinigte Staaten
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund**^	29. Juni 2018	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 Vereinigte Staaten
Legg Mason ClearBridge Global SRI Equity Fund^***^		Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 Vereinigte Staaten
Legg Mason ClearBridge 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**^	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**+^	30. April 2021	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 Vereinigte Staaten
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund**	1. März 2004	Anlageverwalter: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 Vereinigte Staaten
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund** (früher Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund; umbenannt am 9. August 2021)	30. August 2002	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. [†] One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 Vereinigte Staaten
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund** (früher Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund; umbenannt am 9. August 2021)	25. Februar 2004	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. [†] One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 Vereinigte Staaten
Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^***b	20. April 2007 (Handel eingestellt am 25. Februar 2015)	
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund ^***b	28. April 2008 (Handel eingestellt am 14. April 2021)	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. [†] One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 Vereinigte Staaten
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund** (früher Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund (umbenannt am 9. August 2021)	29. Dezember 2010	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. [†] One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 Vereinigte Staaten
Legg Mason QS US Large Cap Fund^***		Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. [†] One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 Vereinigte Staaten

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
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
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund**^b	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**^b	11. März 2016 (hat den Handel am 1. Juni 2021 eingestellt)	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund**^b	11. März 2016 (Handel eingestellt am 31. Juli 2017)	
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund**^b	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**^b	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**^b	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“) Level 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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund**[Ⓜ]	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
Legg Mason Multi-Asset Infrastructure Income Fund***[†]		Anlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 Vereinigte Staaten ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
Legg Mason PCM US Equity Fund[Ⓜ]	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[Ⓜ]	2. Oktober 2008 (Handel eingestellt am 30. November 2010)	

[†] Zum Ende des Geschäftsjahres haben diese Fonds nicht mit dem Handel begonnen.

[Ⓜ] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

^μ 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).

[Ⓜ] Bis zum Widerruf der Genehmigung durch die Zentralbank.

[‡] Mit Wirkung zum 9. August 2021 fusionierte QS Investors, LLC, 880 Third Avenue, 7th Floor, New York, NY 10022, Vereinigte Staaten, mit Franklin Advisers, Inc.

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)

Franklin Templeton International Services S.à r.l.
8A, rue Albert Borschette
L-1246 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

www.leggmasonglobal.com

Für zugelassene Broker in Nord-, Süd- und Mittelamerika

Franklin Templeton Investments
1395 Brickell Avenue
Suite 1550
Miami, Florida 33131, Vereinigte Staaten
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
- Weitere Informationen über die Tochtergesellschaften von Franklin Templeton im Bereich Vermögensverwaltung, 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 2021 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 wurde weiterhin von der COVID-19-Pandemie beeinträchtigt. In seinem Update des *World Economic Outlook* vom Juli 2021 sagte der Internationale Währungsfonds („IWF“): „Die wirtschaftlichen Aussichten haben sich seit der Prognose des *World Economic Outlook* vom April 2021 in allen Ländern weiter verbessert. Der Zugang zu Impfstoffen hat sich als die wichtigste Bruchlinie herausgestellt, entlang derer sich der weltweite Aufschwung in zwei Blöcke aufspaltet: diejenigen, die sich auf eine weitere Normalisierung des Handelns im Laufe dieses Jahres freuen können (fast alle fortgeschrittenen Volkswirtschaften), und diejenigen, die immer noch mit einem Wiederaufflammen der Infektionen und steigenden COVID-Todeszahlen konfrontiert sein werden. Die Erholung ist jedoch selbst in Ländern, in denen Infektionsraten derzeit sehr gering sind, nicht gesichert, solange das Virus anderswo zirkuliert.“ Aus regionaler Sicht geht der IWF davon aus, dass die US-Wirtschaft 2021 um 7,0 % wachsen wird, verglichen mit 3,5 % Prozent Rückgang des BIP in 2020. An anderer Stelle erwartet der IWF für das Jahr 2021 ein BIP-Wachstum in der Eurozone, Großbritannien und Japan von 4,6 %, 7,0 % bzw. 2,8 %.

Marktüberblick - Rentenmärkteⁱ

Der globale Markt für festverzinsliche Anlagen war im Berichtszeitraum weitgehend unverändert. In den Vereinigten Staaten blieben die kurzfristigen Renditen der US-Staatsanleihen niedrig, da das Federal Reserve Board („Fed“ⁱⁱ) den US-Leitzinsⁱⁱⁱ für einen Großteil des Berichtszeitraums in einem Bereich zwischen 0,00 % und 0,25 % hielt. Unterdessen stiegen die Renditen langfristiger US-Staatsanleihen zunächst an und gingen dann zurück, als sich die Wachstumserwartungen abschwächten (Renditen und Preise bewegen sich in entgegengesetzter Richtung). Die Renditen der zehnjährigen US-Staatsanleihen begannen den Berichtszeitraum mit 1,44 % und lagen an dessen Ende bei 1,30%. Dieser Trend trat auch in einer Reihe von Industrieländern außerhalb der Vereinigten Staaten auf. Insgesamt verzeichneten die Spread-Sektoren (ohne US-Staatsanleihen), einschließlich Unternehmensanleihen^{iv} mit Investment-Grade-Rating^v, Unternehmensanleihen mit niedrigerem Rating und auf US-Dollar lautende Staatsanleihen der Schwellenländer, positive Renditen, da die Anleger in dem Niedrigzinsumfeld nach zusätzlichen Renditen suchten.

Marktüberblick - Globale Aktien^{vi}

Der globale Aktienmarkt erholte sich während des Berichtszeitraums. Dazu trugen eine Reihe von Faktoren bei, darunter die Einführung der COVID-19-Impfstoffe, die Verbesserung des Wirtschaftswachstums und Unternehmensgewinne, die häufig über den Erwartungen lagen. Während die Inflation anstieg, bezeichneten die Fed und andere Zentralbanken der Industrieländer dies weitgehend als vorübergehend und behielten ihren akkommodierenden geldpolitischen Kurs bei. Insgesamt verzeichneten die US-Aktien im Berichtszeitraum gute Ergebnisse. Aktien in den Industrieländern legten ebenfalls zu, während die Aktien der Schwellenländer eine leicht negative Rendite verzeichneten.

Wir danken Ihnen für Ihr anhaltendes Vertrauen.

Mit freundlichen Grüßen

Franklin Templeton International Services S.à r.l

ⁱ Rentenwerte - Anleihen.

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

ⁱⁱⁱ Der US-Leitzins ist der vom Federal Open Market Committee festgelegte Zielzinssatz, zu dem Geschäftsbanken ihre überschüssigen Reserven über Nacht leihen und verleihen.

^{iv} Investment Grade - ein Kreditrating, das bedeutet, dass eine Staats- oder Unternehmensanleihe ein relativ geringes Ausfallrisiko hat.

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 2021, 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 ein 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.

Die Informationen und Daten in diesem Material stammen aus Quellen, die als zuverlässig gelten, sie werden jedoch nicht durch ein Unternehmen der Franklin Resources, Inc. oder durch ein mit der Franklin Resources, Inc. verbundenes Unternehmen (zusammen „Franklin Templeton“) garantiert.

Genannte einzelne Wertpapiere sollen als Beispiele für Portfoliositionen 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 Anlage 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 durch die Franklin Templeton International Services S.à r.l, 8A, rue Albert Borschette, L-1246 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg, mit offiziellem Sitz in Luxemburg und reguliert durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier.

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

^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 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoin- ventar- werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 81,32 % (28. Februar 2021: 83,70 %)			25.052 United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 05.10.2021	25.051	2,75	Umgekehrte Pensionsgeschäfte - 23,05 % (28. Februar 2021: 19,49 %)		
Vereinigte Staaten – 81,32 % (28. Februar 2021: 83,70 %)			15.000 United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 07.10.2021	14.999	1,64	Vereinigte Staaten – 23,05 % (28. Februar 2021: 19,49 %)		
25.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 00X 0,130%, fällig 15.09.2021 *	25.000	2,74	14.820 United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 19.10.2021	14.819	1,62	80.000 Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu US\$80.000.111 (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von US\$81.600.151), 0,050%, fällig 01.09.2021		
3.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,089%, fällig 18.10.2021 *	3.000	0,33	10.000 United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 201.10.2021	9.999	1,10	11.176 JP Morgan, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu US\$11.176.016 (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von US\$11.399.564), 0,050%, fällig 01.09.2021		
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,220%, fällig 05.11.2021 *	10.003	1,10	20.000 United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 26.10.2021	19.998	2,19	69.000 JP Morgan, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu US\$69.000.096 (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von US\$70.380.155), 0,050%, fällig 01.09.2021		
1.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,188%, fällig 23.12.2021 *	1.000	0,11	10.000 United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 12.11.2021	24.998	2,74	50.000 Royal Bank of Canada, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu US\$50.000.056 (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von US\$51.000.019), 0,040%, fällig 01.09.2021		
25.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0X 0,150%, fällig 22.02.2022 *	25.012	2,74	25.000 United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 26.11.2021	24.997	2,74	Summe umgekehrte Pensionsvereinbarung (Anschaffungskosten 210.176 USD)		
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,120%, fällig 13.04.2022	10.001	1,10	10.000 United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 02.12.2021	9.999	1,10	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
40.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,050%, fällig 09.06.2022 *	39.995	4,39	10.000 United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 27.01.2022	9.998	1,10	951.625		
15.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Zero coupon, fällig 02.09.2021	15.000	1,64	15.000 United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 03.02.2022	14.997	1,64	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
10.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Zero coupon, fällig 22.11.2021	9.999	1,10	10.000 United States Treasury Note/ Bond, 1,500%, fällig 30.09.2021	15.017	1,65	951.625		
10.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Zero coupon, fällig 07.01.2022	9.998	1,10	10.000 United States Treasury Note/ Bond, 1,500%, fällig 30.10.2021	10.023	1,10	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
5.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Zero coupon, fällig 10.01.2022	4.999	0,55	25.000 United States Treasury Note/ Bond, 2,875%, fällig 15.11.2021	25.143	2,76	(39.834) (4,37)		
5.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Zero coupon, fällig 06.07.2022	4.997	0,55	10.000 United States Treasury Note/ Bond, 1,500%, fällig 30.11.2021	10.036	1,10	Gesamtvermögen		
10.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Zero coupon, fällig 15.07.2022	9.993	1,09	10.000 United States Treasury Note/ Bond, 1,500%, fällig 30.11.2021	10.036	1,10	\$911.791 100,00		
25.000 Federal Home Loan Banks, Series 0X 0,065%, fällig 03.09.2021 *	25.000	2,74	10.000 United States Treasury Note/ Bond, 2,000%, fällig 31.12.2021	10.064	1,10	-		
10.000 Federal Home Loan Banks, Series 0X 0,055%, fällig 08.10.2021 *	10.000	1,10	10.000 United States Treasury Note/ Bond, 2,125%, fällig 15.05.2022	10.144	1,11	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 %.		
40.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000X 0,055%, fällig 20.12.2021 *	40.000	4,39	10.000 United States Treasury Note/ Bond, 1,875%, fällig 31.05.2022	10.134	1,11	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.		
20.000 Federal Home Loan Banks, 0,060%, fällig 13.01.2022 *	20.000	2,19				Analyse des Gesamtvermögens		
5.000 Federal Home Loan Banks, 2,125%, fällig 10.06.2022	5.079	0,56				Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
10.729 Federal Home Loan Mortgage Corp, 0,125%, fällig 25.07.2022	10.733	1,18				Geldmarktinstrumente		
10.000 Federal National Association, 1,375%, fällig 07.10.2021	10.013	1,10				Sonstige Vermögenswerte		
15.000 United States Cash Management Bill, Zero coupon, fällig 15.10.2021	14.999	1,64				0,07		
10.000 United States Cash Management Bill, Zero coupon, fällig 01.11.2021	9.999	1,10				Gesamtvermögen		
10.000 United States Cash Management Bill, Zero coupon, fällig 28.12.2021	9.998	1,10				100,00		
4.600 United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 02.09.2021	4.600	0,50						
21.585 United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 14.09.2021	21.585	2,37						
17.298 United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 21.09.2021	17.298	1,90						
30.000 United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 23.09.2021	29.999	3,29						
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 741.449 USD)								
			741.449	81,32				

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 8,16 % (28. Februar 2021: 8,11 %)			480 Goldentree Loan Management US Clo 4 Ltd, Series 2019 4A, Class AR, 144A, 1,235%, fällig 24.04.2031 *	480	0,18	440 OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, Series 2018 1A, Class A1A, 144A, 1,194%, fällig 20.01.2031 *	441	0,16
308 Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2019 1A, Class A2I, 144A, 4,194%, fällig 07.06.2049	314	0,12	250 Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Class A2X 144A, 1,136%, fällig 15.04.2031 *	250	0,09	600 Owl Rock CLO I Ltd, Series 2019 1A, Class A, 144A, 1,931%, fällig 20.05.2031 *	601	0,22
415 Argent Securities Inc AssetBacked Pass-Through Certificates Series 2003-W7X Series 2003 W3X Class M1X 1,209%, fällig 25.09.2033 *	413	0,15	320 Greywolf CLO V Ltd, Series 2015 1A, Class A1R, 144A, 1,285%, fällig 27.01.2031 *	320	0,12	440 Point Au Roche Park CLO Ltd, Series 2021 1A, Class A, 144A, 1,256%, fällig 20.07.2034 *	441	0,16
500 Benefit Street Partners CLO VIII Ltd, Series 2015 8A, Class A1AR, 144A, 1,234%, fällig 20.01.2031 *	501	0,18	750 Grippen Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Class A, 144A, 1,394%, fällig 20.01.2030 *	750	0,28	117 SBA Small Business Investment Cos, Series 2018 10B, Class 1X 3,548%, fällig 10.09.2028	127	0,05
344 BLUEMOUNTAIN CLO 2012-2 Ltd, Series 2012 2A, Class AR2X 144A, 1,181%, fällig 20.11.2028 *	344	0,13	430 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1X Class A, 144A, 1,146%, fällig 16.06.2036 *	431	0,16	450 Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2005 OP1X Series 2005 OP1X Class M1X 0,699%, fällig 25.01.2035 *	442	0,16
600 BlueMountain CLO XXII Ltd, Series 2018 22A, Class A1X 144A, 1,206%, fällig 15.07.2031 *	600	0,22	1.204 Home Equity Asset Trust 2006-4X Series 2006 4X Class 2A4X 0,644%, fällig 25.08.2036 *	1.204	0,44	178 Seven Sticks CLO Ltd, Series 2016 1A, Class A1R, 144A, 1,176%, fällig 15.07.2028 *	178	0,07
630 Canyon CLO 2020-1 Ltd, Series 2020 1A, Class AR, 144A, 0,000%, fällig 15.07.2034 *	631	0,23	988 Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1X Series 2004 1X Class M1X 0,834%, fällig 25.02.2034 *	988	0,36	122 SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A, Series 2007 A, Class A4A, 0,359%, fällig 16.12.2041 *	119	0,04
231 Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-3 Ltd, Series 2015 3A, Class A1R, 144A, 1,132%, fällig 28.07.2028 *	231	0,09	411 Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-4X Series 2004 4X Class M1X 0,984%, fällig 25.10.2034 *	409	0,15	617 SLM Student Loan Trust 2004-3X Series 2004 3A, Class A6A, 144A, 0,675%, fällig 25.10.2064 *	623	0,23
270 Cayuga Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class AR, 144A, 1,230%, fällig 17.07.2034 *	270	0,10	553 Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2004 WMC5X Series 2004 WMC5X Class M1X 1,014%, fällig 25.07.2035 *	553	0,20	490 Trinitas CLO XVI Ltd, Series 2021 16A, Class A1X 144A, 1,314%, fällig 20.07.2034 *	491	0,18
500 CBAM 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Class A1X 144A, 1,384%, fällig 20.07.2030 *	501	0,18	128 Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006 HE1X Series 2006 HE1X Class M1X 0,669%, fällig 25.12.2036 *	128	0,05	660 Voya CLO 2016-3 Ltd, Series 2016 3A, Class A1R, 144A, 1,324%, fällig 18.10.2031 *	661	0,24
106 Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Series 2001 HE22X Class A1X 0,564%, fällig 25.02.2032 *	104	0,04	500 MKS CLO 2017-2 Ltd, Series 2017 2A, Class A, 144A, 1,324%, fällig 20.01.2031 *	501	0,18	320 Voya CLO 2018-3 Ltd, Series 2018 3A, Class A1A, 144A, 1,276%, fällig 15.10.2031 *	320	0,12
42 CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2007-13X Series 2007 13X Class 2A2X 0,884%, fällig 25.10.2047 *	42	0,02	517 Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2004-NC8X Series 2004 NC8X Class M1X 0,999%, fällig 25.09.2034 *	515	0,19	Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Kosten 21.877 USD) 22.097 8,16		
174 CWABS Inc Asset-Backed Certificates Trust 2004-5X Series 2004 5X Class 2A, 0,584%, fällig 25.10.2034 *	170	0,06	272 Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-NC2X Series 2005 NC2X Class M4X 0,999%, fällig 25.03.2035 *	272	0,10	Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere – 27,67 % (28. Februar 2021: 35,39 %)		
45 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-F, Series 2006 F, Class 2A1A, 0,236%, fällig 15.07.2036 *	42	0,02	1.480 Navient Private Education Refi Loan Trust 2018-C, Series 2018 CA, Class B, 144A, 4,220%, fällig 16.06.2042	1.529	0,56	116 Banc of America Mortgage 2003-C Trust, Series 2003 C, Class B1X 2,372%, fällig 25.04.2033 *	27	0,01
335 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I, Series 2006 I, Class 1A, 0,236%, fällig 15.01.2037 *	321	0,12	200 Navient Student Loan Trust 2017-1X Series 2017 1A, Class A3X 144A, 1,234%, fällig 26.07.2066 *	204	0,08	630 BANK 2018-BNK12X Series 2018 BN12X Class A4X 4,255%, fällig 15.05.2061 *	731	0,27
245 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I, Series 2006 I, Class 2A, 0,236%, fällig 15.01.2037 *	234	0,09	370 Navient Student Loan Trust 2017-3X Series 2017 3A, Class A3X 144A, 1,134%, fällig 26.07.2066 *	377	0,14	97 Bear Stearns ALT-A Trust 2004-6X Series 2004 6X Class M1X 0,909%, fällig 25.07.2034 *	99	0,04
222 Denali Capital CLO X LLC, Series 2013 1A, Class A1LR, 144A, 1,175%, fällig 26.10.2027 *	222	0,08	800 Navient Student Loan Trust 2018-EA, Series 2018 EA, Class B, 144A, 4,440%, fällig 15.12.2059	839	0,31	10.951 Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust, Series 2018 B5X Class XA, 0,636%, fällig 15.07.2051 *	290	0,11
540 Domino's Pizza Master Issuer LLC, Series 2018 1A, Class A2I, 144A, 4,116%, fällig 25.07.2048	562	0,21	350 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd, Series 2018 29A, Class A1X 144A, 1,264%, fällig 19.10.2031 *	351	0,13	879 BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Class A, 144A, 1,346%, fällig 15.07.2035 *	882	0,33
179 Dryden XXV Senior Loan Fund, Series 2012 25A, Class ARR, 144A, 1,026%, fällig 15.10.2027 *	179	0,07	139 NovaStar Mortgage Funding Trust Series 2003-3X Series 2003 3X Class A1X 0,794%, fällig 25.12.2033 *	138	0,05	330 BXMT 2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2X Class A, 144A, 1,064%, fällig 15.02.2038 *	330	0,12
318 EFS Volunteer No 2 LLC, Series 2012 1X Class A2X 144A, 1,434%, fällig 25.03.2036 *	326	0,12	500 Ocean Trails CLO IX, Series 2020 9A, Class A1X 144A, 1,996%, fällig 15.10.2029 *	502	0,19	100 CD 2017-CD3 Mortgage Trust, Series 2017 CD3X Class A4X 3,631%, fällig 10.02.2050	111	0,04
160 Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Series 2018 4X Class A, 4,060%, fällig 15.11.2030	184	0,07	480 Ocean Trails Clo X, Series 2020 10A, Class A1X 144A, 1,676%, fällig 15.10.2031 *	481	0,18	130 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23X Series 2014 GC23X Class B, 4,175%, fällig 10.07.2047 *	139	0,05
			240 Ocean Trails Clo XI, Series 2021 11A, Class A, 144A, 1,372%, fällig 20.07.2034 *	240	0,09	700 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P3X Series 2016 P3X Class A3X 3,063%, fällig 15.04.2049	738	0,27
						150 COMM 2012-CCRE4 Mortgage Trust, Series 2012 CR4X Class AM, 3,251%, fällig 15.10.2045	151	0,06

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)								
10 COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Series 2013 CR12X Class AM, 4,300%, fällig 10.10.2046	11	-	66 Fannie Mae Pool 'AS6328', 3,500%, fällig 01.12.2045	70	0,03	182 Fannie Mae Pool 'B07625', 3,000%, fällig 01.03.2050	192	0,07
160 Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, Series 2014 UBS2X Class XA, 1,287%, fällig 10.03.2047 *	4	-	417 Fannie Mae Pool 'AS7313', 3,500%, fällig 01.06.2046	450	0,17	48 Fannie Mae Pool 'BP1662', 3,500%, fällig 01.02.2050	51	0,02
106 COMM 2015-LC19 Mortgage Trust, Series 2015 LC19X Class ASB, 3,040%, fällig 10.02.2048	110	0,04	118 Fannie Mae Pool 'AS7738', 3,000%, fällig 01.08.2046	127	0,05	139 Fannie Mae Pool 'BP2319', 3,000%, fällig 01.02.2050	147	0,05
100 CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C1X Class AS, 3,791%, fällig 15.04.2050 *	107	0,04	83 Fannie Mae Pool 'AS7844', 3,000%, fällig 01.09.2046	88	0,03	92 Fannie Mae Pool 'BP8713', 3,000%, fällig 01.08.2050	97	0,04
340 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class A2X 144A, 3,953%, fällig 15.09.2037	367	0,14	73 Fannie Mae Pool 'AS8359', 3,000%, fällig 01.11.2046	78	0,03	86 Fannie Mae Pool 'BP9421', 3,000%, fällig 01.07.2050	91	0,03
420 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class B, 144A, 4,185%, fällig 15.09.2037	428	0,16	30 Fannie Mae Pool 'AS8740', 3,500%, fällig 01.02.2037	33	0,01	92 Fannie Mae Pool 'BQ1150', 2,500%, fällig 01.10.2050	96	0,04
581 CSMC Trust 2018-J1X Series 2018 J1X Class A2X 144A, 3,500%, fällig 25.02.2048 *	595	0,22	52 Fannie Mae Pool 'AS8745', 3,000%, fällig 01.02.2047	56	0,02	95 Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500%, fällig 01.11.2050	100	0,04
1.055 CSMC Trust 2018-J1X Series 2018 J1X Class B2X 144A, 3,617%, fällig 25.02.2048 *	1.078	0,40	66 Fannie Mae Pool 'AS9588', 4,000%, fällig 01.05.2047	72	0,03	97 Fannie Mae Pool 'BQ9224', 2,000%, fällig 01.01.2051	98	0,04
206 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C03X Class 1M2X 3,084%, fällig 25.07.2024 *	209	0,08	27 Fannie Mae Pool 'AT4281', 4,000%, fällig 01.06.2043	30	0,01	96 Fannie Mae Pool 'BQ9226', 2,000%, fällig 01.01.2051	97	0,04
26 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C04X Class 2M2X 5,084%, fällig 25.11.2024 *	27	0,01	53 Fannie Mae Pool 'BC0884', 3,000%, fällig 01.05.2046	57	0,02	97 Fannie Mae Pool 'BR0757', 2,500%, fällig 01.01.2051	101	0,04
2 Fannie Mae Interest Strip 390X Class C3X 6,000%, fällig 25.07.2038	-	-	92 Fannie Mae Pool 'BF1509', 3,000%, fällig 01.08.2046	98	0,04	96 Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000%, fällig 01.02.2051	98	0,04
6 Fannie Mae Interest Strip 407X Class 41X 6,000%, fällig 25.01.2038	1	-	131 Fannie Mae Pool 'BC2817', 3,000%, fällig 01.09.2046	140	0,05	94 Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000%, fällig 01.02.2051	95	0,03
12 Fannie Mae Interest Strip 409X Class C13X 3,500%, fällig 25.11.2041	1	-	35 Fannie Mae Pool 'BC9096', 3,500%, fällig 01.12.2046	37	0,01	96 Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000%, fällig 01.02.2051	98	0,04
12 Fannie Mae Interest Strip 409X Class C18X 4,000%, fällig 25.04.2042	2	-	49 Fannie Mae Pool 'BD2455', 3,000%, fällig 01.01.2047	53	0,02	96 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000%, fällig 01.02.2051	98	0,04
11 Fannie Mae Interest Strip 409X Class C2X 3,000%, fällig 25.04.2027	1	-	52 Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000%, fällig 01.10.2046	56	0,02	97 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000%, fällig 01.02.2051	99	0,04
1.000 Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 1,500% ±	1.016	0,37	144 Fannie Mae Pool 'BE2981', 3,000%, fällig 01.02.2032	153	0,06	96 Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000%, fällig 01.03.2051	98	0,04
200 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 1,500% ±	197	0,07	47 Fannie Mae Pool 'BE3702', 4,000%, fällig 01.06.2047	51	0,02	196 Fannie Mae Pool 'BR3290', 2,000%, fällig 01.03.2051	199	0,07
3.200 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000% ±	3.244	1,20	254 Fannie Mae Pool 'BF0104', 4,000%, fällig 01.02.2056	287	0,11	99 Fannie Mae Pool 'BR4035', 2,000%, fällig 01.02.2051	100	0,04
2 Fannie Mae Pool '888795', 5,500%, fällig 01.11.2036	2	-	300 Fannie Mae Pool 'BF0133', 4,000%, fällig 01.08.2056	337	0,12	97 Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000%, fällig 01.03.2051	98	0,04
46 Fannie Mae Pool '890604', 4,500%, fällig 01.10.2044	52	0,02	72 Fannie Mae Pool 'BF0163', 5,000%, fällig 01.11.2046	82	0,03	97 Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000%, fällig 01.03.2051	99	0,04
54 Fannie Mae Pool '890827', 3,500%, fällig 01.12.2037	58	0,02	113 Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000%, fällig 01.01.2057	128	0,05	98 Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000%, fällig 01.03.2051	99	0,04
28 Fannie Mae Pool 'AB9594', 4,000%, fällig 01.06.2043	31	0,01	262 Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000%, fällig 01.06.2057	285	0,11	98 Fannie Mae Pool 'BR5458', 2,000%, fällig 01.03.2051	100	0,04
303 Fannie Mae Pool 'AH4536', 4,000%, fällig 01.02.2041	334	0,12	165 Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500%, fällig 01.09.2057	185	0,07	97 Fannie Mae Pool 'BR5577', 2,000%, fällig 01.03.2051	99	0,04
12 Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500%, fällig 01.05.2040	14	0,01	58 Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500%, fällig 01.08.2058	65	0,02	98 Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000%, fällig 01.03.2051	99	0,04
91 Fannie Mae Pool 'AL9397', 3,000%, fällig 01.10.2046	97	0,04	249 Fannie Mae Pool 'BH2623', 4,000%, fällig 01.08.2047	269	0,10	99 Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000%, fällig 01.03.2051	101	0,04
123 Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500%, fällig 01.11.2046	133	0,05	30 Fannie Mae Pool 'BH4095', 4,000%, fällig 01.10.2047	32	0,01	98 Fannie Mae Pool 'BR5634', 2,000%, fällig 01.03.2051	100	0,04
51 Fannie Mae Pool 'AL9631', 3,000%, fällig 01.12.2046	55	0,02	108 Fannie Mae Pool 'BH9923', 3,500%, fällig 01.09.2047	115	0,04	98 Fannie Mae Pool 'BR5649', 2,000%, fällig 01.03.2051	100	0,04
20 Fannie Mae Pool 'AM8674', 2,810%, fällig 01.04.2025	21	0,01	58 Fannie Mae Pool 'BJ0685', 4,000%, fällig 01.04.2048	62	0,02	99 Fannie Mae Pool 'BR6462', 2,000%, fällig 01.03.2051	100	0,04
94 Fannie Mae Pool 'AO7501', 4,000%, fällig 01.06.2042	104	0,04	39 Fannie Mae Pool 'BL2454', 3,160%, fällig 01.05.2029	43	0,02	100 Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500%, fällig 01.07.2051	104	0,04
31 Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000%, fällig 01.09.2042	33	0,01	195 Fannie Mae Pool 'BL5850', 2,260%, fällig 01.04.2030	207	0,08	100 Fannie Mae Pool 'BT3244', 2,500%, fällig 01.07.2051	104	0,04
			87 Fannie Mae Pool 'BM1948', 6,000%, fällig 01.07.2041	103	0,04	100 Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500%, fällig 01.08.2051	104	0,04
			25 Fannie Mae Pool 'BM2005', 4,000%, fällig 01.12.2047	27	0,01	100 Fannie Mae Pool 'BT3303', 2,500%, fällig 01.08.2051	105	0,04
			181 Fannie Mae Pool 'BM3473', 3,500%, fällig 01.11.2047	197	0,07	490 Fannie Mae Pool 'CA1692', 4,000%, fällig 01.05.2048	533	0,20
			28 Fannie Mae Pool 'BM3904', 5,000%, fällig 01.05.2048	31	0,01	115 Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500%, fällig 01.07.2048	128	0,05
			488 Fannie Mae Pool 'BM4579', 3,000%, fällig 01.04.2047	524	0,19	181 Fannie Mae Pool 'CA2199', 4,500%, fällig 01.08.2048	200	0,07
			50 Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500%, fällig 01.03.2043	54	0,02	22 Fannie Mae Pool 'CA2251', 5,000%, fällig 01.08.2048	24	0,01
			173 Fannie Mae Pool 'BM5119', 4,500%, fällig 01.12.2048	190	0,07	106 Fannie Mae Pool 'CA2471', 4,000%, fällig 01.10.2048	115	0,04
			841 Fannie Mae Pool 'BM5526', 3,500%, fällig 01.02.2048	895	0,33	157 Fannie Mae Pool 'CA2482', 4,500%, fällig 01.10.2048	172	0,06
			145 Fannie Mae Pool 'BN0341', 5,000%, fällig 01.12.2048	159	0,06	178 Fannie Mae Pool 'CA2652', 5,000%, fällig 01.11.2048	196	0,07
			85 Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500%, fällig 01.11.2048	94	0,03	447 Fannie Mae Pool 'CA2798', 4,500%, fällig 01.12.2048	493	0,18
			1.538 Fannie Mae Pool 'BN3898', 4,500%, fällig 01.12.2048	1.699	0,63	324 Fannie Mae Pool 'CA4979', 3,000%, fällig 01.01.2050	342	0,13
			76 Fannie Mae Pool 'BO2878', 3,000%, fällig 01.11.2049	80	0,03	640 Fannie Mae Pool 'CA5164', 3,500%, fällig 01.02.2050	683	0,25

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)								
94 Fannie Mae Pool 'CA8377', 1,500%, fällig 01.12.2035	96	0,04	99 Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500%, fällig 01.06.2051	104	0,04	182 Fannie Mae REMICS, Series 2020 56X Class DI, 2,500%, fällig 25.08.2050	28	0,01
92 Fannie Mae Pool 'CA8460', 2,500%, fällig 01.01.2051	96	0,04	99 Fannie Mae Pool 'FM7741', 2,500%, fällig 01.05.2051	103	0,04	92 Fannie Mae REMICS, Series 2020 74X Class EI, 2,500%, fällig 25.10.2050	14	–
98 Fannie Mae Pool 'CB0114', 2,500%, fällig 01.04.2041	103	0,04	398 Fannie Mae Pool 'FM7751', 2,000%, fällig 01.05.2051	405	0,15	640 Fannie Mae REMICS, Series 2020 89X Class DI, 2,500%, fällig 25.12.2050	86	0,03
196 Fannie Mae Pool 'CB0470', 2,500%, fällig 01.05.2041	206	0,08	100 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500%, fällig 01.07.2051	104	0,04	488 Fannie Mae REMICS, Series 2020 97X Class AI, 2,000%, fällig 25.01.2051	60	0,02
389 Fannie Mae Pool 'CB0545', 3,500%, fällig 01.05.2051	414	0,15	100 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500%, fällig 01.07.2051	104	0,04	293 Fannie Mae REMICS, Series 2021 3X Class IB, 2,500%, fällig 25.02.2051	51	0,02
67 Fannie Mae Pool 'FM0068', 3,500%, fällig 01.02.2040	73	0,03	1.313 Fannie Mae Pool 'FM8210', 3,000%, fällig 01.04.2050	1.389	0,51	865 Fannie Mae REMICS, Series 2021 3X Class QI, 2,500%, fällig 25.02.2051	119	0,04
60 Fannie Mae Pool 'FM0071', 3,500%, fällig 01.02.2040	65	0,02	191 Fannie Mae Pool 'FM8227', 3,500%, fällig 01.06.2049	203	0,07	78 Fannie Mae-Aces, Series 2013 M6X Class 1AC, 3,533%, fällig 25.02.2043 *	88	0,03
33 Fannie Mae Pool 'FM1468', 5,000%, fällig 01.08.2049	36	0,01	600 Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000%, fällig 01.02.2050	634	0,23	400 Fannie Mae-Aces, Series 2018 M15X Class 1A2X 3,700%, fällig 25.01.2036	466	0,17
32 Fannie Mae Pool 'FM1539', 4,500%, fällig 01.09.2049	35	0,01	48 Fannie Mae Pool 'MA1217', 4,000%, fällig 01.10.2042	52	0,02	196 Fannie Mae-Aces, Series 2018 M9X Class APT2X 3,225%, fällig 25.04.2028 *	218	0,08
367 Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000%, fällig 01.09.2049	409	0,15	23 Fannie Mae Pool 'MA1253', 4,000%, fällig 01.11.2042	25	0,01	200 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M23X Class 3A3X 2,720%, fällig 25.10.2031 *	220	0,08
33 Fannie Mae Pool 'FM2075', 3,000%, fällig 01.12.2049	35	0,01	32 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500%, fällig 01.09.2043	36	0,01	596 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M36X Class X1X 1,560%, fällig 25.09.2034 *	62	0,02
50 Fannie Mae Pool 'FM2158', 4,000%, fällig 01.10.2049	54	0,02	64 Fannie Mae Pool 'MA2110', 3,500%, fällig 01.12.2034	69	0,03	36 Freddie Mac Gold Pool 'C91240', 4,500%, fällig 01.01.2029	39	0,01
73 Fannie Mae Pool 'FM2201', 4,000%, fällig 01.01.2048	79	0,03	44 Fannie Mae Pool 'MA2138', 3,500%, fällig 01.01.2035	47	0,02	13 Freddie Mac Gold Pool 'G06409', 6,000%, fällig 01.11.2039	16	0,01
136 Fannie Mae Pool 'FM2333', 3,500%, fällig 01.02.2050	145	0,05	85 Fannie Mae Pool 'MA2320', 3,000%, fällig 01.07.2035	90	0,03	6 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500%, fällig 01.09.2039	7	–
458 Fannie Mae Pool 'FM2761', 5,000%, fällig 01.03.2050	503	0,19	136 Fannie Mae Pool 'MA2523', 3,000%, fällig 01.02.2036	144	0,05	201 Freddie Mac Gold Pool 'G61637', 3,000%, fällig 01.09.2047	217	0,08
223 Fannie Mae Pool 'FM3141', 3,500%, fällig 01.11.2048	238	0,09	103 Fannie Mae Pool 'MA2579', 3,000%, fällig 01.04.2036	109	0,04	324 Freddie Mac Gold Pool 'J39656', 3,000%, fällig 01.09.2033	341	0,13
52 Fannie Mae Pool 'FM3154', 5,000%, fällig 01.09.2049	57	0,02	243 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000%, fällig 01.07.2036	257	0,09	28 Freddie Mac Gold Pool 'Q17792', 3,500%, fällig 01.05.2043	31	0,01
44 Fannie Mae Pool 'FM3155', 5,000%, fällig 01.12.2049	48	0,02	340 Fannie Mae Pool 'MA2707', 3,000%, fällig 01.08.2036	359	0,13	57 Freddie Mac Gold Pool 'Q29184', 4,000%, fällig 01.10.2044	63	0,02
56 Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000%, fällig 01.11.2048	62	0,02	509 Fannie Mae Pool 'MA2773', 3,000%, fällig 01.10.2036	538	0,20	53 Freddie Mac Gold Pool 'Q45560', 3,000%, fällig 01.01.2047	57	0,02
224 Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500%, fällig 01.05.2047	240	0,09	322 Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000%, fällig 01.12.2036	340	0,13	107 Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000%, fällig 01.01.2047	114	0,04
276 Fannie Mae Pool 'FM3572', 4,500%, fällig 01.09.2049	304	0,11	602 Fannie Mae Pool 'MA3058', 4,000%, fällig 01.07.2047	647	0,24	58 Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000%, fällig 01.01.2047	62	0,02
316 Fannie Mae Pool 'FM3773', 3,500%, fällig 01.11.2048	338	0,12	79 Fannie Mae Pool 'MA3149', 4,000%, fällig 01.10.2047	85	0,03	152 Freddie Mac Gold Pool 'Q56683', 3,000%, fällig 01.04.2048	161	0,06
79 Fannie Mae Pool 'FM3904', 4,000%, fällig 01.03.2049	84	0,03	163 Fannie Mae Pool 'MA3210', 3,500%, fällig 01.12.2047	173	0,06	25 Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000%, fällig 01.10.2042	27	0,01
105 Fannie Mae Pool 'FM3957', 5,000%, fällig 01.03.2050	115	0,04	58 Fannie Mae Pool 'MA3239', 4,000%, fällig 01.01.2048	62	0,02	76 Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500%, fällig 01.03.2045	82	0,03
110 Fannie Mae Pool 'FM3978', 4,000%, fällig 01.07.2050	118	0,04	133 Fannie Mae Pool 'MA3501', 5,000%, fällig 01.10.2048	146	0,05	23 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K016X Class X1X 1,599%, fällig 25.10.2021 *	–	–
93 Fannie Mae Pool 'FM4577', 2,500%, fällig 01.10.2050	97	0,04	13 Fannie Mae REMICS, Series 2001 81X Class GE, 6,000%, fällig 25.01.2032	15	0,01	90 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates Q006X Class A2X 4,505%, fällig 25.04.2028 *	96	0,04
371 Fannie Mae Pool 'FM4595', 3,000%, fällig 01.09.2050	393	0,15	25 Fannie Mae REMICS, Series 2005 29X Class ZA, 5,500%, fällig 25.04.2035	28	0,01	123 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,090%, fällig 01.03.2047 *	127	0,05
736 Fannie Mae Pool 'FM4650', 2,500%, fällig 01.10.2040	775	0,29	12 Fannie Mae REMICS, Series 2011 87X Class SG, 6,466%, fällig 25.04.2040 *	1	–	94 Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500%, fällig 01.11.2050	98	0,04
72 Fannie Mae Pool 'FM4737', 3,500%, fällig 01.09.2050	76	0,03	35 Fannie Mae REMICS, Series 2012 101X Class AI, 3,000%, fällig 25.06.2027	1	–	94 Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500%, fällig 01.11.2050	99	0,04
80 Fannie Mae Pool 'FM4925', 3,000%, fällig 01.11.2050	85	0,03	108 Fannie Mae REMICS, Series 2012 134X Class SK, 6,066%, fällig 25.12.2042 * 23	0,01	–	97 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000%, fällig 01.02.2051	99	0,04
59 Fannie Mae Pool 'FM5054', 4,000%, fällig 01.11.2048	64	0,02	8 Fannie Mae REMICS, Series 2012 46X Class BA, 6,000%, fällig 25.05.2042	10	–			
189 Fannie Mae Pool 'FM5423', 2,500%, fällig 01.01.2051	198	0,07	4 Fannie Mae REMICS, Series 2012 70X Class YS, 6,566%, fällig 25.02.2041 *	–	–			
92 Fannie Mae Pool 'FM5713', 2,500%, fällig 01.02.2051	96	0,04	9 Fannie Mae REMICS, Series 2012 75X Class NS, 6,516%, fällig 25.07.2042 *	2	–			
75 Fannie Mae Pool 'FM5783', 3,000%, fällig 01.06.2038	79	0,03	378 Fannie Mae REMICS, Series 2012 96X Class SB, 5,966%, fällig 25.09.2042 * 65	0,02	–			
66 Fannie Mae Pool 'FM5828', 4,000%, fällig 01.10.2048	71	0,03	12 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9X Class BC, 6,500%, fällig 25.07.2042	15	0,01			
95 Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500%, fällig 01.02.2051	99	0,04	17 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9X Class CB, 5,500%, fällig 25.04.2042	19	0,01			
189 Fannie Mae Pool 'FM5931', 2,500%, fällig 01.02.2051	197	0,07	102 Fannie Mae REMICS, Series 2020 47X Class GZ, 2,000%, fällig 25.07.2050	98	0,04			
189 Fannie Mae Pool 'FM5944', 2,500%, fällig 01.01.2051	198	0,07						
151 Fannie Mae Pool 'FM6134', 3,000%, fällig 01.03.2040	159	0,06						
98 Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500%, fällig 01.03.2051	103	0,04						
99 Fannie Mae Pool 'FM6871', 2,500%, fällig 01.04.2051	104	0,04						
395 Fannie Mae Pool 'FM7210', 2,000%, fällig 01.04.2051	403	0,15						
99 Fannie Mae Pool 'FM7304', 2,500%, fällig 01.05.2051	104	0,04						

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)								
391 Freddie Mac Pool 'QB9087', 2,000%, fällig 01.02.2051	398	0,15	58 Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500%, fällig 01.04.2033	62	0,02	156 Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000%, fällig 20.01.2050	164	0,06
97 Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000%, fällig 01.03.2051	98	0,04	6 Freddie Mac REMICS 3621X Class SB, 6,135%, fällig 15.01.2040 *	1	–	43 Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500%, fällig 20.09.2048	45	0,02
99 Freddie Mac Pool 'QC0297', 2,000%, fällig 01.04.2051	101	0,04	25 Freddie Mac REMICS 3947X Class SG, 5,855%, fällig 15.10.2041 *	4	–	97 Ginnie Mae II Pool '785218', 2,000%, fällig 20.12.2050	99	0,04
98 Freddie Mac Pool 'QC1352', 2,000%, fällig 01.04.2051	100	0,04	16 Freddie Mac REMICS 4194X Class BI, 3,500%, fällig 15.04.2043	2	–	192 Ginnie Mae II Pool '785219', 2,000%, fällig 20.12.2050	196	0,07
99 Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500%, fällig 01.07.2051	104	0,04	6 Freddie Mac REMICS 4298X Class PI, 4,000%, fällig 15.04.2043	–	–	97 Ginnie Mae II Pool '785220', 2,000%, fällig 20.12.2050	99	0,04
100 Freddie Mac Pool 'QC4446', 2,500%, fällig 01.07.2051	105	0,04	45 Freddie Mac REMICS 4813X Class CJ, 3,000%, fällig 15.08.2048	46	0,02	191 Ginnie Mae II Pool '785221', 2,000%, fällig 20.12.2050	195	0,07
100 Freddie Mac Pool 'QC4690', 2,500%, fällig 01.08.2051	105	0,04	84 Freddie Mac REMICS 5010X Class IK, 2,500%, fällig 25.09.2050	11	–	194 Ginnie Mae II Pool '785359', 2,000%, fällig 20.03.2051	198	0,07
99 Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500%, fällig 01.08.2051	104	0,04	279 Freddie Mac REMICS 5010X Class JJ, 2,500%, fällig 25.09.2050	41	0,02	99 Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000%, fällig 20.03.2051	101	0,04
131 Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000%, fällig 01.09.2049	140	0,05	95 Freddie Mac REMICS 5013X Class IN, 2,500%, fällig 25.09.2050	15	0,01	45 Ginnie Mae II Pool '8C4732', 3,500%, fällig 20.10.2047	48	0,02
122 Freddie Mac Pool 'RA2114', 3,500%, fällig 01.02.2050	130	0,05	190 Freddie Mac REMICS 5018X Class ML, 2,000%, fällig 25.10.2050	24	0,01	59 Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500%, fällig 20.02.2050	63	0,02
286 Freddie Mac Pool 'RA2313', 3,500%, fällig 01.03.2050	304	0,11	93 Freddie Mac REMICS 5040X Class IB, 2,500%, fällig 25.11.2050	12	–	146 Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000%, fällig 20.11.2049	154	0,06
44 Freddie Mac Pool 'RA2358', 4,000%, fällig 01.03.2050	47	0,02	390 Freddie Mac REMICS 5059X Class IB, 2,500%, fällig 25.01.2051	55	0,02	66 Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000%, fällig 20.02.2050	71	0,03
108 Freddie Mac Pool 'RA2362', 3,500%, fällig 01.03.2050	114	0,04	96 Freddie Mac REMICS 5069X Class ML, 2,500%, fällig 25.02.2051	13	–	97 Ginnie Mae II Pool 'BS8546', 2,500%, fällig 20.12.2050	102	0,04
775 Freddie Mac Pool 'RA3474', 3,000%, fällig 01.09.2050	816	0,30	164 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6X Series 2020 DNA6X Class M1X 144A, 0,950%, fällig 25.12.2050 *	164	0,06	208 Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000%, fällig 20.03.2050	218	0,08
189 Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000%, fällig 01.11.2050	192	0,07	261 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA1X Class M3X 5,634%, fällig 25.07.2028 *	274	0,10	97 Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500%, fällig 20.12.2050	101	0,04
379 Freddie Mac Pool 'RA4175', 2,500%, fällig 01.12.2050	398	0,15	80 Freddie Mac Structured PassThrough Certifi-cates, Series T 56X Class 2AF, 0,484%, fällig 25.05.2043 *	81	0,03	99 Ginnie Mae II Pool 'BZ4350', 2,500%, fällig 20.03.2051	103	0,04
188 Freddie Mac Pool 'RA4414', 2,500%, fällig 01.01.2051	197	0,07	20 Ginnie Mae I Pool '557522', 7,000%, fällig 15.07.2031	23	0,01	43 Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500%, fällig 20.06.2044	47	0,02
289 Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000%, fällig 01.02.2051	294	0,11	11 Ginnie Mae I Pool '565347', 7,000%, fällig 15.08.2031	11	–	54 Ginnie Mae II Pool 'MA2677', 3,000%, fällig 20.03.2045	57	0,02
588 Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000%, fällig 01.05.2051	599	0,22	5 Ginnie Mae I Pool '584344', 7,000%, fällig 15.04.2032	5	–	16 Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500%, fällig 20.03.2045	17	0,01
395 Freddie Mac Pool 'RA5155', 2,000%, fällig 01.05.2051	403	0,15	94 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500%, fällig 15.06.2048	101	0,04	172 Ginnie Mae II Pool 'MA3521', 3,500%, fällig 20.03.2046	183	0,07
99 Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000%, fällig 01.06.2051	101	0,04	49 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000%, fällig 15.09.2042	53	0,02	92 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500%, fällig 20.04.2046	98	0,04
398 Freddie Mac Pool 'RA5576', 2,500%, fällig 01.07.2051	417	0,15	76 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000%, fällig 15.09.2042	80	0,03	24 Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500%, fällig 20.05.2046	25	0,01
400 Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000%, fällig 01.09.2041	410	0,15	162 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000%, fällig 15.10.2042	171	0,06	73 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500%, fällig 20.06.2046	78	0,03
197 Freddie Mac Pool 'SD0552', 2,000%, fällig 01.03.2051	200	0,07	11 Ginnie Mae II Pool '4837', 6,000%, fällig 20.10.2040	13	–	24 Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500%, fällig 20.07.2046	26	0,01
99 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000%, fällig 01.04.2051	101	0,04	9 Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500%, fällig 20.01.2041	10	–	137 Ginnie Mae II Pool 'MA3873', 3,000%, fällig 20.08.2046	144	0,05
99 Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500%, fällig 01.07.2051	104	0,04	7 Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000%, fällig 20.02.2041	8	–	27 Ginnie Mae II Pool 'MA3937', 3,500%, fällig 20.09.2046	29	0,01
35 Freddie Mac Pool 'ZA5318', 3,500%, fällig 01.03.2048	37	0,01	22 Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500%, fällig 20.03.2041	25	0,01	30 Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000%, fällig 20.11.2046	31	0,01
332 Freddie Mac Pool 'ZA6342', 4,500%, fällig 01.03.2049	365	0,13	11 Ginnie Mae II Pool '5240', 6,000%, fällig 20.11.2041	13	–	33 Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000%, fällig 20.02.2047	35	0,01
11 Freddie Mac Pool 'Z17269', 5,000%, fällig 01.03.2038	12	–	21 Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500%, fällig 20.01.2046	23	0,01	264 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000%, fällig 20.06.2047	284	0,10
27 Freddie Mac Pool 'ZM8774', 5,000%, fällig 01.10.2048	30	0,01	696 Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000%, fällig 20.07.2047	747	0,28	223 Ginnie Mae II Pool 'MA4719', 3,500%, fällig 20.09.2047	237	0,09
37 Freddie Mac Pool 'ZN0538', 3,500%, fällig 01.11.2042	40	0,01	33 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500%, fällig 20.10.2049	34	0,01	156 Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000%, fällig 20.11.2047	168	0,06
29 Freddie Mac Pool 'ZN1436', 5,000%, fällig 01.11.2048	32	0,01				19 Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000%, fällig 20.12.2047	20	0,01
6 Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500%, fällig 01.12.2038	7	–				102 Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000%, fällig 20.12.2047	109	0,04
10 Freddie Mac Pool 'ZS3569', 6,000%, fällig 01.10.2036	12	–				17 Ginnie Mae II Pool 'MA5018', 3,000%, fällig 20.02.2048	18	0,01
122 Freddie Mac Pool 'ZS4699', 4,000%, fällig 01.01.2047	133	0,05				176 Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500%, fällig 20.02.2048	187	0,07
35 Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000%, fällig 01.10.2032	37	0,01				49 Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000%, fällig 20.02.2048	53	0,02
141 Freddie Mac Pool 'ZS9316', 3,500%, fällig 01.01.2038	152	0,06				68 Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000%, fällig 20.03.2048	72	0,03
24 Freddie Mac Pool 'ZT0714', 5,000%, fällig 01.10.2048	26	0,01				41 Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000%, fällig 20.04.2048	43	0,02
62 Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000%, fällig 01.01.2046	67	0,02				170 Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500%, fällig 20.05.2048	181	0,07
220 Freddie Mac Pool 'ZT1493', 3,000%, fällig 01.09.2048	235	0,09				156 Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500%, fällig 20.06.2048	168	0,06
223 Freddie Mac Pool 'ZT1596', 5,000%, fällig 01.01.2049	245	0,09				76 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500%, fällig 20.07.2048	81	0,03
132 Freddie Mac Pool 'ZT1854', 4,500%, fällig 01.03.2049	145	0,05				388 Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500%, fällig 20.09.2048	415	0,15
						120 Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500%, fällig 20.10.2048	128	0,05

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)								
51			9			3.619		
Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500%, fällig 20.12.2048	55	0,02	Government National Mortgage Association, Series 2013 145X Class XI, 0,001%, fällig 16.09.2044	–	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 179X Class IO, 1,003%, fällig 16.09.2062 *	310	0,11
537			43			479		
Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500%, fällig 20.01.2049	575	0,21	Government National Mortgage Association, Series 2013 163X Class IO, 1,160%, fällig 16.02.2046 *	1	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 181X Class WI, 2,000%, fällig 20.12.2050	49	0,02
24			103			2.074		
Ginnie Mae II Pool 'MA5762', 3,500%, fällig 20.02.2049	26	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2013 H08X Class BF, 0,503%, fällig 20.03.2063 *	104	0,04	Government National Mortgage Association, Series 2020 195X Class IO, 0,967%, fällig 16.12.2062 *	179	0,07
180			46			362		
Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500%, fällig 20.03.2049	192	0,07	Government National Mortgage Association, Series 2014 105X Class IO, 0,204%, fällig 16.06.2054 *	2	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 47X Class MI, 3,500%, fällig 20.04.2050	53	0,02
93			15			90		
Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500%, fällig 20.04.2049	100	0,04	Government National Mortgage Association, Series 2014 17X Class AM, 3,318%, fällig 16.06.2048 *	16	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2020 47X Class NI, 3,500%, fällig 20.04.2050	14	–
63			23			250		
Ginnie Mae II Pool 'MA6767', 3,500%, fällig 20.07.2050	66	0,02	Government National Mortgage Association, Series 2014 47X Class IA, 0,111%, fällig 16.02.2048 *	–	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 H04X Class FP, 0,603%, fällig 20.06.2069 *	252	0,09
151			76			271		
Ginnie Mae II Pool 'MA6933', 3,500%, fällig 20.10.2050	159	0,06	Government National Mortgage Association, Series 2014 50X Class IO, 0,705%, fällig 16.09.2055 *	3	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09X Class FL, 1,238%, fällig 20.05.2070 *	285	0,10
157			278			160		
Ginnie Mae II Pool 'MA6997', 3,500%, fällig 20.11.2050	165	0,06	Government National Mortgage Association, Series 2014 92X Class IX, 0,190%, fällig 16.05.2054 *	3	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09X Class NF, 1,338%, fällig 20.04.2070 *	165	0,06
500			635			92		
Ginnie Mae II Pool 'MA7056', 4,500%, fällig 20.12.2050	534	0,20	Government National Mortgage Association, Series 2014 H20X Class FA, 0,533%, fällig 20.10.2064 *	637	0,24	Government National Mortgage Association, Series 2020 H13X Class FA, 0,538%, fällig 20.07.2070 *	93	0,03
179			64			6.802		
Ginnie Mae II Pool 'MA7473', 3,000%, fällig 20.07.2051	188	0,07	Government National Mortgage Association, Series 2015 167X Class OL, 4,000%, fällig 16.04.2045	9	–	Government National Mortgage Association, Series 2021 10X Class IO, 1,000%, fällig 16.05.2063 *	606	0,22
800			44			5.664		
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000% ±	817	0,30	Government National Mortgage Association, Series 2015 36X Class MI, 5,500%, fällig 20.03.2045	7	–	Government National Mortgage Association, Series 2021 5X Class IO, 1,094%, fällig 16.01.2061 *	528	0,19
2.100			846			520		
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500% ±	2.178	0,80	Government National Mortgage Association, Series 2015 5X Class IK, 0,464%, fällig 16.11.2054 *	16	0,01	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5X Class A, 144A, 1,646%, fällig 15.09.2031 *	473	0,17
7			498			900		
Government National Mortgage Association, Series 2007 51X Class SG, 6,492%, fällig 20.08.2037 *	1	–	Government National Mortgage Association, Series 2016 128X Class IO, 0,818%, fällig 16.09.2056 *	25	0,01	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5X Class B, 144A, 2,846%, fällig 15.09.2031 *	731	0,27
18			3			570		
Government National Mortgage Association, Series 2009 H01X Class FA, 1,238%, fällig 20.11.2059 *	18	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2019 123X Class A, 3,000%, fällig 20.10.2049	3	–	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, Series 2018 3PCK, Class B, 144A, 2,346%, fällig 15.09.2031 *	542	0,20
3			97			10		
Government National Mortgage Association, Series 2010 85X Class HS, 6,562%, fällig 20.01.2040 *	–	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 123X Class IL, 2,500%, fällig 20.08.2050	13	–	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16X Series 2013 GC16X Class B, 5,161%, fällig 10.11.2046 *	11	–
31			190			95		
Government National Mortgage Association, Series 2010 H26X Class LF, 0,453%, fällig 20.08.2058 *	31	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2020 123X Class NI, 2,500%, fällig 20.08.2050	25	0,01	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-9X Series 2005 9X Class 2A1B, 0,828%, fällig 20.06.2035 *	95	0,03
48			96			450		
Government National Mortgage Association, Series 2011 H01X Class AF, 0,553%, fällig 20.11.2060 *	48	0,02	Government National Mortgage Association, Series 2020 127X Class IN, 2,500%, fällig 20.08.2050	13	–	Independence Plaza Trust 2018-INDP, Series 2018 INDP, Class A, 144A, 3,763%, fällig 10.07.2035	477	0,18
62			96			10		
Government National Mortgage Association, Series 2011 H09X Class AF, 0,603%, fällig 20.03.2061 *	62	0,02	Government National Mortgage Association, Series 2020 129X Class IE, 2,500%, fällig 20.09.2050	13	–	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17X Series 2013 C17X Class B, 5,049%, fällig 15.01.2047 *	11	–
142			97			120		
Government National Mortgage Association, Series 2012 112X Class IO, 0,150%, fällig 16.02.2053 *	1	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 160X Class IH, 2,500%, fällig 20.10.2050	13	–	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23X Series 2014 C23X Class AS, 4,202%, fällig 15.09.2047 *	130	0,05
103			96			13.535		
Government National Mortgage Association, Series 2012 27X Class IO, 0,770%, fällig 16.04.2053 *	1	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 160X Class VI, 2,500%, fällig 20.10.2050	13	–	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2018-C8X Series 2018 C8X Class XA, 0,792%, fällig 15.06.2051 *	0,15	408
23			385			100		
Government National Mortgage Association, Series 2012 34X Class SA, 5,962%, fällig 20.03.2042 *	5	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 160X Class YI, 2,500%, fällig 20.10.2050	53	0,02	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18X Series 2014 C18X Class AS, 4,110%, fällig 15.10.2047 *	108	0,04
53			4.702					
Government National Mortgage Association, Series 2012 44X Class IO, 0,030%, fällig 16.03.2049 *	–	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 178X Class IO, 1,415%, fällig 16.10.2060 *	508	0,19			
10								
Government National Mortgage Association, Series 2012 66X Class CI, 3,500%, fällig 20.02.2038	–	–						
28								
Government National Mortgage Association, Series 2012 H18X Class NA, 0,623%, fällig 20.08.2062 *	28	0,01						
59								
Government National Mortgage Association, Series 2012 H27X Class AI, 1,747%, fällig 20.10.2062 *	3	–						
37								
Government National Mortgage Association, Series 2012 H30X Class GA, 0,453%, fällig 20.12.2062 *	37	0,01						
110								
Government National Mortgage Association, Series 2013 107X Class AD, 2,769%, fällig 16.11.2047 *	116	0,04						

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)								
Belgien – 0,57 % (28. Februar 2021: 0,55 %)								
26 Morgan Stanley Capital I Trust 2012-C4X Series 2012 C4X Class A4X 3,244%, fällig 15.03.2045	27	0,01	120 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650%, fällig 01.02.2026	133	0,05	Finnland – 0,09 % (28. Februar 2021: 0,08 %)		
235 Morgan Stanley Capital I Trust 2017-ASHF, Series 2017 ASHF, Class A, 144A, 0,946%, fällig 15.11.2034 *	234	0,09	140 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000%, fällig 13.04.2028	160	0,06	250 Nordea Bank Abp, 144A, 1,000%, fällig 09.06.2023	253	0,09
550 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class A, 144A, 3,047%, fällig 15.08.2036	563	0,21	480 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,750%, fällig 23.01.2029	571	0,21	Frankreich – 0,58 % (28. Februar 2021: 0,53 %)		
250 New Residential Mortgage Loan Trust 2015-2X Series 2015 2A, Class A1X 144A, 3,750%, fällig 25.08.2055 *	265	0,10	60 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500%, fällig 01.06.2030	67	0,02	200 BNP Paribas SA, 144A, 4,705%, fällig 10.01.2025 *	218	0,08
376 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3X Series 2016 3A, Class A1B, 144A, 3,250%, fällig 25.09.2056 *	397	0,15	180 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350%, fällig 01.06.2040	216	0,08	400 BNP Paribas SA, 144A, 2,219%, fällig 09.06.2026 *	412	0,15
292 New Residential Mortgage Loan Trust 2017-2X Series 2017 2A, Class B1X 144A, 4,500%, fällig 25.03.2057 *	315	0,12	100 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439%, fällig 06.10.2048	121	0,04	200 BNP Paribas SA, 144A, 4,400%, fällig 14.08.2028	231	0,09
433 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Series 2021 NQ2R, Class A3X 144A, 1,353%, fällig 25.09.2058 *	434	0,16	230 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500%, fällig 01.06.2050	286	0,11	200 BNP Paribas SA, 144A, 5,198%, fällig 10.01.2030 *	241	0,09
7 Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-4X Series 2007 4X Class 1A1X 2,064%, fällig 25.09.2037 *	7	-		1.554	0,57	250 Credit Agricole SA/London, 144A, 1,907%, fällig 16.06.2026 *	256	0,09
300 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C15X Series 2018 C15X Class C, 5,291%, fällig 15.12.2051 *	333	0,12	Brasilien – 0,78 % (28. Februar 2021: 0,69 %)			200 Danone SA, 2,589%, fällig 02.11.2023	208	0,08
483 WaMu Mortgage PassThrough Certificates Series 2005-AR6 Trust, Series 2005 AR6X Class 2A1A, 0,544%, fällig 25.04.2045 *	478	0,18	10 Petrobras Global Finance BV, 6,250%, fällig 17.03.2024	11	-	Indonesien – 0,30 % (28. Februar 2021: 0,25 %)		
1.089 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1X Series 2015 NXS1X Class XA, 1,231%, fällig 15.05.2048 *	33	0,01	50 Petrobras Global Finance BV, 6,850%, fällig 05.06.2115	56	0,02	700 Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 5,250%, fällig 24.10.2042	801	0,30
330 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1X Series 2016 BNK1X Class B, 2,967%, fällig 15.08.2049	337	0,12	690 Suzano Austria GmbH, 6,000%, fällig 15.01.2029	825	0,31	Italien – 0,19 % (28. Februar 2021: 0,17 %)		
1.598 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36X Series 2016 C36X Class XA, 1,397%, fällig 15.11.2059 *	81	0,03	270 Vale Overseas Ltd, 6,250%, fällig 10.08.2026	326	0,12	500 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,125%, fällig 14.07.2022	512	0,19
460 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41X Series 2017 C41X Class B, 4,188%, fällig 15.11.2050 *	499	0,18	20 Vale Overseas Ltd, 6,875%, fällig 21.11.2036	28	0,01	Kasachstan – 0,29 % (28. Februar 2021: 0,26 %)		
129 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RC1X Series 2017 RC1X Class A2X 3,118%, fällig 15.01.2060	130	0,05	600 Vale Overseas Ltd, 6,875%, fällig 10.11.2039	859	0,32	650 KazMunayGas National Co JSC, 5,375%, fällig 24.04.2030	780	0,29
1.647 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C23X Series 2014 C23X Class XA, 0,709%, fällig 15.10.2057 *	24	0,01		2.105	0,78	Kuwait – 0,29 % (28. Februar 2021: 0,15 %)		
49 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14X Series 2014 LC14X Class ASB, 3,522%, fällig 15.03.2047	50	0,02	Kanada – 0,41 % (28. Februar 2021: 0,42 %)			400 Equate Petrochemical BV, 4,250%, fällig 03.11.2026	446	0,17
			240 Bank of Montreal, 1,850%, fällig 01.05.2025	248	0,09	320 Equate Petrochemical BV, 144A, 2,625%, fällig 28.04.2028	326	0,12
Summe hypothekarisch gesicherte Wertpapiere (Kosten 74.201 USD)	74.935	27,67	30 Bank of Montreal, 3,803%, fällig 15.12.2032 *	33	0,01	Macau – 0,08 % (28. Februar 2021: 0,07 %)		
			130 Bank of Nova Scotia/The, 1,300%, fällig 11.06.2025	132	0,05	200 Sands China Ltd, 5,125%, fällig 08.08.2025	223	0,08
			40 Barrick North America Finance LLC, 5,700%, fällig 30.05.2041	55	0,02	Mexiko – 0,68 % (28. Februar 2021: 0,47 %)		
			110 Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950%, fällig 15.10.2039	154	0,06	200 Comision Federal de Electricidad, 4,750%, fällig 23.02.2027	226	0,08
			130 Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,950%, fällig 23.06.2023	131	0,05	700 Comision Federal de Electricidad, 144A, 3,348%, fällig 09.02.2031	699	0,26
			210 Royal Bank of Canada, 1,600%, fällig 17.04.2023	215	0,08	200 Orbia Advance Corp SAB de CV, 144A, 1,875%, fällig 11.05.2026	202	0,07
			130 Royal Bank of Canada, 1,150%, fällig 10.06.2025	131	0,05	200 Orbia Advance Corp SAB de CV, 144A, 2,875%, fällig 11.05.2031	203	0,08
				1.099	0,41	440 Petroleos Mexicanos, 6,625%, fällig 15.06.2035	427	0,16
			Chile – 0,32 % (28. Februar 2021: 0,30 %)			20 Petroleos Mexicanos, 6,375%, fällig 23.01.2045	17	0,01
			800 Corp Nacional del Cobre de Chile, 3,625%, fällig 01.08.2027	873	0,32	70 Petroleos Mexicanos, 5,625%, fällig 23.01.2046	57	0,02
			China – 0,21 % (28. Februar 2021: 0,17 %)			Niederlande – 0,60 % (28. Februar 2021: 0,61 %)		
			80 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144A, 2,700%, fällig 01.05.2025	84	0,03	20 Cooperatieve Rabobank UA, 3,875%, fällig 08.02.2022	20	0,01
			450 Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 4,375%, fällig 10.04.2024	491	0,18	250 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375%, fällig 04.08.2025	280	0,10
				575	0,21	300 Cooperatieve Rabobank UA, 3,750%, fällig 21.07.2026	332	0,12
			Kolumbien – 0,26 % (28. Februar 2021: 0,24 %)			260 Cooperatieve Rabobank UA/ NY, 3,375%, fällig 21.05.2025	285	0,11
			650 Ecopetrol SA, 5,875%, fällig 28.05.2045	698	0,26	110 Shell International Finance BV, 2,875%, fällig 10.05.2026	119	0,04
			Dänemark – 0,31 % (28. Februar 2021: 0,29 %)			120 Shell International Finance BV, 2,750%, fällig 06.04.2030	128	0,05
			400 Danske Bank A/S, 144A, 5,000%, fällig 12.01.2022	406	0,15	10 Shell International Finance BV, 4,550%, fällig 12.08.2043	13	-
			200 Danske Bank A/S, 144A, 3,875%, fällig 12.09.2023	212	0,08	140 Shell International Finance BV, 4,000%, fällig 10.05.2046	168	0,06
			200 Danske Bank A/S, 144A, 5,375%, fällig 12.01.2024	221	0,08	270 Shell International Finance BV, 3,250%, fällig 06.04.2050	292	0,11
				839	0,31	Peru – 0,55 % (28. Februar 2021: 0,51 %)		
						400 Petroleos del Peru SA, 4,750%, fällig 19.06.2032	418	0,15

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			200 HSBC Holdings Plc, 4,950%, fällig 31.03.2030	242	0,09	200 Amazon.com Inc, 3,150%, fällig 22.08.2027	221	0,08
Peru – (Fortsetzung)			200 Lloyds Banking Group Plc, 2,907%, fällig 07.11.2023 *	206	0,08	100 Amazon.com Inc, 1,500%, fällig 03.06.2030	98	0,04
200 Petroleos del Peru SA, 144A, 5,625%, fällig 19.06.2047	209	0,08	200 Lloyds Banking Group Plc, 4,650%, fällig 24.03.2026	227	0,08	80 Amazon.com Inc, 2,100%, fällig 12.05.2031	82	0,03
680 Southern Copper Corp, 5,250%, fällig 08.11.2042	875	0,32	200 Lloyds Banking Group Plc, 4,375%, fällig 22.03.2028	230	0,08	80 Amazon.com Inc, 4,950%, fällig 05.12.2044	110	0,04
	1.502	0,55	200 Nationwide Building Society, 144A, 4,363%, fällig 01.08.2024 *	213	0,08	410 Amazon.com Inc, 2,500%, fällig 03.06.2050	394	0,15
Katar – 0,32 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			200 Natwest Group Plc, 4,519%, fällig 25.06.2024 *	214	0,08	30 Amazon.com Inc, 4,250%, fällig 22.08.2057	39	0,01
370 Qatar Petroleum, 144A, 2,250%, fällig 12.07.2031	374	0,14	200 Natwest Group Plc, 4,269%, fällig 22.03.2025 *	217	0,08	210 American Express Co, 2,500%, fällig 30.07.2024	221	0,08
230 Qatar Petroleum, 144A, 3,125%, fällig 12.07.2041	237	0,09	200 Natwest Group Plc, 4,892%, fällig 18.05.2029 *	235	0,09	250 American Express Co, 3,625%, fällig 05.12.2024	272	0,10
240 Qatar Petroleum, 144A, 3,300%, fällig 12.07.2051	248	0,09	270 Reynolds American Inc, 5,850%, fällig 15.08.2045	334	0,12	70 American International Group Inc, 2,500%, fällig 30.06.2025	74	0,03
	859	0,32	140 Vodafone Group Plc, 4,375%, fällig 30.05.2028	163	0,06	100 American International Group Inc, 6,250%, fällig 15.03.2037 *	119	0,04
Russland – 0,12 % (28. Februar 2021: 0,11 %)				3.696	1,36	50 American International Group Inc, 4,750%, fällig 01.04.2048	65	0,02
300 Lukoil International Finance BV, 144A, 4,750%, fällig 02.11.2026	337	0,12	Vereinigte Staaten – 27,25 % (28. Februar 2021: 24,75 %)			11 Amgen Inc, 4,663%, fällig 15.06.2051	14	0,01
Südafrika – 0,12 % (28. Februar 2021: 0,11 %)			10 3M Co, 3,375%, fällig 26.08.2029	11	–	20 Anthem Inc, 3,125%, fällig 15.05.2022	20	0,01
290 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750%, fällig 10.04.2027	335	0,12	90 3M Co, 3,700%, fällig 15.04.2050	107	0,04	30 Anthem Inc, 2,950%, fällig 01.12.2022	31	0,01
Spanien – 0,38 % (28. Februar 2021: 0,34 %)			208 Abbott Laboratories, 3,750%, fällig 30.11.2026	235	0,09	20 Anthem Inc, 3,350%, fällig 01.12.2024	22	0,01
200 Banco Santander SA, 3,848%, fällig 12.04.2023	211	0,08	10 Abbott Laboratories, 4,750%, fällig 30.11.2036	13	–	170 Anthem Inc, 3,650%, fällig 01.12.2027	190	0,07
600 Banco Santander SA, 2,746%, fällig 28.05.2025	633	0,23	100 Abbott Laboratories, 4,900%, fällig 30.11.2046	139	0,05	310 Apple Inc, 1,125%, fällig 11.05.2025	314	0,12
150 Telefonica Emisiones SA, 5,213%, fällig 08.03.2047	188	0,07	20 AbbVie Inc, 3,450%, fällig 15.03.2022	20	0,01	130 Apple Inc, 2,450%, fällig 04.08.2026	139	0,05
	1.032	0,38	220 AbbVie Inc, 2,300%, fällig 21.11.2022	225	0,08	200 Applied Materials Inc, 1,750%, fällig 01.06.2030	199	0,07
Schweden – 0,08 % (28. Februar 2021: 0,15 %)			30 AbbVie Inc, 3,750%, fällig 14.11.2023	32	0,01	70 AT&T Inc, 3,800%, fällig 15.02.2027	78	0,03
200 Swedbank AB, 144A, 1,300%, fällig 02.06.2023	203	0,08	380 AbbVie Inc, 2,600%, fällig 21.11.2024	401	0,15	260 AT&T Inc, 2,300%, fällig 01.06.2027	271	0,10
Schweiz – 0,76 % (28. Februar 2021: 0,61 %)			100 AbbVie Inc, 3,800%, fällig 15.03.2025	109	0,04	130 AT&T Inc, 1,650%, fällig 01.02.2028	130	0,05
310 Credit Suisse AG/New York NY, 1,000%, fällig 05.05.2023	313	0,11	20 AbbVie Inc, 3,600%, fällig 14.05.2025	22	0,01	30 AT&T Inc, 2,250%, fällig 01.02.2032	30	0,01
250 Credit Suisse AG/New York NY, 2,950%, fällig 09.04.2025	267	0,10	90 AbbVie Inc, 2,950%, fällig 21.11.2026	97	0,04	30 AT&T Inc, 144 A 2,550%, fällig 01.12.2033	30	0,01
500 Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194%, fällig 01.04.2031 *	567	0,21	890 AbbVie Inc, 3,200%, fällig 21.11.2029	973	0,36	200 AT&T Inc, 3,100%, fällig 01.02.2043	198	0,07
250 Credit Suisse Group AG, 144A, 3,091%, fällig 14.05.2032 *	261	0,10	20 AbbVie Inc, 4,250%, fällig 21.11.2049	24	0,01	37 AT&T Inc, 4,350%, fällig 15.06.2045	43	0,02
230 UBS AG/London, 144A, 1,750%, fällig 21.04.2022	232	0,09	210 Adobe Inc, 2,300%, fällig 01.02.2030	219	0,08	178 AT&T Inc, 4,500%, fällig 09.03.2048	211	0,08
200 UBS Group AG, 144A, 2,859%, fällig 15.08.2023 *	205	0,07	10 Aetna Inc, 2,800%, fällig 15.06.2023	10	–	116 AT&T Inc, 144 A 3,550%, fällig 15.09.2055	119	0,04
200 UBS Group AG, 144A, 3,126%, fällig 13.08.2030 *	216	0,08	10 Aetna Inc, 3,875%, fällig 15.08.2047	11	–	33 AT&T Inc, 144 A 3,650%, fällig 15.09.2059	34	0,01
	2.061	0,76	90 Air Lease Corp, 3,375%, fällig 01.07.2025	96	0,04	10 Bank of America Corp, 3,300%, fällig 11.01.2023	10	–
Vereinigte Arabische Emirate – 0,60 % (28. Februar 2021: 0,29 %)			30 Alphabet Inc, 0,450%, fällig 15.08.2025	30	0,01	35 Bank of America Corp, 3,004%, fällig 20.12.2023 *	36	0,01
410 Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 144A, 2,000%, fällig 29.04.2028	415	0,15	50 Alphabet Inc, 0,800%, fällig 15.08.2027	49	0,02	90 Bank of America Corp, 3,550%, fällig 05.03.2024 *	94	0,03
270 Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 144A, 3,400%, fällig 29.04.2051	287	0,11	60 Alphabet Inc, 1,100%, fällig 15.08.2030	57	0,02	30 Bank of America Corp, 4,000%, fällig 01.04.2024	33	0,01
730 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625%, fällig 25.09.2048	920	0,34	110 Alphabet Inc, 2,050%, fällig 15.08.2050	100	0,04	110 Bank of America Corp, 4,200%, fällig 26.08.2024	121	0,04
	1.622	0,60	40 Altria Group Inc, 2,350%, fällig 06.05.2025	42	0,02	310 Bank of America Corp, 4,000%, fällig 22.01.2025	339	0,13
Großbritannien – 1,36 % (28. Februar 2021: 1,30 %)			68 Altria Group Inc, 4,400%, fällig 14.02.2026	77	0,03	10 Bank of America Corp, 4,450%, fällig 03.03.2026	11	–
200 Barclays Bank Plc, 1,700%, fällig 12.05.2022	202	0,07	52 Altria Group Inc, 4,800%, fällig 14.02.2029	61	0,02	50 Bank of America Corp, 3,500%, fällig 19.04.2026	55	0,02
200 Barclays Plc, 4,972%, fällig 16.05.2029 *	235	0,09	20 Altria Group Inc, 5,800%, fällig 14.02.2039	25	0,01	400 Bank of America Corp, 1,319%, fällig 19.06.2026 *	401	0,15
130 BAT Capital Corp, 4,540%, fällig 15.08.2047	140	0,05	100 Altria Group Inc, 3,875%, fällig 16.09.2046	101	0,04	320 Bank of America Corp, 4,250%, fällig 22.10.2026	364	0,13
10 BP Capital Markets Plc, 3,535%, fällig 04.11.2024	11	–	320 Altria Group Inc, 5,950%, fällig 14.02.2049	416	0,15	180 Bank of America Corp, 3,593%, fällig 21.07.2028 *	199	0,07
200 HSBC Holdings Plc, 2,633%, fällig 07.11.2025 *	209	0,08	24 Altria Group Inc, 6,200%, fällig 14.02.2059	31	0,01	333 Bank of America Corp, 3,419%, fällig 20.12.2028 *	366	0,14
350 HSBC Holdings Plc, 4,300%, fällig 08.03.2026	395	0,15	160 Amazon.com Inc, 0,800%, fällig 03.06.2025	160	0,06			
200 HSBC Holdings Plc, 4,041%, fällig 13.03.2028 *	223	0,08	200 Amazon.com Inc, 1,200%, fällig 03.06.2027	201	0,07			

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			580 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908%, fällig 23.07.2025			400 Citigroup Inc, 8,125%, fällig 15.07.2039		
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)			460 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200%, fällig 15.03.2028			77 Citigroup Inc, 4,650%, fällig 30.07.2045		
350 Bank of America Corp, 3,970%, fällig 05.03.2029 *	395	0,15	80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050%, fällig 30.03.2029	521	0,19	10 Citigroup Inc, 4,750%, fällig 18.05.2046	691	0,26
200 Bank of America Corp, 3,974%, fällig 07.02.2030 *	227	0,08	200 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, fällig 01.04.2038	248	0,09	90 Coca-Cola Co/The, 3,375%, fällig 25.03.2027	100	0,04
600 Bank of America Corp, 2,592%, fällig 29.04.2031 *	621	0,23	90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484%, fällig 23.10.2045	126	0,05	140 Coca-Cola Co/The, 1,450%, fällig 01.06.2027	143	0,05
140 Bank of America Corp, 5,000%, fällig 21.01.2044	189	0,07	100 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750%, fällig 01.04.2048	129	0,05	60 Coca-Cola Co/The, 2,500%, fällig 01.06.2040	60	0,02
290 Bank of America Corp, 3,946%, fällig 23.01.2049 *	343	0,13	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800%, fällig 01.03.2050	47	0,02	30 Coca-Cola Co/The, 2,600%, fällig 01.06.2050	30	0,01
300 Bank of America Corp, 4,083%, fällig 20.03.2051 *	363	0,13	160 Chevron Corp, 1,554%, fällig 11.05.2025	164	0,06	10 Comcast Corp, 3,100%, fällig 01.04.2025	11	–
70 Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600%, fällig 24.04.2025	72	0,03	140 Chevron Corp, 2,954%, fällig 16.05.2026	152	0,06	30 Comcast Corp, 3,950%, fällig 15.10.2025	34	0,01
73 Becton Dickinson and Co, 3,363%, fällig 06.06.2024	78	0,03	40 Chevron Corp, 1,995%, fällig 11.05.2027	42	0,02	70 Comcast Corp, 3,150%, fällig 01.03.2026	76	0,03
6 Becton Dickinson and Co, 3,734%, fällig 15.12.2024	7	–	210 Chevron Corp, 2,978%, fällig 11.05.2040	220	0,08	120 Comcast Corp, 3,300%, fällig 01.04.2027	132	0,05
94 Becton Dickinson and Co, 4,685%, fällig 15.12.2044	120	0,04	70 Chevron USA Inc, 3,850%, fällig 15.01.2028	80	0,03	320 Comcast Corp, 4,150%, fällig 15.10.2028	372	0,14
130 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250%, fällig 15.01.2049	164	0,06	330 Chevron USA Inc, 4,950%, fällig 15.08.2047	454	0,17	80 Comcast Corp, 3,400%, fällig 01.04.2030	89	0,03
430 Boeing Co/The, 4,875%, fällig 01.05.2025	481	0,18	10 Chubb INA Holdings Inc, 3,350%, fällig 03.05.2026	11	–	100 Comcast Corp, 4,250%, fällig 15.10.2030	118	0,04
320 Boeing Co/The, 5,150%, fällig 01.05.2030	379	0,14	93 Cigna Corp, 3,750%, fällig 15.07.2023	99	0,04	121 Comcast Corp, 7,050%, fällig 15.03.2033	178	0,07
340 Boeing Co/The, 3,250%, fällig 01.02.2035	348	0,13	150 Cigna Corp, 4,125%, fällig 15.11.2025	168	0,06	140 Comcast Corp, 3,900%, fällig 01.03.2038	163	0,06
100 Boeing Co/The, 5,875%, fällig 15.02.2040	130	0,05	520 Cigna Corp, 4,375%, fällig 15.10.2028	607	0,22	10 Comcast Corp, 3,250%, fällig 01.11.2039	11	–
170 Boeing Co/The, 5,705%, fällig 01.05.2040	220	0,08	210 Cimarex Energy Co, 3,900%, fällig 15.05.2027	232	0,09	10 Comcast Corp, 3,750%, fällig 01.04.2040	12	–
140 Boeing Co/The, 3,750%, fällig 01.02.2050	145	0,05	390 Cimarex Energy Co, 4,375%, fällig 15.03.2029	444	0,16	20 Comcast Corp, 3,400%, fällig 15.07.2046	22	0,01
240 Boeing Co/The, 5,805%, fällig 01.05.2050	327	0,12	20 Cintas Corp No 2X 2,900%, fällig 01.04.2022	20	0,01	20 Comcast Corp, 4,000%, fällig 01.03.2048	24	0,01
10 Boeing Co/The, 5,930%, fällig 01.05.2060	14	0,01	30 Cintas Corp No 2X 3,700%, fällig 01.04.2027	34	0,01	170 Comcast Corp, 3,450%, fällig 01.02.2050	187	0,07
160 BP Capital Markets America Inc, 3,216%, fällig 28.11.2023	169	0,06	70 Citigroup Inc, 4,500%, fällig 14.01.2022	71	0,03	140 Comcast Corp, 2,800%, fällig 15.01.2051	136	0,05
30 BP Capital Markets America Inc, 3,790%, fällig 06.02.2024	32	0,01	80 Citigroup Inc, 3,500%, fällig 15.05.2023	84	0,03	41 Comcast Corp, 144 A 2,887%, fällig 01.11.2051	41	0,02
40 BP Capital Markets America Inc, 3,410%, fällig 11.02.2026	44	0,02	150 Citigroup Inc, 1,678%, fällig 15.05.2024 *	153	0,06	54 Comcast Corp, 144 A 2,937%, fällig 01.11.2056	54	0,02
220 BP Capital Markets America Inc, 3,119%, fällig 04.05.2026	239	0,09	180 Citigroup Inc, 3,300%, fällig 27.04.2025	195	0,07	40 ConocoPhillips, 144 A 3,750%, fällig 01.10.2027	45	0,02
80 BP Capital Markets America Inc, 3,633%, fällig 06.04.2030	90	0,03	60 Citigroup Inc, 4,400%, fällig 10.06.2025	67	0,02	350 ConocoPhillips, 144 A 4,300%, fällig 15.08.2028	406	0,15
330 BP Capital Markets America Inc, 3,000%, fällig 24.02.2050	327	0,12	120 Citigroup Inc, 5,500%, fällig 13.09.2025	140	0,05	20 ConocoPhillips Co, 6,950%, fällig 15.04.2029	27	0,01
90 Bristol-Myers Squibb Co, 2,600%, fällig 16.05.2022	92	0,03	90 Citigroup Inc, 3,106%, fällig 08.04.2026 *	96	0,04	50 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20 A, 3,350%, fällig 01.04.2030	55	0,02
10 Bristol-Myers Squibb Co, 3,550%, fällig 15.08.2022	10	–	60 Citigroup Inc, 4,300%, fällig 20.11.2026	68	0,03	30 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20 B, 3,950%, fällig 01.04.2050	35	0,01
179 Bristol-Myers Squibb Co, 2,900%, fällig 26.07.2024	191	0,07	260 Citigroup Inc, 4,450%, fällig 29.09.2027	298	0,11	230 Costco Wholesale Corp, 1,375%, fällig 20.06.2027	233	0,09
43 Bristol-Myers Squibb Co, 3,875%, fällig 15.08.2025	48	0,02	150 Citigroup Inc, 3,520%, fällig 27.10.2028 *	165	0,06	100 Costco Wholesale Corp, 1,750%, fällig 20.04.2032	100	0,04
130 Bristol-Myers Squibb Co, 3,200%, fällig 15.06.2026	143	0,05	200 Citigroup Inc, 3,980%, fällig 20.03.2030 *	227	0,08	50 CVS Health Corp, 2,750%, fällig 01.12.2022	51	0,02
60 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400%, fällig 26.07.2029	68	0,03	570 Citigroup Inc, 4,412%, fällig 31.03.2031 *	669	0,25	30 CVS Health Corp, 3,700%, fällig 09.03.2023	31	0,01
150 Bristol-Myers Squibb Co, 4,250%, fällig 26.10.2049	191	0,07	280 Citigroup Inc, 2,572%, fällig 03.06.2031 *	289	0,11	8 CVS Health Corp, 3,875%, fällig 20.07.2025	9	–
300 Broadcom Inc, 4,700%, fällig 15.04.2025	336	0,12				40 CVS Health Corp, 3,625%, fällig 01.04.2027	44	0,02
240 Broadcom Inc, 3,150%, fällig 15.11.2025	257	0,10				230 CVS Health Corp, 4,300%, fällig 25.03.2028	265	0,10
410 Cameron LNG LLC, 144 A 3,302%, fällig 15.01.2035	445	0,16				110 CVS Health Corp, 3,750%, fällig 01.04.2030	124	0,05
130 Cargill Inc, 144 A 1,375%, fällig 23.07.2023	133	0,05				90 CVS Health Corp, 2,125%, fällig 15.09.2031	90	0,03
10 Carrier Global Corp, 3,577%, fällig 05.04.2050	11	–				100 CVS Health Corp, 4,780%, fällig 25.03.2038	125	0,05
						40 CVS Health Corp, 4,125%, fällig 01.04.2040	47	0,02
						40 CVS Health Corp, 5,125%, fällig 20.07.2045	53	0,02
						370 CVS Health Corp, 5,050%, fällig 25.03.2048	491	0,18
						4 CVS Pass-Through Trust, 5,880%, fällig 10.01.2028	5	–

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			20 Enterprise Products Operating LLC, 3,700%, fällig 31.01.2051			500 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814%, fällig 23.04.2029 *		
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)			10 Enterprise Products Operating LLC, 3,950%, fällig 31.01.2060			780 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223%, fällig 01.05.2029 *		
110 Deere & Co, 3,750%, fällig 15.04.2050	135	0,05	140 EOG Resources Inc, 4,375%, fällig 15.04.2030	166	0,06	30 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250%, fällig 01.02.2041	45	0,02
240 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,500%, fällig 20.10.2025	258	0,10	160 EOG Resources Inc, 3,900%, fällig 01.04.2035	185	0,07	440 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150%, fällig 22.05.2045	591	0,22
220 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,750%, fällig 20.10.2028	245	0,09	320 EOG Resources Inc, 4,950%, fällig 15.04.2050	431	0,16	10 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750%, fällig 201.10.2045	13	0,01
160 Devon Energy Corp, 5,850%, fällig 15.12.2025	186	0,07	10 Exxon Mobil Corp, 1,571%, fällig 15.04.2023	10	–	50 Guardian Life Global Funding, 144 A 1,100%, fällig 23.06.2025	50	0,02
18 Devon Energy Corp, 144 A 5,250%, fällig 15.10.2027	19	0,01	340 Exxon Mobil Corp, 2,992%, fällig 19.03.2025	364	0,13	10 Halliburton Co, 3,800%, fällig 15.11.2025	11	–
30 Devon Energy Corp, 144 A 4,500%, fällig 15.01.2030	33	0,01	140 Exxon Mobil Corp, 3,043%, fällig 01.03.2026	152	0,06	40 Hershey Co/The, 0,900%, fällig 01.06.2025	40	0,01
40 Devon Energy Corp, 5,600%, fällig 15.07.2041	50	0,02	130 Exxon Mobil Corp, 3,482%, fällig 19.03.2030	146	0,05	90 Home Depot Inc/The, 2,500%, fällig 15.04.2027	96	0,04
70 Devon Energy Corp, 4,750%, fällig 15.05.2042	81	0,03	130 Exxon Mobil Corp, 4,114%, fällig 01.03.2046	156	0,06	10 Home Depot Inc/The, 3,900%, fällig 06.12.2028	12	–
400 Devon Energy Corp, 5,000%, fällig 15.06.2045	474	0,18	110 Exxon Mobil Corp, 4,327%, fällig 19.03.2050	138	0,05	80 Home Depot Inc/The, 2,700%, fällig 15.04.2030	86	0,03
50 Diamondback Energy Inc, 2,875%, fällig 01.12.2024	53	0,02	10 FirstEnergy Corp, Series B, 4,750%, fällig 15.03.2023	10	–	110 Home Depot Inc/The, 3,300%, fällig 15.04.2040	122	0,05
50 Diamondback Energy Inc, 3,250%, fällig 01.12.2026	54	0,02	50 FirstEnergy Corp, Series A, 1,600%, fällig 15.01.2026	50	0,02	20 Home Depot Inc/The, 3,900%, fällig 15.06.2047	24	0,01
120 Diamondback Energy Inc, 3,500%, fällig 01.12.2029	129	0,05	180 FirstEnergy Corp, Series B, 4,400%, fällig 15.07.2027	202	0,07	120 Home Depot Inc/The, 3,350%, fällig 15.04.2050	134	0,05
40 Diamondback Energy Inc, 3,125%, fällig 24.03.2031	42	0,02	650 FirstEnergy Corp, Series C, 7,375%, fällig 15.11.2031	909	0,34	90 Honeywell International Inc, 1,350%, fällig 01.06.2025	92	0,03
10 Dollar General Corp, 3,250%, fällig 15.04.2023	10	–	200 FirstEnergy Corp, Series C, 5,350%, fällig 15.07.2047	251	0,09	30 Humana Inc, 3,150%, fällig 01.12.2022	31	0,01
50 Duke Energy Corp, 2,400%, fällig 15.08.2022	51	0,02	50 Fox Corp, 4,030%, fällig 25.01.2024	54	0,02	20 Humana Inc, 4,500%, fällig 01.04.2025	22	0,01
50 Duke Energy Corp, 3,150%, fällig 15.08.2027	54	0,02	280 Fox Corp, 5,476%, fällig 25.01.2039	364	0,13	130 Humana Inc, 3,950%, fällig 15.03.2027	146	0,05
150 Eaton Corp, 2,750%, fällig 02.11.2022	154	0,06	110 General Dynamics Corp, 4,250%, fällig 01.04.2050	143	0,05	10 Humana Inc, 4,950%, fällig 01.10.2044	13	–
50 Eaton Corp, 4,150%, fällig 02.11.2042	60	0,02	40 General Electric Co, 6,750%, fällig 15.03.2032	56	0,02	150 Humana Inc, 3,950%, fällig 15.08.2049	176	0,07
100 El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375%, fällig 15.06.2032	148	0,05	92 General Electric Co, 6,875%, fällig 10.01.2039	139	0,05	10 Intel Corp, 3,700%, fällig 29.07.2025	11	–
120 Energy Transfer LP, 4,500%, fällig 15.04.2024	130	0,05	10 General Motors Co, 5,150%, fällig 01.04.2038	12	–	60 Intel Corp, 1,600%, fällig 12.08.2028	60	0,02
80 Energy Transfer LP, 5,500%, fällig 01.06.2027	95	0,04	30 General Motors Co, 6,250%, fällig 02.10.2043	41	0,02	120 Intel Corp, 4,750%, fällig 25.03.2050	161	0,06
40 Energy Transfer LP, 4,950%, fällig 15.06.2028	46	0,02	10 General Motors Co, 5,950%, fällig 01.04.2049	14	0,01	20 Intel Corp, 3,050%, fällig 12.08.2051	21	0,01
50 Energy Transfer LP, 5,250%, fällig 15.04.2029	59	0,02	20 General Motors Financial Co Inc, 3,450%, fällig 10.04.2022	20	0,01	310 International Business Machines Corp, 3,000%, fällig 15.05.2024	330	0,12
490 Energy Transfer LP, 3,750%, fällig 15.05.2030	533	0,20	120 General Motors Financial Co Inc, 4,350%, fällig 17.01.2027	135	0,05	80 Johnson & Johnson, 0,550%, fällig 01.09.2025	79	0,03
10 Energy Transfer LP, 5,300%, fällig 01.04.2044	12	–	40 Gilead Sciences Inc, 3,700%, fällig 01.04.2024	43	0,02	160 Johnson & Johnson, 0,950%, fällig 01.09.2027	159	0,06
60 Energy Transfer LP, 5,400%, fällig 01.10.2047	73	0,03	100 Gilead Sciences Inc, 3,650%, fällig 01.03.2026	110	0,04	130 Johnson & Johnson, 3,700%, fällig 01.03.2046	157	0,06
50 Energy Transfer LP, 6,250%, fällig 15.04.2049	66	0,02	100 Gilead Sciences Inc, 4,750%, fällig 01.03.2046	129	0,05	50 JPMorgan Chase & Co, 3,625%, fällig 13.05.2024	54	0,02
20 Enterprise Products Operating LLC, 3,900%, fällig 15.02.2024	21	0,01	3 Goldman Sachs Capital II, 4,000%, Perpetual *	3	–	380 JPMorgan Chase & Co, 1,514%, fällig 01.06.2024 *	387	0,14
210 Enterprise Products Operating LLC, 4,150%, fällig 16.10.2028	241	0,09	280 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,876%, fällig 30.10.2022 *	281	0,10	230 JPMorgan Chase & Co, 4,023%, fällig 05.12.2024 *	247	0,09
350 Enterprise Products Operating LLC, 2,800%, fällig 31.01.2030	372	0,14	50 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,625%, fällig 22.01.2023	52	0,02	220 JPMorgan Chase & Co, 2,083%, fällig 22.04.2026 *	227	0,08
20 Enterprise Products Operating LLC, 7,550%, fällig 15.04.2038	31	0,01	70 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,200%, fällig 23.02.2023	73	0,03	70 JPMorgan Chase & Co, 4,125%, fällig 15.12.2026	80	0,03
60 Enterprise Products Operating LLC, 5,700%, fällig 15.02.2042	82	0,03	150 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500%, fällig 01.04.2025	162	0,06	270 JPMorgan Chase & Co, 4,250%, fällig 01.10.2027	310	0,11
20 Enterprise Products Operating LLC, 4,850%, fällig 15.03.2044	25	0,01	140 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250%, fällig 20.10.2025	156	0,06	110 JPMorgan Chase & Co, 3,625%, fällig 01.12.2027	121	0,04
20 Enterprise Products Operating LLC, 4,800%, fällig 01.02.2049	25	0,01	90 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500%, fällig 16.11.2026	98	0,04	260 JPMorgan Chase & Co, 4,203%, fällig 23.07.2029 *	299	0,11
170 Enterprise Products Operating LLC, 4,200%, fällig 31.01.2050	197	0,07				180 JPMorgan Chase & Co, 4,452%, fällig 05.12.2029 *	210	0,08
						440 JPMorgan Chase & Co, 2,522%, fällig 22.04.2031 *	456	0,17

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			90 Microsoft Corp, 2,400%, fällig 06.02.2022	91	0,03	40 PepsiCo Inc, 1,625%, fällig 01.05.2030	40	0,01
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)			300 Microsoft Corp, 2,400%, fällig 08.08.2026	321	0,12	40 PepsiCo Inc, 2,875%, fällig 15.10.2049	42	0,02
40 JPMorgan Chase & Co, 2,580%, fällig 22.04.2032 *	41	0,02	240 Microsoft Corp, 3,300%, fällig 06.02.2027	268	0,10	20 PepsiCo Inc, 3,625%, fällig 19.03.2050	24	0,01
195 JPMorgan Chase & Co, 4,950%, fällig 01.06.2045	261	0,10	60 Microsoft Corp, 2,525%, fällig 01.06.2050	60	0,02	30 PepsiCo Inc, 3,875%, fällig 19.03.2060	38	0,01
50 JPMorgan Chase & Co, 3,109%, fällig 22.04.2051 *	52	0,02	100 Microsoft Corp, 2,921%, fällig 17.03.2052	108	0,04	190 Pfizer Inc, 0,800%, fällig 28.05.2025	190	0,07
30 Kimberly-Clark Corp, 3,100%, fällig 26.03.2030	33	0,01	140 MidAmerican Energy Co, 3,650%, fällig 15.04.2029	159	0,06	110 Pfizer Inc, 2,625%, fällig 01.04.2030	118	0,04
40 Kinder Morgan Inc, 4,300%, fällig 01.06.2025	44	0,02	290 Mondelez International Inc, 1,500%, fällig 04.05.2025	295	0,11	110 Pfizer Inc, 1,700%, fällig 28.05.2030	110	0,04
470 Kinder Morgan Inc, 4,300%, fällig 01.03.2028	537	0,20	370 Morgan Stanley, 2,188%, fällig 28.04.2026 *	385	0,14	230 Pfizer Inc, 2,550%, fällig 28.05.2040	234	0,09
60 Kinder Morgan Inc, 5,550%, fällig 01.06.2045	78	0,03	290 Morgan Stanley, 3,772%, fällig 24.01.2029 *	324	0,12	110 Pfizer Inc, 2,700%, fällig 28.05.2050	112	0,04
120 L3 Harris Technologies Inc, 4,854%, fällig 27.04.2035	152	0,06	400 Morgan Stanley, 2,699%, fällig 22.01.2031 *	419	0,15	20 Philip Morris International Inc, 2,900%, fällig 15.11.2021	20	0,01
160 L3 Harris Technologies Inc, 5,054%, fällig 27.04.2045	214	0,08	200 Morgan Stanley, 3,622%, fällig 01.04.2031 *	224	0,08	20 Philip Morris International Inc, 2,500%, fällig 22.08.2022	20	0,01
240 Las Vegas Sands Corp, 3,200%, fällig 08.08.2024	249	0,09	190 MPLX LP, 4,000%, fällig 15.03.2028	213	0,08	80 Philip Morris International Inc, 2,500%, fällig 02.11.2022	82	0,03
20 Las Vegas Sands Corp, 2,900%, fällig 25.06.2025	21	0,01	100 MPLX LP, 4,500%, fällig 15.04.2038	115	0,04	80 Philip Morris International Inc, 1,125%, fällig 01.05.2023	81	0,03
127 Lehman Escrow Receipt, Zero coupon, Perpetual 1=	1	–	40 MPLX LP, 5,200%, fällig 01.03.2047	49	0,02	80 Philip Morris International Inc, 2,100%, fällig 01.05.2030	81	0,03
104 Lehman Swap Receipt, Zero coupon, Perpetual 1=	1	–	60 MPLX LP, 5,200%, fällig 01.12.2047	74	0,03	40 Philip Morris International Inc, 6,375%, fällig 16.05.2038	57	0,02
20 Lockheed Martin Corp, 3,100%, fällig 15.01.2023	21	0,01	180 MPLX LP, 4,700%, fällig 15.04.2048	211	0,08	10 Philip Morris International Inc, 4,500%, fällig 20.03.2042	12	–
50 Lockheed Martin Corp, 3,550%, fällig 15.01.2026	55	0,02	100 New York Life Global Funding, 144 A 0,950%, fällig 24.06.2025	100	0,04	60 Philip Morris International Inc, 4,250%, fällig 10.11.2044	70	0,03
100 Lockheed Martin Corp, 4,500%, fällig 15.05.2036	127	0,05	100 Newell Brands Inc, 4,700%, fällig 01.04.2026	112	0,04	30 Pioneer Natural Resources Co, 1,125%, fällig 15.01.2026	30	0,01
50 Lowe's Cos Inc, 4,500%, fällig 15.04.2030	59	0,02	60 NIKE Inc, 2,400%, fällig 27.03.2025	64	0,02	100 Pioneer Natural Resources Co, 1,900%, fällig 15.08.2030	97	0,04
60 Mars Inc, 144 A 2,700%, fällig 01.04.2025	64	0,02	110 NIKE Inc, 2,750%, fällig 27.03.2027	119	0,04	240 Pioneer Natural Resources Co, 2,150%, fällig 15.01.2031	235	0,09
260 Mars Inc, 144 A 3,200%, fällig 01.04.2030	288	0,11	110 NIKE Inc, 2,850%, fällig 27.03.2030	120	0,04	50 Principal Life Global Funding II, 144 A 1,250%, fällig 23.06.2025	50	0,02
400 MassMutual Global Funding II, 144 A 0,850%, fällig 09.06.2023	404	0,15	60 NIKE Inc, 3,250%, fällig 27.03.2040	67	0,02	30 Procter & Gamble Co/The, 2,800%, fällig 25.03.2027	33	0,01
400 Mastercard Inc, 3,850%, fällig 26.03.2050	489	0,18	10 NIKE Inc, 3,375%, fällig 27.03.2050	12	–	50 Procter & Gamble Co/The, 3,000%, fällig 25.03.2030	56	0,02
90 McDonald's Corp, 3,300%, fällig 01.07.2025	98	0,04	200 Northrop Grumman Corp, 2,930%, fällig 15.01.2025	213	0,08	10 Progress Energy Inc, 3,150%, fällig 01.04.2022	10	–
150 McDonald's Corp, 1,450%, fällig 01.09.2025	153	0,06	20 Northrop Grumman Corp, 3,250%, fällig 15.01.2028	22	0,01	60 Raytheon Technologies Corp, 3,150%, fällig 15.12.2024	64	0,02
50 McDonald's Corp, 3,700%, fällig 30.01.2026	55	0,02	530 Northrop Grumman Corp, 5,250%, fällig 01.05.2050	755	0,28	120 Raytheon Technologies Corp, 2,250%, fällig 01.07.2030	123	0,05
30 McDonald's Corp, 3,500%, fällig 01.03.2027	33	0,01	270 NVIDIA Corp, 3,500%, fällig 01.04.2040	308	0,11	100 Raytheon Technologies Corp, 4,500%, fällig 01.06.2042	125	0,05
50 McDonald's Corp, 3,500%, fällig 01.07.2027	56	0,02	110 NVIDIA Corp, 3,700%, fällig 01.04.2060	132	0,05	230 Raytheon Technologies Corp, 3,125%, fällig 01.07.2050	240	0,09
30 McDonald's Corp, 3,800%, fällig 01.04.2028	34	0,01	290 Oracle Corp, 1,650%, fällig 25.03.2026	295	0,11	160 Republic Services Inc, 2,500%, fällig 15.08.2024	168	0,06
80 McDonald's Corp, 2,125%, fällig 01.03.2030	81	0,03	310 Oracle Corp, 2,875%, fällig 25.03.2031	327	0,12	50 salesforce.com Inc, 3,250%, fällig 11.04.2023	52	0,02
80 McDonald's Corp, 3,600%, fällig 01.07.2030	90	0,03	60 Otis Worldwide Corp, 2,056%, fällig 05.04.2025	62	0,02	100 salesforce.com Inc, 3,700%, fällig 11.04.2028	114	0,04
180 McDonald's Corp, 4,875%, fällig 09.12.2045	237	0,09	200 Pacific Gas and Electric Co, 1,750%, fällig 16.06.2022	200	0,07	100 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000%, fällig 01.03.2032	144	0,05
20 McDonald's Corp, 3,625%, fällig 01.09.2049	23	0,01	50 Pacific Gas and Electric Co, 2,100%, fällig 01.08.2027	48	0,02	10 State Street Corp, 3,300%, fällig 16.12.2024	11	–
40 McDonald's Corp, 4,200%, fällig 01.04.2050	49	0,02	70 Pacific Gas and Electric Co, 2,500%, fällig 01.02.2031	66	0,02	130 Target Corp, 2,250%, fällig 15.04.2025	137	0,05
31 Medtronic Inc, 3,500%, fällig 15.03.2025	34	0,01	20 Pacific Gas and Electric Co, 3,300%, fällig 01.08.2040	18	0,01	2 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850%, fällig 16.12.2039	3	–
15 Medtronic Inc, 4,625%, fällig 15.03.2045	20	0,01	30 Pacific Gas and Electric Co, 3,500%, fällig 01.08.2050	27	0,01	60 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144 A 2,900%, fällig 01.03.2030	63	0,02
150 Merck & Co Inc, 0,750%, fällig 24.02.2026	149	0,06	110 PayPal Holdings Inc, 1,350%, fällig 01.06.2023	112	0,04	50 Texas Instruments Inc, 2,250%, fällig 04.09.2029	52	0,02
80 Merck & Co Inc, 1,450%, fällig 24.06.2030	79	0,03	110 PayPal Holdings Inc, 1,650%, fällig 01.06.2025	113	0,04	70 Texas Instruments Inc, 1,750%, fällig 04.05.2030	70	0,03
215 MetLife Inc, 6,400%, fällig 15.12.2036	277	0,10	150 PepsiCo Inc, 0,750%, fällig 01.05.2023	151	0,06	100 Texas Instruments Inc, 3,875%, fällig 15.03.2039	121	0,04
270 Metropolitan Life Global Funding I, 144 A 0,900%, fällig 08.06.2023	273	0,10	10 PepsiCo Inc, 2,250%, fällig 19.03.2025	11	–	80 Texas Instruments Inc, 4,150%, fällig 15.05.2048	102	0,04
120 Micron Technology Inc, 2,497%, fällig 24.04.2023	124	0,05	10 PepsiCo Inc, 2,625%, fällig 19.03.2027	11	–			

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			30 Verizon Communications Inc, 3,000%, fällig 22.03.2027	32	0,01	60 Williams Cos Inc/The, 4,900%, fällig 15.01.2045	73	0,03
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			100 Verizon Communications Inc, 2,100%, fällig 22.03.2028	103	0,04	90 Williams Cos Inc/The, 5,100%, fällig 15.09.2045	113	0,04
170 The Vanguard Group Inc, 3,050%, fällig 22.08.2050	167	0,06	205 Verizon Communications Inc, 4,329%, fällig 21.09.2028	240	0,09	60 Williams Cos Inc/The, 4,850%, fällig 01.03.2048	74	0,03
100 Time Warner Cable LLC, 5,875%, fällig 15.11.2040	129	0,05	30 Verizon Communications Inc, 3,875%, fällig 08.02.2029	34	0,01	30 Wyeth LLC, 5,950%, fällig 01.04.2037	43	0,02
20 TIX Cos Inc/The, 2,250%, fällig 15.09.2026	21	0,01	100 Verizon Communications Inc, 3,150%, fällig 22.03.2030	109	0,04		73.806	27,25
130 T-Mobile USA Inc, 3,500%, fällig 15.04.2025	140	0,05	310 Verizon Communications Inc, 2,550%, fällig 21.03.2031	320	0,12	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 94.952 USD)		
20 T-Mobile USA Inc, 3,750%, fällig 15.04.2027	22	0,01	530 Verizon Communications Inc, 4,500%, fällig 10.08.2033	642	0,24	102.438	37,82	
30 T-Mobile USA Inc, 2,050%, fällig 15.02.2028	31	0,01	60 Verizon Communications Inc, 4,400%, fällig 01.11.2034	72	0,03	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 27,32 % (28. Februar 2021: 26,13 %)		
200 T-Mobile USA Inc, 3,875%, fällig 15.04.2030	224	0,08	20 Verizon Communications Inc, 5,250%, fällig 16.03.2037	27	0,01	Chile – 0,41 % (28. Februar 2021: 0,24 %)		
80 T-Mobile USA Inc, 2,550%, fällig 15.02.2031	82	0,03	180 Verizon Communications Inc, 2,650%, fällig 20.11.2040	175	0,06	370 Chile Government International Bond, 3,100%, fällig 07.05.2041	376	0,14
180 T-Mobile USA Inc, 2,250%, fällig 15.11.2031	179	0,07	200 Verizon Communications Inc, 3,850%, fällig 01.11.2042	229	0,08	760 Chile Government International Bond, 3,100%, fällig 22.01.2061	742	0,27
110 T-Mobile USA Inc, 3,000%, fällig 15.02.2041	109	0,04	70 Verizon Communications Inc, 4,125%, fällig 15.08.2046	82	0,03		1.118	0,41
30 T-Mobile USA Inc, 3,300%, fällig 15.02.2051	30	0,01	70 Verizon Communications Inc, 4,862%, fällig 21.08.2046	91	0,03	China – 0,03 % (28. Februar 2021: 0,03 %)		
400 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850%, fällig 01.02.2026	504	0,19	420 Verizon Communications Inc, 4,522%, fällig 15.09.2048	529	0,20	CNY 500 China Government Bond, 3,310%, fällig 30.11.2025	80	0,03
70 Union Pacific Corp, 3,750%, fällig 15.07.2025	77	0,03	130 Verizon Communications Inc, 4,000%, fällig 22.03.2050	151	0,06	Kolumbien – 0,48 % (28. Februar 2021: 0,23 %)		
140 Union Pacific Corp, 2,150%, fällig 05.02.2027	146	0,05	70 Verizon Communications Inc, 2,875%, fällig 20.11.2050	68	0,03	220 Colombia Government International Bond, 3,125%, fällig 15.04.2031	215	0,08
140 Union Pacific Corp, 2,400%, fällig 05.02.2030	145	0,05	180 Visa Inc, 3,150%, fällig 14.12.2025	197	0,07	660 Colombia Government International Bond, 3,250%, fällig 22.04.2032	646	0,24
130 Union Pacific Corp, 3,750%, fällig 05.02.2070	148	0,05	30 Visa Inc, 4,300%, fällig 14.12.2045	39	0,01	400 Colombia Government International Bond, 5,625%, fällig 26.02.2044	448	0,16
30 UnitedHealth Group Inc, 2,875%, fällig 15.12.2021	30	0,01	50 Visa Inc, 3,650%, fällig 15.09.2047	59	0,02		1.309	0,48
20 UnitedHealth Group Inc, 2,375%, fällig 15.10.2022	20	0,01	40 Walmart Inc, 3,400%, fällig 26.06.2023	42	0,02	Indien – 0,08 % (28. Februar 2021: 0,07 %)		
40 UnitedHealth Group Inc, 3,500%, fällig 15.06.2023	42	0,02	40 Walmart Inc, 3,550%, fällig 26.06.2025	44	0,02	200 Export-Import Bank of India, 3,375%, fällig 05.08.2026	214	0,08
50 UnitedHealth Group Inc, 3,750%, fällig 15.07.2025	56	0,02	90 Walmart Inc, 3,050%, fällig 08.07.2026	99	0,04	Indonesien – 0,65 % (28. Februar 2021: 0,54 %)		
60 UnitedHealth Group Inc, 1,250%, fällig 15.01.2026	61	0,02	180 Walmart Inc, 3,700%, fällig 26.06.2028	206	0,08	1.500 Indonesia Government International Bond, 4,350%, fällig 11.01.2048	1.745	0,65
30 UnitedHealth Group Inc, 3,875%, fällig 15.12.2028	35	0,01	20 Walt Disney Co/The, 6,650%, fällig 15.11.2037	31	0,01	Israel – 0,32 % (28. Februar 2021: 0,29 %)		
30 UnitedHealth Group Inc, 2,000%, fällig 15.05.2030	30	0,01	60 Wells Fargo & Co, 4,125%, fällig 15.08.2023	64	0,02	800 Israel Government International Bond, 2,750%, fällig 03.07.2030	863	0,32
110 UnitedHealth Group Inc, 2,750%, fällig 15.05.2040	113	0,04	61 Wells Fargo & Co, 4,480%, fällig 16.01.2024	66	0,02	Kasachstan – 0,09 % (28. Februar 2021: 0,08 %)		
50 UnitedHealth Group Inc, 4,250%, fällig 15.03.2043	62	0,02	40 Wells Fargo & Co, 3,750%, fällig 24.01.2024	43	0,02	200 Kazakhstan Government International Bond, 4,875%, fällig 14.10.2044	255	0,09
40 UnitedHealth Group Inc, 4,250%, fällig 15.06.2048	51	0,02	300 Wells Fargo & Co, 1,654%, fällig 02.06.2024 *	306	0,11	Kuwait – 0,19 % (28. Februar 2021: 0,17 %)		
20 UnitedHealth Group Inc, 4,450%, fällig 15.12.2048	26	0,01	240 Wells Fargo & Co, 2,188%, fällig 30.04.2026 *	249	0,09	460 Kuwait International Government Bond, 3,500%, fällig 20.03.2027	515	0,19
50 UnitedHealth Group Inc, 3,700%, fällig 15.08.2049	58	0,02	200 Wells Fargo & Co, 4,100%, fällig 03.06.2026	225	0,08	Mexiko – 0,48 % (28. Februar 2021: 0,40 %)		
110 UnitedHealth Group Inc, 2,900%, fällig 15.05.2050	114	0,04	180 Wells Fargo & Co, 3,000%, fällig 23.10.2026	195	0,07	1.140 Mexico Government International Bond, 4,750%, fällig 08.03.2044	1.288	0,48
110 UnitedHealth Group Inc, 3,875%, fällig 15.08.2059	133	0,05	260 Wells Fargo & Co, 4,300%, fällig 22.07.2027	298	0,11	Panama – 0,45 % (28. Februar 2021: 0,39 %)		
20 UnitedHealth Group Inc, 3,125%, fällig 15.05.2060	21	0,01	420 Wells Fargo & Co, 2,393%, fällig 02.06.2028 *	438	0,16	290 Panama Government International Bond, 2,252%, fällig 29.09.2032	283	0,10
50 US Bancorp, 3,600%, fällig 11.09.2024	54	0,02	150 Wells Fargo & Co, 4,150%, fällig 24.01.2029	173	0,06	200 Panama Government International Bond, 4,500%, fällig 15.05.2047	231	0,09
290 US Bancorp, 1,450%, fällig 12.05.2025	297	0,11	200 Wells Fargo & Co, 2,879%, fällig 30.10.2030 *	213	0,08	620 Panama Government International Bond, 4,300%, fällig 29.04.2053	697	0,26
150 USAA Capital Corp, 144 A, 2,125%, fällig 01.05.2030	153	0,06	280 Wells Fargo & Co, 4,478%, fällig 04.04.2031 *	332	0,12		1.211	0,45
180 Verizon Communications Inc, 3,376%, fällig 15.02.2025	195	0,07	20 Wells Fargo & Co, 4,650%, fällig 04.11.2044	25	0,01	Peru – 0,29 % (28. Februar 2021: 0,26 %)		
40 Verizon Communications Inc, 0,850%, fällig 20.11.2025	40	0,01	50 Wells Fargo & Co, 4,900%, fällig 17.11.2045	65	0,02	120 Peruvian Government International Bond, 6,550%, fällig 14.03.2037	166	0,06
70 Verizon Communications Inc, 1,450%, fällig 20.03.2026	71	0,03	430 Wells Fargo & Co, 4,400%, fällig 14.06.2046	526	0,19	80 Peruvian Government International Bond, 3,300%, fällig 11.03.2041	82	0,03
40 Verizon Communications Inc, 2,625%, fällig 15.08.2026	43	0,02	350 Wells Fargo & Co, 4,750%, fällig 07.12.2046	447	0,17			
40 Verizon Communications Inc, 4,125%, fällig 16.03.2027	46	0,02	880 Wells Fargo & Co, 5,013%, fällig 04.04.2051 *	1.228	0,45			
			280 Williams Cos Inc/The, 3,750%, fällig 15.06.2027	311	0,12			

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			4.080 United States Treasury Note/ Bond, 1,625%, fällig 15.05.2031	4.207	1,55	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Kosten 2.227 USD)		
390 Peruvian Government International Bond, 5,625%, fällig 18.11.2050	543	0,20	460 United States Treasury Note/ Bond, 1,250%, fällig 15.08.2031	458	0,17	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 267.692 USD)		
	791	0,29	3.360 United States Treasury Note/ Bond, 1,125%, fällig 15.08.2040	2.984	1,10	Gekaufte Optionen – 0,03 % (28. Februar 2021: 0,04 %)		
Polen – 0,25 % (28. Februar 2021: 0,23 %)			430 United States Treasury Note/ Bond, 1,375%, fällig 15.11.2040	398	0,15	– U.S. 10 Year Oktober 2021 Call 133,00X fällig 24.09.2021 – Goldman Sachs 11 –		
130 Republic of Poland Government International Bond, 5,000%, fällig 23.03.2022	134	0,05	880 United States Treasury Note/ Bond, 1,875%, fällig 15.02.2041	887	0,33	– U.S. 10 Year Oktober 2021 Put 133,00X fällig 24.09.2021 – Goldman Sachs 5 –		
500 Republic of Poland Government International Bond, 4,000%, fällig 22.01.2024	542	0,20	890 United States Treasury Note/ Bond, 2,250%, fällig 15.05.2041	953	0,35	– U.S. Bond Oktober 2021 Call 162,00X fällig 24.09.2021 – Goldman Sachs 18 0,01		
	676	0,25	110 United States Treasury Note/ Bond, 2,875%, fällig 15.08.2045	131	0,05	U.S. Bond Oktober 2021 Call 163,00X fällig 24.09.2021 – Goldman Sachs 21 0,01		
Katar – 0,52 % (28. Februar 2021: 0,44 %)			640 United States Treasury Note/ Bond, 3,000%, fällig 15.02.2048	786	0,29	Summe gekaufte Optionen (Kosten 66 USD)		
1.070 Qatar Government International Bond, 144 A 4,817%, fällig 14.03.2049	1.401	0,52	1.790 United States Treasury Note/ Bond, 3,125%, fällig 15.05.2048	2.250	0,83	Credit Default Swaps – 0,29 % (28. Februar 2021: 0,36 %)		
Russland – 0,39 % (28. Februar 2021: 0,34 %)			280 United States Treasury Note/ Bond, 3,000%, fällig 15.02.2049	346	0,13	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 789 0,29		
800 Russian Foreign Bond – Eurobond, 5,625%, fällig 04.04.2042	1.063	0,39	220 United States Treasury Note/ Bond, 2,875%, fällig 15.05.2049	266	0,10	Zinsswaps – 0,81 % (28. Februar 2021: 0,99 %)		
Saudi-Arabien – 0,15 % (28. Februar 2021: 0,14 %)			2.370 United States Treasury Note/ Bond, 2,250%, fällig 15.08.2049	2.538	0,94	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 2.210 0,81		
400 Saudi Government International Bond, 2,875%, fällig 04.03.2023	414	0,15	5.390 United States Treasury Note/ Bond, 2,000%, fällig 15.02.2050	5.478	2,02	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
Vereinigte Arabische Emirate – 0,55 % (28. Februar 2021: 0,50 %)			9.580 United States Treasury Note/ Bond, 1,250%, fällig 15.05.2050	8.124	3,00	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 13 –		
1.450 Abu Dhabi Government International Bond, 2,500%, fällig 101.10.2022	1.485	0,55	7.130 United States Treasury Note/ Bond, 1,375%, fällig 15.08.2050	6.239	2,30	Futures – 0,07 % (28. Februar 2021: 0,09 %)		
Vereinigte Staaten – 21,63 % (28. Februar 2021: 21,54 %)			3.330 United States Treasury Note/ Bond, 1,625%, fällig 15.11.2050	3.099	1,14	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 205 0,07		
140 Tennessee Valley Authority, 1,875%, fällig 15.08.2022	142	0,05	3.750 United States Treasury Note/ Bond, 1,875%, fällig 15.02.2051	3.703	1,37	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
390 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375%, fällig 15.02.2044	640	0,24	1.800 United States Treasury Note/ Bond, 2,375%, fällig 15.05.2051	1.988	0,73	278.982 102,99		
10 United States Treasury Note/ Bond, 2,125%, fällig 15.05.2022	10	–	550 United States Treasury Note/ Bond, 2,000%, fällig 15.08.2051	560	0,21	Verträge (in Tsd.)		
40 United States Treasury Note/ Bond, 0,250%, fällig 15.11.2023	40	0,01		58.591	21,63	Verkaufte Optionen: (0,01 %) (28. Februar 2021: (0,12 %))		
20 United States Treasury Note/ Bond, 2,250%, fällig 30.04.2024	21	0,01	Uruguay – 0,36 % (28. Februar 2021: 0,24 %)			– U.S. 10 Year Oktober 2021 Call 134,00X fällig 24.09.2021 – Goldman Sachs (6) (0,01)		
110 United States Treasury Note/ Bond, 0,250%, fällig 30.06.2025	109	0,04	490 Uruguay Government International Bond, 4,375%, fällig 23.01.2031	576	0,21	– U.S. 10 Year Oktober 2021 Put 131,00X fällig 24.09.2021 – Goldman Sachs (2) –		
2.540 United States Treasury Note/ Bond, 0,250%, fällig 31.08.2025	2.503	0,92	300 Uruguay Government International Bond, 5,100%, fällig 18.06.2050	401	0,15	– U.S. 10 Year Oktober 2021 Put 131,50X fällig 24.09.2021 – Goldman Sachs (1) –		
110 United States Treasury Note/ Bond, 0,250%, fällig 30.10.2025	108	0,04		977	0,36	– U.S. Bond Oktober 2021 Call 165,50X fällig 24.09.2021 – Goldman Sachs (4) –		
70 United States Treasury Note/ Bond, 2,250%, fällig 31.03.2026	75	0,03	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 74.435 USD)			– U.S. Bond Oktober 2021 Call 170,00X fällig 24.09.2021 – Goldman Sachs (1) –		
1.680 United States Treasury Note/ Bond, 0,750%, fällig 30.04.2026	1.682	0,62	73.996	27,32		Summe verkaufte Optionen (Kosten (44) USD)		
680 United States Treasury Note/ Bond, 2,125%, fällig 31.05.2026	724	0,27	Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,82 % (28. Februar 2021: 4,22 %)			(16) (0,01)		
1.150 United States Treasury Note/ Bond, 1,250%, fällig 31.03.2028	1.166	0,43	2.227 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	2.227	0,82			
3.660 United States Treasury Note/ Bond, 1,250%, fällig 30.04.2028	3.710	1,37						
960 United States Treasury Note/ Bond, 1,250%, fällig 30.06.2028	972	0,36						
1.290 United States Treasury Note/ Bond, 1,125%, fällig 31.08.2028	1.294	0,48						

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts			% von Gesamt Vermögen
Zinsswaps – (0,13 %) (28. Februar 2021: (0,08 %))			*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.	
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(360)	(0,13)	†	Illiquid.	
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			∞	Das Wertpapier wurde vom Manager oder dem jeweiligen Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.	
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	–	–	±	Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.	
Futures – (0,04 %) (28. Februar 2021: (0,32 %))			β	Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.	
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(115)	(0,04)			
Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	(491)	(0,18)			
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	278.491	102,81			
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	(7.633)	(2,81)			
Gesamtvermögen	\$270.858	100,00			

Analyse des Gesamtvermögens		% von Gesamt Vermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		95,53
Organismen für gemeinsame Anlagen		0,78
Finanzderivate		1,15
Sonstige Vermögenswerte		2,54
Gesamtvermögen		100,00

ABKÜRZUNGEN:

Fortwährend	–	Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
REMIC	–	Real Estate Mortgage Investment Conduit.
TBA	–	To Be Announced.
CNY	–	Chinesischer Renminbi

- 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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 38.977.000 USD und machten 14,44 % des Nettovermögens aus.

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzzeit	Kauf-/Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000%	Verkauf	20.06.2026	31.012	\$ 789
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.078 USD)					\$ 789
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)					-
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.078 USD)					\$ 789

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	
Goldman Sachs	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,190%	15.06.2022	11.149	\$ 4	
Goldman Sachs	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,820%	04.06.2024	24.773	(9)	
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,260%, Receive Floating USD Fed Funds Rate	15.05.2027	5.555	163	
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,450%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.05.2027	5.928	172	
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,780%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.2027	4.398	67	
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,250%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2028	6.995	(85)	
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,350%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2028	5.231	(97)	
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,560%, Receive Floating USD SOFR Compound	20.07.2045	2.880	501	
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,740%, Receive Floating USD SOFR Compound	19.08.2045	1.170	160	
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,800%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.2045	1.359	247	
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,000%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	2.620	384	
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,200%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	721	75	
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,225%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	362	35	
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,520%, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2047	636	(16)	
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,630%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	1.121	13	
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,729%, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2047	655	(47)	
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,000%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	1.516	(106)	
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,900%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	17.03.2050	1.110	206	
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,200%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	07.10.2050	1.544	180	
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,671%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	09.07.2051	1.072	3	
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 2.982 USD)					\$ 2.210
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (247) USD)					(360)
Nettowertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 2.735 USD)					\$ 1.850

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	14	Verkauf	EUR	12	\$ –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.814	Verkauf	USD	3.311	13
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 12 USD)								\$ 13
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)								–
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 12 USD)								\$ 13

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro\$ Dezember 2021	Goldman Sachs	(267)	\$(66.633)	\$ (44)
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Goldman Sachs	233	57.688	57
90 Day Euro\$ Juni 2023	Goldman Sachs	57	14.159	17
90 Day Euro\$ September 2023	Goldman Sachs	13	3.222	2
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Goldman Sachs	30	4.004	1
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2021	Goldman Sachs	(53)	(7.845)	17
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2021	Goldman Sachs	(194)	(42.744)	(29)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021	Goldman Sachs	651	80.541	111
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2021	Goldman Sachs	(74)	(12.060)	(42)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 270 USD)				\$ 205
Nicht realisierte Wertminderung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (949) USD)				(115)
Nettowertsteigerung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (679) USD)				\$ 90

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 8,79 % (28. Februar 2021: 7,62 %)			185 CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-13X Series 2004 13X Class MF1X 5,071%, fällig 25.04.2035 *	187	0,01	2.000 Nelnet Student Loan Trust 2014-2X Series 2014 2A, Class B, 144 A 1,584%, fällig 25.06.2041 *	2.006	0,13
194 Aegis Asset Backed Sec Corp Mort Pass Thr Certs Series 2003-3X Series 2003 3X Class M2X 2,559%, fällig 25.01.2034 *	191	0,01	1.090 Dividend Solar Loans 2018- 2 LLC, Series 2018 2X Class A, 144 A 3,720%, fällig 20.12.2038	1.110	0,07	2.500 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd, Series 2018 29A, Class A1X 144 A 1,264%, fällig 19.10.2031 *	2.503	0,16
943 Allegro CLO II-S Ltd, Series 2014 1RA, Class A1X 144 A 1,214%, fällig 20.10.2028 *	944	0,06	550 Dryden 37 Senior Loan Fund, Series 2015 37A, Class AR, 144 A 1,226%, fällig 15.01.2031 *	550	0,03	2.000 Neuberger Berman Loan Advisers Clo 42 Ltd, Series 2021 42A, Class A, 144 A 1,241%, fällig 16.07.2035 *	2.002	0,13
275 Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Ctf's Ser 2005 R7X Series 2005 R7X Class M2X 0,834%, fällig 25.09.2035 *	276	0,02	3.758 Educational Funding Co LLC/ The, Series 2006 1A, Class A3X 144 A 0,475%, fällig 25.04.2033 *	3.135	0,20	4.000 Ocean Trails CLO IX, Series 2020 9A, Class A1X 144 A 1,996%, fällig 15.10.2029 *	4.015	0,26
3.060 Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Ctf's Ser 2005 R8X Series 2005 R8X Class M4X 0,954%, fällig 25.10.2035 *	3.056	0,20	2.672 Encore Credit Receivables Trust 2005-3X Series 2005 3X Class M5X 1,044%, fällig 25.10.2035 *	2.650	0,17	4.390 Ocean Trails Clo X, Series 2020 10A, Class A1X 144 A 1,676%, fällig 15.10.2031 *	4.399	0,28
1.250 Apidos CLO XII, Series 2013 12A, Class AR, 144 A 1,206%, fällig 15.04.2031 *	1.251	0,08	179 Fannie Mae Grantor Trust 2017-T1X Series 2017 T1X Class A, 2,898%, fällig 25.06.2027	196	0,01	1.280 Ocean Trails Clo XI, Series 2021 11A, Class A, 144 A 1,372%, fällig 20.07.2034 *	1.280	0,08
2.064 Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2019 1A, Class A2I, 144 A 4,194%, fällig 07.06.2049	2.108	0,13	8.581 Fieldstone Mortgage Investment Trust Series 20052X Series 2005 2X Class M3X 0,864%, fällig 25.12.2035 *	8.414	0,54	4.390 OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, Series 2018 1A, Class A1A, 144 A 1,194%, fällig 20.01.2031 *	4.394	0,28
5.137 Asset Backed Securities Corp Home Equity Loan Trust Series RFC 2007- HE1X Series 2007 HE1X Class A4X 0,224%, fällig 25.12.2036 *	5.040	0,32	3.079 First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF15X Series 2006 FF15X Class A2X 0,204%, fällig 25.11.2036 *	2.964	0,19	2.500 Octagon Investment Partners 36 Ltd, Series 2018 1A, Class A1X 144 A 1,096%, fällig 15.04.2031 *	2.499	0,16
2.390 BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Series 1996 1X Class B1X 7,875%, fällig 10.10.2026	228	0,01	2.060 Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Series 2018 4X Class A, 4,060%, fällig 15.11.2030	2.373	0,15	1.390 Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1X Series 2007 FXD1X Class 1A1X 5,866%, fällig 25.01.2037	1.403	0,09
859 BLUEMOUNTAIN CLO 2012-2 Ltd, Series 2012 2A, Class AR2X 144 A 1,181%, fällig 20.11.2028 *	859	0,05	200 Freddie Mac Structured PassThrough Certificates FRESR 2017-SR01X Series 2017 SR01X Class A3X 3,089%, fällig 25.11.2027	212	0,01	452 Origen Manufactured Housing Contract Trust 2006-A, Series 2006 A, Class A2X 1,671%, fällig 15.10.2037 *	442	0,03
735 BlueMountain CLO 2013-2 Ltd, Series 2013 2A, Class A1R, 144 A 1,318%, fällig 22.10.2030 *	736	0,05	500 Galaxy XXI CLO Ltd, Series 2015 21A, Class AR, 144 A 1,154%, fällig 20.04.2031 *	500	0,03	1.550 Owl Rock CLO I Ltd, Series 2019 1A, Class A, 144 A 1,931%, fällig 20.05.2031 *	1.551	0,10
2.000 BlueMountain CLO XXII Ltd, Series 2018 22A, Class A1X 144 A 1,206%, fällig 15.07.2031 *	2.001	0,13	2.980 Goldentree Loan Management US Clo 10 Ltd, Series 2021 10A, Class A, 144 A 1,217%, fällig 20.07.2034 *	2.983	0,19	250 Palmer Square CLO 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Class A1X 144 A 1,164%, fällig 18.04.2031 *	250	0,02
3.564 Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-1 Ltd, Series 2014 1A, Class A1R2X 144 A 1,104%, fällig 17.04.2031 *	3.566	0,23	3.150 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021- 4X Series 2021 4GS, Class A, 144 A 1,930%, fällig 20.07.2048	3.167	0,20	2.360 Point Au Roche Park CLO Ltd, Series 2021 1A, Class A, 144 A 1,256%, fällig 20.07.2034 *	2.363	0,15
3.202 Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-3 Ltd, Series 2015 3A, Class A1R, 144 A 1,132%, fällig 28.07.2028 *	3.203	0,20	1.100 Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Class A2X 144 A 1,136%, fällig 15.04.2031 *	1.100	0,07	3.600 RASC Series 2007-KS1 Trust, Series 2007 KS1X Class A4X 0,304%, fällig 25.01.2037 *	3.472	0,22
1.740 Cayuga Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class AR, 144 A 1,230%, fällig 17.07.2034 *	1.742	0,11	4.034 Greywolf CLO V Ltd, Series 2015 1A, Class A1R, 144 A 1,285%, fällig 27.01.2031 *	4.038	0,26	4.540 RASC Series 2007-KS3 Trust, Series 2007 KS3X Class A4X 0,424%, fällig 25.04.2037 *	4.423	0,28
1.750 Cedar Funding VIII Clo Ltd, Series 2017 8A, Class A1X 144 A 1,384%, fällig 17.10.2030 *	1.752	0,11	1.890 GSA Home Equity Trust 2005-6X Series 2005 6X Class M4X 1,134%, fällig 25.06.2035 *	1.867	0,12	2.305 Renaissance Home Equity Loan Trust 2004-1X Series 2004 1X Class AV3X 1,024%, fällig 25.05.2034 *	2.287	0,15
25 ContilMortgage Home Equity Loan Trust 1999-1X Series 1999 1X Class B, 9,000%, fällig 25.04.2030	27	-	2.122 Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1X Series 2004 1X Class M1X 0,834%, fällig 25.02.2034 *	2.121	0,14	2.010 Saxon Asset Securities Trust 2006-3X Series 2006 3X Class A4X 0,324%, fällig 25.10.2046 *	1.840	0,12
3.208 Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2004 3X Class 1A, 0,504%, fällig 25.08.2034 *	3.131	0,20	2.000 Magnetite XIV-R Ltd, Series 2015 14RA, Class A2X 144 A 1,254%, fällig 18.10.2031 *	2.005	0,13	166 SBA Small Business Investment Cos, Series 2018 10B, Class 1X 3,548%, fällig 10.09.2028	180	0,01
386 Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2005 8X Class M4X 1,014%, fällig 25.12.2035 *	386	0,02	1.833 Magnolia Finance, 0,000%, fällig 09.08.2024 ∞	1.752	0,11	359 Shackleton 2014-VI-R CLO Ltd, Series 2014 6RA, Class A, 144 A 1,154%, fällig 17.07.2028 *	359	0,02
1.960 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1X Class M2X 144 A 3,003%, fällig 25.07.2057 *	1.967	0,13	3.140 MFI 2021-FL6 Ltd, Series 2021 FL6X Class A, 144 A 1,196%, fällig 16.07.2036 *	3.150	0,20	3.400 SLM Private Education Loan Trust 2010-C, Series 2010 C, Class A5X 144 A 4,846%, fällig 15.10.2041 *	3.798	0,24
			3.000 National Collegiate II Commutation Trust, Series 2005 AR15X Class AR15X 0,000%, fällig 01.06.2045	575	0,04	958 SMB Private Education Loan Trust 2014-A, Series 2014 A, Class A3X 144 A 1,596%, fällig 15.04.2032 *	967	0,06
			3.300 National Collegiate Student Loan Trust 2006-3X Series 2006 3X Class B, 0,444%, fällig 26.01.2032 *	2.731	0,17			

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			497 BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND, Series 2018 IND, Class G, 144 A 2,146%, fällig 15.11.2035 *	499	0,03	2.554 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03X Class 1B1X 3,834%, fällig 25.10.2030 *	2.661	0,17
2 SMB Private Education Loan Trust 2015-A, Series 2015 A, Class R, 144 A 0,000%, fällig 15.10.2048	706	0,05	2.324 BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND, Series 2018 IND, Class H, 144 A 3,096%, fällig 15.11.2035 *	2.331	0,15	2.313 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03X Class 1M2X 2,234%, fällig 25.10.2030 *	2.344	0,15
618 SMB Private Education Loan Trust, Series 2020 B, Class A1A, 144 A 1,290%, fällig 15.07.2053	621	0,04	3.100 BXP Trust 2017-CQHP, Series 2017 CQHP, Class A, 144 A 0,946%, fällig 15.11.2034 *	3.077	0,20	560 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05X Class 1B1X 4,334%, fällig 25.01.2031 *	587	0,04
1.200 South Texas Higher Education Authority Inc, Series 2012 1X Class A3X 1,052%, fällig 01.10.2046 *	1.204	0,08	71 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-3X Series 2005 3X Class 1A2X 0,664%, fällig 25.04.2035 *	67	-	17 Fannie Mae Interest Strip 390X Class C3X 6,000%, fällig 25.07.2038	3	-
1.598 Structured Asset Investment Loan Trust 2005-HE1X Series 2005 HE1X Class M2X 0,804%, fällig 25.07.2035 *	1.600	0,10	300 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27X Series 2015 GC27X Class AS, 3,571%, fällig 10.02.2048	318	0,02	8 Fannie Mae Interest Strip 407X Class 22X 5,000%, fällig 25.01.2039 *	2	-
149 Towd Point Mortgage Trust 2016-3X Series 2016 3X Class A1X 144 A 2,250%, fällig 25.04.2056 *	150	0,01	8.968 Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6X Series 2006 AR6X Class 2A4X 0,524%, fällig 25.09.2036 *	3.122	0,20	5 Fannie Mae Interest Strip 407X Class 23X 5,000%, fällig 25.01.2039 *	1	-
2.950 Trinitas CLO XVI Ltd, Series 2021 16A, Class A1X 144 A 1,314%, fällig 20.07.2034 *	2.958	0,19	20 COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Series 2013 CR12X Class B, 4,762%, fällig 10.10.2046 *	21	-	9 Fannie Mae Interest Strip 407X Class 27X 5,500%, fällig 25.01.2039 *	1	-
622 Tryon Park CLO Ltd, Series 2013 1A, Class A1SR, 144 A 1,016%, fällig 15.04.2029 *	623	0,04	10 COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Series 2013 CR12X Class C, 5,241%, fällig 10.10.2046 *	10	-	8 Fannie Mae Interest Strip 407X Class 34X 5,000%, fällig 25.01.2038	1	-
700 Venture XXVIII CLO Ltd, Series 2017 28A, Class A2X 144 A 1,244%, fällig 20.07.2030 *	700	0,04	726 COMM 2013-CCRE6 Mortgage Trust, Series 2013 CR6X Class B, 144 A 3,397%, fällig 10.03.2046	744	0,05	22 Fannie Mae Interest Strip 407X Class 41X 6,000%, fällig 25.01.2038	5	-
2.690 Voya CLO 2018-3 Ltd, Series 2018 3A, Class A1A, 144 A 1,276%, fällig 15.10.2031 *	2.693	0,17	90 COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1X Class B, 4,035%, fällig 10.02.2048 *	96	0,01	72 Fannie Mae Interest Strip 409X Class C13X 3,500%, fällig 25.11.2041	7	-
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Kosten 135.645 USD)	137.932	8,79	70 COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1X Class C, 4,451%, fällig 10.02.2048 *	73	-	83 Fannie Mae Interest Strip 409X Class C18X 4,000%, fällig 25.04.2042	11	-
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere – 22,04 % (28. Februar 2021: 28,98 %)			1.255 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07X Series 2019 R07X Class 1M2X 144 A 2,184%, fällig 25.10.2039 *	1.261	0,08	122 Fannie Mae Interest Strip 409X Class C2X 3,000%, fällig 25.04.2027	7	-
75 Alternative Loan Trust 2005-14X Series 2005 14X Class 2A2X 0,334%, fällig 25.05.2035 * 64	-		500 CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C1X Class AS, 3,791%, fällig 15.04.2050 *	537	0,03	83 Fannie Mae Interest Strip 409X Class C22X 4,500%, fällig 25.11.2039	12	-
242 Alternative Loan Trust 2005-56X Series 2005 56X Class 4A1X 0,704%, fällig 25.11.2035 *	236	0,02	1.050 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class A2X 144 A 3,953%, fällig 15.09.2037	1.134	0,07	10.700 Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 1,500% ±	10.872	0,69
184 Alternative Loan Trust 2005-IM1X Series 2005 IM1X Class A1X 0,684%, fällig 25.01.2036 *	178	0,01	140 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class E, 144 A 4,373%, fällig 15.09.2037	127	0,01	1.200 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 1,500% ±	1.179	0,08
44 Alternative Loan Trust 2006-18CB, Series 2006 18CB, Class A6X 28,262%, fällig 25.07.2036 *	67	-	5.170 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class F, 144 A 4,373%, fällig 15.09.2037	4.072	0,26	7.600 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000% ±	7.705	0,49
106 APS Resecuritization Trust 2015-3X Series 2015 3X Class 1A, 144 A 0,954%, fällig 27.10.2046 *	107	0,01	600 CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class G, 144 A 5,696%, fällig 15.07.2032 *	510	0,03	12 Fannie Mae Pool '254793', 5,000%, fällig 01.07.2033	13	-
2.235 BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10X Series 2016 GG10X Class AJA, 144 A 6,024%, fällig 10.08.2045 *	1.017	0,07	1.680 DBCG 2017-BBG Mortgage Trust, Series 2017 BBG, Class A, 144 A 0,796%, fällig 15.06.2034 *	1.682	0,11	15 Fannie Mae Pool '555743', 5,000%, fällig 01.09.2033	17	-
2.618 Banc of America Funding 2014-R2 Trust, Series 2014 R2X Class 2A2X 144 A 0,299%, fällig 26.05.2037 *	2.480	0,16	175 Deutsche Mortgage Securities Inc Mortgage Loan Trust Series 2006-PR1X Series 2006 PR1X Class 3AF1X 144 A 0,376%, fällig 15.04.2036 *	161	0,01	1 Fannie Mae Pool '725162', 6,000%, fällig 01.02.2034	1	-
780 BANK 2017-BNK7X Series 2017 BNK7X Class ASX 3,435%, fällig 15.09.2060	864	0,06	491 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C03X Class 1M2X 3,084%, fällig 25.07.2024 *	498	0,03	7 Fannie Mae Pool '745000', 6,000%, fällig 01.10.2035	9	-
12.984 BANK 2017-BNK7X Series 2017 BNK7X Class XA, 0,903%, fällig 15.09.2060 *	457	0,03	906 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C04X Class 1M2X 4,334%, fällig 25.01.2029 *	942	0,06	8 Fannie Mae Pool '843997', 1,961%, fällig 01.11.2035 *	8	-
1.500 BANK 2018-BNK15X Series 2018 BN15X Class B, 4,812%, fällig 15.11.2061 *	1.729	0,11				16 Fannie Mae Pool '865915', 2,234%, fällig 01.03.2036 *	16	-
2.570 BBCCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Class E, 144 A 4,715%, fällig 10.08.2033 *	2.604	0,17				18 Fannie Mae Pool '888560', 6,000%, fällig 01.11.2035	21	-
324 Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR1X Series 2007 AR1X Class 1A1X 0,244%, fällig 25.01.2037 *	310	0,02				41 Fannie Mae Pool '889117', 5,000%, fällig 01.10.2035	47	-
						39 Fannie Mae Pool '890248', 6,000%, fällig 01.08.2037	47	-
						487 Fannie Mae Pool '890604', 4,500%, fällig 01.10.2044	545	0,03
						162 Fannie Mae Pool '890827', 3,500%, fällig 01.12.2037	175	0,01
						9 Fannie Mae Pool '985626', 6,000%, fällig 01.04.2033	11	-
						19 Fannie Mae Pool '995072', 5,500%, fällig 01.08.2038	22	-
						46 Fannie Mae Pool 'AB9683', 4,000%, fällig 01.06.2043	51	-
						45 Fannie Mae Pool 'AE0758', 7,000%, fällig 01.02.2039	53	-
						40 Fannie Mae Pool 'AK8441', 4,000%, fällig 01.04.2042	44	-
						- Fannie Mae Pool 'AL2931', 6,000%, fällig 01.06.2023	-	-
						478 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500%, fällig 01.01.2043	519	0,03
						44 Fannie Mae Pool 'AL3026', 3,500%, fällig 01.12.2042	48	-
						34 Fannie Mae Pool 'AL3508', 4,000%, fällig 01.04.2043	38	-
						28 Fannie Mae Pool 'AL4741', 4,500%, fällig 01.01.2044	31	-

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)								
409 Fannie Mae Pool 'CA4819', 4,000%, fällig 01.12.2049	447	0,03	394 Fannie Mae Pool 'FM6871', 2,500%, fällig 01.04.2051	414	0,03	678 Fannie Mae Pool 'MA3210', 3,500%, fällig 01.12.2047	722	0,05
1.230 Fannie Mae Pool 'CA4979', 3,000%, fällig 01.01.2050	1.301	0,08	2.173 Fannie Mae Pool 'FM7210', 2,000%, fällig 01.04.2051	2.217	0,14	170 Fannie Mae Pool 'MA3211', 4,000%, fällig 01.12.2047	183	0,01
750 Fannie Mae Pool 'CA5522', 4,000%, fällig 01.04.2050	821	0,05	397 Fannie Mae Pool 'FM7304', 2,500%, fällig 01.05.2051	415	0,03	202 Fannie Mae Pool 'MA3239', 4,000%, fällig 01.01.2048	219	0,01
282 Fannie Mae Pool 'CA8377', 1,500%, fällig 01.12.2035	287	0,02	1.872 Fannie Mae Pool 'FM7518', 2,500%, fällig 01.06.2051	1.964	0,13	263 Fannie Mae Pool 'MA3332', 3,500%, fällig 01.04.2048	280	0,02
370 Fannie Mae Pool 'CA8460', 2,500%, fällig 01.01.2051	384	0,02	596 Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500%, fällig 01.06.2051	625	0,04	576 Fannie Mae Pool 'MA3501', 5,000%, fällig 01.10.2048	634	0,04
97 Fannie Mae Pool 'CA9358', 2,500%, fällig 01.03.2041	103	0,01	198 Fannie Mae Pool 'FM7676', 2,500%, fällig 01.06.2051	207	0,01	99 Fannie Mae REMICS, Series 2005 29X Class ZA, 5,500%, fällig 25.04.2035	114	0,01
490 Fannie Mae Pool 'CB0100', 2,500%, fällig 01.04.2041	521	0,03	98 Fannie Mae Pool 'FM7727', 2,500%, fällig 01.06.2051	104	0,01	413 Fannie Mae REMICS, Series 2011 59X Class NZ, 5,500%, fällig 25.07.2041	467	0,03
196 Fannie Mae Pool 'CB0101', 2,500%, fällig 01.04.2041	209	0,01	495 Fannie Mae Pool 'FM7741', 2,500%, fällig 01.05.2051	517	0,03	112 Fannie Mae REMICS, Series 2012 133X Class CS, 6,06%, fällig 25.12.2042 *	23	-
781 Fannie Mae Pool 'CB0114', 2,500%, fällig 01.04.2041	823	0,05	2.784 Fannie Mae Pool 'FM7751', 2,000%, fällig 01.05.2051	2.832	0,18	16 Fannie Mae REMICS, Series 2012 28X Class B, 6,500%, fällig 25.06.2039	17	-
1.669 Fannie Mae Pool 'CB0470', 2,500%, fällig 01.05.2041	1.751	0,11	2.081 Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000%, fällig 01.01.2049	2.250	0,14	214 Fannie Mae REMICS, Series 2012 35X Class SC, 6,416%, fällig 25.04.2042 *	43	-
1.071 Fannie Mae Pool 'CB0545', 3,500%, fällig 01.05.2051	1.138	0,07	398 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500%, fällig 01.07.2051	418	0,03	57 Fannie Mae REMICS, Series 2012 46X Class BA, 6,000%, fällig 25.05.2042	67	-
472 Fannie Mae Pool 'FM0068', 3,500%, fällig 01.02.2040	513	0,03	498 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500%, fällig 01.07.2051	522	0,03	86 Fannie Mae REMICS, Series 2012 51X Class B, 7,000%, fällig 25.05.2042	106	0,01
181 Fannie Mae Pool 'FM0071', 3,500%, fällig 01.02.2040	194	0,01	947 Fannie Mae Pool 'FM8210', 3,000%, fällig 01.04.2050	1.001	0,06	4 Fannie Mae REMICS, Series 2012 70X Class YS, 6,566%, fällig 25.02.2041 *	-	-
128 Fannie Mae Pool 'FM1539', 4,500%, fällig 01.09.2049	139	0,01	763 Fannie Mae Pool 'FM8275', 3,500%, fällig 01.06.2049	813	0,05	75 Fannie Mae REMICS, Series 2012 74X Class SA, 6,566%, fällig 25.03.2042 *	13	-
1.879 Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000%, fällig 01.09.2049	2.095	0,13	2.200 Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000%, fällig 01.02.2050	2.326	0,15	220 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9X Class BC, 6,500%, fällig 25.07.2042	263	0,02
150 Fannie Mae Pool 'FM2158', 4,000%, fällig 01.10.2049	163	0,01	15 Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500%, fällig 01.04.2031	17	-	270 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9X Class CB, 5,500%, fällig 25.04.2042	309	0,02
72 Fannie Mae Pool 'FM2173', 4,000%, fällig 01.09.2048	78	0,01	60 Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500%, fällig 01.05.2031	66	-	1.478 Fannie Mae REMICS, Series 2016 23X Class ST, 5,916%, fällig 25.11.2045 *	304	0,02
363 Fannie Mae Pool 'FM2333', 3,500%, fällig 01.02.2050	388	0,02	18 Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500%, fällig 01.06.2031	19	-	240 Fannie Mae REMICS, Series 2016 61X Class BS, 6,016%, fällig 25.09.2046 *	44	-
1.299 Fannie Mae Pool 'FM3123', 2,500%, fällig 01.03.2038	1.353	0,09	26 Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500%, fällig 01.11.2031	29	-	1.130 Fannie Mae REMICS, Series 2017 76X Class SB, 6,016%, fällig 25.10.2057 *	230	0,01
1.452 Fannie Mae Pool 'FM3141', 3,500%, fällig 01.11.2048	1.550	0,10	27 Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500%, fällig 01.12.2031	30	-	318 Fannie Mae REMICS, Series 2017 85X Class SC, 6,116%, fällig 25.11.2047 *	58	-
104 Fannie Mae Pool 'FM3154', 5,000%, fällig 01.09.2049	114	0,01	102 Fannie Mae Pool 'MA1146', 4,000%, fällig 01.08.2042	112	0,01	614 Fannie Mae REMICS, Series 2020 47X Class GZ, 2,000%, fällig 25.07.2050	586	0,04
128 Fannie Mae Pool 'FM3155', 5,000%, fällig 01.12.2049	140	0,01	25 Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500%, fällig 01.09.2042	27	-	819 Fannie Mae REMICS, Series 2020 56X Class DI, 2,500%, fällig 25.08.2050	127	0,01
281 Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000%, fällig 01.11.2048	308	0,02	762 Fannie Mae Pool 'MA1217', 4,000%, fällig 01.10.2042	835	0,05	843 Fannie Mae REMICS, Series 2020 57X Class NI, 2,500%, fällig 25.08.2050	121	0,01
2.937 Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500%, fällig 01.05.2047	3.143	0,20	161 Fannie Mae Pool 'MA1253', 4,000%, fällig 01.11.2042	176	0,01	458 Fannie Mae REMICS, Series 2020 74X Class EI, 2,500%, fällig 25.10.2050	68	-
113 Fannie Mae Pool 'FM3542', 4,000%, fällig 01.05.2049	123	0,01	429 Fannie Mae Pool 'MA1283', 3,500%, fällig 01.12.2042	466	0,03	2.560 Fannie Mae REMICS, Series 2020 89X Class DI, 2,500%, fällig 25.12.2050	343	0,02
441 Fannie Mae Pool 'FM3572', 4,500%, fällig 01.09.2049	486	0,03	311 Fannie Mae Pool 'MA1437', 3,500%, fällig 01.05.2043	338	0,02	1.464 Fannie Mae REMICS, Series 2020 97X Class AI, 2,000%, fällig 25.01.2051	181	0,01
4.078 Fannie Mae Pool 'FM3773', 3,500%, fällig 01.11.2048	4.367	0,28	34 Fannie Mae Pool 'MA1547', 4,000%, fällig 01.08.2043	37	-	2.052 Fannie Mae REMICS, Series 2021 3X Class IB, 2,500%, fällig 25.02.2051	360	0,02
686 Fannie Mae Pool 'FM3830', 3,000%, fällig 01.04.2050	726	0,05	64 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500%, fällig 01.09.2043	71	-	2.498 Fannie Mae REMICS, Series 2021 3X Class QL, 2,500%, fällig 25.02.2051	344	0,02
472 Fannie Mae Pool 'FM3957', 5,000%, fällig 01.03.2050	518	0,03	59 Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500%, fällig 01.10.2043	67	-	389 Fannie Mae-Aces, Series 2013 M6X Class 1AC, 3,533%, fällig 25.02.2043 *	438	0,03
440 Fannie Mae Pool 'FM3978', 4,000%, fällig 01.07.2050	472	0,03	30 Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500%, fällig 01.11.2043	34	-	200 Fannie Mae-Aces, Series 2017 M8X Class A2X 3,061%, fällig 25.05.2027 *	220	0,01
1.114 Fannie Mae Pool 'FM4165', 3,000%, fällig 01.09.2050	1.182	0,08	64 Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500%, fällig 01.12.2043	72	-			
648 Fannie Mae Pool 'FM4577', 2,500%, fällig 01.10.2050	680	0,04	191 Fannie Mae Pool 'MA2110', 3,500%, fällig 01.12.2034	207	0,01			
741 Fannie Mae Pool 'FM4595', 3,000%, fällig 01.09.2050	786	0,05	132 Fannie Mae Pool 'MA2138', 3,500%, fällig 01.01.2035	142	0,01			
430 Fannie Mae Pool 'FM4737', 3,500%, fällig 01.09.2050	456	0,03	85 Fannie Mae Pool 'MA2320', 3,000%, fällig 01.07.2035	90	0,01			
319 Fannie Mae Pool 'FM4925', 3,000%, fällig 01.11.2050	339	0,02	788 Fannie Mae Pool 'MA2523', 3,000%, fällig 01.02.2036	833	0,05			
77 Fannie Mae Pool 'FM5434', 4,500%, fällig 01.05.2046	86	0,01	618 Fannie Mae Pool 'MA2579', 3,000%, fällig 01.04.2036	654	0,04			
276 Fannie Mae Pool 'FM5713', 2,500%, fällig 01.02.2051	288	0,02	1.216 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000%, fällig 01.07.2036	1.283	0,08			
289 Fannie Mae Pool 'FM5743', 2,500%, fällig 01.02.2051	302	0,02	494 Fannie Mae Pool 'MA2707', 3,000%, fällig 01.08.2036	522	0,03			
80 Fannie Mae Pool 'FM5754', 3,500%, fällig 01.03.2037	86	0,01	2.577 Fannie Mae Pool 'MA2773', 3,000%, fällig 01.10.2036	2.725	0,17			
678 Fannie Mae Pool 'FM5783', 3,000%, fällig 01.06.2038	715	0,05	1.286 Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000%, fällig 01.12.2036	1.359	0,09			
379 Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500%, fällig 01.02.2051	397	0,03						
849 Fannie Mae Pool 'FM5931', 2,500%, fällig 01.02.2051	888	0,06						
661 Fannie Mae Pool 'FM5944', 2,500%, fällig 01.01.2051	693	0,04						
149 Fannie Mae Pool 'FM6015', 3,500%, fällig 01.08.2039	159	0,01						
605 Fannie Mae Pool 'FM6134', 3,000%, fällig 01.03.2040	635	0,04						
393 Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500%, fällig 01.03.2051	411	0,03						

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)								
800 Fannie Mae-Aces, Series 2018 M15X Class 1A2X 3,700%, fällig 25.01.2036	931	0,06	124 Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000%, fällig 01.10.2042	137	0,01	175 Freddie Mac Pool 'RA2358', 4,000%, fällig 01.03.2050	189	0,01
881 Fannie Mae-Aces, Series 2018 M9X Class APT2X 3,225%, fällig 25.04.2028 *	982	0,06	72 Freddie Mac Gold Pool 'U91254', 4,000%, fällig 01.04.2043	80	0,01	3.702 Freddie Mac Pool 'RA3474', 3,000%, fällig 01.09.2050	3.900	0,25
543 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M19X Class A2X 2,560%, fällig 25.09.2029	586	0,04	32 Freddie Mac Gold Pool 'U95137', 4,000%, fällig 01.08.2043	36	-	850 Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000%, fällig 01.11.2050	865	0,06
1.299 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M23X Class 3A3X 2,720%, fällig 25.10.2031 *	1.433	0,09	858 Freddie Mac Gold Pool 'U99054', 4,000%, fällig 01.06.2043	941	0,06	1.222 Freddie Mac Pool 'RA4414', 2,500%, fällig 01.01.2051	1.279	0,08
121 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M28X Class AV, 2,232%, fällig 25.02.2027	128	0,01	48 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K016X Class X1X 1,599%, fällig 25.10.2021 *	-	-	1.540 Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000%, fällig 01.02.2051	1.569	0,10
1.888 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M36X Class X1X 1,560%, fällig 25.09.2034 *	197	0,01	6.705 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K058X Class X1X 1,050%, fällig 25.08.2026 *	273	0,02	3.430 Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000%, fällig 01.05.2051	3.495	0,22
318 Flagstar Mortgage Trust 2018-2X Series 2018 2X Class A4X 144 A 3,500%, fällig 25.04.2048 *	319	0,02	89 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,090%, fällig 01.03.2047 * 92	0,01		2.072 Freddie Mac Pool 'RA5155', 2,000%, fällig 01.05.2051	2.113	0,13
98 Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000%, fällig 01.02.2038	102	0,01	125 Freddie Mac Pool 'QA5768', 3,000%, fällig 01.01.2050	133	0,01	497 Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000%, fällig 01.06.2051	506	0,03
97 Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000%, fällig 01.04.2038	102	0,01	60 Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000%, fällig 01.01.2050	63	-	2.684 Freddie Mac Pool 'RA5576', 2,500%, fällig 01.07.2051	2.816	0,18
168 Freddie Mac Gold Pool 'G06409', 6,000%, fällig 01.11.2039	200	0,01	765 Freddie Mac Pool 'QA7256', 3,000%, fällig 01.02.2050	801	0,05	2.300 Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000%, fällig 01.09.2041	2.358	0,15
18 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500%, fällig 01.09.2039	21	-	89 Freddie Mac Pool 'QB2667', 3,000%, fällig 01.08.2050	93	0,01	163 Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000%, fällig 01.07.2047	177	0,01
493 Freddie Mac Gold Pool 'G08682', 4,000%, fällig 01.12.2045	538	0,03	86 Freddie Mac Pool 'QB2927', 3,000%, fällig 01.09.2050	91	0,01	986 Freddie Mac Pool 'SD0552', 2,000%, fällig 01.03.2051	1.001	0,06
9 Freddie Mac Gold Pool 'G13888', 5,000%, fällig 01.06.2025	9	-	469 Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500%, fällig 01.11.2050	492	0,03	296 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000%, fällig 01.04.2051	302	0,02
1.713 Freddie Mac Gold Pool 'G60985', 3,000%, fällig 01.05.2047	1.834	0,12	282 Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500%, fällig 01.11.2050	297	0,02	673 Freddie Mac Pool 'SD0633', 3,500%, fällig 01.02.2051	724	0,05
1.208 Freddie Mac Gold Pool 'G61637', 3,000%, fällig 01.09.2047	1.301	0,08	88 Freddie Mac Pool 'QB5799', 2,500%, fällig 01.11.2050	92	0,01	596 Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500%, fällig 01.07.2051	625	0,04
1.092 Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000%, fällig 01.10.2046	1.171	0,07	292 Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000%, fällig 01.02.2051	297	0,02	390 Freddie Mac Pool 'SD8065', 4,500%, fällig 01.05.2050	423	0,03
4.256 Freddie Mac Gold Pool 'G67713', 4,000%, fällig 01.06.2048	4.668	0,30	390 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000%, fällig 01.02.2051	397	0,03	529 Freddie Mac Pool 'ZA5297', 4,000%, fällig 01.03.2048	580	0,04
29 Freddie Mac Gold Pool 'Q19135', 4,000%, fällig 01.06.2043	32	-	193 Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000%, fällig 01.02.2051	196	0,01	175 Freddie Mac Pool 'ZA5318', 3,500%, fällig 01.03.2048	186	0,01
33 Freddie Mac Gold Pool 'Q19254', 4,000%, fällig 01.06.2043	36	-	1.562 Freddie Mac Pool 'QB9087', 2,000%, fällig 01.02.2051	1.592	0,10	1.758 Freddie Mac Pool 'ZA6342', 4,500%, fällig 01.03.2049	1.933	0,12
35 Freddie Mac Gold Pool 'Q19611', 4,000%, fällig 01.07.2043	39	-	198 Freddie Mac Pool 'QB9090', 2,000%, fällig 01.02.2051	202	0,01	1.145 Freddie Mac Pool 'ZA6680', 4,000%, fällig 01.04.2049	1.250	0,08
30 Freddie Mac Gold Pool 'Q19615', 4,000%, fällig 01.07.2043	34	-	290 Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000%, fällig 01.03.2051	295	0,02	147 Freddie Mac Pool 'Z17269', 5,000%, fällig 01.03.2038	169	0,01
11 Freddie Mac Gold Pool 'Q27298', 4,000%, fällig 01.07.2044	12	-	195 Freddie Mac Pool 'QB9484', 2,000%, fällig 01.03.2051	199	0,01	255 Freddie Mac Pool 'ZM1278', 3,500%, fällig 01.06.2046	276	0,02
583 Freddie Mac Gold Pool 'Q40356', 4,000%, fällig 01.05.2046	633	0,04	98 Freddie Mac Pool 'QB9485', 2,000%, fällig 01.03.2051	100	0,01	267 Freddie Mac Pool 'ZM3746', 5,000%, fällig 01.07.2047	295	0,02
427 Freddie Mac Gold Pool 'Q45560', 3,000%, fällig 01.01.2047	455	0,03	293 Freddie Mac Pool 'QB9961', 2,000%, fällig 01.03.2051	298	0,02	69 Freddie Mac Pool 'ZM5722', 3,500%, fällig 01.02.2048	73	-
1.066 Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000%, fällig 01.01.2047	1.141	0,07	294 Freddie Mac Pool 'QC0160', 2,000%, fällig 01.03.2051	300	0,02	248 Freddie Mac Pool 'ZM7733', 5,000%, fällig 01.08.2048	273	0,02
290 Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000%, fällig 01.01.2047	311	0,02	288 Freddie Mac Pool 'QC0161', 2,000%, fällig 01.03.2051	292	0,02	67 Freddie Mac Pool 'ZN0480', 3,500%, fällig 01.10.2042	73	-
246 Freddie Mac Gold Pool 'Q45827', 3,000%, fällig 01.01.2047	263	0,02	290 Freddie Mac Pool 'QC0288', 2,000%, fällig 01.04.2051	294	0,02	146 Freddie Mac Pool 'ZN1436', 5,000%, fällig 01.11.2048	161	0,01
629 Freddie Mac Gold Pool 'Q48149', 4,500%, fällig 01.05.2047	686	0,04	297 Freddie Mac Pool 'QC0297', 2,000%, fällig 01.04.2051	302	0,02	4 Freddie Mac Pool 'ZS0823', 5,000%, fällig 01.12.2034	5	-
			99 Freddie Mac Pool 'QC0885', 2,000%, fällig 01.04.2051	101	0,01	7 Freddie Mac Pool 'ZS2059', 5,500%, fällig 01.04.2038	8	-
			198 Freddie Mac Pool 'QC1164', 2,000%, fällig 01.04.2051	201	0,01	26 Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500%, fällig 01.12.2038	30	-
			394 Freddie Mac Pool 'QC1352', 2,000%, fällig 01.04.2051	399	0,03	138 Freddie Mac Pool 'ZS3204', 5,000%, fällig 01.06.2041	155	0,01
			98 Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500%, fällig 01.05.2051	104	0,01	70 Freddie Mac Pool 'ZS3412', 5,500%, fällig 01.12.2038	82	0,01
			298 Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500%, fällig 01.07.2051	312	0,02	11 Freddie Mac Pool 'ZS4748', 4,000%, fällig 01.12.2047	12	-
			200 Freddie Mac Pool 'QC4818', 2,500%, fällig 01.08.2051	209	0,01	165 Freddie Mac Pool 'ZS8669', 3,000%, fällig 01.09.2032	175	0,01
			99 Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500%, fällig 01.08.2051	104	0,01	173 Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000%, fällig 01.10.2032	184	0,01
			98 Freddie Mac Pool 'QK0701', 2,500%, fällig 01.04.2041	103	0,01	40 Freddie Mac Pool 'ZS8779', 5,000%, fällig 01.07.2025	44	-
			916 Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000%, fällig 01.09.2049	978	0,06	797 Freddie Mac Pool 'ZS9316', 3,500%, fällig 01.01.2038	863	0,06
			1.775 Freddie Mac Pool 'RA2313', 3,500%, fällig 01.03.2050	1.888	0,12	360 Freddie Mac Pool 'ZT1107', 3,500%, fällig 01.03.2043	391	0,03
			66 Freddie Mac Pool 'RA2353', 4,500%, fällig 01.03.2050	72	-	34 Freddie Mac Pool 'ZT1159', 3,500%, fällig 01.02.2044	37	-
						432 Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000%, fällig 01.01.2046	466	0,03
						992 Freddie Mac Pool 'ZT1493', 3,000%, fällig 01.09.2048	1.059	0,07
						921 Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500%, fällig 01.04.2033	994	0,06

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)								
77 Freddie Mac Reference REMIC R007X Class ZA, 6,000%, fällig 15.05.2036	90	0,01	21 Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000%, fällig 20.08.2040	23	–	63 Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500%, fällig 20.03.2045	68	–
50 Freddie Mac REMICS 3621X Class SB, 6,135%, fällig 15.01.2040 *	10	–	15 Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000%, fällig 20.09.2040	16	–	99 Ginnie Mae II Pool 'MA3375', 3,000%, fällig 20.01.2046	104	0,01
289 Freddie Mac REMICS 4813X Class CJ, 3,000%, fällig 15.08.2048	300	0,02	8 Ginnie Mae II Pool '4871', 6,000%, fällig 20.11.2040	10	–	86 Ginnie Mae II Pool 'MA3521', 3,500%, fällig 20.03.2046	92	0,01
501 Freddie Mac REMICS 5010X Class IK, 2,500%, fällig 25.09.2050	67	–	26 Ginnie Mae II Pool '4905', 6,000%, fällig 20.12.2040	30	–	391 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500%, fällig 20.04.2046	416	0,03
1.210 Freddie Mac REMICS 5010X Class JI, 2,500%, fällig 25.09.2050	178	0,01	6 Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000%, fällig 20.01.2041	7	–	212 Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500%, fällig 20.05.2046	226	0,01
477 Freddie Mac REMICS 5013X Class IN, 2,500%, fällig 25.09.2050	73	–	21 Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000%, fällig 20.02.2041	25	–	365 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500%, fällig 20.06.2046	390	0,03
952 Freddie Mac REMICS 5018X Class MI, 2,000%, fällig 25.10.2050	122	0,01	237 Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500%, fällig 20.03.2041	264	0,02	220 Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500%, fällig 20.07.2046	235	0,02
279 Freddie Mac REMICS 5040X Class IB, 2,500%, fällig 25.11.2050	35	–	6 Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000%, fällig 20.07.2040	7	–	135 Ginnie Mae II Pool 'MA3937', 3,500%, fällig 20.09.2046	144	0,01
1.560 Freddie Mac REMICS 5059X Class IB, 2,500%, fällig 25.01.2051	222	0,01	72 Ginnie Mae II Pool '783368', 4,500%, fällig 20.07.2041	81	0,01	179 Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000%, fällig 20.11.2046	188	0,01
574 Freddie Mac REMICS 5069X Class MI, 2,500%, fällig 25.02.2051	78	0,01	169 Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500%, fällig 20.01.2046	181	0,01	131 Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000%, fällig 20.02.2047	138	0,01
1.695 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2X Series 2020 DNA2X Class M2X 144 A 1,934%, fällig 25.02.2050 *	1.708	0,11	1.689 Ginnie Mae II Pool '784674', 3,500%, fällig 20.04.2048	1.834	0,12	33 Ginnie Mae II Pool 'MA4381', 3,000%, fällig 20.04.2047	35	–
1.730 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6X Series 2020 DNA6X Class M2X 144 A 2,050%, fällig 25.12.2050 *	1.745	0,11	228 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500%, fällig 20.10.2049	236	0,02	2.488 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000%, fällig 20.06.2047	2.670	0,17
63 Freddie Mac Strips 334X Class S7X 6,005%, fällig 15.08.2044 * 14	–	–	547 Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000%, fällig 20.01.2050	573	0,04	445 Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500%, fällig 20.08.2047	479	0,03
498 Freddie Mac Strips 353X Class S1X 5,905%, fällig 15.12.2046 *	108	0,01	129 Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500%, fällig 20.09.2048	136	0,01	25 Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000%, fällig 20.11.2047	26	–
1.327 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2015 HQ2X Class B, 8,034%, fällig 25.05.2025 *	1.382	0,09	679 Ginnie Mae II Pool '785218', 2,000%, fällig 20.12.2050	790	0,05	1.014 Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000%, fällig 20.11.2047	1.089	0,07
271 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA2X Class M3X 4,734%, fällig 25.10.2028 *	282	0,02	864 Ginnie Mae II Pool '785219', 2,000%, fällig 20.12.2050	883	0,06	264 Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000%, fällig 20.12.2047	277	0,02
3.948 FREMF 2012-K20 Mortgage Trust, Series 2012 K20X Class X2A, 144 A 0,200%, fällig 25.05.2045	4	–	679 Ginnie Mae II Pool '785220', 2,000%, fällig 20.12.2050	695	0,04	433 Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000%, fällig 20.12.2047	462	0,03
38 Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000%, fällig 15.04.2040	44	–	396 Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000%, fällig 20.03.2051	405	0,03	822 Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500%, fällig 20.02.2048	872	0,06
69 Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000%, fällig 15.05.2040	80	0,01	1.488 Ginnie Mae II Pool 'AP6338', 4,000%, fällig 20.10.2045	1.624	0,10	396 Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000%, fällig 20.02.2048	425	0,03
72 Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000%, fällig 15.09.2042	77	0,01	361 Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500%, fällig 20.10.2047	385	0,02	293 Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000%, fällig 20.03.2048	311	0,02
565 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500%, fällig 15.06.2048	606	0,04	249 Ginnie Mae II Pool 'BD0384', 3,500%, fällig 20.10.2047	269	0,02	386 Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000%, fällig 20.04.2048	410	0,03
99 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000%, fällig 15.09.2042	105	0,01	177 Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500%, fällig 20.02.2050	188	0,01	714 Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500%, fällig 20.04.2048	765	0,05
242 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000%, fällig 15.09.2042	257	0,02	194 Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000%, fällig 20.10.2049	209	0,01	868 Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500%, fällig 20.05.2048	924	0,06
505 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000%, fällig 15.10.2042	535	0,03	146 Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000%, fällig 20.11.2049	154	0,01	285 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500%, fällig 20.07.2048	305	0,02
323 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000%, fällig 15.10.2042	342	0,02	150 Ginnie Mae II Pool 'BS1728', 4,000%, fällig 20.01.2050	163	0,01	560 Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500%, fällig 20.10.2048	596	0,04
2 Ginnie Mae I Pool 'AB9205', 3,000%, fällig 15.11.2042	2	–	131 Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000%, fällig 20.02.2050	142	0,01	343 Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000%, fällig 20.11.2048	370	0,02
299 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000%, fällig 15.11.2042	317	0,02	389 Ginnie Mae II Pool 'BS8546', 2,500%, fällig 20.12.2050	410	0,03	239 Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500%, fällig 20.12.2048	255	0,02
22 Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500%, fällig 20.10.2037	26	–	625 Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000%, fällig 20.03.2050	654	0,04	219 Ginnie Mae II Pool 'MA5762', 3,500%, fällig 20.02.2049	232	0,01
28 Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500%, fällig 20.01.2040	32	–	231 Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500%, fällig 20.06.2044	249	0,02	401 Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500%, fällig 20.03.2049	427	0,03
33 Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500%, fällig 20.05.2040	37	–	412 Ginnie Mae II Pool 'MA2677', 3,000%, fällig 20.03.2045	437	0,03	372 Ginnie Mae II Pool 'MA5819', 5,000%, fällig 20.03.2049	402	0,03
111 Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000%, fällig 20.07.2040	125	0,01						

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)								
187			68			1.141		
Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500%, fällig 20.04.2049	199	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2014 17X Class AM, 3,318%, fällig 16.06.2048 *	73	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 123X Class NI, 2,500%, fällig 20.08.2050	150	0,01
639			314			574		
Ginnie Mae II Pool 'MA6342', 5,000%, fällig 20.12.2049	687	0,04	Government National Mortgage Association, Series 2014 176X Class IA, 4,000%, fällig 20.11.2044	38	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 127X Class IN, 2,500%, fällig 20.08.2050	76	0,01
403			2.494			479		
Ginnie Mae II Pool 'MA6413', 5,000%, fällig 20.01.2050	434	0,03	Government National Mortgage Association, Series 2014 H20X Class FA, 0,533%, fällig 20.10.2064 *	2.503	0,16	Government National Mortgage Association, Series 2020 129X Class IE, 2,500%, fällig 20.09.2050	65	–
359			676			17.360		
Ginnie Mae II Pool 'MA6603', 5,000%, fällig 20.04.2050	388	0,02	Government National Mortgage Association, Series 2015 167X Class OI, 4,000%, fällig 16.04.2045	98	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2020 157X Class IO, 0,970%, fällig 16.06.2062 *	1.420	0,09
1.000			1.038			290		
Ginnie Mae II Pool 'MA6999', 4,500%, fällig 20.11.2050	1.067	0,07	Government National Mortgage Association, Series 2015 183X Class IO, 0,652%, fällig 16.09.2057 *	40	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 160X Class IH, 2,500%, fällig 20.12.2050	39	–
200			234			384		
Ginnie Mae II Pool 'MA7056', 4,500%, fällig 20.12.2050	214	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2016 135X Class SB, 6,005%, fällig 16.10.2046 *	68	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 160X Class VI, 2,500%, fällig 20.10.2050	51	–
6.700			1.119			1.635		
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000% ±	6.839	0,44	Government National Mortgage Association, Series 2016 21X Class ST, 6,062%, fällig 20.02.2046 *	236	0,02	Government National Mortgage Association, Series 2020 160X Class YI, 2,500%, fällig 20.10.2050	224	0,01
10.400			509			13.105		
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500% ±	10.786	0,69	Government National Mortgage Association, Series 2016 84X Class IG, 4,500%, fällig 16.11.2045	89	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2020 178X Class IO, 1,415%, fällig 16.10.2060 *	1.416	0,09
2.100			1.124			3.548		
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,000% ±	2.196	0,14	Government National Mortgage Association, Series 2017 111X Class IO, 0,598%, fällig 16.02.2059 *	49	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 181X Class WI, 2,000%, fällig 20.12.2050	363	0,02
322			1.347			1.087		
Government National Mortgage Association, Series 2009 H01X Class FA, 1,238%, fällig 20.11.2059 *	324	0,02	Government National Mortgage Association, Series 2017 157X Class IO, 0,579%, fällig 16.12.2059 *	75	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 47X Class MI, 3,500%, fällig 20.04.2050	159	0,01
6			1.175			362		
Government National Mortgage Association, Series 2010 42X Class BS, 6,392%, fällig 20.04.2040 *	1	–	Government National Mortgage Association, Series 2017 28X Class IO, 0,658%, fällig 16.02.2057 *	53	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 47X Class NI, 3,500%, fällig 20.04.2050	56	–
5			1.255			1.173		
Government National Mortgage Association, Series 2010 85X Class HS, 6,562%, fällig 20.01.2040 *	–	–	Government National Mortgage Association, Series 2017 41X Class IO, 0,693%, fällig 16.07.2058 *	55	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09X Class FL, 1,238%, fällig 20.05.2070 *	1.233	0,08
442			149			240		
Government National Mortgage Association, Series 2010 H11X Class FA, 1,086%, fällig 20.06.2060 *	449	0,03	Government National Mortgage Association, Series 2017 H15X Class KI, 2,199%, fällig 20.07.2067 *	16	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09X Class NF, 1,338%, fällig 20.04.2070 *	248	0,02
450			5.824			176		
Government National Mortgage Association, Series 2010 H20X Class AF, 0,433%, fällig 20.10.2060 *	450	0,03	Government National Mortgage Association, Series 2017 H18X Class BI, 1,623%, fällig 20.09.2067 *	396	0,03	Government National Mortgage Association, Series 2020 H12X Class F, 0,588%, fällig 20.07.2070 *	178	0,01
9			77			276		
Government National Mortgage Association, Series 2010 H22X Class FE, 0,453%, fällig 20.05.2059 *	9	–	Government National Mortgage Association, Series 2017 H20X Class IB, 2,056%, fällig 20.10.2067 *	7	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 H13X Class FA, 0,538%, fällig 20.07.2070 *	278	0,02
709			526			157		
Government National Mortgage Association, Series 2010 H24X Class FA, 0,453%, fällig 20.10.2060 *	710	0,05	Government National Mortgage Association, Series 2018 H06X Class PF, 0,403%, fällig 20.02.2068 *	526	0,03	Government National Mortgage Association, Series 2020 H13X Class FC, 0,538%, fällig 20.07.2070 *	158	0,01
31			929			28.948		
Government National Mortgage Association, Series 2010 H26X Class LF, 0,453%, fällig 20.08.2058 *	31	–	Government National Mortgage Association, Series 2018 H07X Class FD, 0,403%, fällig 20.05.2068 *	929	0,06	Government National Mortgage Association, Series 2021 5X Class IO, 1,094%, fällig 16.01.2061 *	2.697	0,17
262			23			3.180		
Government National Mortgage Association, Series 2011 H01X Class AF, 0,553%, fällig 20.11.2060 *	263	0,02	Government National Mortgage Association, Series 2019 123X Class A, 3,000%, fällig 20.10.2049	24	–	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5X Class A, 144 A 1,646%, fällig 15.09.2031 *	2.893	0,18
62			493			2.410		
Government National Mortgage Association, Series 2011 H09X Class AF, 0,603%, fällig 20.03.2061 *	62	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 123X Class IL, 2,500%, fällig 20.08.2050	51	–	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5X Class B, 144 A 2,846%, fällig 15.09.2031 *	1.957	0,12
16			387			264		
Government National Mortgage Association, Series 2012 66X Class CI, 3,500%, fällig 20.02.2038	–	–	Government National Mortgage Association, Series 2019 90X Class AB, 3,000%, fällig 20.07.2049	515	0,03	GS Mortgage Securities Trust 2006-GG8X Series 2006 GG8X Class AJ, 5,622%, fällig 10.11.2039	76	0,01
442			13.745			80		
Government National Mortgage Association, Series 2013 107X Class AD, 2,769%, fällig 16.11.2047 *	462	0,03	Government National Mortgage Association, Series 2013 50X Class IO, 0,133%, fällig 16.10.2048 *	100	0,01	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16X Series 2013 GC16X Class B, 5,161%, fällig 10.11.2046 *	85	0,01
1.228			1.228					
Government National Mortgage Association, Series 2014 169X Class IO, 0,683%, fällig 16.10.2056 *	39	–						

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			153 Residential Asset Securitization Trust 2005 A15X Series 2005 A15X Class 1A4X 5,750%, fällig 25.02.2036	158	0,01	Belgien – 0,46 % (28. Februar 2021: 0,51 %)		
962 GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20X Series 2014 GC20X Class XA, 1,158%, fällig 10.04.2047 *	20	–	7 Sequoia Mortgage Trust 2004-10X Series 2004 10X Class A1A, 0,708%, fällig 20.11.2034 *	7	–	1.990 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650%, fällig 01.02.2026	2.198	0,14
21 HarborView Mortgage Loan Trust 2007-7X Series 2007 7X Class 2A1 A, 1,084%, fällig 25.10.2037 *	22	–	690 UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2X Series 2017 C2X Class A4X 3,487%, fällig 15.08.2050	761	0,05	40 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900%, fällig 01.02.2046	51	–
3.980 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHH, Series 2018 PHH, Class F, 144 A 4,660%, fällig 15.06.2035 *†	1.087	0,07	82.438 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C9X Series 2018 C9X Class XA, 1,040%, fällig 15.03.2051 *	4.016	0,26	680 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000%, fällig 13.04.2028	774	0,05
4.070 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Class F, 144 A 2,946%, fällig 15.12.2036 *	3.786	0,24	100 VNO 2012-6 AVE Mortgage Trust, Series 2012 6AVE, Class A, 144 A 2,996%, fällig 15.11.2030	102	0,01	280 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500%, fällig 01.06.2030	312	0,02
1.956 JP Morgan Mortgage Trust 2017-5X Series 2017 5X Class A2X 144 A 3,087%, fällig 26.10.2048 *	2.039	0,13	2.346 WaMu Mortgage PassThrough Certificates Series 2005-AR6 Trust, Series 2005 AR6X Class 2A1 A, 0,544%, fällig 25.04.2045 *	2.321	0,15	840 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350%, fällig 01.06.2040	1.009	0,07
343 JP Morgan Mortgage Trust 2018-4X Series 2018 4X Class A1X 144 A 3,500%, fällig 25.10.2048 *	348	0,02	197 WaMu Mortgage PassThrough Certificates Series 2007-OA2 Trust, Series 2007 OA2X Class 2A, 1,532%, fällig 25.03.2047 *	192	0,01	100 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600%, fällig 15.04.2048	123	0,01
30 JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17X Series 2013 C17X Class B, 5,049%, fällig 15.01.2047 *	32	–	163 Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5X Series 2015 SBC5X Class A, 144 A 4,104%, fällig 14.09.2022 *	166	0,01	890 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550%, fällig 23.01.2049	1.240	0,08
160 JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C31X Series 2015 C31X Class B, 4,773%, fällig 15.08.2048 *	176	0,01	20 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2013-LC12X Series 2013 LC12X Class B, 4,443%, fällig 15.07.2046 *	20	–	1.160 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500%, fällig 01.06.2050	1.445	0,09
78 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2007-3X Series 2007 3X Class 12 A1X 0,484%, fällig 25.05.2047 *	94	0,01	250 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC20X Series 2015 LC20X Class AS, 3,467%, fällig 15.04.2050	266	0,02	7.152	0,46	
73 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5X Series 2007 5X Class AJ, 5,450%, fällig 12.08.2048 *	36	–	160 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1X Series 2015 NXS1X Class AS, 3,406%, fällig 15.05.2048	171	0,01	Brasilien – 0,74 % (28. Februar 2021: 0,56 %)		
24 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-9X Series 2007 9X Class AJ, 6,193%, fällig 12.09.2049 *	24	–	5.854 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017- RB1X Series 2017 RB1X Class XA, 1,396%, fällig 15.03.2050 *	327	0,02	57 Petrobras Global Finance BV, 6,250%, fällig 17.03.2024	64	–
14 Morgan Stanley Capital I Trust 2006-IQ12X Series 2006 IQ12X Class AJ, 5,399%, fällig 15.12.2043	9	–	2.330 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013- C14X Series 2013 C14X Class B, 3,841%, fällig 15.06.2046 *	2.404	0,15	6.520 Petrobras Global Finance BV, 5,299%, fällig 27.01.2025	7.335	0,47
2 Morgan Stanley Capital I Trust 2007-IQ13X Series 2007 IQ13X Class AJ, 5,438%, fällig 15.03.2044	2	–	2.010 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014- C21X Series 2014 C21X Class B, 4,213%, fällig 15.08.2047 *	2.103	0,13	390 Petrobras Global Finance BV, 7,375%, fällig 17.01.2027	478	0,03
31 Morgan Stanley Capital I Trust 2007-IQ16X Series 2007 IQ16X Class AJ, 6,470%, fällig 12.12.2049 *	18	–	Summe hypothekarisch gesicherte Wertpapiere (Kosten 347.466 USD)			345.979	22,04	
1.888 Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-2 AR, Series 2005 2AR, Class B1X 0,584%, fällig 25.04.2035 *	1.421	0,09	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 33,42 % (28. Februar 2021: 34,30 %)					
280 MSCG Trust 2015-ALDR, Series 2015 ALDR, Class A2X 144 A 3,577%, fällig 07.06.2035 *	290	0,02	Australien – 0,21 % (28. Februar 2021: 0,30 %)					
2.870 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class A, 144 A 3,047%, fällig 15.08.2036	2.940	0,19	300 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000%, fällig 30.09.2043	414	0,03	Kanada – 0,13 % (28. Februar 2021: 0,41 %)		
536 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3X Series 2016 3A, Class A1B, 144 A 3,250%, fällig 25.09.2056 *	566	0,04	200 Commonwealth Bank of Australia, 144 A 3,900%, fällig 12.07.2047	245	0,02	120 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144 A 3,875%, fällig 15.01.2028	122	0,01
1.009 New Residential Mortgage Loan Trust 2017-6X Series 2017 6A, Class A1X 144 A 4,000%, fällig 27.08.2057 *	1.081	0,07	10 Glencore Funding LLC, 144 A 4,125%, fällig 30.05.2023	11	–	110 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.02.2029	110	0,01
1.225 Prime Mortgage Trust 2006 DR1X Series 2006 DR1X Class 2A1X 144 A 5,500%, fällig 25.05.2035	1.132	0,07	1.970 Glencore Funding LLC, 144 A 4,125%, fällig 12.03.2024	2.119	0,13	160 Bank of Montreal, 3,803%, fällig 15.12.2032 *	177	0,01
			430 Glencore Funding LLC, 144 A 4,000%, fällig 27.03.2027	476	0,03	290 Barrick North America Finance LLC, 5,700%, fällig 30.05.2041	401	0,02
				3.265	0,21	500 Barrick North America Finance LLC, 5,750%, fällig 01.05.2043	703	0,04
						120 MEG Energy Corp. 144 A 5,875%, fällig 01.02.2029	124	0,01
						20 Teck Resources Ltd, 6,000%, fällig 15.08.2040	26	–
						390 Yamana Gold Inc, 4,625%, fällig 15.12.2027	437	0,03
							2.100	0,13
						China – 0,34 % (28. Februar 2021: 0,19 %)		
						370 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144 A 2,700%, fällig 01.05.2025	389	0,02
						2.650 Prosus NV, 144 A 3,061%, fällig 13.07.2031	2.595	0,16
						1.660 Prosus NV, 144 A 3,832%, fällig 08.02.2051	1.506	0,10
						820 Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 144 A 4,375%, fällig 10.04.2024	895	0,06
							5.385	0,34

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			850 Intesa Sanpaolo SpA, 144 A 5,710%, fällig 15.01.2026	957	0,06	1.020 Shell International Finance BV, 3,250%, fällig 06.04.2050	1.105	0,07
Kolumbien – 0,07 % (28. Februar 2021: 0,06 %)			200 UniCredit SpA, 144 A 7,296%, fällig 02.04.2034 *	242	0,02		5.768	0,37
960 Ecopetrol SA, 5,875%, fällig 28.05.2045	1.031	0,07		3.320	0,21			
Dänemark – 0,09 % (28. Februar 2021: 0,26 %)			Japan – 0,29 % (28. Februar 2021: 0,33 %)			Peru – 0,19 % (28. Februar 2021: 0,18 %)		
1.020 Danske Bank A/S, 144 A 3,375%, fällig 12.01.2024	1.125	0,07	580 Nissan Motor Co Ltd, 144 A 3,043%, fällig 15.09.2023	604	0,04	2.290 Southern Copper Corp, 5,250%, fällig 08.11.2042	2.946	0,19
280 Danske Bank A/S, 144 A 3,244%, fällig 20.12.2025 *	298	0,02	1.810 Nissan Motor Co Ltd, 144 A 3,522%, fällig 17.09.2025	1.937	0,12	Katar – 0,20 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
	1.423	0,09	1.780 Nissan Motor Co Ltd, 144 A 4,345%, fällig 17.09.2027	1.982	0,13	1.360 Qatar Petroleum, 144 A 2,250%, fällig 12.07.2031	1.373	0,09
Frankreich – 0,66 % (28. Februar 2021: 0,76 %)			Kasachstan – 0,04 % (28. Februar 2021: 0,04 %)			870 Qatar Petroleum, 144 A 3,125%, fällig 12.07.2041	898	0,05
200 Altice France SA/France, 144 A 7,375%, fällig 01.05.2026	208	0,01	520 KazMunayGas National Co JSC, 144 A 6,375%, fällig 24.10.2048	686	0,04	880 Qatar Petroleum, 144 A 3,300%, fällig 12.07.2051	911	0,06
280 BNP Paribas SA, 144 A 3,375%, fällig 09.01.2025	300	0,02	Kuwait – 0,04 % (28. Februar 2021: 0,03 %)				3.182	0,20
1.880 BNP Paribas SA, 144 A 4,705%, fällig 10.01.2025 *	2.047	0,13	520 Equate Petrochemical BV, 144 A 4,250%, fällig 03.11.2026	579	0,04	Südafrika – 0,15 % (28. Februar 2021: 0,15 %)		
1.660 BNP Paribas SA, 144 A 2,219%, fällig 09.06.2026 *	1.709	0,11	Luxemburg – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,05 %)			670 Anglo American Capital Plc, 144 A 3,625%, fällig 11.09.2024	723	0,05
620 BNP Paribas SA, 144 A 4,625%, fällig 13.03.2027	703	0,04	150 ArcelorMittal SA, 7,000%, fällig 15.10.2039	216	0,01	1.130 Anglo American Capital Plc, 144 A 4,750%, fällig 10.04.2027	1.306	0,08
1.580 BNP Paribas SA, 144 A 4,400%, fällig 14.08.2028	1.823	0,12	Macau – 0,20 % (28. Februar 2021: 0,19 %)			290 Anglo American Capital Plc, 144 A 4,000%, fällig 11.09.2027	324	0,02
360 BNP Paribas SA, 144 A 5,198%, fällig 10.01.2030 *	435	0,03	730 Sands China Ltd, 4,600%, fällig 08.08.2023	772	0,05		2.353	0,15
550 BNP Paribas SA, 144 A 4,375%, fällig 01.03.2033 *	611	0,04	540 Sands China Ltd, 5,125%, fällig 08.08.2025	601	0,04	Spanien – 0,15 % (28. Februar 2021: 0,18 %)		
500 BPCE SA, 144 A 5,150%, fällig 21.07.2024	556	0,04	580 Sands China Ltd, 5,400%, fällig 08.08.2028	668	0,04	1.200 Banco Santander SA, 2,746%, fällig 28.05.2025	1.265	0,08
590 Credit Agricole SA, 144 A 4,000%, fällig 10.01.2033 *	643	0,04	1.090 Wynn Macau Ltd, 144 A 5,625%, fällig 26.08.2028	1.105	0,07	500 Telefonica Emisiones SA, 4,103%, fällig 08.03.2027	565	0,03
240 Danone SA, 144 A 2,947%, fällig 02.11.2026	258	0,02		3.146	0,20	210 Telefonica Emisiones SA, 5,213%, fällig 08.03.2047	264	0,02
940 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144 A 3,750%, fällig 17.09.2024	1.004	0,06	Mexiko – 0,13 % (28. Februar 2021: 0,13 %)			260 Telefonica Emisiones SA, 4,895%, fällig 06.03.2048	318	0,02
	10.297	0,66	700 America Movil SAB de CV, 3,125%, fällig 16.07.2022	716	0,04		2.412	0,15
Irland – 0,07 % (28. Februar 2021: 0,08 %)			20 America Movil SAB de CV, 6,375%, fällig 01.03.2035	29	–	Schweiz – 0,47 % (28. Februar 2021: 0,59 %)		
850 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,150%, fällig 15.02.2024	889	0,06	20 America Movil SAB de CV, 6,125%, fällig 15.11.2037	28	–	710 Credit Suisse AG/New York NY, 2,950%, fällig 09.04.2025	758	0,05
43 Park Aerospace Holdings Ltd, 144 A 5,250%, fällig 15.08.2022	45	–	590 Petroleos Mexicanos, 4,250%, fällig 15.01.2025	601	0,04	700 Credit Suisse Group AG, 144 A 2,593%, fällig 11.09.2025 *	729	0,04
50 Park Aerospace Holdings Ltd, 144 A 4,500%, fällig 15.03.2023	52	–	260 Petroleos Mexicanos, 6,875%, fällig 04.08.2026	284	0,02	610 Credit Suisse Group AG, 144 A 2,193%, fällig 05.06.2026 *	626	0,04
120 Park Aerospace Holdings Ltd, 144 A 5,500%, fällig 15.02.2024	132	0,01	25 Petroleos Mexicanos, 6,625%, fällig 15.06.2035	24	–	670 Credit Suisse Group AG, 144 A 4,194%, fällig 01.04.2031 *	760	0,05
	1.118	0,07	510 Petroleos Mexicanos, 5,500%, fällig 27.06.2044	413	0,03	720 Credit Suisse Group AG, 144 A 3,091%, fällig 14.05.2032 *	751	0,05
Israel – 0,34 % (28. Februar 2021: 0,36 %)				2.095	0,13	210 Glencore Finance Canada Ltd, 144 A 6,000%, fällig 15.11.2041	282	0,02
480 Teva Pharmaceutical Finance Co BV, Series 2X 3,650%, fällig 10.11.2021	483	0,03	Marokko – 0,15 % (28. Februar 2021: 0,08 %)			200 UBS AG/London, 144 A 4,500%, fällig 26.06.2048	268	0,02
1.240 Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950%, fällig 18.12.2022	1.251	0,08	1.230 OCP SA, 144 A 4,500%, fällig 22.10.2025	1.335	0,09	820 UBS Group AG, 144 A 4,253%, fällig 23.03.2028	932	0,06
180 Teva Pharmaceutical Finance IV BV, 3,650%, fällig 10.11.2021	180	0,01	540 OCP SA, 144 A 3,750%, fällig 23.06.2031	548	0,03	2.090 UBS Group AG, 144 A 7,000%, Perpetual *	2.293	0,14
1.200 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800%, fällig 21.07.2023	1.185	0,08	480 OCP SA, 144 A 5,125%, fällig 23.06.2051	486	0,03		7.399	0,47
210 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,000%, fällig 15.04.2024	220	0,01		2.369	0,15	Vereinigte Arabische Emirate – 0,08 % (28. Februar 2021: 0,08 %)		
590 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125%, fällig 31.01.2025	645	0,04	Niederlande – 0,37 % (28. Februar 2021: 0,61 %)			200 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144 A 5,625%, fällig 25.09.2048	252	0,02
1.400 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, fällig 01.10.2026	1.339	0,09	200 ABN AMRO Bank NV, 144 A 4,750%, fällig 28.07.2025	224	0,02	760 DP World Ltd/United Arab Emirates, 5,625%, fällig 25.09.2048	958	0,06
	5.303	0,34	1.840 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375%, fällig 04.08.2025	2.058	0,13		1.210	0,08
Italien – 0,21 % (28. Februar 2021: 0,37 %)			250 Cooperatieve Rabobank UA, 144 A 1,339%, fällig 24.06.2026 *	252	0,02	Großbritannien – 1,07 % (28. Februar 2021: 1,18 %)		
830 Intesa Sanpaolo SpA, 144 A 3,375%, fällig 12.01.2023	861	0,05	600 Shell International Finance BV, 2,750%, fällig 06.04.2030	642	0,04	410 Barclays Plc, 4,972%, fällig 16.05.2029 *	482	0,03
1.160 Intesa Sanpaolo SpA, 144 A 5,017%, fällig 26.06.2024	1.260	0,08	160 Shell International Finance BV, 4,550%, fällig 12.08.2043	203	0,01	3.540 Barclays Plc, 5,088%, fällig 20.06.2030 *	4.137	0,26
			770 Shell International Finance BV, 4,375%, fällig 11.05.2045	961	0,06	160 BAT Capital Corp, 3,557%, fällig 15.08.2027	173	0,01
			270 Shell International Finance BV, 4,000%, fällig 10.05.2046	323	0,02	2.230 BAT Capital Corp, 4,540%, fällig 15.08.2047	2.394	0,15
						430 HSBC Holdings Plc, 4,250%, fällig 18.08.2025	476	0,03
						330 HSBC Holdings Plc, 4,300%, fällig 08.03.2026	372	0,02

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			1.920 Altria Group Inc, 5,950%, fällig 14.02.2049	2.498	0,16	10 AT&T Inc, 144 A 3,800%, fällig 01.12.2057	11	–
Großbritannien — (Fortsetzung)			76 Altria Group Inc, 6,200%, fällig 14.02.2059	99	0,01	235 AT&T Inc, 144 A 3,650%, fällig 15.09.2059	242	0,02
400 HSBC Holdings Plc, 4,041%, fällig 13.03.2028 *	446	0,03	790 Amazon.com Inc, 0,800%, fällig 03.06.2025	792	0,05	280 Bank of America Corp, 3,300%, fällig 11.01.2023	292	0,02
1.480 HSBC Holdings Plc, 4,583%, fällig 19.06.2029 *	1.711	0,11	970 Amazon.com Inc, 1,200%, fällig 03.06.2027	975	0,06	264 Bank of America Corp, 3,004%, fällig 20.12.2023 *	273	0,02
200 HSBC Holdings Plc, 4,950%, fällig 31.03.2030	242	0,02	660 Amazon.com Inc, 3,150%, fällig 22.08.2027	731	0,05	680 Bank of America Corp, 3,550%, fällig 05.03.2024 *	710	0,05
340 HSBC Holdings Plc, 6,500%, fällig 02.05.2036	474	0,03	510 Amazon.com Inc, 1,500%, fällig 03.06.2030	502	0,03	330 Bank of America Corp, 4,000%, fällig 01.04.2024	359	0,02
1.500 Lloyds Banking Group Plc, 4,650%, fällig 24.03.2026	1.702	0,11	260 Amazon.com Inc, 2,100%, fällig 12.05.2031	267	0,02	520 Bank of America Corp, 4,200%, fällig 26.08.2024	570	0,04
780 Lloyds Banking Group Plc, 4,375%, fällig 22.03.2028	898	0,06	860 Amazon.com Inc, 3,875%, fällig 22.08.2037	1.027	0,07	470 Bank of America Corp, 4,000%, fällig 22.01.2025	514	0,03
630 Natwest Group Plc, 4,269%, fällig 22.03.2025 *	683	0,04	340 Amazon.com Inc, 4,950%, fällig 05.12.2044	468	0,03	130 Bank of America Corp, 4,450%, fällig 03.03.2026	147	0,01
230 Natwest Group Plc, 4,892%, fällig 18.05.2029 *	271	0,02	320 Amazon.com Inc, 4,050%, fällig 22.08.2047	396	0,03	830 Bank of America Corp, 3,500%, fällig 19.04.2026	914	0,06
1.000 Natwest Group Plc, 5,076%, fällig 27.01.2030 *	1.200	0,08	790 Amazon.com Inc, 2,500%, fällig 03.06.2050	760	0,05	1.510 Bank of America Corp, 1,319%, fällig 19.06.2026 *	1.515	0,10
290 Reynolds American Inc, 5,850%, fällig 15.08.2045	359	0,02	140 Amazon.com Inc, 4,250%, fällig 22.08.2057	183	0,01	1.550 Bank of America Corp, 4,250%, fällig 22.10.2026	1.761	0,11
420 Standard Chartered Plc, 144 A 5,700%, fällig 26.03.2044	555	0,04	5 Ambac Assurance Corp, 144 A 5,100%, Perpetual	7	–	940 Bank of America Corp, 3,593%, fällig 21.07.2028 *	1.040	0,07
110 Vodafone Group Plc, 5,250%, fällig 30.05.2048	147	0,01	370 American International Group Inc, 2,500%, fällig 30.06.2025	389	0,02	1.770 Bank of America Corp, 3,419%, fällig 20.12.2028 *	1.946	0,12
	16.722	1,07	70 American International Group Inc, 3,750%, fällig 10.07.2025	77	–	4.250 Bank of America Corp, 3,970%, fällig 05.03.2029 *	4.799	0,31
Vereinigte Staaten – 26,56 % (28. Februar 2021: 26,59 %)			234 American International Group Inc, 6,250%, fällig 15.03.2037 *	278	0,02	1.800 Bank of America Corp, 3,974%, fällig 07.02.2030 *	2.046	0,13
470 3 M Co, 2,375%, fällig 26.08.2029	495	0,03	330 Amgen Inc, 3,625%, fällig 22.05.2024	354	0,02	1.500 Bank of America Corp, 2,884%, fällig 22.10.2030 *	1.590	0,10
130 3 M Co, 3,050%, fällig 15.04.2030	143	0,01	34 Amgen Inc, 4,663%, fällig 15.06.2051	44	–	560 Bank of America Corp, 4,330%, fällig 15.03.2050 *	701	0,04
920 3 M Co, 3,700%, fällig 15.04.2050	1.098	0,07	180 Anthem Inc, 3,125%, fällig 15.05.2022	184	0,01	2.260 Bank of America Corp, 4,083%, fällig 20.03.2051 *	2.734	0,17
872 Abbott Laboratories, 3,750%, fällig 30.11.2026	987	0,06	530 Anthem Inc, 2,950%, fällig 01.12.2022	546	0,03	380 Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600%, fällig 24.04.2025	391	0,03
230 Abbott Laboratories, 4,750%, fällig 30.11.2036	298	0,02	200 Anthem Inc, 3,350%, fällig 01.12.2024	216	0,01	30 Bausch Health Cos Inc, 144 A 5,500%, fällig 01.11.2025	31	–
420 Abbott Laboratories, 4,900%, fällig 30.11.2046	585	0,04	730 Anthem Inc, 3,650%, fällig 01.12.2027	818	0,05	250 BBVA USA, 3,875%, fällig 10.04.2025	276	0,02
190 AbbVie Inc, 3,450%, fällig 15.03.2022	192	0,01	75 Apache Corp, 3,250%, fällig 15.04.2022	76	–	435 Becton Dickinson and Co, 3,363%, fällig 06.06.2024	465	0,03
120 AbbVie Inc, 2,900%, fällig 06.11.2022	124	0,01	200 Apache Corp, 4,375%, fällig 15.10.2028	216	0,01	26 Becton Dickinson and Co, 3,734%, fällig 15.12.2024	28	–
2.460 AbbVie Inc, 2,300%, fällig 21.11.2022	2.517	0,16	130 Apache Corp, 4,250%, fällig 15.01.2030	140	0,01	555 Becton Dickinson and Co, 4,685%, fällig 15.12.2044	707	0,05
140 AbbVie Inc, 3,750%, fällig 14.11.2023	149	0,01	17 Apache Corp, 6,000%, fällig 15.01.2037	20	–	600 Becton Dickinson and Co, 4,669%, fällig 06.06.2047	763	0,05
2.150 AbbVie Inc, 2,600%, fällig 21.11.2024	2.266	0,14	1.160 Apache Corp, 5,100%, fällig 01.09.2040	1.292	0,08	1.330 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250%, fällig 15.01.2049	1.675	0,11
590 AbbVie Inc, 3,800%, fällig 15.03.2025	644	0,04	60 Apache Corp, 5,250%, fällig 01.02.2042	66	–	2.010 Boeing Co/The, 4,875%, fällig 01.05.2025	2.248	0,14
250 AbbVie Inc, 3,600%, fällig 14.05.2025	272	0,02	510 Apache Corp, 4,750%, fällig 15.04.2043	548	0,04	680 Boeing Co/The, 2,196%, fällig 04.02.2026	683	0,04
520 AbbVie Inc, 2,950%, fällig 21.11.2026	561	0,04	180 Apache Corp, 4,250%, fällig 15.01.2044	183	0,01	150 Boeing Co/The, 3,100%, fällig 01.05.2026	159	0,01
1.530 AbbVie Inc, 3,200%, fällig 21.11.2029	1.673	0,11	1.190 Apple Inc, 1,125%, fällig 11.05.2025	1.204	0,08	320 Boeing Co/The, 2,700%, fällig 01.02.2027	332	0,02
7 AbbVie Inc, 4,750%, fällig 15.03.2045	9	–	720 Apple Inc, 2,450%, fällig 04.08.2026	768	0,05	200 Boeing Co/The, 2,800%, fällig 01.03.2027	209	0,01
110 AbbVie Inc, 4,250%, fällig 21.11.2049	134	0,01	400 AT&T Inc, 3,800%, fällig 15.02.2027	447	0,03	690 Boeing Co/The, 3,200%, fällig 01.03.2029	727	0,05
90 Aetna Inc, 2,800%, fällig 15.06.2023	93	0,01	1.300 AT&T Inc, 2,300%, fällig 01.06.2027	1.357	0,09	1.780 Boeing Co/The, 5,150%, fällig 01.05.2030	2.108	0,13
450 Air Lease Corp, 3,375%, fällig 01.07.2025	482	0,03	510 AT&T Inc, 1,650%, fällig 01.02.2028	510	0,03	2.220 Boeing Co/The, 3,250%, fällig 01.02.2035	2.273	0,14
160 Alphabet Inc, 0,450%, fällig 15.08.2025	159	0,01	60 AT&T Inc, 2,250%, fällig 01.02.2032	60	–	180 Boeing Co/The, 3,550%, fällig 01.03.2038	186	0,01
310 Alphabet Inc, 0,800%, fällig 15.08.2027	303	0,02	180 AT&T Inc, 144 A 2,550%, fällig 01.12.2033	181	0,01	810 Boeing Co/The, 5,705%, fällig 01.05.2040	1.050	0,07
370 Alphabet Inc, 1,100%, fällig 15.08.2030	352	0,02	640 AT&T Inc, 3,100%, fällig 01.02.2043	635	0,04	1.290 Boeing Co/The, 3,750%, fällig 01.02.2050	1.339	0,09
600 Alphabet Inc, 2,050%, fällig 15.08.2050	545	0,03	161 AT&T Inc, 4,350%, fällig 15.06.2045	187	0,01	1.870 Boeing Co/The, 5,805%, fällig 01.05.2050	2.544	0,16
170 Altria Group Inc, 2,350%, fällig 06.05.2025	177	0,01	1.218 AT&T Inc, 4,500%, fällig 09.03.2048	1.445	0,09	20 Boeing Co/The, 5,930%, fällig 01.05.2060	28	–
846 Altria Group Inc, 4,400%, fällig 14.02.2026	958	0,06	29 AT&T Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.09.2053	30	–	690 BP Capital Markets America Inc, 3,216%, fällig 28.11.2023	729	0,05
177 Altria Group Inc, 4,800%, fällig 14.02.2029	206	0,01	559 AT&T Inc, 144 A 3,550%, fällig 15.09.2055	573	0,04			
160 Altria Group Inc, 5,800%, fällig 14.02.2039	201	0,01						
330 Altria Group Inc, 3,875%, fällig 16.09.2046	334	0,02						

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			210 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800%, fällig 01.03.2050			20 Coca-Cola Co/The, 2,500%, fällig 01.06.2040		
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)			400 Cheniere Energy Inc, 4,625%, fällig 15.10.2028			280 Coca-Cola Co/The, 2,600%, fällig 01.06.2050		
330 BP Capital Markets America Inc, 3,410%, fällig 11.02.2026	361	0,02	90 Cheniere Energy Partners LP, 144 A 4,000%, fällig 01.03.2031	246	0,02	40 Comcast Corp, 3,100%, fällig 01.04.2025	278	0,02
1.150 BP Capital Markets America Inc, 3,119%, fällig 04.05.2026	1.250	0,08	700 Chevron Corp, 1,554%, fällig 11.05.2025	422	0,03	130 Comcast Corp, 3,950%, fällig 15.10.2025	145	0,01
440 BP Capital Markets America Inc, 3,633%, fällig 06.04.2030	497	0,03	340 Chevron Corp, 2,954%, fällig 16.05.2026	95	0,01	640 Comcast Corp, 3,150%, fällig 01.03.2026	695	0,04
1.400 BP Capital Markets America Inc, 3,000%, fällig 24.02.2050	1.386	0,09	240 Chevron Corp, 1,995%, fällig 11.05.2027	718	0,05	280 Comcast Corp, 3,300%, fällig 01.04.2027	308	0,02
55 Brighthouse Financial Inc, 4,700%, fällig 22.06.2047	62	–	80 Chevron Corp, 3,078%, fällig 11.05.2050	249	0,02	2.140 Comcast Corp, 4,150%, fällig 15.10.2028	2.485	0,16
240 Bristol-Myers Squibb Co, 2,600%, fällig 16.05.2022	244	0,02	950 Chevron USA Inc, 3,850%, fällig 15.01.2028	85	0,01	390 Comcast Corp, 3,400%, fällig 01.04.2030	434	0,03
120 Bristol-Myers Squibb Co, 3,550%, fällig 15.08.2022	124	0,01	330 Chevron USA Inc, 5,250%, fällig 15.11.2043	1.080	0,07	1.420 Comcast Corp, 4,250%, fällig 15.10.2030	1.677	0,11
881 Bristol-Myers Squibb Co, 2,900%, fällig 26.07.2024	939	0,06	180 Chevron USA Inc, 4,950%, fällig 15.08.2047	455	0,03	60 Comcast Corp, 4,250%, fällig 15.01.2033	72	–
194 Bristol-Myers Squibb Co, 3,875%, fällig 15.08.2025	215	0,01	140 Chubb INA Holdings Inc, 3,350%, fällig 03.05.2026	248	0,02	60 Comcast Corp, 5,650%, fällig 15.06.2035	82	0,01
810 Bristol-Myers Squibb Co, 3,200%, fällig 15.06.2026	890	0,06	232 Cigna Corp, 3,750%, fällig 15.07.2023	154	0,01	13 Comcast Corp, 6,500%, fällig 15.11.2035	19	–
2.280 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400%, fällig 26.07.2029	2.567	0,16	290 Cigna Corp, 4,125%, fällig 15.11.2025	246	0,02	1.540 Comcast Corp, 3,900%, fällig 01.03.2038	1.796	0,11
531 Bristol-Myers Squibb Co, 5,000%, fällig 15.08.2045	733	0,05	2.980 Cigna Corp, 4,375%, fällig 15.10.2028	324	0,02	80 Comcast Corp, 3,250%, fällig 01.11.2039	87	0,01
1.270 Broadcom Inc, 4,700%, fällig 15.04.2025	1.421	0,09	210 Cimarex Energy Co, 4,375%, fällig 01.06.2024	3480	0,22	80 Comcast Corp, 3,750%, fällig 01.04.2040	92	0,01
850 Broadcom Inc, 3,150%, fällig 15.11.2025	911	0,06	1.790 Cimarex Energy Co, 3,900%, fällig 15.05.2027	227	0,01	80 Comcast Corp, 3,400%, fällig 15.07.2046	87	0,01
160 Cameron LNG LLC, 144 A 2,902%, fällig 15.07.2031	172	0,01	560 Cimarex Energy Co, 4,375%, fällig 15.03.2029	1.978	0,13	14 Comcast Corp, 3,969%, fällig 01.11.2047	16	–
850 Cameron LNG LLC, 144 A 3,302%, fällig 15.01.2035	923	0,06	270 Cintas Corp No 2X 2,900%, fällig 01.04.2022	637	0,04	110 Comcast Corp, 4,000%, fällig 01.03.2048	130	0,01
30 Carrier Global Corp, 2,700%, fällig 15.02.2031	31	–	270 Cintas Corp No 2X 3,700%, fällig 01.04.2027	274	0,02	203 Comcast Corp, 3,999%, fällig 01.11.2049	242	0,02
50 Carrier Global Corp, 3,577%, fällig 05.04.2050	54	–	10 Citigroup Inc, 4,500%, fällig 14.01.2022	303	0,02	270 Comcast Corp, 3,450%, fällig 01.02.2050	297	0,02
70 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 4,500%, fällig 15.08.2030	73	–	50 Citigroup Inc, 4,050%, fällig 30.07.2022	10	–	240 Comcast Corp, 2,800%, fällig 15.01.2051	233	0,01
1.840 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500%, fällig 01.05.2032	1.925	0,12	250 Citigroup Inc, 3,500%, fällig 15.05.2023	52	–	59 Comcast Corp, 144 A 2,887%, fällig 01.11.2051	59	–
300 Centene Corp, 4,625%, fällig 15.12.2029	329	0,02	680 Citigroup Inc, 1,678%, fällig 15.05.2024 *	263	0,02	66 Comcast Corp, 4,049%, fällig 01.11.2052	80	0,01
290 Centene Corp, 3,375%, fällig 15.02.2030	303	0,02	330 Citigroup Inc, 3,300%, fällig 27.04.2025	694	0,04	477 Comcast Corp, 144 A 2,937%, fällig 01.11.2056	473	0,03
2.210 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908%, fällig 23.07.2025	2.502	0,16	440 Citigroup Inc, 4,400%, fällig 10.06.2025	358	0,02	74 Comcast Corp, 144 A 2,987%, fällig 01.11.2063	73	–
1.550 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200%, fällig 15.03.2028	1.756	0,11	220 Citigroup Inc, 5,500%, fällig 13.09.2025	490	0,03	20 CommonSpirit Health, 4,350%, fällig 01.11.2042	24	–
1.200 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050%, fällig 30.03.2029	1.422	0,09	490 Citigroup Inc, 3,106%, fällig 08.04.2026 *	256	0,02	350 ConocoPhillips, 144 A 3,750%, fällig 01.10.2027	394	0,03
740 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, fällig 01.04.2038	916	0,06	110 Citigroup Inc, 4,300%, fällig 20.11.2026	524	0,03	720 ConocoPhillips, 144 A 4,300%, fällig 15.08.2028	835	0,05
260 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484%, fällig 23.10.2045	363	0,02	2.130 Citigroup Inc, 4,450%, fällig 29.09.2027	125	0,01	85 ConocoPhillips Co, 6,950%, fällig 15.04.2029	115	0,01
1.000 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750%, fällig 01.04.2048	1.289	0,08	60 Citigroup Inc, 4,125%, fällig 25.07.2028	2.441	0,16	240 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20 A, 3,350%, fällig 01.04.2030	266	0,02
			1.360 Citigroup Inc, 3,520%, fällig 27.10.2028 *	68	–	190 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20 B, 3,950%, fällig 01.04.2050	221	0,01
			1.750 Citigroup Inc, 4,075%, fällig 23.04.2029 *	1.496	0,10	640 Constellation Brands Inc, 4,750%, fällig 15.11.2024	717	0,05
			2.300 Citigroup Inc, 3,980%, fällig 20.03.2030 *	1.986	0,13	111 Continental Airlines 2007-1 Class A Pass Through Trust, Series 071 A, 5,983%, fällig 19.04.2022	113	0,01
			1.590 Citigroup Inc, 4,412%, fällig 31.03.2031 *	2.614	0,17	210 Continental Resources Inc/OK, 4,500%, fällig 15.04.2023	219	0,01
			1.120 Citigroup Inc, 2,572%, fällig 03.06.2031 *	1.865	0,12	130 Continental Resources Inc/OK, 3,800%, fällig 01.06.2024	139	0,01
			1.456 Citigroup Inc, 8,125%, fällig 15.07.2039	1.157	0,07	1.160 Continental Resources Inc/OK, 4,375%, fällig 15.01.2028	1.304	0,08
			255 Citigroup Inc, 5,300%, fällig 06.05.2044	347	0,02	100 Continental Resources Inc/OK, 4,900%, fällig 01.06.2044	113	0,01
			390 Citigroup Inc, Series P, 5,950%, Perpetual *	429	0,03	1.020 Costco Wholesale Corp, 1,375%, fällig 20.06.2027	1.032	0,07
			90 Citigroup Inc, Series M, 6,300%, Perpetual *	97	0,01	340 Costco Wholesale Corp, 1,600%, fällig 20.04.2030	338	0,02
			100 Citigroup Inc, 5,950%, Perpetual *	105	0,01	300 CSC Holdings LLC, 144 A 4,125%, fällig 01.12.2030	301	0,02
			720 Coca-Cola Co/The, 3,375%, fällig 25.03.2027	804	0,05			
			670 Coca-Cola Co/The, 1,450%, fällig 01.06.2027	684	0,04			

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			10 Energy Transfer LP, 7,600%, fällig 01.02.2024	11	–	890 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000%, fällig 13.11.2030	940	0,06
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			800 Energy Transfer LP, 4,500%, fällig 15.04.2024	869	0,06	500 Ford Motor Credit Co LLC, 3,625%, fällig 17.06.2031	516	0,03
220 CVS Health Corp, 2,750%, fällig 01.12.2022	225	0,01	210 Energy Transfer LP, 4,950%, fällig 15.06.2028	243	0,02	340 Fox Corp, 4,030%, fällig 25.01.2024	367	0,02
142 CVS Health Corp, 3,700%, fällig 09.03.2023	149	0,01	530 Energy Transfer LP, 5,250%, fällig 15.04.2029	625	0,04	2.040 Fox Corp, 5,476%, fällig 25.01.2039	2.651	0,17
761 CVS Health Corp, 3,875%, fällig 20.07.2025	839	0,05	1.530 Energy Transfer LP, 3,750%, fällig 15.05.2030	1.663	0,11	10 Freeport-McMoRan Inc, 3,875%, fällig 15.03.2023	10	–
220 CVS Health Corp, 3,625%, fällig 01.04.2027	244	0,02	60 Energy Transfer LP, 5,300%, fällig 01.04.2044	70	–	30 Freeport-McMoRan Inc, 4,550%, fällig 14.11.2024	32	–
268 CVS Health Corp, 4,300%, fällig 25.03.2028	309	0,02	30 Energy Transfer LP, 5,400%, fällig 01.10.2047	36	–	260 Freeport-McMoRan Inc, 4,625%, fällig 01.08.2030	287	0,02
530 CVS Health Corp, 3,750%, fällig 01.04.2030	598	0,04	750 Energy Transfer LP, 6,250%, fällig 15.04.2049	995	0,06	970 Freeport-McMoRan Inc, 5,450%, fällig 15.03.2043	1.242	0,08
500 CVS Health Corp, 2,125%, fällig 15.09.2031	499	0,03	470 Energy Transfer LP, Series F, 6,750%, Perpetual *	476	0,03	1.380 GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418%, fällig 15.11.2035	1.677	0,11
400 CVS Health Corp, 4,780%, fällig 25.03.2038	498	0,03	80 Energy Transfer LP / Regency Energy Finance Corp, 5,875%, fällig 01.03.2022	81	0,01	230 General Dynamics Corp, 3,250%, fällig 01.04.2025	248	0,02
220 CVS Health Corp, 4,125%, fällig 01.04.2040	256	0,02	1.080 Enterprise Products Operating LLC, 4,150%, fällig 16.10.2028	1.242	0,08	90 General Dynamics Corp, 3,500%, fällig 15.05.2025	98	0,01
440 CVS Health Corp, 5,125%, fällig 20.07.2045	582	0,04	670 Enterprise Products Operating LLC, 2,800%, fällig 31.01.2030	712	0,05	40 General Dynamics Corp, 4,250%, fällig 01.04.2040	50	–
3.700 CVS Health Corp, 5,050%, fällig 25.03.2048	4.906	0,31	2.150 Enterprise Products Operating LLC, 4,200%, fällig 31.01.2050	2.490	0,16	330 General Dynamics Corp, 4,250%, fällig 01.04.2050	429	0,03
70 CVS Health Corp, 4,250%, fällig 01.04.2050	85	0,01	420 Enterprise Products Operating LLC, 3,700%, fällig 31.01.2051	456	0,03	140 General Electric Co, 3,450%, fällig 01.05.2027	155	0,01
17 CVS Pass-Through Trust, 144 A 5,298%, fällig 11.01.2027	19	–	90 Enterprise Products Operating LLC, 3,950%, fällig 31.01.2060	100	0,01	280 General Electric Co, 3,625%, fällig 01.05.2030	315	0,02
19 CVS Pass-Through Trust, 6,036%, fällig 10.12.2028	23	–	240 EOG Resources Inc, 4,150%, fällig 15.01.2026	269	0,02	230 General Electric Co, 6,750%, fällig 15.03.2032	320	0,02
34 CVS Pass-Through Trust, 6,943%, fällig 10.01.2030	41	–	190 EOG Resources Inc, 4,375%, fällig 15.04.2030	225	0,01	282 General Electric Co, 6,875%, fällig 10.01.2039	427	0,03
150 DCP Midstream Operating LP, 144 A 6,450%, fällig 03.11.2036	182	0,01	690 EOG Resources Inc, 3,900%, fällig 01.04.2035	797	0,05	240 General Motors Co, 5,400%, fällig 02.10.2023	262	0,02
140 Deere & Co, 3,100%, fällig 15.04.2030	155	0,01	180 EOG Resources Inc, 4,950%, fällig 15.04.2050	243	0,02	440 General Motors Co, 6,125%, fällig 01.10.2025	519	0,03
740 Deere & Co, 3,750%, fällig 15.04.2050	909	0,06	500 EQT Corp, 3,000%, fällig 01.10.2022	511	0,03	50 General Motors Co, 5,150%, fällig 01.04.2038	60	–
710 Delta Air Lines Inc, 3,625%, fällig 15.03.2022	718	0,05	50 EQT Corp, 6,625%, fällig 01.02.2025	57	–	230 General Motors Co, 6,250%, fällig 02.10.2043	315	0,02
190 Delta Air Lines Inc, 3,800%, fällig 19.04.2023	197	0,01	250 EQT Corp, 3,900%, fällig 01.10.2027	270	0,02	330 General Motors Co, 5,950%, fällig 01.04.2049	450	0,03
410 Delta Air Lines Inc, 2,900%, fällig 28.10.2024	418	0,03	20 EQT Corp, 5,000%, fällig 15.01.2029	23	–	360 General Motors Financial Co Inc, 4,375%, fällig 25.09.2021	361	0,02
3.560 Delta Air Lines Inc, 144 A 7,000%, fällig 01.05.2025	4.166	0,27	110 EQT Corp, 144 A 3,625%, fällig 15.05.2031	116	0,01	40 General Motors Financial Co Inc, 3,450%, fällig 10.04.2022	41	–
810 Delta Air Lines Inc, 7,375%, fällig 15.01.2026	954	0,06	60 Exxon Mobil Corp, 1,571%, fällig 15.04.2023	61	–	10 General Motors Financial Co Inc, 4,250%, fällig 15.05.2023	11	–
330 Devon Energy Corp, 144 A 8,250%, fällig 01.08.2023	372	0,02	1.700 Exxon Mobil Corp, 2,992%, fällig 19.03.2025	1.819	0,12	50 General Motors Financial Co Inc, 4,350%, fällig 17.01.2027	56	–
530 Devon Energy Corp, 5,850%, fällig 15.12.2025	617	0,04	180 Exxon Mobil Corp, 3,043%, fällig 01.03.2026	195	0,01	200 Gilead Sciences Inc, 3,500%, fällig 01.02.2025	217	0,01
260 Devon Energy Corp, 144 A 4,500%, fällig 15.01.2030	284	0,02	650 Exxon Mobil Corp, 3,482%, fällig 19.03.2030	732	0,05	250 Gilead Sciences Inc, 4,750%, fällig 01.03.2046	322	0,02
40 Devon Energy Corp, 5,600%, fällig 15.07.2041	50	–	1.130 Exxon Mobil Corp, 4,114%, fällig 01.03.2046	1.354	0,09	10 GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,250%, fällig 01.06.2025	11	–
240 Devon Energy Corp, 4,750%, fällig 15.05.2042	276	0,02	80 Exxon Mobil Corp, 4,327%, fällig 19.03.2050	100	0,01	80 GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,375%, fällig 15.04.2026	92	0,01
1.950 Devon Energy Corp, 5,000%, fällig 15.06.2045	2.311	0,15	110 FirstEnergy Corp, Series B, 4,750%, fällig 15.03.2023	115	0,01	3 Goldman Sachs Capital II, 4,000%, Perpetual *	3	–
50 Diamondback Energy Inc, 3,250%, fällig 01.12.2026	54	–	270 FirstEnergy Corp, Series A, 1,600%, fällig 15.01.2026	268	0,02	440 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,876%, fällig 30.10.2022 *	442	0,03
340 Diamondback Energy Inc, 3,500%, fällig 01.12.2029	367	0,02	3.460 FirstEnergy Corp, Series B, 4,400%, fällig 15.07.2027	3.887	0,25	440 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,200%, fällig 23.02.2023	457	0,03
450 DISH DBS Corp, 5,875%, fällig 15.11.2024	484	0,03	1.948 FirstEnergy Corp, Series C, 7,375%, fällig 15.11.2031	2.725	0,17	800 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,850%, fällig 08.07.2024	865	0,06
410 DISH DBS Corp, 7,750%, fällig 01.07.2026	470	0,03	1.000 FirstEnergy Corp, Series C, 5,350%, fällig 15.07.2047	1.254	0,08	760 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500%, fällig 01.04.2025	823	0,05
170 DISH DBS Corp, 144 A 5,125%, fällig 01.06.2029	169	0,01	150 Ford Motor Co, 4,750%, fällig 15.01.2043	162	0,01	720 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250%, fällig 20.10.2025	804	0,05
60 Dollar General Corp, 3,250%, fällig 15.04.2023	62	–	200 Ford Motor Credit Co LLC, 3,339%, fällig 28.03.2022	202	0,01	1.970 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500%, fällig 16.11.2026	2.146	0,14
130 Duke Energy Carolinas LLC, 5,300%, fällig 15.02.2040	178	0,01	200 Ford Motor Credit Co LLC, 5,125%, fällig 16.06.2025	220	0,01			
640 Duke Energy Ohio Inc, 3,650%, fällig 01.02.2029	718	0,05	600 Ford Motor Credit Co LLC, 4,125%, fällig 17.08.2027	643	0,04			
660 Eaton Corp, 2,750%, fällig 02.11.2022	679	0,04	260 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900%, fällig 16.02.2028	259	0,02			
420 Eaton Corp, 4,150%, fällig 02.11.2042	508	0,03						
36 El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375%, fällig 15.06.2032	53	–						

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			20 Humana Inc, 4,800%, fällig 15.03.2047	26	–	370 Kraft Heinz Foods Co, 4,875%, fällig 01.10.2049	461	0,03
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)			50 ILCF E-Capital Trust II, 144 A 3,910%, fällig 21.12.2065 *	42	–	300 Kraft Heinz Foods Co, 5,500%, fällig 01.06.2050	401	0,03
4.750 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814%, fällig 23.04.2029 *	5.325	0,34	80 Intel Corp, 3,700%, fällig 29.07.2025	88	0,01	770 L3 Harris Technologies Inc, 4,854%, fällig 27.04.2035	978	0,06
2.650 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223%, fällig 01.05.2029 *	3.036	0,19	410 Intel Corp, 1,600%, fällig 12.08.2028	413	0,03	230 L3 Harris Technologies Inc, 5,054%, fällig 27.04.2045	308	0,02
670 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250%, fällig 01.02.2041	996	0,06	130 Intel Corp, 3,734%, fällig 08.12.2047	149	0,01	270 Lamb Weston Holdings Inc, 144 A 4,875%, fällig 01.11.2026	278	0,02
80 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,210%, fällig 22.04.2042 * 85	0,01		520 Intel Corp, 4,750%, fällig 25.03.2050	697	0,04	1.250 Las Vegas Sands Corp, 3,200%, fällig 08.08.2024	1.299	0,08
560 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150%, fällig 22.05.2045	753	0,05	200 Intel Corp, 3,050%, fällig 12.08.2051	206	0,01	1.320 Las Vegas Sands Corp, 2,900%, fällig 25.06.2025	1.364	0,09
970 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750%, fällig 20.10.2045	1.282	0,08	1.940 International Business Machines Corp, 3,000%, fällig 15.05.2024	2.065	0,13	160 Lehman Brothers Escrow, Series DMTN, Zero coupon, Perpetual τ_{∞}	–	–
29 Halliburton Co, 3,800%, fällig 15.11.2025	32	–	150 International Lease Finance Corp, 5,875%, fällig 15.08.2022	158	0,01	207 Lehman Escrow Receipt, Zero coupon, Perpetual τ_{∞}	2	–
60 Halliburton Co, 4,850%, fällig 15.11.2035	71	–	930 Johnson & Johnson, 0,950%, fällig 01.09.2027	922	0,06	79 Lehman Swap Receipt, Zero coupon, Perpetual τ_{∞}	–	–
320 Halliburton Co, 5,000%, fällig 15.11.2045	385	0,02	1.040 Johnson & Johnson, 3,625%, fällig 03.03.2037	1.226	0,08	120 Lennar Corp, 4,500%, fällig 30.04.2024	131	0,01
50 Hanesbrands Inc, 144 A 4,625%, fällig 15.05.2024	53	–	1.420 JPMorgan Chase & Co, 1,514%, fällig 01.06.2024 *	1.446	0,09	50 Lennar Corp, 4,750%, fällig 30.05.2025	56	–
400 Hanesbrands Inc, 144 A 5,375%, fällig 15.05.2025	421	0,03	250 JPMorgan Chase & Co, 3,875%, fällig 10.09.2024	272	0,02	460 Lennar Corp, 4,750%, fällig 29.11.2027	536	0,03
200 Hanesbrands Inc, 144 A 4,875%, fällig 15.05.2026	218	0,01	1.400 JPMorgan Chase & Co, 4,023%, fällig 05.12.2024 *	1.504	0,10	80 Levi Strauss & Co, 5,000%, fällig 01.05.2025	82	0,01
150 HCA Inc, 4,750%, fällig 01.05.2023	160	0,01	1.160 JPMorgan Chase & Co, 2,083%, fällig 22.04.2026 *	1.198	0,08	90 Lockheed Martin Corp, 3,100%, fällig 15.01.2023	93	0,01
100 HCA Inc, 5,000%, fällig 15.03.2024	110	0,01	970 JPMorgan Chase & Co, 4,250%, fällig 01.10.2027	1.113	0,07	460 Lockheed Martin Corp, 3,550%, fällig 15.01.2026	509	0,03
270 HCA Inc, 5,375%, fällig 01.02.2025	305	0,02	1.000 JPMorgan Chase & Co, 3,509%, fällig 23.01.2029 *	1.106	0,07	40 Lockheed Martin Corp, 4,500%, fällig 15.05.2036	51	–
10 HCA Inc, 5,250%, fällig 15.04.2025	11	–	770 JPMorgan Chase & Co, 4,203%, fällig 23.07.2029 *	885	0,06	280 Lowe's Cos Inc, 4,500%, fällig 15.04.2030	333	0,02
170 HCA Inc, 5,250%, fällig 15.06.2026	197	0,01	780 JPMorgan Chase & Co, 4,452%, fällig 05.12.2029 *	912	0,06	1.090 Mars Inc, 144 A 3,200%, fällig 01.04.2030	1.206	0,08
40 HCA Inc, 5,375%, fällig 01.09.2026	46	–	640 JPMorgan Chase & Co, 2,522%, fällig 22.04.2031 *	663	0,04	110 Mastercard Inc, 3,850%, fällig 26.03.2050	135	0,01
90 HCA Inc, 5,625%, fällig 01.09.2028	107	0,01	1.730 JPMorgan Chase & Co, 4,950%, fällig 01.06.2045	2.314	0,15	290 McDonald's Corp, 3,375%, fällig 26.05.2025	314	0,02
660 HCA Inc, 5,875%, fällig 01.02.2029	801	0,05	300 JPMorgan Chase & Co, 3,109%, fällig 22.04.2051 *	314	0,02	430 McDonald's Corp, 3,300%, fällig 01.07.2025	466	0,03
630 HCA Inc, 3,500%, fällig 01.09.2030	677	0,04	380 Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,500%, fällig 01.09.2023	399	0,03	100 McDonald's Corp, 1,450%, fällig 01.09.2025	102	0,01
400 HCA Inc, 5,500%, fällig 15.06.2047	529	0,03	110 Kinder Morgan Energy Partners LP, 4,250%, fällig 01.09.2024	120	0,01	460 McDonald's Corp, 3,700%, fällig 30.01.2026	509	0,03
180 Hershey Co/The, 0,900%, fällig 01.06.2025	181	0,01	300 Kinder Morgan Inc, 4,300%, fällig 01.06.2025	332	0,02	510 McDonald's Corp, 3,500%, fällig 01.03.2027	564	0,04
500 Hilton Domestic Operating Co Inc, 144 A 5,375%, fällig 01.05.2025	525	0,03	680 Kinder Morgan Inc, 4,300%, fällig 01.03.2028	777	0,05	360 McDonald's Corp, 3,500%, fällig 01.07.2027	400	0,03
200 Hilton Domestic Operating Co Inc, 144 A 5,750%, fällig 01.05.2028	216	0,01	270 Kinder Morgan Inc, 5,300%, fällig 01.12.2034	335	0,02	260 McDonald's Corp, 3,800%, fällig 01.04.2028	294	0,02
330 Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875%, fällig 01.04.2027	343	0,02	170 Kinder Morgan Inc, 5,550%, fällig 01.06.2045	221	0,01	130 McDonald's Corp, 3,600%, fällig 01.07.2030	147	0,01
380 Home Depot Inc/The, 2,500%, fällig 15.04.2027	407	0,03	60 Kinder Morgan Inc, 5,200%, fällig 01.03.2048	76	–	80 McDonald's Corp, 3,625%, fällig 01.09.2049	90	0,01
70 Home Depot Inc/The, 3,900%, fällig 06.12.2028	81	0,01	30 KKR Group Finance Co II LLC, 144 A 5,500%, fällig 01.02.2043	41	–	720 McDonald's Corp, 4,200%, fällig 01.04.2050	885	0,06
440 Home Depot Inc/The, 2,700%, fällig 15.04.2030	473	0,03	130 Kraft Heinz Foods Co, 3,000%, fällig 01.06.2026	138	0,01	60 MDC Holdings Inc, 6,000%, fällig 15.01.2043	77	0,01
490 Home Depot Inc/The, 3,300%, fällig 15.04.2040	544	0,03	150 Kraft Heinz Foods Co, 4,250%, fällig 01.03.2031	173	0,01	290 Medtronic Inc, 3,500%, fällig 15.03.2025	317	0,02
90 Home Depot Inc/The, 3,900%, fällig 15.06.2047	108	0,01	20 Kraft Heinz Foods Co, 6,750%, fällig 15.03.2032	27	–	750 Merck & Co Inc, 0,750%, fällig 24.02.2026	747	0,05
1.370 Home Depot Inc/The, 3,350%, fällig 15.04.2050	1.528	0,10	80 Kraft Heinz Foods Co, 5,000%, fällig 15.07.2035	99	0,01	450 Merck & Co Inc, 1,450%, fällig 24.06.2030	442	0,03
440 Honeywell International Inc, 1,350%, fällig 01.06.2025	449	0,03	50 Kraft Heinz Foods Co, 6,875%, fällig 26.01.2039	75	–	300 MetLife Inc, 6,400%, fällig 15.12.2036	386	0,02
430 Humana Inc, 3,950%, fällig 15.03.2027	484	0,03	10 Kraft Heinz Foods Co, 144 A 7,125%, fällig 01.08.2039	15	–	580 Micron Technology Inc, 2,497%, fällig 24.04.2023	599	0,04
1.700 Humana Inc, 3,125%, fällig 15.08.2029	1.839	0,12	10 Kraft Heinz Foods Co, 4,625%, fällig 01.10.2039	12	–	770 Microsoft Corp, 2,400%, fällig 06.02.2022	776	0,05
70 Humana Inc, 4,625%, fällig 01.12.2042	87	0,01	170 Kraft Heinz Foods Co, 5,000%, fällig 04.06.2042	215	0,01	820 Microsoft Corp, 2,875%, fällig 06.02.2024	866	0,06
90 Humana Inc, 4,950%, fällig 01.10.2044	118	0,01	520 Kraft Heinz Foods Co, 5,200%, fällig 15.07.2045	669	0,04	200 Microsoft Corp, 2,700%, fällig 12.02.2025	213	0,01
			210 Kraft Heinz Foods Co, 4,375%, fällig 01.06.2046	244	0,02	1.940 Microsoft Corp, 2,400%, fällig 08.08.2026	2.074	0,13
						1.400 Microsoft Corp, 3,300%, fällig 06.02.2027	1.562	0,10
						10 Microsoft Corp, 3,450%, fällig 08.08.2036	12	–
						390 Microsoft Corp, 2,525%, fällig 01.06.2050	390	0,02

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)								
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)								
10 Microsoft Corp, 2,921%, fällig 17.03.2052	11	–	100 Occidental Petroleum Corp, 4,400%, fällig 15.04.2046	102	0,01	280 Raytheon Technologies Corp, 3,150%, fällig 15.12.2024	299	0,02
43 Microsoft Corp, 2,675%, fällig 01.06.2060	43	–	520 Occidental Petroleum Corp, 4,100%, fällig 15.02.2047	509	0,03	650 Raytheon Technologies Corp, 3,950%, fällig 16.08.2025	721	0,05
207 Microsoft Corp, 3,041%, fällig 17.03.2062	225	0,01	260 Occidental Petroleum Corp, 4,200%, fällig 15.03.2048	255	0,02	630 Raytheon Technologies Corp, 4,125%, fällig 16.11.2028	725	0,05
730 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144 A 6,500%, fällig 20.06.2027	794	0,05	1.000 Occidental Petroleum Corp, 4,400%, fällig 15.08.2049	1.009	0,06	280 Raytheon Technologies Corp, 2,250%, fällig 01.07.2030	286	0,02
30 Molson Coors Beverage Co, 3,500%, fällig 01.05.2022	31	–	1.250 Oracle Corp, 1,650%, fällig 25.03.2026	1.270	0,08	130 Raytheon Technologies Corp, 4,500%, fällig 01.06.2042	163	0,01
960 Mondelez International Inc, 1,500%, fällig 04.05.2025	978	0,06	1.690 Oracle Corp, 2,875%, fällig 25.03.2031	1.781	0,11	370 Republic Services Inc, 2,500%, fällig 15.08.2024	389	0,02
1.770 Morgan Stanley, 2,188%, fällig 28.04.2026 *	1.840	0,12	300 Otis Worldwide Corp, 2,056%, fällig 05.04.2025	311	0,02	430 salesforce.com Inc, 3,250%, fällig 11.04.2023	449	0,03
1.360 Morgan Stanley, 3,772%, fällig 24.01.2029 *	1.520	0,10	990 Pacific Gas and Electric Co, 1,750%, fällig 16.06.2022	990	0,06	140 salesforce.com Inc, 3,700%, fällig 11.04.2028	159	0,01
50 Morgan Stanley, 4,431%, fällig 23.01.2030 *	58	–	310 Pacific Gas and Electric Co, 2,100%, fällig 01.08.2027	300	0,02	80 Santander Holdings USA Inc, 4,500%, fällig 17.07.2025	89	0,01
960 Morgan Stanley, 2,699%, fällig 22.01.2031 *	1.006	0,06	390 Pacific Gas and Electric Co, 2,500%, fällig 01.02.2031	368	0,02	322 Schlumberger Holdings Corp, 3,900%, fällig 17.05.2028	360	0,02
2.090 Morgan Stanley, 3,622%, fällig 01.04.2031 *	2.343	0,15	80 Pacific Gas and Electric Co, 3,300%, fällig 01.08.2040	74	–	430 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000%, fällig 01.03.2032	619	0,04
380 MPLX LP, 4,875%, fällig 01.12.2024	423	0,03	190 Pacific Gas and Electric Co, 3,500%, fällig 01.08.2050	172	0,01	150 Southwestern Electric Power Co, 6,200%, fällig 15.03.2040	213	0,01
230 MPLX LP, 4,000%, fällig 15.03.2028	257	0,02	90 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144 A 4,125%, fällig 15.02.2028	95	0,01	552 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144 A 8,000%, fällig 20.09.2025	626	0,04
1.750 MPLX LP, 4,800%, fällig 15.02.2029	2.050	0,13	540 PayPal Holdings Inc, 1,350%, fällig 01.06.2023	549	0,04	20 Sprint Capital Corp, 6,875%, fällig 15.11.2028	26	–
410 MPLX LP, 4,500%, fällig 15.04.2038	470	0,03	560 PayPal Holdings Inc, 1,650%, fällig 01.06.2025	577	0,04	515 Sprint Capital Corp, 8,750%, fällig 15.03.2032	790	0,05
20 MPLX LP, 5,200%, fällig 01.03.2047	25	–	720 PepsiCo Inc, 0,750%, fällig 01.05.2023	727	0,05	10 Sprint Corp, 7,875%, fällig 15.09.2023	11	–
960 MPLX LP, 4,700%, fällig 15.04.2048	1.124	0,07	80 PepsiCo Inc, 2,250%, fällig 19.03.2025	84	0,01	220 Sprint Corp, 7,625%, fällig 15.02.2025	261	0,02
320 MPLX LP, 5,500%, fällig 15.02.2049	414	0,03	70 PepsiCo Inc, 2,625%, fällig 19.03.2027	75	–	150 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,000%, fällig 15.01.2028	158	0,01
160 Newell Brands Inc, 4,700%, fällig 01.04.2026	179	0,01	580 PepsiCo Inc, 1,625%, fällig 01.05.2030	579	0,04	290 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500%, fällig 01.03.2030	320	0,02
360 NIKE Inc, 2,400%, fällig 27.03.2025	382	0,02	220 PepsiCo Inc, 2,875%, fällig 15.10.2049	231	0,01	360 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875%, fällig 01.02.2031	392	0,03
580 NIKE Inc, 2,750%, fällig 27.03.2027	628	0,04	100 PepsiCo Inc, 3,625%, fällig 19.03.2050	119	0,01	200 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144 A 4,000%, fällig 15.01.2032	210	0,01
290 NIKE Inc, 3,250%, fällig 27.03.2040	324	0,02	180 PepsiCo Inc, 3,875%, fällig 19.03.2060	225	0,01	640 Target Corp, 2,250%, fällig 15.04.2025	673	0,04
790 NIKE Inc, 3,375%, fällig 27.03.2050	910	0,06	940 Pfizer Inc, 0,800%, fällig 28.05.2025	942	0,06	16 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850%, fällig 16.12.2039	25	–
640 Northrop Grumman Corp, 2,930%, fällig 15.01.2025	681	0,04	620 Pfizer Inc, 2,625%, fällig 01.04.2030	667	0,04	1.010 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144 A 4,900%, fällig 15.09.2044	1.332	0,08
1.140 Northrop Grumman Corp, 3,250%, fällig 15.01.2028	1.247	0,08	580 Pfizer Inc, 1,700%, fällig 28.05.2030	581	0,04	1.820 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144 A 2,900%, fällig 01.03.2030	1.896	0,12
490 Northrop Grumman Corp, 5,250%, fällig 01.05.2050	698	0,04	310 Philip Morris International Inc, 2,900%, fällig 15.11.2021	312	0,02	380 Texas Instruments Inc, 1,750%, fällig 04.05.2030	380	0,02
320 NVIDIA Corp, 2,850%, fällig 01.04.2030	347	0,02	160 Philip Morris International Inc, 2,500%, fällig 22.08.2022	164	0,01	980 The Vanguard Group Inc, 3,050%, fällig 22.08.2050 † 963	0,06	
870 NVIDIA Corp, 3,500%, fällig 01.04.2040	992	0,06	540 Philip Morris International Inc, 2,500%, fällig 02.11.2022	553	0,04	420 Time Warner Cable LLC, 7,300%, fällig 01.07.2038	613	0,04
1.980 NVIDIA Corp, 3,500%, fällig 01.04.2050	2.278	0,15	360 Philip Morris International Inc, 1,125%, fällig 01.05.2023	365	0,02	560 Time Warner Cable LLC, 5,875%, fällig 15.11.2040	723	0,05
620 NVIDIA Corp, 3,700%, fällig 01.04.2060	742	0,05	400 Philip Morris International Inc, 2,100%, fällig 01.05.2030	404	0,03	85 Time Warner Entertainment Co LP, 8,375%, fällig 15.07.2033	127	0,01
30 Occidental Petroleum Corp, 6,950%, fällig 01.07.2024	34	–	160 Philip Morris International Inc, 4,500%, fällig 20.03.2042	191	0,01	50 TIX Cos Inc/The, 2,250%, fällig 15.09.2026	53	–
130 Occidental Petroleum Corp, 5,550%, fällig 15.03.2026	145	0,01	170 Pioneer Natural Resources Co, 1,125%, fällig 15.01.2026	168	0,01	2.640 T-Mobile USA Inc, 3,500%, fällig 15.04.2025	2.853	0,18
410 Occidental Petroleum Corp, 3,400%, fällig 15.04.2026	422	0,03	710 Pioneer Natural Resources Co, 2,150%, fällig 15.01.2031	696	0,04			
610 Occidental Petroleum Corp, 3,200%, fällig 15.08.2026	630	0,04	240 Principal Life Global Funding II, 144 A 1,250%, fällig 23.06.2025	242	0,02			
260 Occidental Petroleum Corp, 3,000%, fällig 15.02.2027	261	0,02	120 Procter & Gamble Co/The, 2,800%, fällig 25.03.2027	131	0,01			
600 Occidental Petroleum Corp, 3,500%, fällig 15.08.2029	623	0,04	340 Procter & Gamble Co/The, 3,000%, fällig 25.03.2030	377	0,02			
260 Occidental Petroleum Corp, 7,875%, fällig 15.09.2031	346	0,02	19 Range Resources Corp, 5,875%, fällig 01.07.2022	19	–			
730 Occidental Petroleum Corp, 6,450%, fällig 15.09.2036	914	0,06	314 Range Resources Corp, 5,000%, fällig 15.03.2023	323	0,02			
200 Occidental Petroleum Corp, 6,200%, fällig 15.03.2040	239	0,02	200 Range Resources Corp, 4,875%, fällig 15.05.2025	207	0,01			
240 Occidental Petroleum Corp, 4,625%, fällig 15.06.2045	249	0,02						
520 Occidental Petroleum Corp, 6,600%, fällig 15.03.2046	659	0,04						

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			210 Verizon Communications Inc, 0,850%, fällig 20.11.2025	209	0,01	560 Wells Fargo & Co, 3,584%, fällig 22.05.2028 *	622	0,04
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			390 Verizon Communications Inc, 1,450%, fällig 20.03.2026	395	0,03	750 Wells Fargo & Co, 2,393%, fällig 02.06.2028 *	783	0,05
160 T-Mobile USA Inc, 2,250%, fällig 15.02.2026	164	0,01	260 Verizon Communications Inc, 2,625%, fällig 15.08.2026	277	0,02	960 Wells Fargo & Co, 4,150%, fällig 24.01.2029	1.106	0,07
120 T-Mobile USA Inc, 3,750%, fällig 15.04.2027	133	0,01	190 Verizon Communications Inc, 3,000%, fällig 22.03.2027	206	0,01	1.330 Wells Fargo & Co, 2,879%, fällig 30.10.2030 *	1.415	0,09
140 T-Mobile USA Inc, 2,050%, fällig 15.02.2028	143	0,01	580 Verizon Communications Inc, 2,100%, fällig 22.03.2028	596	0,04	620 Wells Fargo & Co, 4,478%, fällig 04.04.2031 *	735	0,05
520 T-Mobile USA Inc, 2,625%, fällig 15.02.2029	527	0,03	1.062 Verizon Communications Inc, 4,329%, fällig 21.09.2028	1.241	0,08	580 Wells Fargo & Co, 4,900%, fällig 17.11.2045	754	0,05
1.520 T-Mobile USA Inc, 3,875%, fällig 15.04.2030	1.705	0,11	190 Verizon Communications Inc, 3,875%, fällig 08.02.2029	217	0,01	720 Wells Fargo & Co, 4,400%, fällig 14.06.2046	880	0,06
450 T-Mobile USA Inc, 2,550%, fällig 15.02.2031	459	0,03	500 Verizon Communications Inc, 3,150%, fällig 22.03.2030	543	0,03	1.890 Wells Fargo & Co, 4,750%, fällig 07.12.2046	2.411	0,15
380 T-Mobile USA Inc, 2,875%, fällig 15.02.2031	391	0,03	630 Verizon Communications Inc, 1,750%, fällig 20.01.2031	611	0,04	5.810 Wells Fargo & Co, 5,013%, fällig 04.04.2051 *	8.107	0,52
390 T-Mobile USA Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.04.2031	416	0,03	1.110 Verizon Communications Inc, 2,550%, fällig 21.03.2031	1.147	0,07	130 Wells Fargo & Co, Series U, 5,875%, Perpetual *	147	0,01
240 T-Mobile USA Inc, 3,500%, fällig 15.04.2031	256	0,02	1.390 Verizon Communications Inc, 4,500%, fällig 10.08.2033	1.684	0,11	170 Western Midstream Operating LP, 2,229%, fällig 13.01.2023 *	170	0,01
70 T-Mobile USA Inc, 2,250%, fällig 15.11.2031	70	-	580 Verizon Communications Inc, 5,250%, fällig 16.03.2037	770	0,05	460 Western Midstream Operating LP, 4,350%, fällig 01.02.2025	484	0,03
220 T-Mobile USA Inc, 3,000%, fällig 15.02.2041	219	0,01	1.480 Verizon Communications Inc, 2,650%, fällig 20.11.2040	1.437	0,09	110 Western Midstream Operating LP, 4,500%, fällig 01.03.2028	119	0,01
10 T-Mobile USA Inc, 3,300%, fällig 15.02.2051	10	-	510 Verizon Communications Inc, 3,850%, fällig 01.11.2042	584	0,04	1.890 Western Midstream Operating LP, 5,300%, fällig 01.02.2030	2.121	0,14
150 Toll Brothers Finance Corp, 4,375%, fällig 15.04.2023	157	0,01	430 Verizon Communications Inc, 4,125%, fällig 15.08.2046	506	0,03	50 Western Midstream Operating LP, 5,500%, fällig 15.08.2048	57	-
1.350 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850%, fällig 01.02.2026	1.700	0,11	550 Verizon Communications Inc, 4,862%, fällig 21.08.2046	717	0,05	310 Western Midstream Operating LP, 6,500%, fällig 01.02.2050	366	0,02
340 Union Pacific Corp, 3,750%, fällig 15.07.2025	376	0,02	50 Verizon Communications Inc, 5,500%, fällig 16.03.2047	71	-	40 WestRock RKT LLC, 4,000%, fällig 01.03.2023	42	-
1.090 Union Pacific Corp, 144 A 2,891%, fällig 06.04.2036	1.147	0,07	910 Verizon Communications Inc, 4,522%, fällig 15.09.2048	1.145	0,07	197 Williams Cos Inc/The, 7,875%, fällig 01.09.2021	197	0,01
1.260 Union Pacific Corp, 3,839%, fällig 20.03.2060	1.471	0,09	320 Verizon Communications Inc, 4,000%, fällig 22.03.2050	372	0,02	100 Williams Cos Inc/The, 3,700%, fällig 15.01.2023	104	0,01
470 Union Pacific Corp, 3,750%, fällig 05.02.2070	537	0,03	2.200 Verizon Communications Inc, 2,875%, fällig 20.11.2050	2.122	0,14	350 Williams Cos Inc/The, Series A, 7,500%, fällig 15.01.2031	489	0,03
30 United Airlines Inc, 144 A 4,375%, fällig 15.04.2026	31	-	830 Visa Inc, 3,150%, fällig 14.12.2025	906	0,06	760 Williams Cos Inc/The, 7,750%, fällig 15.06.2031	1.071	0,07
550 United Airlines Inc, 144 A 4,625%, fällig 15.04.2029	571	0,04	890 Visa Inc, 4,300%, fällig 14.12.2045	1.143	0,07	1.038 Williams Cos Inc/The, 8,750%, fällig 15.03.2032	1.609	0,10
180 United Rentals North America Inc, 5,875%, fällig 15.09.2026	186	0,01	390 VOC Escrow Ltd, 144 A 5,000%, fällig 15.02.2028	386	0,02	110 Wyeth LLC, 5,950%, fällig 01.04.2037	158	0,01
70 United Rentals North America Inc, 3,875%, fällig 15.11.2027	74	-	240 Walmart Inc, 3,400%, fällig 26.06.2023	253	0,02	416.810	26,56	
160 United Rentals North America Inc, 4,875%, fällig 15.01.2028	170	0,01	200 Walmart Inc, 3,550%, fällig 26.06.2025	220	0,01	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 478.056 USD)		
210 United Rentals North America Inc, 5,250%, fällig 15.01.2030	230	0,01	1.590 Walmart Inc, 3,700%, fällig 26.06.2028	1.817	0,12	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 28,99 % (28. Februar 2021: 26,81 %)		
1.230 United Rentals North America Inc, 3,875%, fällig 15.02.2031	1.275	0,08	170 Walt Disney Co/The, 6,650%, fällig 15.11.2037	260	0,02	Argentinien – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,14 %)		
230 UnitedHealth Group Inc, 2,875%, fällig 15.12.2021	232	0,01	140 Wells Fargo & Co, Series M, 3,450%, fällig 13.02.2023	146	0,01	212 Argentine Republic Government International Bond, 1,000%, fällig 09.07.2029	87	0,01
210 UnitedHealth Group Inc, 3,500%, fällig 15.06.2023	222	0,01	410 Wells Fargo & Co, 4,480%, fällig 16.01.2024	447	0,03	2.566 Argentine Republic Government International Bond, 0,500%, fällig 09.07.2030	1.008	0,06
410 UnitedHealth Group Inc, 3,750%, fällig 15.07.2025	455	0,03	240 Wells Fargo & Co, 3,750%, fällig 24.01.2024	257	0,02	1.062 Argentine Republic Government International Bond, 1,125%, fällig 09.07.2035	373	0,02
210 UnitedHealth Group Inc, 1,250%, fällig 15.01.2026	213	0,01	1.500 Wells Fargo & Co, 1,654%, fällig 02.06.2024 *	1.532	0,10	1.850 Argentine Republic Government International Bond, 2,500%, fällig 09.07.2041	725	0,05
660 UnitedHealth Group Inc, 3,875%, fällig 15.12.2028	762	0,05	1.150 Wells Fargo & Co, 2,188%, fällig 30.04.2026 *	1.195	0,08	370 Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144 A 6,500%, fällig 15.02.2023 €	195	0,01
200 UnitedHealth Group Inc, 2,000%, fällig 15.05.2030	203	0,01	870 Wells Fargo & Co, 3,000%, fällig 23.10.2026	941	0,06	320 Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144 A 7,875%, fällig 15.06.2027 €	174	0,01
160 UnitedHealth Group Inc, 4,250%, fällig 15.06.2048	202	0,01	3.940 Wells Fargo & Co, 4,300%, fällig 22.07.2027	4.519	0,29	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 28,99 % (28. Februar 2021: 26,81 %)		
130 UnitedHealth Group Inc, 4,450%, fällig 15.12.2048	169	0,01				Argentinien – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,14 %)		
940 UnitedHealth Group Inc, 3,700%, fällig 15.08.2049	1.096	0,07				Argentinien – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,14 %)		
300 UnitedHealth Group Inc, 3,875%, fällig 15.08.2059	364	0,02				Argentinien – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,14 %)		
80 UnitedHealth Group Inc, 3,125%, fällig 15.05.2060	85	0,01				Argentinien – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,14 %)		
1.410 US Bancorp, 1,450%, fällig 12.05.2025	1.443	0,09				Argentinien – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,14 %)		
1.190 Verizon Communications Inc, 3,376%, fällig 15.02.2025	1.289	0,08				Argentinien – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,14 %)		

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)								
Brasilien – 0,86 % (28. Februar 2021: 0,82 %)								
BRL 11.136			148.560			2.610		
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN-F, 10,000%, fällig 01.01.2023		0,14	Mexican Bonos, Series M 20X 8,500%, fällig 31.05.2029		0,52	Abu Dhabi Government International Bond, 144 A 3,875%, fällig 16.04.2050		0,20
BRL 17.005	2.191		142.047	7.216	0,46			4.665
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN-F, 10,000%, fällig 01.01.2027		0,21	Mexican Bonos, Series M, 7,750%, fällig 13.11.2042					0,30
	3.293		256.970	13.346	0,85			
350 Brazilian Government International Bond, 2,625%, fällig 05.01.2023		0,02	2.590 Mexico Government International Bond, 4,600%, fällig 10.02.2048		0,18			
	361		190 Mexico Government International Bond, 5,750%, fällig 12.10.2110		0,02			
	832	0,05						
	811	0,05						
	6.120	0,39						
	13.548	0,86						
Kolumbien – 0,20 % (28. Februar 2021: 0,09 %)								
	890	0,06	Nigeria – 0,02 % (28. Februar 2021: 0,02 %)					
Colombia Government International Bond, 3,250%, fällig 22.04.2032			300 Nigeria Government International Bond, 144 A 6,500%, fällig 28.11.2027		0,02			
	865	0,05	Panama – 0,10 % (28. Februar 2021: 0,09 %)					
	1.270	0,09	470 Panama Government International Bond, 2,252%, fällig 29.09.2032		0,03			
	3.158	0,20	950 Panama Government International Bond, 4,500%, fällig 01.04.2056		0,07			
Ägypten – 0,07 % (28. Februar 2021: 0,07 %)								
	1.110	0,07	Peru – 0,19 % (28. Februar 2021: 0,18 %)					
Egypt Government International Bond, 144 A 5,577%, fällig 21.02.2023		0,07	1.980 Peruvian Government International Bond, 2,783%, fällig 23.01.2031		0,13			
Indonesien – 0,68 % (28. Februar 2021: 0,62 %)								
	650	0,04	50 Peruvian Government International Bond, 6,550%, fällig 14.03.2037		0,01			
Indonesia Government International Bond, 3,750%, fällig 25.04.2022			580 Peruvian Government International Bond, 5,625%, fällig 18.11.2050		0,05			
	1.698	0,11	2.905		0,19			
	224	0,01	Katar – 0,35 % (28. Februar 2021: 0,32 %)					
	390	0,03	620 Qatar Government International Bond, 144 A 4,000%, fällig 14.03.2029		0,05			
	1.610	0,13	2.580 Qatar Government International Bond, 144 A 4,817%, fällig 14.03.2049		0,21			
	280	0,02	1.090 Qatar Government International Bond, 144 A 4,400%, fällig 16.04.2050		0,09			
	200	0,02	Russland – 1,60 % (28. Februar 2021: 1,31 %)					
	430	0,03	52.900 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6211X 7,000%, fällig 25.01.2023		0,05			
	4.260	0,29	116.430 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6215X 7,000%, fällig 16.08.2023		0,10			
	10.720	0,68	16.270 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6219X 7,750%, fällig 16.09.2026		0,02			
Israel – 0,07 % (28. Februar 2021: 0,07 %)								
	650	0,07	143.230 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6207X 8,150%, fällig 03.02.2027		0,13			
Israel Government International Bond, 2,750%, fällig 03.07.2030		0,04	180.331 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6212X 7,050%, fällig 19.01.2028		0,16			
	390	0,03	637.894 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6224X 6,900%, fällig 23.05.2029		0,56			
	1.127	0,07	232.730 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6228X 7,650%, fällig 10.04.2030		0,21			
Kenia – 0,12 % (28. Februar 2021: 0,00 %)								
	1.870	0,12	22.030 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6225X 7,250%, fällig 10.05.2034		0,02			
Republic of Kenya Government International Bond, 144 A 6,300%, fällig 23.01.2034		0,12	382.680 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6230X 7,700%, fällig 16.03.2039		0,35			
Kuwait – 0,11 % (28. Februar 2021: 0,10 %)								
	1.530	0,11	Vereinigte Arabische Emirate – 0,30 % (28. Februar 2021: 0,27 %)					
Kuwait International Government Bond, 144 A 3,500%, fällig 20.03.2027		0,11	1.570 Abu Dhabi Government International Bond, 144 A 2,500%, fällig 10.10.2022		0,10			
Mexiko – 2,05 % (28. Februar 2021: 1,96 %)								
	6.990	0,02						
Mexican Bonos, Series M 20X 10,000%, fällig 05.12.2024		0,02						

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)								
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)								
47.130 United States Treasury Note/ Bond , 1,375%, fällig 15.08.2050 ¹	41.239	2,63	1.836 Change Healthcare Holdings LLC, 3,500%, fällig 01.03.2024 *	1.834	0,12	1.125 Harbor Freight Tools USA Inc, 3,250%, fällig 19.10.2027 *	1.122	0,07
18.010 United States Treasury Note/ Bond , 1,625%, fällig 15.11.2050	16.763	1,07	2.097 Charter Communications Operating LLC, 1,850%, fällig 30.04.2025 *	2.092	0,13	1.435 Hilton Worldwide Finance LLC, 1,834%, fällig 21.06.2026 *	1.422	0,09
19.500 United States Treasury Note/ Bond , 1,875%, fällig 15.02.2051	19.255	1,23	433 Charter Communications Operating LLC, 1,850%, fällig 01.02.2027 *	429	0,03	1.145 ICON Luxembourg S.a.r.l., 3,000%, fällig 01.07.2028 *	1.145	0,07
12.920 United States Treasury Note/ Bond , 2,375%, fällig 15.05.2051	14.272	0,91	1.268 Citadel Securities, 2,592%, fällig 27.02.2028 *	1.253	0,08	567 iHeartCommunications Inc, 3,092%, fällig 01.05.2026 *	562	0,04
3.270 United States Treasury Note/ Bond , 2,000%, fällig 15.08.2051	3.329	0,21	1.007 CityCenter Holdings LLC, 3,000%, fällig 18.04.2024 *	1.006	0,06	285 Indigo Merger Sub, Inc., 3,000%, fällig 01.07.2028 *	285	0,02
	347.020	22,11	727 Clarios Global LP, 3,342%, fällig 30.04.2026 *	721	0,05	680 Ineos U.S. Petrochemical, 3,250%, fällig 21.01.2026 *	679	0,04
			259 CSC Holdings LLC, 2,345%, fällig 15.01.2026 *	256	0,02	1.360 Jane Street Group, LLC, 2,842%, fällig 21.01.2027 *	1.342	0,09
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 463.546 USD)	455.023	28,99	99 CSC Holdings LLC, 2,595%, fällig 15.04.2027 *	98	0,01	2.100 Level 3 Parent LLC, 1,842%, fällig 01.03.2027 *	2.072	0,13
Schuldverschreibungen – 5,99 % (28. Februar 2021: 5,79 %)								
1.412 1011778 BC ULC, 1,842%, fällig 14.11.2026 *	1.390	0,09	1.889 DCert Buyer, Inc., 4,092%, fällig 16.10.2026 *	1.888	0,12	630 Michaels Cos Inc./ The, 5,000%, fällig 08.04.2028 *	631	0,04
190 AECOM, 1,842%, fällig 09.04.2028 *	190	0,01	1.337 Deerfield Dakota Holding LLC, 4,750%, fällig 05.03.2027 *	1.340	0,09	1.351 MPH Acquisition Holdings LLC, 3,750%, fällig 07.06.2023 *	1.349	0,09
560 Air Canada, 4,250%, fällig 27.07.2028 *	561	0,03	1.225 Dell International LLC, 2,000%, fällig 19.09.2025 *	1.226	0,08	2.189 Nexstar Broadcasting Inc, 2,596%, fällig 19.09.2026 *	2.181	0,14
2.157 Allied Universal Holdco LLC, 4,250%, fällig 14.05.2028 *	2.160	0,14	70 Delta 2 (Lux) S.a.r.l., 3,500%, fällig 01.02.2024 *	70	0,01	670 Parexel International Corporation, 2,842%, fällig 27.09.2024 *	669	0,04
556 Alterra Mountain Co, 2,842%, fällig 30.07.2028 *	554	0,04	800 Delta Topco Inc, 4,500%, fällig 07.10.2027 *	802	0,05	342 PCI Gaming Authority, 2,592%, fällig 31.05.2026 *	340	0,02
214 American Axle & Manufacturing Inc, 3,000%, fällig 06.04.2024 *	214	0,01	713 Edelman Financial Center LLC/The, 4,250%, fällig 05.04.2028 *	710	0,05	632 Phoenix Guarantor Inc, 3,339%, fällig 05.03.2026 *	627	0,04
687 AmWINS Group, Inc., 3,000%, fällig 17.02.2028 *	681	0,04	318 Energizer Holdings, Inc., 2,750%, fällig 16.12.2027 *	317	0,02	520 Phoenix Newco, Inc., 0,000%, fällig 11.08.2028 *	520	0,03
1.214 API Group Inc, 2,592%, fällig 01.10.2026 *	1.204	0,08	298 Entercom Media Corp, 2,588%, fällig 17.11.2024 *	294	0,02	2.620 Pilot Travel Centers, 0,000%, fällig 29.07.2028 *	2.605	0,17
410 Aramark Services Inc, 1,842%, fällig 11.03.2025 *	403	0,03	386 Eyecare Partners LLC, 3,857%, fällig 20.02.2027 *	383	0,02	1.975 PPD, Inc., 2,750%, fällig 06.01.2028 *	1.972	0,13
499 Aramark Services Inc, 1,842%, fällig 15.01.2027 *	489	0,03	171 FinCo I LLC, 2,592%, fällig 27.06.2025 *	170	0,01	1.854 Prime Security, 3,500%, fällig 23.09.2026 *	1.853	0,12
2.035 Asplundh Tree Expert LLC, 1,842%, fällig 04.09.2027 *	2.024	0,13	237 First Eagle Holdings Inc, 2,647%, fällig 17.02.2027 *	234	0,01	470 Project Sky Merger Sub, Inc., 0,000%, fällig 10.08.2028 *	469	0,03
1.094 Asurion LLC, 3,092%, fällig 03.11.2024 *	1.077	0,07	795 Focus Financial Partners LLC, 2,092%, fällig 03.07.2024 *	789	0,05	620 Quikrete Holdings, Inc., 0,000%, fällig 11.06.2028 *	616	0,04
206 Asurion LLC, 3,217%, fällig 03.11.2023 *	204	0,01	909 Four Seasons Hotels Ltd, 2,092%, fällig 30.11.2023 *	904	0,06	988 Rackspace Technology Global, Inc, 3,500%, fällig 09.02.2028 *	979	0,06
1.008 Asurion LLC, 3,342%, fällig 18.12.2026 *	989	0,06	663 Froneri U.S. Inc, 2,342%, fällig 30.01.2027 *	654	0,04	1.610 RealPage Inc, 3,750%, fällig 18.02.2028 *	1.603	0,10
1.512 Athenahealth Inc, 4,410%, fällig 11.02.2026 *	1.519	0,10	1.874 Gainwell Acquisition Corp, 4,750%, fällig 01.10.2027 *	1.877	0,12	1.500 RegionalCare Hospital Partners Holding, 3,842%, fällig 16.11.2025 *	1.491	0,09
146 Atlantic Aviation Inc, 3,850%, fällig 30.11.2025 *	146	0,01	350 Garda World Security Corp, 4,340%, fällig 30.10.2026 *	350	0,02	1.892 Reynolds Consumer Products LLC, 1,842%, fällig 04.02.2027 *	1.880	0,12
358 Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 2,750%, fällig 01.12.2027 *	359	0,02	2.138 Genesee & Wyoming Inc, 2,147%, fällig 30.12.2026 *	2.118	0,13	420 Reynolds Group Holdings Inc, 2,842%, fällig 05.02.2023 *	418	0,03
1.085 Bausch Health Americas Inc, 2,842%, fällig 27.11.2025 *	1.080	0,07	106 GFL Environmental Inc, 3,500%, fällig 31.05.2025 *	106	0,01	2.342 Scientific Games International Inc, 2,842%, fällig 14.08.2024 *	2.325	0,15
1.053 Berry Global Inc, 1,856%, fällig 01.07.2026 *	1.045	0,07	504 GoDaddy Operating Co, 1,842%, fällig 15.02.2024 *	500	0,03	1.480 SkyMiles IP Ltd, 4,750%, fällig 16.09.2027 *	1.571	0,10
611 Beta Sub LLC, 3,864%, fällig 06.08.2026 *	610	0,04	406 Golden Nugget LLC, 3,250%, fällig 04.10.2023 *	404	0,03	1.870 Sotera Health, 3,250%, fällig 13.12.2026 *	1.860	0,12
262 Brightview Landscapes LLC, 2,625%, fällig 15.08.2025 *	261	0,02	2.073 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 2,086%, fällig 15.11.2027 *	2.048	0,13	1.396 Station Casinos LLC, 2,500%, fällig 08.02.2027 *	1.378	0,09
362 Brookfield WEC Holdings Inc., 3,250%, fällig 01.08.2025 *	359	0,02	350 GVC Holdings Gibraltar Ltd, 0,000%, fällig 16.03.2027 *	349	0,02	876 Terrier Media Buyer, Inc., 3,592%, fällig 17.12.2026 *	872	0,06
1.499 Caesars Resort Collection LLC, 2,842%, fällig 22.12.2024 *	1.489	0,09				947 Trans Union LLC, 1,842%, fällig 13.11.2026 *	939	0,06
883 Caesars Resort Collection LLC, 4,592%, fällig 19.06.2025 *	886	0,06						

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)								
80 TransDigm Group Inc., 2,342%, fällig 09.12.2025 *	78	–	– U.S. Bond Oktober 2021 Call 162,00X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley	101	0,01			
50 Triton Water Holdings, Inc., 4,000%, fällig 16.03.2028 *	50	–	– U.S. Bond Oktober 2021 Call 163,00X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley	122	0,01			
1.365 UFC Holdings LLC, 3,500%, fällig 29.04.2026 *	1.359	0,09	– U.S. Bond Oktober 2021 Put 163,00X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley	98	0,01			
1.107 United Airlines Inc., 4,500%, fällig 14.04.2028 *	1.111	0,07	3.770 USD Put/AUD Call 0,7270X fällig 23.11.2021 – Goldman Sachs	77	–			
832 Univision Communications Inc., 4,000%, fällig 24.03.2026 *	831	0,05	7.400 USD Put/CAD Call 1,2685X fällig 23.11.2021 – BNP Paribas	123	0,01			
537 US Foods Inc., 1,842%, fällig 27.06.2023 *	531	0,03	15.929 USD Put/JPY Call 107,80X fällig 11.11.2021 – Morgan Stanley	52	–			
219 Valeant Pharmaceuticals International, 3,092%, fällig 28.05.2025 *	218	0,01	3.770 USD Put/NZD Call 0,6955X fällig 23.11.2021 – Goldman Sachs	97	0,01			
507 Verscend Holding Corp., 4,092%, fällig 27.08.2025 *	507	0,03						
620 Verscend Holding Corp., 4,115%, fällig 27.08.2025 *	620	0,04						
361 VFH Parent LLC, 3,088%, fällig 01.03.2026 *	360	0,02						
1.810 VICI Properties 1 LLC, 1,838%, fällig 22.12.2024 *	1.803	0,11						
2.102 Virgin Media Bristol LLC, 2,595%, fällig 04.01.2028 *	2.084	0,13						
322 Western Digital Corp., 1,842%, fällig 29.04.2023 *	322	0,02						
18 Whatabrands LLC, 2,832%, fällig 03.08.2026 *	18	–						
20 Whatabrands LLC, 3,750%, fällig 21.07.2028 *	20	–						
690 Zayo Group Holdings Inc., 3,092%, fällig 09.03.2027 *	682	0,04						
590 Ziggo BV, 2,595%, fällig 15.04.2028 *	585	0,04						
Summe Schuldverschreibungen (Kosten 94.239 USD)	94.072	5,99						
Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,08 % (28. Februar 2021: 1,67 %)								
2.243 Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	32.563	2,08						
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Kosten 29.244 USD)	32.563	2,08						
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Kosten 1.548.196 USD)								
	1.590.022	101,31						
Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts						
Gekaufte Optionen – 0,05 % (28. Februar 2021: 0,05 %)								
– U.S. 10 Year Oktober 2021 Call 133,00X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley	60	–						
– U.S. 10 Year Oktober 2021 Put 133,00X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley	32	–						
Summe verkaufte Optionen (Kosten 260 USD)	(94)	(0,01)						
Verkäufte Optionen – (0,01 %) (28. Februar 2021: (0,12 %))								
– U.S. 10 Year Oktober 2021 Call 134,00X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley	(35)	(0,01)						
– U.S. 10 Year Oktober 2021 Call 135,50X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley	(3)	–						
– U.S. 10 Year Oktober 2021 Put 131,00X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley	(3)	–						
– U.S. 10 Year Oktober 2021 Put 131,50X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley	(9)	–						
– U.S. Bond Oktober 2021 Call 165,50X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley	(25)	–						
– U.S. Bond Oktober 2021 Call 170,00X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley	(4)	–						
Summe verkaufte Optionen (Kosten 260 USD)	(94)	(0,01)						
Zinsswaps – (0,32 %) (28. Februar 2021: (0,08 %))								
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(4.995)	(0,32)						
Devisenterminkontrakte – (0,08 %) (28. Februar 2021: (0,15 %))								
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.294)	(0,08)						
Futures – (0,16 %) (28. Februar 2021: (0,35 %))								
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(2.542)	(0,16)						
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten								
	(8.925)	(0,57)						
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten								
	1.599.313	101,90						
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten								
	(29.791)	(1,90)						
Gesamtvermögen								
	\$1.569.522	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 213.618.000 USD und machten 13,62 % des Nettovermögens aus.							
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.							
†	Illiquid.							
∞	Das Wertpapier wurde vom Manager oder dem jeweiligen Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.							
ε	Die Sicherheit ist zum 31. August 2021 (entweder Hauptsumme und/oder Zinsen) voreingestellt.							
≠	Die Wertpapiere (in ihrer Gesamtheit oder in Teilen) sind zum 31. August 2021 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 (CPI)/Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.							
ABKÜRZUNGEN:								
Fortwährend	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.							
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.							
TBA	– To Be Announced.							
BRL	– Brasilianischer Real							
MXN	– Mexikanischer Peso							
RUB	– Russischer Rubel							
Analyse des Gesamtvermögens								
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden								
85,85								
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden								
5,52								
Organismen für gemeinsame Anlagen								
1,91								
Finanzderivate								
1,07								
Sonstige Vermögenswerte								
5,65								
Gesamtvermögen								
100,00								

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kauf-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5,000%	Verkauf	20.06.2026	39.405	\$3.884
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000%	Verkauf	20.06.2026	192.923	4.907
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 9.660 USD)					
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)					
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 9.660 USD)					
					\$8.791
					–
					\$8.791

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	Pay Floating BRL CDI CETIP, Receive Fixed 7,024%	04.01.2027	16.899	\$ (130)
Citi	Pay Floating BRL CDI CETIP, Receive Fixed 7,024%	04.01.2027	15.900	(123)
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024%	04.01.2027	13.400	(103)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,044%	04.01.2027	11.000	(83)
Morgan Stanley	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,190%	15.06.2022	56.215	19
Morgan Stanley	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,820%	04.06.2024	134.778	(48)
Morgan Stanley	Pay Fixed 0,260%, Receive Floating USD Fed Funds Rate	15.05.2027	36.140	1.063
Morgan Stanley	Pay Fixed 0,450%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.05.2027	6.293	183
Morgan Stanley	Pay Fixed 0,780%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.2027	22.635	343
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,250%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2028	42.975	(523)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,350%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2028	40.431	(748)
Morgan Stanley	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,450%	18.07.2029	142.060	312
Morgan Stanley	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,440%	20.07.2029	147.960	320
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,200%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	7.206	745
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,225%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	3.620	355
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,520%, Receive Floating USD Sofr Compound	15.02.2047	3.638	(90)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,630%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	12.066	136
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,729%, Receive Floating USD Sofr Compound	15.02.2047	12.341	(885)
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,000%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	28.581	(2.005)
Morgan Stanley	Pay Fixed 0,900%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	17.03.2050	5.517	1.026
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,200%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	07.10.2050	7.910	921
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,000%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	03.06.2051	735	(57)
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,050%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	07.06.2051	2.210	(200)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,671%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	09.07.2051	5.948	15
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 8.077 USD)				\$ 5.438
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.290) USD)				(4.995)
Nettowersteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 6.787 USD)				\$ 443

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	14	Verkauf	AUD	20	\$ -
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	29	Verkauf	AUD	39	-
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	2.620	Verkauf	EUR	2.226	(11)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	1.322	Verkauf	USD	959	9
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	4.416	Verkauf	USD	3.247	(16)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	44.377	Verkauf	USD	52.207	209
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	24	Verkauf	USD	33	-
18.10.2021	Citi	Kauf	INR	156.175	Verkauf	USD	2.065	64
19.10.2021	BNP Paribas	Kauf	USD	7.118	Verkauf	EUR	5.993	35
19.10.2021	Citi	Kauf	USD	27.133	Verkauf	CNH	176.871	(157)
19.10.2021	Citi	Kauf	USD	2.122	Verkauf	EUR	1.800	(5)
19.10.2021	Citi	Kauf	CAD	43.091	Verkauf	USD	34.307	(156)
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	GBP	6.744	Verkauf	USD	9.335	(62)
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	CAD	25.350	Verkauf	USD	20.422	(330)
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	ZAR	29.450	Verkauf	USD	2.025	(11)
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	IDR	219.474.874	Verkauf	USD	14.871	496
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	JPY	2.167.758	Verkauf	USD	19.752	(39)
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	AUD	27.283	Verkauf	USD	20.463	(498)
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	361	Verkauf	BRL	1.900	(3)
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	23.477	Verkauf	EUR	19.740	146
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	RUB	1.415.758	Verkauf	USD	18.652	541
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	MXN	177.617	Verkauf	USD	8.789	(6)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.679 USD)							\$ 1.500	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (2.446) USD)							(1.294)	
Nettowersteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (767) USD)							\$ 206	

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro\$ Dezember 2021	Morgan Stanley	(1.434)	\$(357.873)	(187)
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Morgan Stanley	1.356	335.729	324
90 Day Euro\$ Juni 2023	Morgan Stanley	314	77.998	93
90 Day Euro\$ September 2023	Morgan Stanley	74	18.343	12
Australia 10 Year Bond September 2021	Morgan Stanley	188	20.053	577
Euro FX Currency September 2021	Morgan Stanley	9	1.329	(46)
Euro-Bund September 2021	Morgan Stanley	(453)	(93.845)	(1.730)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2021	Morgan Stanley	(25)	(6.273)	(392)
Euro-OAT September 2021	Morgan Stanley	91	17.318	310
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2021	Morgan Stanley	(13)	(17.980)	(68)
Mexican Peso Currency September 2021	Morgan Stanley	6	149	(2)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Morgan Stanley	166	22.153	3
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2021	Morgan Stanley	(92)	(13.618)	28
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2021	Morgan Stanley	(81)	(17.846)	(2)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021	Morgan Stanley	2.223	275.027	378
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2021	Morgan Stanley	169	27.542	(3)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Morgan Stanley	287	56.620	(112)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 2.931 USD)				\$ 1.725
Nicht realisierte Wertminderung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (5.784) USD)				(2.542)
Nettowertminderung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (2.853) USD)				\$ (817)

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 36,34 % (28. Februar 2021: 39,27 %)			Japan – 0,58 % (28. Februar 2021: 0,59 %)			Vereinigte Arabische Emirate – 0,48 % (28. Februar 2021: 0,20 %)		
Australien – 0,90 % (28. Februar 2021: 0,92 %)			300 Asahi Group Holdings Ltd, 1,151%, fällig 19.09.2025			USD 250 MDGH—GMTN BV, 2,875%, fällig 21.05.2030		
970 Glencore Finance Europe Ltd, 1,750%, fällig 17.03.2025			340 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 0,680%, fällig 26.01.2023			320 MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000%, fällig 10.03.2034		
1.020			345			323		
0,90			0,30			0,28		
Belgien – 1,77 % (28. Februar 2021: 1,79 %)			660			547		
140 Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2,125%, fällig 02.12.2027			660			0,48		
157			0,58			Großbritannien – 3,72 % (28. Februar 2021: 4,29 %)		
0,14			Luxemburg – 1,25 % (28. Februar 2021: 1,26 %)			100 Aviva Plc, 3,375%, fällig 04.12.2045 *		
USD 90 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350%, fällig 01.06.2040			555 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,750%, fällig 12.03.2029			112		
91			584			0,10		
0,08			260 Prologis International Funding II SA, 2,375%, fällig 14.11.2030			360 Barclays Plc, 3,375%, fällig 02.04.2025 *		
USD 140 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500%, fällig 01.06.2050			303			391		
148			0,27			270 Leeds Building Society, 1,375%, fällig 05.05.2022		
1.100 KBC Group NV, 0,002%, fällig 24.11.2022 *			500 SELP Finance Sarl, 1,500%, fällig 20.11.2025			273		
1.107			527			0,24		
0,97			1.414			1.110 Lloyds Banking Group Plc, 0,237%, fällig 21.06.2024 *		
500 KBC Group NV, 1,875%, fällig 11.03.2027 *			1.414			1.127		
505			1,25			0,99		
0,45			Niederlande – 1,76 % (28. Februar 2021: 2,09 %)			530 Natwest Group Plc, 2,500%, fällig 22.03.2023		
2.008			850 ABN AMRO Bank NV, 7,125%, fällig 06.07.2022			553		
1,77			902			0,49		
Kanada – 0,05 % (28. Februar 2021: 0,10 %)			250 CTP NV, 0,625%, fällig 27.11.2023			GBP 140 Pinewood Finance Co Ltd, 3,250%, fällig 30.09.2025		
USD 60 1011778 BC ULCC / New Red Finance Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.02.2029			253			166		
50			0,22			0,15		
0,04			320 Enxsis Holding NV, 0,750%, fällig 02.07.2031			420 Rentokil Initial Plc, 0,950%, fällig 22.11.2024		
USD 10 MEG Energy Corp, 144 A 5,875%, fällig 01.02.2029			337			433		
9			0,30			0,38		
0,01			300 ING Groep NV, 3,000%, fällig 11.04.2028 *			USD 280 Standard Chartered Plc, 3,950%, fällig 11.01.2023		
59			314			v		
0,05			0,28			580 Standard Chartered Plc, 3,125%, fällig 19.11.2024		
China – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			USD 40 Shell International Finance BV, 2,750%, fällig 06.04.2030			638		
USD 10 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144 A 2,700%, fällig 01.05.2025			36			0,56		
9			0,03			GBP 140 Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250%, fällig 15.05.2029		
0,01			156			173		
Dänemark – 0,35 % (28. Februar 2021: 0,36 %)			1.998			107		
390 Danske Bank A/S, 0,750%, fällig 02.06.2023			1,76			0,09		
397			Norwegen – 1,23 % (28. Februar 2021: 1,25 %)			4.219		
0,35			1.030 DNB Bank ASA, 0,050%, fällig 14.11.2023			3,72		
Frankreich – 1,83 % (28. Februar 2021: 2,58 %)			1.040			Vereinigte Staaten – 10,92 % (28. Februar 2021: 10,85 %)		
310 Altice France SA/France, 3,375%, fällig 15.01.2028			353			USD 50 3 M Co, 3,700%, fällig 15.04.2050		
302			0,31			51		
0,27			1.393			0,04		
600 Dassault Systemes SE, 0,125%, fällig 16.09.2026			1,23			430 Abbvie Inc, 1,250%, fällig 01.06.2024		
608			Singapur – 0,51 % (28. Februar 2021: 0,50 %)			445		
0,54			500 Temasek Financial I Ltd, 1,250%, fällig 20.11.2049			0,39		
200 IPD 3 BV, 5,500%, fällig 01.12.2025			576			USD 420 Allied Universal Holdco LLC/ Allied Universal Finance Corp/ Atlas Luxco 4 Sarl, 144 A 4,625%, fällig 01.06.2028		
209			0,51			357		
0,18			Südafrika – 0,29 % (28. Februar 2021: 0,29 %)			44		
200 RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 2,125%, fällig 27.09.2038			310 Anglo American Capital Plc, 1,625%, fällig 108.09.2025			0,04		
243			329			0,02		
0,21			Spanien – 0,67 % (28. Februar 2021: 0,66 %)			27		
700 Thales SA, 0,750%, fällig 23.01.2025			300 Banco Santander SA, 2,500%, fällig 18.03.2025			220 AT&T Inc, 3,550%, fällig 17.12.2032		
720			325			281		
0,63			0,28			0,25		
2.082			440 Tendram Brands SAU, 5,250%, fällig 15.09.2024 *			747		
1,83			767			0,66		
Deutschland – 2,87 % (28. Februar 2021: 3,83 %)			4.563			254		
100 Allianz SE, 4,750%, Perpetual *			4.02			0,22		
110			Supranational – 4,02 % (28. Februar 2021: 4,09 %)			444		
0,10			780 African Development Bank, 0,500%, fällig 21.03.2029			0,39		
200 Bayer AG, 2,375%, fällig 12.11.2079 *			3.480 European Stability Mechanism, Series EUR, 0,750%, fällig 05.09.2028			291		
202			3.745			0,26		
0,18			4.563			0,15		
300 Muenchener Rueckversicherungs Gesellschaft AG in Muenchen, 6,250%, fällig 26.05.2042 *			314			173		
314			0,28			0,15		
0,28			Schweden – 0,83 % (28. Februar 2021: 0,84 %)			57		
400 Muenchener Rueckversicherungs Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250%, fällig 26.05.2049 *			469			0,05		
469			0,41			USD 13 Bristol-Myers Squibb Co, 2,900%, fällig 26.07.2024		
1.020 NRW Bank, 0,375%, fällig 16.05.2029			1.062			12		
1.062			0,93			0,01		
0,93			1.100 Vonovia Finance BV, 0,000%, fällig 22.12.2022 *			63		
1.105			3.262			0,05		
0,97			Schweiz – 1,46 % (28. Februar 2021: 1,20 %)			62		
3.262			230 Credit Suisse Group AG, 3,250%, fällig 02.04.2026 *			0,05		
2,87			254			USD 200 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 4,500%, fällig 01.06.2033		
Israel – 0,29 % (28. Februar 2021: 0,29 %)			168			176		
USD 370 Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950%, fällig 18.12.2022			320 UBS AG/London, 0,500%, fällig 31.03.2031			0,15		
316			322			0,02		
0,28			338			0,02		
USD 10 Teva Pharmaceutical Finance Neth-erlands III BV, 2,800%, fällig 21.07.2023			330 UBS Group AG, 1,750%, fällig 16.11.2022			19		
9			338			0,02		
0,01			550 UBS Group AG, 1,500%, fällig 30.11.2024			27		
USD 10 Teva Pharmaceutical Finance Neth-erlands III BV, 3,150%, fällig 01.10.2026			571			0,02		
8			1.653			790 Citigroup Inc, 1,750%, fällig 28.01.2025		
333			1,46			839		
0,29			Italien – 0,55 % (28. Februar 2021: 0,56 %)			10 Coca-Cola Co/The, 2,500%, fällig 01.06.2040		
620 UniCredit SpA, 2,000%, fällig 23.09.2029 *			628			8		
628			0,55			0,01		
0,55			USD 10 Coca-Cola Co/The, 2,600%, fällig 01.06.2050			8		
						0,01		

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			USD 10 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144 A 4,000%, fällig 15.01.2032			Indonesien – 2,20 % (28. Februar 2021: 2,28 %)		
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			USD 60 Texas Instruments Inc, 1,750%, fällig 04.05.2030			560 Indonesia Government International Bond, 1,400%, fällig 30.10.2031		
USD 50 Coca-Cola Co/The, 2,500%, fällig 15.03.2051	41	0,04	USD 50 T-Mobile USA Inc, 4,000%, fällig 15.04.2022	9	0,01	USD 1.950 Indonesia Government International Bond, 4,200%, fällig 15.10.2050	576	0,51
USD 80 Costco Wholesale Corp, 1,600%, fällig 20.04.2030	67	0,06	USD 10 T-Mobile USA Inc, 2,250%, fällig 15.02.2026	43	0,04		1.916	1,69
USD 290 CSC Holdings LLC, 144 A 4,125%, fällig 01.12.2030	246	0,22	USD 40 T-Mobile USA Inc, 2,625%, fällig 15.02.2029	9	0,01		2.492	2,20
USD 140 CVS Health Corp, 3,750%, fällig 01.04.2030	134	0,12	USD 110 T-Mobile USA Inc, 3,875%, fällig 15.04.2030	34	0,03	Italien – 9,01 % (28. Februar 2021: 10,10 %)		
USD 90 Delta Air Lines Inc, 3,800%, fällig 19.04.2023	79	0,07	USD 30 T-Mobile USA Inc, 2,875%, fällig 15.02.2031	104	0,09	2.650 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4,500%, fällig 01.03.2024	2.972	2,62
USD 170 Delta Air Lines Inc, 144 A 7,000%, fällig 01.05.2025	168	0,15	USD 40 T-Mobile USA Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.04.2031	26	0,02	1.900 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144 A 0,400%, fällig 15.05.2030	2.167	1,91
USD 100 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,500%, fällig 20.10.2025	91	0,08	USD 10 United Airlines Inc, 144 A 4,375%, fällig 15.04.2026	36	0,03	3.795 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144 A 3,250%, fällig 01.09.2046	5.085	4,48
USD 90 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,750%, fällig 20.10.2028	85	0,07	USD 230 United Airlines Inc, 144 A 4,625%, fällig 15.04.2029	9	0,01		10.224	9,01
USD 70 Devon Energy Corp, 144 A 8,250%, fällig 01.08.2023	67	0,06	USD 20 UnitedHealth Group Inc, 3,750%, fällig 15.07.2025	202	0,18	Mexiko – 2,02 % (28. Februar 2021: 1,94 %)		
430 DH Europe Finance II Sarl, 1,800%, fällig 108.09.2049	465	0,41	USD 50 Visa Inc, 2,050%, fällig 15.04.2030	19	0,02	850 Mexico Government International Bond, 2,875%, fällig 08.04.2039	892	0,79
USD 60 Exxon Mobil Corp, 3,452%, fällig 15.04.2051	56	0,05	USD 60 Visa Inc, 2,700%, fällig 15.04.2040	44	0,04	USD 1.500 Mexico Government International Bond, 4,600%, fällig 23.01.2046	1.396	1,23
USD 200 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000%, fällig 13.11.2030	179	0,16	390 Wells Fargo & Co, 2,250%, fällig 02.05.2023	53	0,05		2.288	2,02
USD 200 Freeport-McMoRan Inc, 4,625%, fällig 01.08.2030	19	0,02	450 Wells Fargo & Co, 1,625%, fällig 02.06.2025	407	0,36	Katar – 0,69 % (28. Februar 2021: 0,65 %)		
USD 200 Freeport-McMoRan Inc, 5,450%, fällig 15.03.2043	217	0,19		477	0,42	USD 710 Qatar Government International Bond, 4,817%, fällig 14.03.2049	787	0,69
520 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000%, fällig 27.07.2023	542	0,48		12.397	10,92	Rumänien – 0,94 % (28. Februar 2021: 0,71 %)		
540 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,125%, fällig 30.09.2024	576	0,51	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 39.387 EUR)	41.253	36,34	1.070 Romanian Government International Bond, 2,000%, fällig 14.04.2033	1.068	0,94
USD 50 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500%, fällig 01.04.2025	46	0,04	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 55,93 % (28. Februar 2021: 53,84 %)			Südafrika – 1,54 % (28. Februar 2021: 1,48 %)		
680 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000%, fällig 01.11.2028	756	0,67	Belgien – 3,03 % (28. Februar 2021: 3,11 %)			USD 2.000 Republic of South Africa Government International Bond, 4,300%, fällig 12.10.2028	1.752	1,54
USD 70 Home Depot Inc/The, 2,700%, fällig 15.04.2030	64	0,06	China – 1,12 % (28. Februar 2021: 1,15 %)			Südkorea – 1,03 % (28. Februar 2021: 1,05 %)		
USD 20 Home Depot Inc/The, 3,300%, fällig 15.04.2040	19	0,02	2.020 Kingdom of Belgium Government Bond, Series 71X 3,750%, fällig 22.06.2045	3.443	3,03	1.150 Export-Import Bank of Korea, 0,375%, fällig 26.03.2024	1.171	1,03
USD 210 Home Depot Inc/The, 3,350%, fällig 15.04.2050	198	0,17	Frankreich – 9,17 % (28. Februar 2021: 9,40 %)			Spanien – 7,66 % (28. Februar 2021: 7,79 %)		
580 John Deere Bank SA, 0,000%, fällig 03.10.2022 *	583	0,51	680 China Government International Bond, 1,000%, fällig 12.11.2039	674	0,60	1.350 Spain Government Bond, 0,450%, fällig 30.10.2022	1.368	1,20
USD 60 JPMorgan Chase & Co, 2,522%, fällig 22.04.2031 *	53	0,05	590 Export-Import Bank of China/The, 0,300%, fällig 06.03.2022	592	0,52	1.600 Spain Government Bond, 144 A 1,300%, fällig 30.10.2026	1.736	1,53
USD 110 JPMorgan Chase & Co, 3,109%, fällig 22.04.2051 *	98	0,09		1.266	1,12	790 Spain Government Bond, 144 A 1,400%, fällig 30.04.2028	870	0,77
USD 20 McDonald's Corp, 3,625%, fällig 01.09.2049	19	0,02	1.510 French Republic Government Bond OAT, 1,000%, fällig 25.05.2027	1.638	1,44	1.330 Spain Government Bond, 144 A 2,900%, fällig 30.10.2046	1.856	1,64
USD 70 McDonald's Corp, 4,200%, fällig 01.04.2050	73	0,06	2.935 French Republic Government Bond OAT, 3,250%, fällig 25.05.2045	4.698	4,14	2.110 Spain Government Bond, Series 30 Y, 144 A 2,700%, fällig 30.10.2048	2.864	2,52
USD 230 Morgan Stanley, 3,622%, fällig 01.04.2031 *	218	0,19	880 French Republic Government Bond OAT, 144 A 1,500%, fällig 25.05.2050	1.061	0,93		8.694	7,66
USD 120 Netflix Inc, 5,500%, fällig 15.02.2022	104	0,09	590 French Republic Government Bond OAT, 4,000%, fällig 25.04.2060	1.210	1,07	Vereinigte Arabische Emirate – 0,71 % (28. Februar 2021: 0,68 %)		
320 Netflix Inc, 3,875%, fällig 15.11.2029	388	0,34	1.600 UNEDIC ASSEO, 1,250%, fällig 25.05.2033	1.804	1,59	USD 290 Abu Dhabi Government International Bond, 3,125%, fällig 16.04.2030	271	0,24
USD 40 Northrop Grumman Corp, 5,250%, fällig 01.05.2050	48	0,04		10.411	9,17	USD 540 Abu Dhabi Government International Bond, 3,875%, fällig 16.04.2050	536	0,47
USD 90 NVIDIA Corp, 3,500%, fällig 01.04.2050	88	0,08	Deutschland – 15,71 % (28. Februar 2021: 9,93 %)				807	0,71
USD 50 PayPal Holdings Inc, 1,350%, fällig 01.06.2023	43	0,04	4.080 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250%, fällig 15.02.2027	4.291	3,78	Großbritannien – 0,45 % (28. Februar 2021: 1,42 %)		
USD 50 PayPal Holdings Inc, 1,650%, fällig 01.06.2025	44	0,04	330 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 98X 4,750%, fällig 04.07.2028	455	0,40	GBP 280 United Kingdom Gilt, 2,500%, fällig 22.07.2065	506	0,45
450 Prologis Euro Finance LLC, 1,875%, fällig 05.01.2029	503	0,44	2.700 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, fällig 15.08.2030	2.816	2,48	Vereinigte Staaten – 0,65 % (28. Februar 2021: 0,56 %)		
USD 40 Raytheon Technologies Corp, 2,250%, fällig 01.07.2030	35	0,03	8.030 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, fällig 15.02.2031	8.361	7,36	USD 1.000 United States Treasury Note/ Bond, 1,375%, fällig 15.08.2050	741	0,65
USD 42 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144 A 8,000%, fällig 20.09.2025	40	0,03	1.060 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 2007X 4,250%, fällig 04.07.2039	1.915	1,69			
USD 40 State Street Corp, 3,152%, fällig 30.03.2031 *	37	0,03		17.838	15,71	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 60.157 EUR)	63.488	55,93

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts	Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts
Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,72 % (28. Februar 2021: 1,28 %)					
USD 964 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	817	0,72			
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Kosten 814 EUR)	817	0,72			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 100.358 EUR)					
	105.558	92,99			
Zinsswaps – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,19 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	15	0,01			
Devisenterminkontrakte – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,04 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	186	0,16			
Futures – 0,11 % (28. Februar 2021: 0,77 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	120	0,11			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
	105.879	93,27			
Verträge					
Verkäufte Optionen – 0,00 % (28. Februar 2021: (0,03 %)) (710) EUR Call/NOK Put 10,30X fällig 208.09.2021 – JP Morgan	(5)	–			
Summe verkaufte Optionen (Kosten (7) EUR)	(5)	–			
Credit Default Swaps – (0,10 %) (28. Februar 2021: (0,09 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(119)	(0,10)			
Inflationsswaps – (0,07 %)(28. Februar 2021: 0,00 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(81)	(0,07)			
Zinsswaps – (0,03 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(34)	(0,03)			
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: (0,17 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(6)	–			
Futures – (0,45 % (28. Februar 2021: (0,46 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(506)	(0,45)			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
	(751)	(0,65)			
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
	105.128	92,62			
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen					
	8.394	7,38			
Gesamtnettvermögen					
	€113.522	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 17.193.000 EUR und machten 15,14 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihezins entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

ABKÜRZUNGEN:

Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

GBP – Britisches Pfund Sterling

USD – US-Dollar

	% von Gesamt Vermögen
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	91,58
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,71
Finanzderivate	0,28
Sonstige Vermögenswerte	7,43
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzinheit	Kauf-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000%	Kauf	20.06.2026	4.450	€ (119)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – EUR)					€ –
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (105) EUR)					(119)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (105) EUR)					€ (119)

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating EUR 6M Euribor Reuters, Receive Fixed -0,250%	30.06.2026	3.320	€ 15
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,500%, Receive Floating EUR 6M Euribor Reuters	30.06.2051	570	(34)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 217 EUR)				€ 15
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – EUR)				(34)
Nettowertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 217 EUR)				€ (19)

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	USD-USA-CPI-U	28.04.2026	3.060	€ (81)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – EUR)				€ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – EUR)				(81)
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – EUR)				€ (81)

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
18.11.2021	Citi	Kauf	PLN	5.030	Verkauf	EUR	1.094	€	17
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	EUR	390	Verkauf	SEK	3.980		(1)
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	EUR	6.659	Verkauf	USD	7.829		39
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	EUR	547	Verkauf	AUD	872		7
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	EUR	149	Verkauf	CAD	220		2
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	AUD	190	Verkauf	EUR	117		–
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	NOK	16.947	Verkauf	EUR	1.630		18
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	HUF	809.300	Verkauf	EUR	2.275		35
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	AUD	570	Verkauf	EUR	354		(1)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	EUR	1.206	Verkauf	GBP	1.023		16
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	EUR	113	Verkauf	NOK	1.200		(4)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	EUR	6.280	Verkauf	USD	7.382		38
18.11.2021	UBS	Kauf	SEK	3.981	Verkauf	EUR	389		1
18.11.2021	UBS	Kauf	EUR	1.866	Verkauf	USD	2.191		13
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 42 EUR)								€	186
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (187) EUR)									(6)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (145) EUR)								€	180

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
90 Day Euro\$ Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(74)	€ (15.641)	€ (8)	
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	84	17.614	(21)	
Canadian 5 Year Bond Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	7	592	1	
Euro-Bobl September 2021	Bank of America Merrill Lynch	4	540	4	
Euro-BTP September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(920)	(28)	
Euro-Bund Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(4)	(690)	3	
Euro-Bund September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(22)	(3.860)	(19)	
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(28)	(5.950)	(403)	
Euro-OAT September 2021	Bank of America Merrill Lynch	5	806	20	
Long Gilt Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(25)	(3.733)	24	
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(243)	(27.465)	36	
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(13)	(1.630)	3	
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(37)	(6.904)	(5)	
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	216	22.633	29	
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(31)	(4.279)	(13)	
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	15	2.506	(9)	
Nicht realisierte Wertsteigerung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 855 EUR)				€	120
Nicht realisierte Wertminderung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (509) EUR)					(506)
Nettowertminderung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 346 EUR)				€	(386)

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 3,85 % (28. Februar 2021: 0,75 %)			50 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Series 2005 8XS, Class M1X 0,729%, fällig 25.04.2035 *	49	0,08	Macau – 0,68 % (28. Februar 2021: 0,79 %)		
100 AGL CLO 12 Ltd, Series 2021 12A, Class D, 144 A 2,980%, fällig 20.07.2034 *	100	0,16	96 WaMu Mortgage Pass- Through Certificates Series 2005-AR15 Trust, Series 2005 AR15X Class A1C4X 0,884%, fällig 25.11.2045 *	64	0,11	400 Wynn Macau Ltd, 144 A 5,500%, fällig 15.01.2026	411	0,68
100 AGL CLO 6 Ltd, Series 2020 6A, Class ER, 144 A 6,634%, fällig 20.07.2034 *	100	0,17	Summe hypothekarisch gesicherte Wertpapiere (Kosten 625 USD)			Südkorea – 0,10 % (28. Februar 2021: 0,32 %)		
100 Apex Credit CLO 2017 Ltd, Series 2017 1A, Class D, 144 A 3,725%, fällig 24.04.2029 *	100	0,16	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 75,43 % (28. Februar 2021: 82,67 %)			Schweiz – 0,72 % (28. Februar 2021: 1,66 %)		
250 Apidos CLO XXXVI, Series 2021 36A, Class D, 144 A 0,000%, fällig 20.07.2034 *	250	0,41	Bermuda – 0,70 % (28. Februar 2021: 0,80 %)			200 Credit Suisse Group AG, 144 A 7,500%, Perpetual *	216	0,36
100 Ballyrock CLO 16 Ltd, Series 2021 16A, Class D, 144 A 6,385%, fällig 20.07.2034 *	99	0,16	Brasilien – 0,04 % (28. Februar 2021: 0,09 %)			200 UBS Group AG, 144 A 7,000%, Perpetual *	220	0,36
320 Canyon Capital CLO 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Class DR, 144 A 3,112%, fällig 15.07.2030 *	320	0,53	Kanada – 2,88 % (28. Februar 2021: 2,46 %)			Vereinigte Staaten – 65,54 % (28. Februar 2021: 64,91 %)		
150 Canyon CLO 2021-3 Ltd, Series 2021 3A, Class E, 144 A 6,295%, fällig 15.07.2034 *	150	0,25	400 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144 A 7,625%, fällig 15.10.2025	426	0,70	350 AdaptHealth LLC, 144 A 6,125%, fällig 01.08.2028	373	0,62
51 First Franklin Mortgage Loan Trust 2004-FFH1X Series 2004 FFH1X Class M1X 0,759%, fällig 25.03.2034 *	50	0,08	Kaimaninseln – 0,58 % (28. Februar 2021: 1,17 %)			150 ADT Security Corp/The, 4,125%, fällig 15.06.2023	158	0,26
100 Goldentree Loan Management US Clo 10 Ltd, Series 2021 10A, Class E, 144 A 6,317%, fällig 20.07.2034 *	100	0,16	183 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 6,500%, fällig 15.09.2024	181	0,30	320 Adtalem Global Education Inc, 144 A 5,500%, fällig 01.03.2028	328	0,54
100 Goldentree Loan Management US Clo 8 Ltd, Series 2020 8A, Class FR, 144 A 0,000%, fällig 20.10.2034 *	97	0,16	171 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144 A 6,500%, fällig 15.09.2024	170	0,28	190 Akumin Inc, 144 A 7,000%, fällig 01.11.2025	180	0,30
150 Golub Capital Partners CLO 37B Ltd, Series 2018 37A, Class D, 144 A 3,434%, fällig 20.07.2030 *	149	0,25	Chile – 0,03 % (28. Februar 2021: 0,11 %)			180 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144 A 10,500%, fällig 15.02.2028	174	0,29
100 Golub Capital Partners CLO 53B Ltd, Series 2021 53A, Class E, 144 A 6,830%, fällig 20.07.2034 *	100	0,16	20 Liberty Latin America Ltd, 2,000%, fällig 15.07.2024	20	0,03	120 Alliance Data Systems Corp, 144 A 4,750%, fällig 15.12.2024	123	0,20
100 Nassau LLC, Series 2021 IA, Class D, 144 A 3,892%, fällig 26.08.2034 *	100	0,16	Frankreich – 1,16 % (28. Februar 2021: 1,56 %)			150 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 6,625%, fällig 15.07.2026	86	0,14
46 New Century Home Equity Loan Trust 2003-6X Series 2003 6X Class M1X 1,164%, fällig 25.01.2034 *	46	0,08	280 Altice France SA/France, 144 A 7,375%, fällig 01.05.2026	291	0,48	400 Allied Universal Holdco LLC/ Allied Universal Finance Corp/ Atlas Luxco 4 Sarl, 144 A 4,625%, fällig 01.06.2028	402	0,66
77 Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1X Series 2007 FXD1X Class 3A4X 5,860%, fällig 25.01.2037	78	0,13	200 Banijay Entertainment SASU, 144 A 5,375%, fällig 01.03.2025	205	0,34	190 Alta Equipment Group Inc, 144 A 5,625%, fällig 15.04.2026	195	0,32
100 Point Au Roche Park CLO Ltd, Series 2021 1A, Class D, 144 A 2,976%, fällig 20.07.2034 *	100	0,17	200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025	206	0,34	10 Alteryx Inc, 0,500%, fällig 01.08.2024	0,02	–
150 RR 18 Ltd, Series 2021 18A, Class D, 144 A 0,000%, fällig 15.10.2034 *	150	0,25	Deutschland – 0,40 % (28. Februar 2021: 1,68 %)			– Ambac Assurance Corp, 144 A 5,100%, Perpetual	–	–
250 Vibrant Clo VII Ltd, Series 2017 7A, Class C, 144 A 3,734%, fällig 15.09.2030 *	247	0,41	30 Mercer International Inc, 5,125%, fällig 01.02.2029	30	0,05	210 American Airlines Inc, 144 A 11,750%, fällig 15.07.2025	261	0,43
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Kosten 2.331 USD)			2.336 3,85			440 American Airlines Inc/ AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144 A 5,500%, fällig 20.04.2026		
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere – 1,07 % (28. Februar 2021: 3,01 %)			200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			8 American Axle & Manufacturing Inc, 6,250%, fällig 01.04.2025		
70 Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Series 2004 AR1X Class 6M2X 2,184%, fällig 25.02.2034 *	75	0,12	702 1,16			100 American Axle & Manufacturing Inc, 6,250%, fällig 15.03.2026		
260 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2017 DNA3X Class B1X 4,534%, fällig 25.03.2030 *	275	0,46	200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			210 American News Co LLC, 144 A 8,500%, fällig 01.09.2026		
37 Impac CMB Trust Series 2004- 6X Series 2004 6X Class 2A, 6,060%, fällig 25.10.2034	40	0,07	200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			120 Apache Corp, 4,875%, fällig 15.11.2027		
105 Lehman XS Trust Series 2006-12 N, Series 2006 12N, Class A31 A, 0,484%, fällig 25.08.2046 *	105	0,17	200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			185 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 4,750%, fällig 23.08.2022		
58 Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2003-A1X Series 2003 A1X Class M, 6,629%, fällig 25.05.2033 *	38	0,06	200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			110 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 5,375%, fällig 15.10.2023		
			200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			200 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144 A 3,250%, fällig 01.09.2028		
			200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			200 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144 A 5,250%, fällig 15.08.2027		
			200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			50 Bank of America Corp, Series FF, 5,875%, Perpetual *		
			200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			180 Bath & Body Works Inc, 144 A 9,375%, fällig 01.07.2025		
			200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			300 Bath & Body Works Inc, 5,250%, fällig 01.02.2028		
			200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			410 Bausch Health Americas Inc, 144 A 9,250%, fällig 01.04.2026		
			200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			64 Bausch Health Cos Inc, 6,125%, fällig 15.04.2025		
			200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			110 Bausch Health Cos Inc, 144 A 9,000%, fällig 15.12.2025		
			200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			140 Bausch Health Cos Inc, 144 A 5,750%, fällig 15.08.2027		
			200 Banijay Entertainment SASU, 5,375%, fällig 01.03.2025			200 Bausch Health Cos Inc, 144 A 7,000%, fällig 15.01.2028		

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			40 DraftKings Inc, 144 A Zero coupon, fällig 15.03.2028	39	0,06	70 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144 A 5,250%, fällig 15.03.2022	70	0,12
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)			40 Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144 A 6,625%, fällig 15.07.2025	42	0,07	170 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144 A 4,250%, fällig 01.02.2027	171	0,28
40 BCPE Empire Holdings Inc, 144 A 7,625%, fällig 01.05.2027	40	0,07	100 Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144 A 5,500%, fällig 30.01.2026	104	0,17	320 LD Holdings Group LLC, 144 A 6,500%, fällig 01.11.2025	327	0,54
510 Berry Petroleum Co LLC, 144 A 7,000%, fällig 15.02.2026	507	0,84	40 Entegris Inc, 144 A 4,375%, fällig 15.04.2028	42	0,07	160 LD Holdings Group LLC, 144 A 6,125%, fällig 01.04.2028	158	0,26
90 Berry Petroleum Co LLC, 7,000%, fällig 15.02.2026	89	0,15	30 Entegris Inc, 144 A 3,625%, fällig 01.05.2029	31	0,05	40 Legacy LifePoint Health LLC, 4,375%, fällig 15.02.2027	40	0,07
60 Blackstone Mortgage Trust Inc, 4,375%, fällig 05.05.2022	61	0,10	130 EQM Midstream Partners LP, 4,000%, fällig 01.08.2024	133	0,22	250 Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144 A 5,000%, fällig 01.02.2026	258	0,43
350 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144 A 7,625%, fällig 15.12.2025	379	0,63	230 EQM Midstream Partners LP, 144 A 6,000%, fällig 01.07.2025	249	0,41	43 Lehman Escrow Receipt, Zero coupon, Perpetual ^{frs}	1	–
250 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144 A 6,625%, fällig 15.07.2026	261	0,43	250 EQM Midstream Partners LP, 4,125%, fällig 01.12.2026	255	0,42	90 Match Group Holdings II LLC, 144 A 5,000%, fällig 15.12.2027	95	0,16
200 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144 A 6,000%, fällig 01.02.2026	209	0,34	190 EQM Midstream Partners LP, 144 A 6,500%, fällig 01.07.2027	212	0,35	280 MGM Resorts International, 5,500%, fällig 15.04.2027	305	0,50
450 Caesars Entertainment Inc, 144 A 6,250%, fällig 01.07.2025	476	0,79	10 EQM Midstream Partners LP, 5,500%, fällig 15.07.2028	11	0,02	90 Michaels Cos Inc/The, 144 A 5,250%, fällig 01.05.2028	93	0,15
270 Carnival Corp, 144 A 10,500%, fällig 01.02.2026	312	0,51	200 EQT Corp, 6,625%, fällig 01.02.2025	230	0,38	20 Microchip Technology Inc, 4,250%, fällig 01.09.2025	21	0,03
150 Carnival Corp, 144 A 9,875%, fällig 01.08.2027	173	0,29	370 EQT Corp, 144 A 3,125%, fällig 15.05.2026	381	0,63	100 Midcap Financial Issuer Trust, 144 A 6,500%, fällig 01.05.2028	105	0,17
250 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 5,500%, fällig 01.05.2026	258	0,43	50 Exterran Energy Solutions LP / EES Finance Corp, 8,125%, fällig 01.05.2025	45	0,07	70 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144 A 6,500%, fällig 20.06.2027	76	0,13
140 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 5,125%, fällig 01.05.2027	147	0,24	90 Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 7,875%, fällig 15.11.2025	94	0,16	110 Minerals Technologies Inc, 144 A 5,000%, fällig 01.07.2028	115	0,19
60 CDW LLC / CDW Finance Corp, 4,125%, fällig 01.05.2025	63	0,10	200 Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144 A 7,875%, fällig 15.11.2025	209	0,35	250 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000%, fällig 15.10.2027	265	0,44
130 Centene Corp, 4,250%, fällig 15.12.2027	138	0,23	210 Ford Motor Co, 9,000%, fällig 22.04.2025	257	0,42	70 Murphy Oil USA Inc, 5,625%, fällig 01.05.2027	74	0,12
230 Century Communities Inc, 5,875%, fällig 15.07.2025	237	0,39	200 Ford Motor Credit Co LLC, 5,125%, fällig 16.06.2025	220	0,36	60 Navient Corp, 5,000%, fällig 15.03.2027	63	0,10
80 Cheesecake Factory Inc/The, 0,375%, fällig 15.06.2026	75	0,12	630 Ford Motor Credit Co LLC, 2,700%, fällig 10.08.2026	637	1,05	360 NCL Corp Ltd, 144 A 12,250%, fällig 15.05.2024	425	0,70
70 Cheniere Energy Inc, 4,250%, fällig 15.03.2045	59	0,10	330 Forestar Group Inc, 144 A 3,850%, fällig 15.05.2026	333	0,55	50 NCL Corp Ltd, 3,625%, fällig 15.12.2024	47	0,08
270 Cheniere Energy Partners LP, 144 A 4,000%, fällig 01.03.2031	285	0,47	160 Freerport-McMoRan Inc, 4,550%, fällig 14.11.2024	173	0,29	180 NCL Corp Ltd, 144 A 3,625%, fällig 15.12.2024	170	0,28
20 Chesapeake Energy Corp, 144 A 5,500%, fällig 01.02.2026	21	0,03	70 Full House Resorts Inc, 144 A 8,250%, fällig 15.02.2028	75	0,12	180 NCL Corp Ltd, 144 A 10,250%, fällig 01.02.2026	208	0,34
150 CHS/Community Health Systems Inc, 144 A 6,625%, fällig 15.02.2025	158	0,26	240 Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 5,625%, fällig 15.06.2024	236	0,39	50 NCL Corp Ltd, 144 A 5,875%, fällig 15.03.2026	50	0,08
170 CHS/Community Health Systems Inc, 8,000%, fällig 15.03.2026	182	0,30	10 GEO Group Inc/The, 5,125%, fällig 01.04.2023	10	0,02	80 Netflix Inc, 4,375%, fällig 15.11.2026	91	0,15
190 CHS/Community Health Systems Inc, 144 A 8,000%, fällig 15.03.2026	204	0,34	170 GEO Group Inc/The, 5,875%, fällig 15.10.2024	154	0,25	160 NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC, 144 A 7,125%, fällig 01.04.2026	170	0,28
70 Cinemark USA Inc, 144 A 5,875%, fällig 15.03.2026	70	0,12	200 GEO Group Inc/The, 6,000%, fällig 15.04.2026	169	0,28	60 NMI Holdings Inc, 144 A 7,375%, fällig 01.06.2025	68	0,11
40 Citigroup Inc, Series M, 6,300%, Perpetual *	43	0,07	30 Global Medical Response Inc, 144 A 6,500%, fällig 01.10.2025	31	0,05	310 Northern Oil and Gas Inc, 144 A 8,125%, fällig 01.03.2028	322	0,53
102 Cogent Communications Group Inc, 5,375%, fällig 01.03.2022	103	0,17	70 Golden Nugget Inc, 6,750%, fällig 15.10.2024	70	0,12	610 Oasis Petroleum Inc, 144 A 6,375%, fällig 01.06.2026	637	1,05
390 CommScope Inc, 144 A 8,250%, fällig 01.03.2027	412	0,68	120 Granite US Holdings Corp, 144 A 11,000%, fällig 01.10.2027	134	0,22	40 Occidental Petroleum Corp, 5,550%, fällig 15.03.2026	45	0,07
120 Comstock Resources Inc, 144 A 7,500%, fällig 15.05.2025	124	0,21	100 Greif Inc, 144 A 6,500%, fällig 01.03.2027	105	0,17	460 Occidental Petroleum Corp, 3,400%, fällig 15.04.2026	473	0,78
300 Continental Resources Inc/OK, 3,800%, fällig 01.06.2024	321	0,53	60 Halozyne Therapeutics Inc, 144 A 0,250%, fällig 01.03.2027	55	0,09	430 Occidental Petroleum Corp, 3,200%, fällig 15.08.2026	444	0,73
20 CoreCivic Inc, 4,625%, fällig 01.05.2023	20	0,03	50 Hanesbrands Inc, 144 A 4,875%, fällig 15.05.2026	55	0,09	260 Par Pharmaceutical Inc, 144 A 7,500%, fällig 01.04.2027	264	0,43
120 CoreCivic Inc, 8,250%, fällig 15.04.2026	127	0,21	270 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144 A 5,750%, fällig 20.01.2026	285	0,47	150 Party City Holdings Inc, 144 A 8,750%, fällig 15.02.2026	157	0,26
50 Covanta Holding Corp, 5,875%, fällig 01.07.2025	52	0,09	190 HCA Inc, 5,375%, fällig 01.02.2025	214	0,35	110 PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp, 144 A 9,250%, fällig 15.05.2025	106	0,18
200 CSC Holdings LLC, 144 A 5,375%, fällig 01.02.2028	211	0,35	250 HCA Inc, 5,375%, fällig 01.09.2026	289	0,48	490 Penn Virginia Escrow LLC, 144 A 9,250%, fällig 15.08.2026	477	0,79
110 DCP Midstream Operating LP, 4,950%, fällig 01.04.2022	111	0,18	200 iHeartCommunications Inc, 144 A 5,250%, fällig 15.08.2027	210	0,35	250 PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144 A 4,750%, fällig 15.02.2028	261	0,43
120 DCP Midstream Operating LP, 5,375%, fällig 15.07.2025	132	0,22	140 IIP Operating Partnership LP, 144 A 5,500%, fällig 25.05.2026	147	0,24	210 PM General Purchaser LLC, 144 A 9,500%, fällig 01.10.2028	229	0,38
20 Delta Air Lines Inc, 2,900%, fällig 28.10.2024	20	0,03	200 International Game Technology Plc, 144 A 4,125%, fällig 15.04.2026	208	0,34	340 Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144 A 5,750%, fällig 15.04.2026	368	0,61
40 Delta Air Lines Inc, 144 A 7,000%, fällig 01.05.2025	47	0,08	190 Istar Inc, 4,250%, fällig 01.08.2025	198	0,33	150 Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 5,750%, fällig 15.04.2026	162	0,27
400 Delta Air Lines Inc, 7,375%, fällig 15.01.2026	471	0,78	150 JB Poindexter & Co Inc, 144 A 7,125%, fällig 15.04.2026	158	0,26	90 Range Resources Corp, 4,875%, fällig 15.05.2025	93	0,15
130 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,500%, fällig 20.10.2025	140	0,23	60 Kraton Polymers LLC / Kraton Polymers Capital Corp, 144 A 4,250%, fällig 15.12.2025	62	0,10			
870 DISH DBS Corp, 7,750%, fällig 01.07.2026	998	1,65						
320 Diversified Healthcare Trust, 9,750%, fällig 15.06.2025	352	0,58						

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			230 Tenet Healthcare Corp, 144 A 7,500%, fällig 01.04.2025			220 Air Canada, 4,250%, fällig 27.07.2028 *		
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			130 T-Mobile USA Inc, 2,625%, fällig 15.04.2026			90 Baldwin Risk Partners, LLC, 4,000%, fällig 14.10.2027 *		
390 Range Resources Corp, 9,250%, fällig 01.02.2026	427	0,70	150 TransDigm Inc, 144 A 8,000%, fällig 15.12.2025	134	0,22	50 Bass Pro Group LLC, 5,000%, fällig 26.02.2028 *	90	0,15
300 Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144 A 7,625%, fällig 15.06.2025	323	0,53	70 TransDigm Inc, 144 A 6,250%, fällig 15.03.2026	74	0,12	69 Beta Sub LLC, 3,864%, fällig 06.08.2026 *	50	0,08
90 Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144 A 0,250%, fällig 15.06.2026	90	0,15	260 TransDigm Inc, 5,500%, fällig 15.11.2027	266	0,44	140 Carnival Corp, 3,750%, fällig 30.06.2025 *	69	0,11
300 RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc, 144 A 9,750%, fällig 01.12.2026	320	0,53	200 Triton Water Holdings Inc, 144 A 6,250%, fällig 01.04.2029	198	0,33	48 Clarios Global LP, 3,342%, fällig 30.04.2026 *	139	0,23
60 Resolute Forest Products Inc, 144 A 4,875%, fällig 01.03.2026	62	0,10	37 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875%, fällig 15.01.2026	39	0,06	80 Claros Mortgage Trust, Inc., 6,000%, fällig 09.08.2026 *	47	0,08
200 RLI Lodging Trust LP, 144 A 3,750%, fällig 01.07.2026	202	0,33	10 United Airlines Holdings Inc, 4,250%, fällig 01.10.2022	10	0,02	34 CoreCivic Inc, 5,500%, fällig 18.12.2024 *	80	0,13
150 Rocket Mortgage LLC, 144 A 5,250%, fällig 15.01.2028	158	0,26	460 United Airlines Inc, 144 A 4,375%, fällig 15.04.2026	478	0,79	90 CP Atlas Buyer, 4,250%, fällig 27.12.2027 *	34	0,06
300 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144 A 4,250%, fällig 01.07.2026	293	0,48	70 United Rentals North America Inc, 5,500%, fällig 15.05.2027	74	0,12	249 DCert Buyer, Inc., 4,092%, fällig 16.10.2026 *	89	0,15
245 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144 A 5,500%, fällig 31.08.2026	249	0,41	100 Univision Communications Inc, 144 A 9,500%, fällig 01.05.2025	109	0,18	260 DIRECTV Financing LLC, 5,750%, fällig 22.07.2027 *	249	0,41
369 RR Donnelley & Sons Co, 144 A 6,125%, fällig 01.11.2026	388	0,64	40 Urban One Inc, 144 A 7,375%, fällig 01.02.2028	43	0,07	50 Equinox Holdings Inc, 10,000%, fällig 08.03.2024 *	50	0,08
450 Scientific Games International Inc, 144 A 8,250%, fällig 15.03.2026	479	0,79	270 US Renal Care Inc, 144 A 10,625%, fällig 15.07.2027	284	0,47	99 Eyecare Partners LLC, 3,857%, fällig 05.02.2027 *	98	0,16
160 Scientific Games International Inc, 144 A 7,000%, fällig 15.05.2028	173	0,28	340 Vericast Corp, 144 A 11,000%, fällig 15.09.2026	362	0,60	60 Eyecare Partners LLC, 8,357%, fällig 21.01.2027 *	59	0,10
390 Service Properties Trust, 4,350%, fällig 01.10.2024	396	0,65	90 VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144 A 3,750%, fällig 15.02.2027	94	0,15	100 First Brands Group LLC, 6,000%, fällig 24.03.2027 *	101	0,17
260 Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144 A 4,625%, fällig 01.11.2026	270	0,45	220 Viking Cruises Ltd, 6,250%, fällig 15.05.2025	221	0,36	50 Focus Financial Partners LLC, 2,092%, fällig 03.07.2024 *	49	0,08
210 Sirius XM Radio Inc, 144 A 4,000%, fällig 15.07.2028	215	0,35	150 Viking Cruises Ltd, 144 A 6,250%, fällig 15.05.2025	151	0,25	66 Global Medical Response, Inc, 5,750%, fällig 24.09.2025 *	67	0,11
60 Sizzling Platter LLC / Sizzling Platter Finance Corp, 144 A 8,500%, fällig 28.11.2025	62	0,10	110 Viking Cruises Ltd, 144 A 13,000%, fällig 15.05.2025	127	0,21	16 GlobalFranz Enterprises Inc, 5,104%, fällig 02.05.2026 *	16	0,03
330 Southwestern Energy Co, 4,100%, fällig 15.03.2022	331	0,55	190 Western Midstream Operating LP, 4,350%, fällig 01.02.2025	200	0,33	150 Hayward Industries Inc., 3,250%, fällig 14.05.2028 *	149	0,25
170 Spirit Airlines Inc, 1,000%, fällig 15.05.2026	158	0,26	230 Western Midstream Operating LP, 3,950%, fällig 01.06.2025	241	0,40	32 ICON Luxembourg S.a.r.l., 3,000%, fällig 01.07.2028 *	32	0,05
208 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144 A 8,000%, fällig 20.09.2025	236	0,39	90 William Carter Co/The, 144 A 5,625%, fällig 15.03.2027	94	0,16	6 iHeartCommunications Inc, 3,092%, fällig 01.05.2026 *	6	0,01
70 Spotify USA Inc, 144 A Zero coupon, fällig 15.03.2026	63	0,10	370 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144 A 7,750%, fällig 15.04.2025	394	0,65	8 Indigo Merger Sub, Inc., 3,000%, fällig 01.07.2028 *	8	0,01
290 Sprint Capital Corp, 6,875%, fällig 15.11.2028	378	0,62	250 XPO Logistics Inc, 144 A 6,250%, fällig 01.05.2025	264	0,44	40 Ineos U.S. Petrochemical, 3,250%, fällig 21.01.2026 *	40	0,07
110 Sprint Communications Inc, 11,500%, fällig 15.11.2021	112	0,19	Sambia – 1,39 % (28. Februar 2021: 1,60 %)			100 Jane Street Group, LLC, 2,842%, fällig 21.01.2027 *	99	0,16
50 Sprint Communications Inc, 6,000%, fällig 15.11.2022	53	0,09	200 First Quantum Minerals Ltd, 144 A 7,250%, fällig 01.04.2023	204	0,34	30 Jazz Financing Lux S.a.r.l., 4,000%, fällig 22.04.2028 *	30	0,05
35 Sprint Corp, 7,875%, fällig 15.09.2023	40	0,07	200 First Quantum Minerals Ltd, 144 A 7,250%, fällig 01.04.2023	204	0,34	70 Les Schwab Tire Centers, 4,000%, fällig 26.10.2027 *	70	0,12
250 Sprint Corp, 7,125%, fällig 15.06.2024	288	0,47	400 First Quantum Minerals Ltd, 144 A 6,875%, fällig 15.10.2027	434	0,71	57 Leslie's Poolmart Inc, 3,250%, fällig 08.03.2028 *	57	0,09
40 Starwood Property Trust Inc, 5,000%, fällig 15.12.2021	40	0,07	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 44.968 USD)			200 Magenta Buyer LLC, 0,000%, fällig 03.05.2029 *	200	0,33
40 Starwood Property Trust Inc, 144 A 5,500%, fällig 01.11.2023	42	0,07	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,14 % (28. Februar 2021: 0,29 %)			79 Medical Solutions Holdings Inc, 5,500%, fällig 14.06.2024 *	79	0,13
330 Starwood Property Trust Inc, 144 A 3,625%, fällig 15.07.2026	332	0,55	Argentinien – 0,14 % (28. Februar 2021: 0,29 %)			100 Michaels Cos Inc./The, 5,000%, fällig 08.04.2028 *	100	0,16
30 StoneX Group Inc, 144 A 8,625%, fällig 15.06.2025	33	0,05	7 Argentine Republic Government International Bond, 1,000%, fällig 09.07.2029	3	0,01	300 One Call Corp, 6,250%, fällig 07.04.2027 *	303	0,50
300 Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP / Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp, 144 A 5,875%, fällig 15.05.2025	300	0,50	204 Argentine Republic Government International Bond, 0,500%, fällig 09.07.2030	80	0,13	30 PAE Holding Corporation, 5,250%, fällig 13.10.2027 *	30	0,05
90 Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp, 144 A 5,250%, fällig 15.01.2029	95	0,16	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 109 USD)			57 Particle Investments S.a.r.l., 5,750%, fällig 11.05.2027 *	58	0,09
360 Sunnova Energy Corp, 144 A 5,875%, fällig 01.09.2026	363	0,60	Schuldverschreibungen – 9,03 % (28. Februar 2021: 9,94 %)			60 Peraton Corporation, 4,500%, fällig 22.02.2028 *	60	0,10
120 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 6,500%, fällig 15.07.2027	130	0,21	70 8 Th Avenue Food & Provisions Inc, 7,839%, fällig 01.10.2026			20 PetSmart Inc, 4,500%, fällig 29.01.2028 *	20	0,03
450 Tenet Healthcare Corp, 6,750%, fällig 15.06.2023	488	0,81	50 AAdvantage Loyalty IP Ltd, 0,000%, fällig 10.03.2028 *			110 Pilot Travel Centers, 0,000%, fällig 29.07.2028 *	109	0,18
			23 Academy Ltd, 4,500%, fällig 06.11.2027 *			53 Precision Medicine Group LLC, 3,750%, fällig 20.11.2027 *	53	0,09
						7 Precision Medicine Group LLC, 3,750%, fällig 20.11.2027 *	7	0,01
						290 Project Sky Merger Sub, Inc., 0,000%, fällig 10.08.2028 *	289	0,48
						160 Quikrete Holdings, Inc., 0,000%, fällig 11.06.2028 *	159	0,26
						40 Radiology Partners Inc, 4,357%, fällig 09.07.2025 *	40	0,07

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Vorzugsaktien – 0,23 % (28. Februar 2021: 1,26 %)		
8 Redstone Holdco 2 LP, 5,500%, fällig 27.04.2028 *	8	0,01	Vereinigte Staaten – 0,23 % (28. Februar 2021: 1,26 %)		
22 Redstone Holdco 2 LP, 5,500%, fällig 16.04.2028 *	22	0,04	2 B Riley Financial Inc	58	0,09
250 Reedy Industries Inc, 0,000%, fällig 24.08.2028 *	251	0,41	B Riley Financial Inc	4	0,01
60 Reedy Industries Inc, 0,000%, fällig 24.08.2028 *	60	0,10	1 GMAC Capital Trust I, Series 2	15	0,02
50 RV Retailer, LLC, 6,250%, fällig 28.01.2028 *	50	0,08	Targa Resources Corp, Series A	65	0,11
19 Spencer Spirit IH LLC, 6,092%, fällig 14.06.2026 **	19	0,03		142	0,23
60 Symplr Software, Inc, 5,250%, fällig 23.11.2027 *	60	0,10	Summe Vorzugsaktien	142	0,23
79 TransDigm Group Inc, 2,342%, fällig 09.12.2025 *	78	0,13	(Kosten 137 USD)		
20 TruGreen LP, 9,250%, fällig 30.10.2028 *	20	0,03	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 53.674 USD)	54.418	89,78
100 U.S. Renal Care Inc, 5,125%, fällig 26.06.2026 *	100	0,16	Devisenterminkontrakte – 0,03 % (28. Februar 2021: 0,01 %)		
100 United Airlines Inc, 0,000%, fällig 21.04.2028 *	100	0,17	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	16	0,03
29 Vericast Corp, 5,750%, fällig 03.11.2023 **†	27	0,04	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	54.434	89,81
40 Versend Holding Corp., 4,092%, fällig 27.08.2025 *	40	0,07	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
110 Whatabrands LLC, 3,750%, fällig 21.07.2028 *	110	0,18	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	–	–
180 Worldwide Express Inc, 5,000%, fällig 23.07.2028 *	180	0,30	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	–	–
199 WP CityMD Bidco LLC, 4,500%, fällig 13.08.2026 *	200	0,33	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	54.434	89,81
49 Zynwave, 5,250%, fällig 30.10.2027 *	49	0,08	Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	6.175	10,19
Summe Schuldverschreibungen (Kosten 5.436 USD)	5.473	9,03	Gesamtneuvermögen	\$60.609	100,00
Stammaktien – 0,03 % (28. Februar 2021: 0,46 %)					
Vereinigte Staaten – 0,03 % (28. Februar 2021: 0,46 %)					
4 Southwestern Energy Co	19	0,03			
Summe Stammaktien (Kosten 68 USD)	19	0,03			

- 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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 31.870.000 USD und machten 52,57 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

† Illiquid.

∞ Das Wertpapier wurde vom Manager oder dem jeweiligen Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.

ε Die Sicherheit ist zum 31. August 2021 (entweder Hauptsomme und/oder Zinsen) voreingestellt.

ABKÜRZUNGEN:

Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

CAD – Kanadischer Dollar

**% von
Gesamt**

Analyse des Gesamtvermögens

	% von Gesamt Vermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	76,71
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	8,58
Finanzderivate	0,03
Sonstige Vermögenswerte	14,68
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	43	Verkauf	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.240	Verkauf	15
18.11.2021	Citi	Kauf	USD	177	Verkauf	1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 3 USD)						\$ 16
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)						–
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 3 USD)						\$ 16

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,73 % (28. Februar 2021: 0,59 %)			200 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350%, fällig 01.06.2040	240	0,07	1.250 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, fällig 01.10.2026	1.196	0,34	
590 Home Equity Asset Trust 2005-6X Series 2005 6X Class M5X 1,029%, fällig 25.12.2035 *	589	0,17	40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439%, fällig 06.10.2048	48	0,01		2.351	0,66	
2.160 HSI Asset Securitization Corp Trust 2007-OPT1X Series 2007 OPT1X Class 1A, 0,224%, fällig 25.12.2036 * 1.992	0,56		240 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500%, fällig 01.06.2050	299	0,09	Italien – 0,46 % (28. Februar 2021: 0,54 %)			
			EUR 780 Ideal Standard International SA, 6,375%, fällig 30.07.2026	899	0,25	EUR 500 International Design Group SPA, 4,250%, fällig 15.05.2026 *	595	0,17	
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Kosten 2.309 USD)	2.581	0,73		2.777	0,78	940 UniCredit SpA, 5,459%, fällig 30.06.2035 * 1.040	0,29	1.635	0,46
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 3,85 % (28. Februar 2021: 4,39 %)			Brasilien – 3,52 % (28. Februar 2021: 3,91 %)			Kasachstan – 0,63 % (28. Februar 2021: 0,68 %)			
580 BANK 2018-BNK15X Series 2018 BN15X Class B, 4,812%, fällig 15.11.2061 *	668	0,19	1.310 Braskem America Finance Co, 7,125%, fällig 22.07.2041	1.733	0,49	460 KazMunayGas National Co JSC, 5,375%, fällig 24.04.2030 552 0,16			
230 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2015 C03X Class 2M2X 5,084%, fällig 25.07.2025 *	232	0,06	2.220 Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 6,125%, Perpetual *	2.269	0,64	1.520 KazTransGas JSC, 4,375%, fällig 26.09.2027 1.680	0,47	2.232	0,63
2.196 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C01X Class 1M2X 3,634%, fällig 25.07.2029 *	2.263	0,64	3.044 Petrobras Global Finance BV, 6,250%, fällig 17.03.2024	3.436	0,97				
830 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C01X Class 1B1X 3,634%, fällig 25.07.2030 *	852	0,24	760 Suzano Austria GmbH, 5,750%, fällig 14.07.2026	892	0,25	Luxemburg – 0,41 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			
744 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03X Class 1M2X 2,234%, fällig 25.10.2030 *	754	0,21	1.040 Suzano Austria GmbH, 5,000%, fällig 15.01.2030	1.185	0,33	GBP 1.040 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250%, fällig 01.04.2028	1.458	0,41	
453 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3X Series 2020 DNA3X Class M2X 144 A 3,084%, fällig 25.06.2050 *	455	0,13	1.770 Ultrapar International SA, 144 A 5,250%, fällig 06.10.2026	1.960	0,55	Macau – 0,28 % (28. Februar 2021: 0,15 %)			
730 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3X Series 2021 DNA3X Class B1X 144 A 3,550%, fällig 25.10.2033 *	759	0,21	870 Vale Overseas Ltd, 6,250%, fällig 10.08.2026	1.050	0,29	940 Sands China Ltd, 4,600%, fällig 08.08.2023	994	0,28	
947 Hilton USA Trust 2016-HHV, Series 2016 HHV, Class D, 144 A 4,333%, fällig 05.11.2038 *	1.025	0,29		12.525	3,52	Mexiko – 1,48 % (28. Februar 2021: 1,58 %)			
5.300 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Series 2018 PHMZ, Class M, 144 A 8,454%, fällig 15.06.2035 *†	2.112	0,59	Kanada – 1,26 % (28. Februar 2021: 0,95 %)			1.310 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 6,875%, Perpetual *	1.352	0,38	
14 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12X Series 2007 LD12X Class AJ, 6,716%, fällig 15.02.2051 *	13	-	1.200 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144 A 3,875%, fällig 15.01.2028	1.217	0,34	1.360 BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125%, fällig 18.01.2033 *	1.420	0,40	
802 Motel 6 Trust 2017-MTL6X Series 2017 MTL6X Class F, 144 A 4,346%, fällig 15.08.2034 *	806	0,23	2.090 MEG Energy Corp, 7,125%, fällig 01.02.2027	2.202	0,62	1.980 Orbia Advance Corp SAB de CV, 5,875%, fällig 17.09.2044	2.507	0,70	
648 PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1 R, Series 2021 1R, Class A, 144 A 2,996%, fällig 27.02.2024 *	660	0,19	260 Open Text Corp, 144 A 3,875%, fällig 15.02.2028	271	0,08		5.279	1,48	
1.850 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-1X Series 2017 1X Class M1X 144 A 4,000%, fällig 25.01.2056 *	1.874	0,53	740 Open Text Holdings Inc, 144 A 4,125%, fällig 15.02.2030	780	0,22	Marokko – 0,49 % (28. Februar 2021: 0,58 %)			
1.854 WaMu Mortgage PassThrough Certificates Series 2005-AR17 Trust, Series 2005 AR17X Class A1C3X 1,044%, fällig 25.12.2045 *	1.217	0,34		4.470	1,26	1.600 OCP SA, 4,500%, fällig 22.10.2025	1.737	0,49	
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Kosten 16.862 USD)	13.690	3,85	Chile – 0,11 % (28. Februar 2021: 0,11 %)			Niederlande – 1,93 % (28. Februar 2021: 2,14 %)			
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 47,61 % (28. Februar 2021: 46,57 %)			China – 0,26 % (28. Februar 2021: 0,45 %)			Peru – 1,61 % (28. Februar 2021: 2,02 %)			
Argentinien – 0,34 % (28. Februar 2021: 0,29 %)			Kolumbien – 0,57 % (28. Februar 2021: 0,54 %)			Südafrika – 0,51 % (28. Februar 2021: 0,04 %)			
1.320 Pampa Energia SA, 7,500%, fällig 24.01.2027	1.218	0,34	1.926 Millicom International Cellular SA, 5,125%, fällig 15.01.2028	2.010	0,57	610 Petroles del Peru SA, 5,625%, fällig 19.06.2047	637	0,18	
Belgien – 0,78 % (28. Februar 2021: 0,52 %)			Frankreich – 0,56 % (28. Februar 2021: 1,61 %)			Spanien – 0,79 % (28. Februar 2021: 0,42 %)			
1.010 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900%, fällig 01.02.2046 10.291		0,36	1.690 BNP Paribas SA, 7,375%, Perpetual *	1.975	0,56	EUR 900 Telefonica Europe BV, 2,376%, Perpetual *	1.041	0,29	
			Deutschland – 0,70 % (28. Februar 2021: 0,72 %)			EUR 370 Tendam Brands SAU, 5,000%, fällig 15.09.2024	439	0,12	
			EUR 120 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625%, fällig 15.01.2027	144	0,04	EUR 1.130 Tendam Brands SAU, 5,250%, fällig 15.09.2024 *	1.339	0,38	
			EUR 800 Renk AG/Frankfurt am Main, 5,750%, fällig 15.07.2025	990	0,28		2.819	0,79	
			EUR 540 TUI Cruises GmbH, 6,500%, fällig 15.05.2026	654	0,18	Schweden – 0,12 % (28. Februar 2021: 0,83 %)			
			EUR 558 Vertical Holdco GmbH, 6,625%, fällig 15.07.2028	707	0,20	400 Svenska Handelsbanken AB, 4,750%, Perpetual *	430	0,12	
				2.495	0,70	Schweiz – 1,46 % (28. Februar 2021: 1,27 %)			
			Irland – 0,77 % (28. Februar 2021: 0,71 %)			720 Credit Suisse Group AG, 7,500%, Perpetual *	778	0,22	
			280 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,500%, fällig 15.09.2023	299	0,08	828 Glencore Finance Canada Ltd, 6,000%, fällig 15.11.2041	1.111	0,31	
			96 Park Aerospace Holdings Ltd, 144 A 5,250%, fällig 15.08.2022	100	0,03	1.060 Syngenta Finance NV, 4,441%, fällig 24.04.2023	1.112	0,31	
			660 Park Aerospace Holdings Ltd, 144 A 4,500%, fällig 15.03.2023	693	0,20				
			1.490 Park Aerospace Holdings Ltd, 144 A 5,500%, fällig 15.02.2024	1.635	0,46				
				2.727	0,77				
			Israel – 0,66 % (28. Februar 2021: 0,77 %)						
			1.170 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800%, fällig 21.07.2023	1.155	0,32				

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			2.658 Continental Resources Inc/OK, 4,900%, fällig 01.06.2044	2.998	0,84	1.180 Lamb Weston Holdings Inc, 144 A 4,875%, fällig 01.11.2026	1.215	0,34
Schweiz - (Fortsetzung)			750 CSC Holdings LLC, 144 A 6,500%, fällig 01.02.2029	829	0,23	440 Legacy LifePoint Health LLC, 144 A 4,375%, fällig 15.02.2027	439	0,12
2.010 UBS Group AG, 7,000%, Perpetual *	2.205	0,62	930 DCP Midstream Operating LP, 144 A 6,450%, fällig 03.11.2036	1.129	0,32	318 Lehman Escrow Receipt, Zero coupon, Perpetual * 660 Lumen Technologies Inc, Series W, 6,750%, fällig 01.12.2023	4	-
	5.206	1,46	850 Delta Air Lines Inc, 144 A 7,000%, fällig 01.05.2025	995	0,28	540 Delta Air Lines Inc, 7,375%, fällig 15.01.2026	727	0,20
Vereinigte Arabische Emirate – 0,67 % (28. Februar 2021: 0,59 %)			970 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,500%, fällig 20.10.2025	1.041	0,29	1.083 Match Group Holdings II LLC, 144 A 5,000%, fällig 15.12.2027	1.140	0,32
1.880 DP World Ltd/United Arab Emirates, 5,625%, fällig 25.09.2048	2.370	0,67	640 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,750%, fällig 20.10.2028	714	0,20	200 McDonald's Corp, 4,200%, fällig 01.04.2050	246	0,07
Großbritannien – 4,23 % (28. Februar 2021: 3,32 %)			624 Devon Energy Corp, 144 A 5,250%, fällig 15.10.2027	664	0,19	160 Morgan Stanley, 5,597%, fällig 24.03.2051 *	241	0,07
398 Barclays Bank Plc, 7,625%, fällig 21.11.2022	429	0,12	246 Devon Energy Corp, 144 A 5,875%, fällig 15.06.2028	271	0,08	1.310 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 4,625%, fällig 01.08.2029	1.402	0,39
GBP 620 Barclays Plc, 7,125%, Perpetual *	970	0,27	1.275 DISH DBS Corp, 5,875%, fällig 15.07.2022	1.320	0,37	340 Navient Corp, 5,875%, fällig 25.10.2024	371	0,10
GBP 1.160 Gatwick Airport Finance Plc, 4,375%, fällig 07.04.2026	1.612	0,45	420 DISH DBS Corp, 5,875%, fällig 15.11.2024	452	0,13	1.040 NCL Corp Ltd, 144 A 10,250%, fällig 01.02.2026	1.203	0,34
GBP 1.459 Greene King Finance Plc, Series B2X 2,161%, fällig 15.03.2036 *	1.686	0,47	2.250 DISH DBS Corp, 7,750%, fällig 01.07.2026	2.580	0,73	1.500 Netflix Inc, 144 A 4,875%, fällig 15.06.2030	1.797	0,51
1.470 HSBC Holdings Plc, 6,375%, Perpetual *	1.625	0,46	1.660 Diversified Healthcare Trust, 9,750%, fällig 15.06.2025	1.828	0,51	371 Newell Brands Inc, 4,350%, fällig 01.04.2023	392	0,11
EUR 110 INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750%, fällig 15.07.2026	134	0,04	200 El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375%, fällig 15.06.2032	297	0,08	580 NGPL PipeCo LLC, 144 A 7,768%, fällig 15.12.2037	837	0,24
EUR 1.600 Lloyds Banking Group Plc, 4,947%, Perpetual *	2.092	0,59	940 Energy Transfer LP, 7,600%, fällig 01.02.2024	1.062	0,30	120 NIKE Inc, 3,375%, fällig 27.03.2050	138	0,04
GBP 1.275 Marston's Issuer Plc, Series B1X 2,628%, fällig 16.07.2035 *	1.420	0,40	830 Energy Transfer LP / Regency Energy Finance Corp, 4,500%, fällig 01.11.2023	887	0,25	690 Occidental Petroleum Corp, 3,500%, fällig 15.08.2029	716	0,20
GBP 492 Saga Plc, 3,375%, fällig 12.05.2024	654	0,18	860 Enterprise Products Operating LLC, 4,800%, fällig 01.02.2049	1.073	0,30	205 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000%, fällig 01.03.2032	295	0,08
GBP 1.150 Saga Plc, 5,500%, fällig 15.07.2026	1.551	0,44	110 EOG Resources Inc, 4,375%, fällig 15.04.2030	130	0,04	700 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144 A 8,000%, fällig 20.09.2025	794	0,22
GBP 1.062 Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411%, fällig 13.07.2044	1.936	0,54	30 EOG Resources Inc, 4,950%, fällig 15.04.2050	40	0,01	2.250 Sprint Capital Corp, 8,750%, fällig 15.03.2032	3.449	0,97
GBP 680 Wheel Bidco Ltd, 6,750%, fällig 15.07.2026	950	0,27	210 Exxon Mobil Corp, 4,327%, fällig 19.03.2050	263	0,07	980 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500%, fällig 01.03.2030	1.082	0,30
	15.059	4,23	50 Exxon Mobil Corp, 3,452%, fällig 15.04.2051	55	0,02	870 T-Mobile USA Inc, 3,875%, fällig 15.04.2030	976	0,27
Vereinigte Staaten – 22,53 % (28. Februar 2021: 21,25 %)			1.650 FirstEnergy Corp, Series C, 7,375%, fällig 15.11.2031	2.309	0,65	580 United Rentals North America Inc, 5,500%, fällig 15.05.2027	613	0,17
810 AbbVie Inc, 4,850%, fällig 15.06.2044	1.037	0,29	2.270 Ford Motor Co, 8,500%, fällig 21.04.2023	2.513	0,71	690 United Rentals North America Inc, 3,875%, fällig 15.11.2027	726	0,20
615 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144 A 6,000%, fällig 01.06.2029	616	0,17	390 Ford Motor Credit Co LLC, 3,815%, fällig 02.11.2027	411	0,12	520 Verizon Communications Inc, 3,400%, fällig 22.03.2041	558	0,16
400 American Airlines Inc/ AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144 A 5,500%, fällig 20.04.2026	422	0,12	2.310 Freepoint-McMoRan Inc, 5,450%, fällig 15.03.2043	2.957	0,83	380 Verizon Communications Inc, 4,000%, fällig 22.03.2050	442	0,12
1.320 American Airlines Inc/ AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144 A 5,750%, fällig 20.04.2029	1.427	0,40	2.139 GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418%, fällig 15.11.2035	2.600	0,73	150 Verizon Communications Inc, 3,550%, fällig 22.03.2051	163	0,05
1.790 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144 A 5,250%, fällig 15.08.2027	1.855	0,52	50 General Dynamics Corp, 4,250%, fällig 01.04.2040	62	0,02	420 Verizon Communications Inc, 3,700%, fällig 22.03.2061	463	0,13
1.670 Bank of America Corp, 3,311%, fällig 22.04.2042 *	1.802	0,51	350 General Dynamics Corp, 4,250%, fällig 01.04.2050	455	0,13	460 Viking Cruises Ltd, 144 A 5,875%, fällig 15.09.2027	446	0,12
180 Bank of America Corp, 4,083%, fällig 20.03.2051 *	218	0,06	137 General Electric Co, 6,875%, fällig 10.01.2039	208	0,06	530 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144 A 5,625%, fällig 15.02.2029	528	0,15
350 Bausch Health Americas Inc, 144 A 9,250%, fällig 01.04.2026	378	0,11	390 General Motors Co, 5,400%, fällig 02.10.2023	427	0,12	140 Visa Inc, 2,700%, fällig 15.04.2040	146	0,04
790 Boeing Co/The, 4,875%, fällig 01.05.2025	883	0,25	235 Goldman Sachs Capital II, 4,000%, Perpetual *	235	0,07	1.000 VOC Escrow Ltd, 144 A 5,000%, fällig 15.02.2028	990	0,28
230 Boeing Co/The, 3,750%, fällig 01.02.2050	239	0,07	970 Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875%, fällig 01.04.2027	1.008	0,28	560 Wells Fargo & Co, 5,013%, fällig 04.04.2051 *	781	0,22
180 BP Capital Markets America Inc, 3,633%, fällig 06.04.2030	203	0,06	30 JPMorgan Chase & Co, 3,109%, fällig 22.04.2051 *	31	0,01	880 Wells Fargo & Co, Series U, 5,875%, Perpetual *	993	0,28
241 Bristol-Myers Squibb Co, 5,000%, fällig 15.08.2045	332	0,09	710 JPMorgan Chase & Co, 3,328%, fällig 22.04.2052 *	773	0,22	452 Williams Cos Inc/The, Series A, 7,500%, fällig 15.01.2031	632	0,18
1.930 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 5,125%, fällig 01.05.2027	2.020	0,57	47 JPMorgan Chase & Co, Series I, 3,599%, Perpetual *	47	0,01	1.235 Williams Cos Inc/The, 5,750%, fällig 24.06.2044	1.652	0,46
640 Centene Corp, 4,625%, fällig 15.12.2029	703	0,20	1.800 JPMorgan Chase & Co, Series U, 6,125%, Perpetual *	1.949	0,55		80.146	22,53
400 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500%, fällig 01.06.2041	405	0,11	550 Kinder Morgan Inc, 8,050%, fällig 15.10.2030	768	0,22			
310 Cigna Corp, 4,800%, fällig 15.08.2038	388	0,11	865 Kinder Morgan Inc, 7,800%, fällig 01.08.2031	1.248	0,35			
812 Comcast Corp, 144 A 2,937%, fällig 01.11.2056	806	0,23	135 Kinder Morgan Inc, 7,750%, fällig 15.01.2032	196	0,05			
340 Comcast Corp, 4,950%, fällig 15.10.2058	490	0,14	370 Kraft Heinz Foods Co, 5,200%, fällig 15.07.2045	476	0,13			
			1.036 L3 Harris Technologies Inc, 5,054%, fällig 27.04.2045	1.388	0,39			

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			IDR 64.296.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR78X 8,250%, fällig 15.05.2029	1,45	360	United States Treasury Note/ Bond , 3,000%, fällig 15.02.2047	0,12
Sambia – 0,48 % (28. Februar 2021: 0,47 %)				5.140	1,45	120	United States Treasury Note/ Bond , 3,125%, fällig 15.05.2048	0,04
	560	0,16		12.772	3,59	820	United States Treasury Note/ Bond , 3,000%, fällig 15.02.2049	0,28
	1.090	0,32	Mexiko – 2,90 % (28. Februar 2021: 3,16 %)			430	United States Treasury Note/ Bond , 2,875%, fällig 15.05.2049	0,15
	1.140	0,32	MXN 45.164	Mexican Bonos, Series M 20X 7,500%, fällig 03.06.2027	0,66	40	United States Treasury Note/ Bond , 1,250%, fällig 15.05.2050	0,01
	1.721	0,48	MXN 157.267	Mexican Bonos, Series M, 7,750%, fällig 13.11.2042	2,24	1.700	United States Treasury Note/ Bond , 1,375%, fällig 15.08.2050	0,42
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 152.976 USD)				10.324	2,90		14.119	3,97
	169.330	47,61	Nigeria – 0,15 % (28. Februar 2021: 0,14 %)			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 83.399 USD)		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 21,97 % (28. Februar 2021: 24,57 %)			520	Nigeria Government International Bond, 7,625%, fällig 28.11.2047	0,15	78.152	21,97	
Argentinien – 0,45 % (28. Februar 2021: 0,20 %)			Panama – 0,22 % (28. Februar 2021: 0,20 %)			Schuldverschreibungen – 6,04 % (28. Februar 2021: 6,99 %)		
	38	0,01	680	Panama Government International Bond, 4,500%, fällig 01.04.2056	0,22	589	Alterra Mountain Co, 2,842%, fällig 30.07.2028 *	0,17
	199	0,02	Peru – 0,15 % (28. Februar 2021: 0,22 %)			969	API Group Inc, 2,592%, fällig 01.10.2026 *	0,27
	370	0,04	500	Peruvian Government International Bond, 2,392%, fällig 23.01.2026	0,15	1.061	Aramark Services Inc, 1,842%, fällig 11.03.2025 *	0,29
	2.510	0,38	Russland – 2,41 % (28. Februar 2021: 2,27 %)			1.189	Asurion LLC, 3,092%, fällig 03.11.2024 *	0,33
	1.589	0,45	RUB 288.495	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212X 7,050%, fällig 19.01.2028	1,13	348	Asurion LLC, 3,342%, fällig 18.12.2026 *	0,10
Brasilien – 1,93 % (28. Februar 2021: 1,06 %)			RUB 329.535	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6225X 7,250%, fällig 10.05.2034	1,28	708	Brightview Landscapes LLC, 2,625%, fällig 15.08.2025 *	0,20
	6.864	0,38		518	0,15	836	Caesars Resort Collection LLC, 2,842%, fällig 22.12.2024 *	0,23
	16.570	0,91	Türkei – 0,66 % (28. Februar 2021: 0,37 %)			872	Clarios Global LP, 3,342%, fällig 30.04.2026 *	0,24
	11.694	0,64	1.390	Turkey Government International Bond, 4,750%, fällig 26.01.2026	0,39	1	CWGS Group, LLC, 0,000%, fällig 03.06.2028 *	–
	6.863	1,93	790	Turkey Government International Bond, 4,375%, fällig 08.07.2027	0,27	163	Entercom Media Corp, 2,588%, fällig 17.11.2024 *	0,04
China – 2,39 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Vereinigte Staaten – 3,97 % (28. Februar 2021: 8,29 %)			959	First Eagle Holdings Inc, 2,647%, fällig 17.02.2027 *	0,27
	36.000	1,76	540	United States Treasury Note/ Bond , 0,125%, fällig 30.06.2022	0,15	638	Focus Financial Partners LLC, 2,092%, fällig 03.07.2024 *	0,18
	10.000	0,50	430	United States Treasury Note/ Bond , 0,125%, fällig 30.04.2023	0,12	94	Golden Nugget LLC, 3,250%, fällig 04.10.2023 *	0,03
	2.500	0,13	4.140	United States Treasury Note/ Bond , 0,375%, fällig 30.11.2025	1,15	493	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 2,086%, fällig 15.11.2027 *	0,13
	8.489	2,39	440	United States Treasury Note/ Bond , 1,500%, fällig 15.08.2026	0,13	1.246	Hilton Worldwide Finance LLC, 1,834%, fällig 21.06.2026 *	0,35
Kolumbien – 0,42 % (28. Februar 2021: 0,56 %)			1.460	United States Treasury Note/ Bond , 2,000%, fällig 15.11.2026	0,44	513	Level 3 Parent LLC, 1,842%, fällig 01.03.2027 *	0,14
	1.350	0,42	770	United States Treasury Note/ Bond , 2,250%, fällig 15.02.2027	0,23	349	MPH Acquisition Holdings LLC, 3,750%, fällig 07.06.2023 *	0,10
	1.511	0,42	30	United States Treasury Note/ Bond , 0,625%, fällig 15.08.2030	0,01	233	Nexstar Broadcasting Inc, 2,596%, fällig 19.09.2026 *	0,07
Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 0,31 % (28. Februar 2021: 0,29 %)			1.650	United States Treasury Note/ Bond , 3,000%, fällig 15.05.2045	0,56	946	Option Care Health Inc, 3,842%, fällig 06.08.2026 *	0,27
	880	0,31	15	United States Treasury Note/ Bond , 3,000%, fällig 15.11.2045	0,01	28	Ortho Clinical Diagnostics S.A., 3,500%, fällig 17.01.2027 *	0,01
	1.112	0,31	500	United States Treasury Note/ Bond , 2,250%, fällig 15.08.2046	0,15	596	Prime Security, 3,500%, fällig 23.09.2026 *	0,17
Ägypten – 0,56 % (28. Februar 2021: 0,54 %)						112	Reynolds Consumer Products LLC, 1,842%, fällig 04.02.2027 *	0,03
	1.360	0,37				9	Reynolds Group Holdings Inc, 2,842%, fällig 05.02.2023 *	–
	550	0,19				1.414	Scientific Games International Inc, 2,842%, fällig 14.08.2024 *	0,39
	2.012	0,56				943	Sedgwick Claims Management Services Inc, 3,342%, fällig 31.12.2025 *	0,26
Ghana – 0,28 % (28. Februar 2021: 0,27 %)						1.100	Sotera Health, 3,250%, fällig 13.12.2026 *	0,31
	1.000	0,28						
Indonesien – 3,59 % (28. Februar 2021: 3,25 %)								
	1.390	0,49						
	77.619.000	1,65						

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Stammaktien – 0,10 % (28. Februar 2021: 0,05 %)		
906 Terrier Media Buyer, Inc., 3,592%, fällig 17.12.2026 *	902	0,25	Vereinigte Staaten – 0,10 % (28. Februar 2021: 0,05 %)		
297 Trans Union LLC, 1,842%, fällig 13.11.2026 *	295	0,08	44 Berry Corp	263	0,08
255 UFC Holdings LLC, 3,500%, fällig 29.04.2026 *	253	0,07	57 Hercules Offshore Inc †∞	2	–
1.630 Valeant Pharmaceuticals International, 3,092%, fällig 28.05.2025 *	1.626	0,46	16 Southwestern Energy Co	74	0,02
186 VICI Properties 1 LLC, 1,838%, fällig 22.12.2024 *	186	0,05		339	0,10
830 Virgin Media Bristol LLC, 2,595%, fällig 04.01.2028 *	823	0,23	Summe Stammaktien		
1.140 Whatabrands LLC, 3,750%, fällig 21.07.2028 *	1.138	0,32	(Anschaffungskosten 1.380 USD)	339	0,10
Summe Schuldverschreibungen	21.493	6,04	Summe der ergebniswirksam zum		
(Kosten 21.693 USD)			beizulegenden Zeitwert bewerteten		
Organismen für gemeinsame Anlagen – 9,90 %			Anlagen (Kosten 308.048 USD)	320.810	90,20
(28. Februar 2021: 9,89 %)			Devisenterminkontrakte – 0,23 %		
86 Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US\$ Distributing (M)	8.955	2,52	(28. Februar 2021: 1,46 %)		
EUR 63 Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Euro High Yield Fund – LM Class Euro (Accumulating)	14.160	3,98	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	834	0,23
35 Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Legg Mason Western Asset India Bond – LM Class US\$ Accumulating	4.901	1,38	Futures – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,17 %)		
EUR 57 Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	7.209	2,02	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	51	0,01
Summe Organismen für gemeinsame			Summe der erfolgswirksam zum		
Anlagen (Kosten 29.429 USD)	35.225	9,90	beizulegenden Zeitwert bewerteten		
			finanziellen Vermögenswerte	321.695	90,44
			Devisenterminkontrakte – (0,53 %)		
			(28. Februar 2021: (0,32 %))		
			Nicht realisierte Wertminderung aus		
			Kontrakten (siehe unten)	(1.891)	(0,53)
			Futures – (0,09 %)		
			(28. Februar 2021: (0,08 %))		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(337)	(0,09)
			Summe der erfolgswirksam zum		
			beizulegenden Zeitwert bewerteten		
			finanziellen Verbindlichkeiten	(2.228)	(0,62)
			Summe erfolgswirksam zum		
			beizulegenden Zeitwert bewertete		
			finanzielle Vermögenswerte und		
			Verbindlichkeiten	319.467	89,82
			Sonstige die Verbindlichkeiten		
			übersteigendes Vermögen	36.206	10,18
			Gesamtvermögen	\$355.673	100,00

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, betreffen 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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 37.715.000 USD und machten 10,63 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

† Illiquid.

∞ Das Wertpapier wurde vom Manager oder dem jeweiligen Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.

ε Die Sicherheit ist zum 31. August 2021 (entweder Hauptsumme und/oder Zinsen) voreingestellt.

ABKÜRZUNGEN:

Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.

BRL – Brasilianischer Real

CNY – Chinesischer Renminbi

EUR – Euro

GBP – Britisches Pfund Sterling

IDR – Indonesische Rupiah

MXN – Mexikanischer Peso

RUB – Russischer Rubel

ZAR – Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden

73,36

Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden

5,97

Organismen für gemeinsame Anlagen

93,78

Finanzderivate

0,25

Sonstige Vermögenswerte

10,64

Gesamtvermögen

100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
10.09.2021	Citi	Buy	IDR 34.311.880	Sell USD 2.369 \$ 37
10.09.2021	Goldman Sachs	Buy	USD 6.526	Sell RUB 486.631 (109)
10.09.2021	Goldman Sachs	Buy	RUB 729.455	Sell USD 9.807 140
10.09.2021	Morgan Stanley	Buy	USD 8.022	Sell BRL 41.776 (46)
10.09.2021	Morgan Stanley	Buy	BRL 36.567	Sell USD 6.902 160
13.09.2021	Citi	Buy	INR 108.790	Sell USD 1.477 11
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD 1.202	Sell AUD 1.630 10
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD 12	Sell EUR 10 –
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD 20.770	Sell GBP 15.128 (30)
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD 108	Sell GBP 78 –
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD 4	Sell SGD 4 –
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	PLN 20.814	Sell USD 5.352 83
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	EUR 14.209	Sell USD 16.716 66
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	AUD 105.581	Sell USD 77.638 (393)
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	CHF 3.343	Sell USD 3.655 (3)
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	SGD 1.440	Sell USD 1.062 9
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	GBP 67.765	Sell USD 93.941 (768)
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	GBP –	Sell USD – –
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	ZAR 18.970	Sell USD 1.285 17
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD 578	Sell ZAR 8.579 (11)
18.11.2021	Bank of America Merrill Lynch	Buy	USD 10.248	Sell SGD 13.924 (108)
18.11.2021	BNP Paribas	Buy	USD 1.972	Sell EUR 1.680 (15)
18.11.2021	BNP Paribas	Buy	USD 757	Sell GBP 547 5
18.11.2021	BNP Paribas	Buy	EUR 1.600	Sell USD 1.883 10
18.11.2021	Citi	Buy	USD 6.477	Sell GBP 4.690 29
18.11.2021	Citi	Buy	MXN 36.560	Sell USD 1.798 3
18.11.2021	Goldman Sachs	Buy	USD 1.662	Sell GBP 1.200 12
18.11.2021	Goldman Sachs	Buy	USD 5.755	Sell MXN 116.467 17
18.11.2021	Goldman Sachs	Buy	EUR 3.011	Sell USD 3.540 21
18.11.2021	HSBC	Buy	USD 42.489	Sell EUR 36.178 (294)
18.11.2021	HSBC	Buy	EUR 2.000	Sell USD 2.351 14
18.11.2021	JP Morgan	Buy	USD 713	Sell AUD 967 5
18.11.2021	JP Morgan	Buy	USD 2.110	Sell EUR 1.794 (12)
18.11.2021	JP Morgan	Buy	USD 1.887	Sell GBP 1.362 14
18.11.2021	JP Morgan	Buy	GBP 500	Sell USD 687 1
18.11.2021	JP Morgan	Buy	AUD 1.400	Sell USD 1.017 8

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
		Buy	EUR	7.392	Sell	USD	8.688	
18.11.2021	JP Morgan	Buy	EUR	7.392	Sell	USD	8.688	\$ 53
18.11.2021	JP Morgan	Buy	MXN	74.843	Sell	USD	3.696	(10)
18.11.2021	Morgan Stanley	Buy	USD	528	Sell	EUR	450	(4)
18.11.2021	Morgan Stanley	Buy	ZAR	18.000	Sell	USD	1.191	35
18.11.2021	Morgan Stanley	Buy	CAD	1.230	Sell	USD	981	(6)
18.11.2021	Morgan Stanley	Buy	USD	3.996	Sell	ZAR	59.862	(82)
18.11.2021	UBS	Buy	USD	427	Sell	GBP	308	4
18.11.2021	UBS	Buy	EUR	8.725	Sell	USD	10.247	70
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 9.596 USD)								\$ 834
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (2.105) USD)								(1.891)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 7.491 USD)								\$ (1.057)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro\$ Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(151)	\$(37.684)	\$ (21)
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	152	37.633	(122)
Euro-Bund Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(56)	(11.409)	40
Euro-Bund September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(66)	(13.673)	(52)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(251)	(17)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(60)	(8.007)	11
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(319)	(39.466)	(93)
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	10	1.630	(7)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(24)	(4.735)	(25)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.115 USD)				\$ 51
Nicht realisierte Wertminderung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (501) USD)				(337)
Nettowertminderung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 614 USD)				\$ (286)

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 4,69 % (28. Februar 2021: 4,30 %)			500 Ocean Trails Clo X, Series 2020 10A, Class D, 144 A 4,826%, fällig 15.10.2031 *	500	0,19	Deutschland – 0,11 % (28. Februar 2021: 1,23 %)		
310 AGL CLO 6 Ltd, Series 2020 6A, Class ER, 144 A 6,634%, fällig 20.07.2034 *	310	0,12	580 Saranac CLO III Ltd, Series 2014 3A, Class DR, 144 A 3,385%, fällig 22.06.2030 *	560	0,22	290 Mercer International Inc, 5,125%, fällig 01.02.2029	292	0,11
400 Ammc Clo 20 Ltd, Series 2017 20A, Class E, 144 A 5,944%, fällig 17.04.2029 *	393	0,15	320 Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Class DRR, 144 A 2,946%, fällig 15.04.2027 *	309	0,12	Hongkong – 0,18 % (28. Februar 2021: 0,22 %)		
400 Apex Credit CLO 2019-II Ltd, Series 2019 2A, Class D, 144 A 4,175%, fällig 25.10.2032 *	400	0,16	100 Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Class ERR, 144 A 5,866%, fällig 15.04.2027 *	88	0,03	450 Melco Resorts Finance Ltd, 144 A 5,375%, fällig 04.12.2029	466	0,18
710 Ares XLII Clo Ltd, Series 2017 42A, Class D, 144 A 3,588%, fällig 22.01.2028 *	712	0,28	370 Wellfleet CLO 2017-2A Ltd, Series 2017 2A, Class C, 144 A 3,534%, fällig 20.10.2029 *	370	0,14	Israel – 0,33 % (28. Februar 2021: 0,40 %)		
250 Ares XXXVR CLO Ltd, Series 2015 35RA, Class D, 144 A 3,126%, fällig 15.07.2030 *	249	0,10	Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Kosten 12.013 USD)			12.073	4,69	
500 ASSURANT CLO Ltd, Series 2018 3A, Class DR, 144 A 3,234%, fällig 20.10.2031 *	500	0,19	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 83,63 % (28. Februar 2021: 82,68 %)					
460 Avery Point VI CLO Ltd, Series 2015 6A, Class DR, 144 A 3,071%, fällig 05.08.2027 *	460	0,18	Argentinien – 0,36 % (28. Februar 2021: 0,39 %)					
440 Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Class C, 144 A 3,284%, fällig 20.04.2031 *	439	0,17	200 Transportadora de Gas del Sur SA, 144 A 6,750%, fällig 02.05.2025	190	0,07	200 Altice France Holding SA, 144 A 10,500%, fällig 15.05.2027	220	0,09
300 BLUEMOUNTAIN CLO 2012-2 Ltd, Series 2012 2A, Class ER2X 144 A 5,881%, fällig 20.11.2028 *	298	0,12	818 YPF SA, 144 A 4,000%, fällig 12.02.2026	743	0,29	1.070 ARD Finance SA, 144 A 6,500%, fällig 30.06.2027	1.128	0,44
500 BlueMountain CLO 2015-2 Ltd, Series 2015 2A, Class ER, 144 A 5,334%, fällig 18.07.2027 *	492	0,19	933	0,36	780 Intelsat Jackson Holdings SA, 144 A 8,000%, fällig 15.02.2024	811	0,31	
420 Canyon CLO 2020-1 Ltd, Series 2020 1A, Class ER, 144 A 0,000%, fällig 15.07.2034 *	420	0,16	Bermuda – 0,31 % (28. Februar 2021: 0,36 %)			3.136	1,22	
400 Catskill Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Class D, 144 A 6,134%, fällig 20.04.2029 *	400	0,16	740 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144 A 7,625%, fällig 15.10.2025	788	0,31	Luxemburg – 1,22 % (28. Februar 2021: 0,71 %)		
250 ClFC Funding 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Class D, 144 A 3,634%, fällig 23.04.2029 *	250	0,10	Brasilien – 0,24 % (28. Februar 2021: 0,28 %)					
250 Cumberland Park CLO Ltd, Series 2015 2A, Class ER, 144 A 5,784%, fällig 20.07.2028 *	251	0,10	200 Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 144 A 6,125%, Perpetual *	204	0,08	200 Sands China Ltd, 3,800%, fällig 08.01.2026	213	0,08
300 Goldentree Loan Management US Clo 10 Ltd, Series 2021 10A, Class E, 144 A 6,317%, fällig 20.07.2034 *	300	0,11	330 Petrobras Global Finance BV, 7,375%, fällig 17.01.2027	405	0,16	200 Sands China Ltd, 5,400%, fällig 08.08.2028	230	0,09
300 GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd, Series 2014 9A, Class DR2X 144 A 3,130%, fällig 29.10.2029 *	300	0,12	609	0,24	1.560 Wynn Macau Ltd, 144 A 5,625%, fällig 26.08.2028	1.582	0,62	
250 Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Class E, 144 A 5,076%, fällig 15.04.2031 *	243	0,09	Kanada – 2,15 % (28. Februar 2021: 2,83 %)			460 Wynn Macau Ltd, 144 A 5,125%, fällig 15.12.2029	458	0,18
510 Grippen Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Class E, 144 A 5,834%, fällig 20.01.2030 *	508	0,20	630 Air Canada, 144 A 3,875%, fällig 15.08.2026	634	0,25	2.483	0,97	
250 Harriman Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class ER, 144 A 6,534%, fällig 20.04.2034 *	251	0,10	280 ATS Automation Tooling Systems Inc, 144 A 4,125%, fällig 15.12.2028	289	0,11	Niederlande – 0,17 % (28. Februar 2021: 0,20 %)		
300 LCM 32 Ltd 32A, Class E, 144 A 6,500%, fällig 20.07.2034 *	298	0,12	500 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144 A 5,375%, fällig 15.01.2028	527	0,20	420 UPC Holding BV, 144 A 5,500%, fällig 15.01.2028	444	0,17
300 LCM XXII Ltd 22A, Class DR, 144 A 5,634%, fällig 20.10.2028 *	288	0,11	850 Empire Communities Corp, 144 A 7,000%, fällig 15.12.2025	898	0,35	Schweiz – 0,48 % (28. Februar 2021: 0,34 %)		
693 Magnetite XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144 A 5,806%, fällig 15.10.2031 *	688	0,27	300 GFL Environmental Inc, 144 A 3,750%, fällig 01.08.2025	309	0,12	920 Credit Suisse Group AG, 144 A 6,375%, Perpetual *	1.018	0,39
500 Marble Point CLO XIV Ltd, Series 2018 2A, Class D, 144 A 3,664%, fällig 20.01.2032 *	493	0,19	260 Hudbay Minerals Inc, 144 A 4,500%, fällig 01.04.2026	262	0,10	200 Credit Suisse Group AG, 144 A 7,250%, Perpetual *	225	0,09
280 Mountain View CLO IX Ltd, Series 2015 9A, Class CR, 144 A 3,246%, fällig 15.07.2031 *	271	0,11	390 Hudbay Minerals Inc, 144 A 6,125%, fällig 01.04.2029	420	0,16	1.243	0,48	
500 Nassau LLC, Series 2021 IA, Class D, 144 A 3,892%, fällig 26.08.2034 *	500	0,19	1.100 MEG Energy Corp, 144 A 7,125%, fällig 01.02.2027	1.159	0,45	Großbritannien – 1,58 % (28. Februar 2021: 1,02 %)		
250 Neuberger Berman CLO XVIII Ltd, Series 2014 18A, Class DR2X 144 A 6,054%, fällig 20.10.2030 *	244	0,09	650 Open Text Holdings Inc, 144 A 4,125%, fällig 15.02.2030	685	0,27	252 Barclays Bank Plc, 7,625%, fällig 21.11.2022	272	0,11
300 Ocean Trails CLO V, Series 2014 5A, Class DRR, 144 A 3,579%, fällig 13.10.2031 *	288	0,11	340 Superior Plus LP / Superior General Partner Inc, 144 A 4,500%, fällig 15.03.2029	353	0,14	280 Barclays Plc, 8,000%, Perpetual *	318	0,12
			5.536	2,15		800 HSBC Holdings Plc, 4,600%, Perpetual *	821	0,32
			Kaimaninseln – 1,08 % (28. Februar 2021: 1,04 %)			1.000 Virgin Media Secured Finance Plc, 144 A 5,500%, fällig 15.05.2029	1.073	0,42
			2.795 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144 A 6,500%, fällig 15.09.2024	2.774	1,08	920 Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC, 144 A 5,000%, fällig 15.07.2028	954	0,37
			Chile – 0,03 % (28. Februar 2021: 0,10 %)			600 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144 A 4,750%, fällig 15.07.2031	617	0,24
			80 Liberty Latin America Ltd, 2,000%, fällig 15.07.2024	82	0,03	4.055	1,58	
			Kolumbien – 0,07 % (28. Februar 2021: 0,09 %)			Vereinigte Staaten – 71,13 % (28. Februar 2021: 68,04 %)		
			180 Millicom International Cellular SA, 144 A 5,125%, fällig 15.01.2028	188	0,07	760 Academy Ltd, 144 A 6,000%, fällig 15.11.2027	815	0,32
			Frankreich – 1,50 % (28. Februar 2021: 1,11 %)			440 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144 A 5,000%, fällig 01.05.2028	437	0,17
			377 Altice France SA/France, 144 A 7,375%, fällig 01.05.2026	392	0,15	410 AdaptHealth LLC, 144 A 6,125%, fällig 01.08.2028	437	0,17
			800 Altice France SA/France, 144 A 8,125%, fällig 01.02.2027	870	0,34	550 AdaptHealth LLC, 144 A 4,625%, fällig 01.08.2029	552	0,21
			650 Altice France SA/France, 144 A 5,125%, fällig 15.07.2029	658	0,26	360 AdaptHealth LLC, 144 A 5,125%, fällig 01.03.2030	365	0,14
			800 BNP Paribas SA, 144 A 7,000%, Perpetual *	963	0,37	780 ADT Security Corp/The, 144 A 4,125%, fällig 01.08.2029	780	0,30
			800 Credit Agricole SA, 144 A 8,125%, Perpetual *	975	0,38	800 Adtalem Global Education Inc, 144 A 5,500%, fällig 01.03.2028	820	0,32
			3.858	1,50		1.230 Akumin Inc, 144 A 7,000%, fällig 01.11.2025	1.163	0,45
						2.140 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144 A 10,500%, fällig 15.02.2028	2.071	0,80
						430 Alliance Data Systems Corp, 144 A 4,750%, fällig 15.12.2024	442	0,17

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			1.020			510		
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)			Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144 A 6,625%, fällig 15.07.2026	1.065	0,41	Cornerstone Building Brands Inc, 144 A 6,125%, fällig 15.01.2029	546	0,21
			360			CP Atlas Buyer Inc, 144 A 7,000%, fällig 01.12.2028	572	0,22
			810			750		
550	589	0,23	Boeing Co/The, 5,150%, fällig 01.05.2030	426	0,17	CSC Holdings LLC, 144 A 6,500%, fällig 01.02.2029	829	0,32
			800			450		
500			Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144 A 6,000%, fällig 01.02.2026	837	0,33	CSC Holdings LLC, 144 A 4,125%, fällig 01.12.2030	451	0,18
			690			480		
650	501	0,19	Burford Capital Global Finance LLC, 144 A 6,250%, fällig 15.04.2028	836	0,32	CSC Holdings LLC, 144 A 4,500%, fällig 15.11.2031	484	0,19
			540			250		
Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144 A 6,25%, fällig 01.06.2028	652	0,25	Caesars Entertainment Inc, 144 A 6,250%, fällig 01.07.2025	729	0,28	DCP Midstream Operating LP, 144 A 6,450%, fällig 03.11.2036	303	0,12
			600			600		
720	741	0,29	Calpine Corp, 144 A 5,000%, fällig 01.02.2031	571	0,22	DCP Midstream Operating LP, 144 A 6,750%, fällig 15.09.2037	748	0,29
			770			500		
80	75	0,03	Carnival Corp, 144 A 5,750%, fällig 01.03.2027	611	0,24	Delta Air Lines Inc, 7,375%, fällig 15.01.2026	589	0,23
			1.210			500		
160	148	0,06	Carriage Services Inc, 144 A 4,250%, fällig 15.05.2029	788	0,31	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,500%, fällig 20.10.2025	537	0,21
			380			400		
420	443	0,17	Carrols Restaurant Group Inc, 144 A 5,875%, fällig 01.07.2029	367	0,14	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,750%, fällig 20.10.2028	446	0,17
			560			770		
1.180	1.276	0,50	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 4,500%, fällig 15.08.2030	586	0,23	DIRECTV Holdings LLC / DIRECTV Financing Co Inc, 144 A 5,875%, fällig 15.08.2027	806	0,31
			1.000			1.700		
180	186	0,07	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 4,250%, fällig 01.02.2031	1.028	0,40	DISH DBS Corp, 7,750%, fällig 01.07.2026	1.949	0,76
			1.710			2.420		
920	967	0,38	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500%, fällig 01.05.2032	1.789	0,70	DISH DBS Corp, 144 A 5,125%, fällig 01.06.2029	2.411	0,94
			200			300		
1.310	1.311	0,51	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 4,500%, fällig 01.06.2033	208	0,08	DISH Network Corp, 3,375%, fällig 15.08.2026	314	0,12
			470			860		
784	907	0,35	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 4,250%, fällig 15.01.2034	475	0,18	Diversified Healthcare Trust, 9,750%, fällig 15.06.2025	947	0,37
			470			630		
1.110	1.129	0,44	Centene Corp, 4,625%, fällig 15.12.2029	516	0,20	Diversified Healthcare Trust, 4,750%, fällig 15.02.2028	639	0,25
			260			290		
78	76	0,03	Century Communities Inc, 144 A 3,875%, fällig 15.08.2029	264	0,10	Diversified Healthcare Trust, 4,375%, fällig 01.03.2031	285	0,11
			380			220		
470	479	0,19	Cheesecake Factory Inc/The, 0,375%, fällig 15.06.2026	357	0,14	DraftKings Inc, 144 A Zero coupon, fällig 15.03.2028	212	0,08
			1.193			300		
390	478	0,19	Cheniery Energy Inc, 4,250%, fällig 15.03.2045	1.009	0,39	Edgewell Personal Care Co, 144 A 4,125%, fällig 01.04.2029	302	0,12
			520			650		
290	323	0,13	Cheniery Energy Partners LP, 144 A 4,000%, fällig 01.03.2031	548	0,21	Elastic NV, 144 A 4,125%, fällig 15.07.2029	661	0,26
			100			290		
420	428	0,17	Chesapeake Energy Corp, 144 A 5,500%, fällig 01.02.2026	105	0,04	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144 A 6,625%, fällig 15.07.2025	308	0,12
			1.350			160		
1.340	1.307	0,51	CHS/Community Health Systems Inc, 144 A 6,875%, fällig 15.04.2029	1.404	0,55	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144 A 5,500%, fällig 30.01.2026	166	0,06
			970			80		
300	303	0,12	CHS/Community Health Systems Inc, 144 A 6,125%, fällig 01.04.2030	979	0,38	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144 A 5,750%, fällig 30.01.2028	84	0,03
			670			570		
870	888	0,34	Cinemark USA Inc, 144 A 5,875%, fällig 15.03.2026	668	0,26	Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc, 144 A 9,500%, fällig 31.07.2027	561	0,22
			490			620		
310	401	0,16	Clarivate Science Holdings Corp, 144 A 4,875%, fällig 01.07.2029	506	0,20	Endo Luxembourg Finance Co I Sarl / Endo US Inc, 144 A 6,125%, fällig 01.04.2029	615	0,24
			840			180		
702	787	0,31	Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144 A 7,500%, fällig 01.06.2029	870	0,34	Energy Transfer LP, Series H, 6,500%, Perpetual *	185	0,07
			20			730		
250	291	0,11	CNX Midstream Partners LP / CNX Midstream Finance Corp, 144 A 6,500%, fällig 15.03.2026	21	0,01	Entegris Inc, 144 A 3,625%, fällig 01.05.2029	756	0,29
			1.400			210		
1.080	1.246	0,48	Colgate Energy Partners III LLC, 144 A 5,875%, fällig 01.07.2029	1.419	0,55	EQM Midstream Partners LP, 144 A 6,000%, fällig 01.07.2025	227	0,09
			1.120			200		
650	701	0,27	Commscope Inc, 144 A 8,250%, fällig 01.03.2027	1.182	0,46	EQM Midstream Partners LP, 144 A 6,500%, fällig 01.07.2027	223	0,09
			460			990		
1.050	982	0,38	Commscope Inc, 144 A 4,750%, fällig 01.09.2029	466	0,18	EQM Midstream Partners LP, 5,500%, fällig 15.07.2028	1.082	0,42
			170			500		
1.320	1.312	0,51	Comstock Resources Inc, 144 A 7,500%, fällig 15.05.2025	121	0,05	EQM Midstream Partners LP, 6,500%, fällig 15.07.2048	566	0,22
			740			200		
640	603	0,23	Comstock Resources Inc, 144 A 5,875%, fällig 15.01.2030	743	0,29	EQT Corp, 6,625%, fällig 01.02.2025	230	0,09
			480			720		
1.570	1.560	0,61	Continental Resources Inc/OK, 144 A 5,750%, fällig 15.01.2031	168	0,06	EQT Corp, 5,000%, fällig 15.01.2029	820	0,32
			110			500		
250	253	0,10	CoreCivic Inc, 4,625%, fällig 01.05.2023	112	0,04	EQT Corp, 7,500%, fällig 01.02.2030	650	0,25
			670			200		
300	325	0,13	CoreCivic Inc, 8,250%, fällig 15.04.2026	708	0,28	EQT Corp, 144 A 3,625%, fällig 15.05.2031	212	0,08
						410		
						510		
						1.060		
						Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144 A 7,875%, fällig 15.11.2025	1.110	0,43
						830		
						Ford Motor Co, 9,000%, fällig 22.04.2025	1.015	0,39
						390		
						Ford Motor Credit Co LLC, 5,125%, fällig 16.06.2025	429	0,17

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			1.160	Madison IAQ LLC, 144 A 5,875%, fällig 30.06.2029	1.189	250	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp, 144 A 9,250%, fällig 15.05.2025	242	0,09
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)			530	Match Group Holdings II LLC, 144 A 4,625%, fällig 01.06.2028	554	1.580	Penn Virginia Escrow LLC, 144 A 9,250%, fällig 15.08.2026	1.539	0,60
1.030	Ford Motor Credit Co LLC, 5,113%, fällig 03.05.2029	0,45	810	Michaels Cos Inc/The, 144 A 5,250%, fällig 01.05.2028	832	250	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144 A 7,750%, fällig 15.02.2029	275	0,11
2.090	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000%, fällig 13.11.2030	0,86	830	Michaels Cos Inc/The, 144 A 7,875%, fällig 01.05.2029	856	560	Playtika Holding Corp, 144 A 4,250%, fällig 15.03.2029	566	0,22
600	Forestar Group Inc, 144 A 3,850%, fällig 15.05.2026	0,24	700	Midcap Financial Issuer Trust, 144 A 6,500%, fällig 01.05.2028	733	830	PM General Purchaser LLC, 144 A 9,500%, fällig 01.10.2028	904	0,35
540	Forestar Group Inc, 144 A 5,000%, fällig 01.03.2028	0,22	420	Midcap Financial Issuer Trust, 144 A 5,625%, fällig 15.01.2030	419	500	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144 A 3,375%, fällig 31.08.2027	483	0,19
360	Foundation Building Materials Inc, 144 A 6,000%, fällig 01.03.2029	0,14	700	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144 A 6,500%, fällig 20.06.2027	761	1.470	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144 A 6,250%, fällig 15.01.2028	1.525	0,59
750	Freeport-McMoRan Inc, 5,450%, fällig 15.03.2043	0,37	260	Mohegan Gaming & Entertainment, 144 A 7,875%, fällig 15.10.2024	273	520	Quicken Loans LLC / Quicken Loans Co-Issuer Inc, 144 A 3,875%, fällig 01.03.2031	533	0,21
220	Frontier Communications Holdings LLC, 144 A 5,000%, fällig 01.05.2028	0,09	1.090	MPH Acquisition Holdings LLC, 144 A 5,750%, fällig 01.11.2028	1.042	750	Rackspace Technology Global Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.02.2028	721	0,28
200	Frontier Communications Holdings LLC, 144 A 6,750%, fällig 01.05.2029	0,08	250	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000%, fällig 15.10.2027	265	700	Radiology Partners Inc, 144 A 9,250%, fällig 01.02.2028	752	0,29
600	Full House Resorts Inc, 144 A 8,250%, fällig 15.02.2028	0,25	240	Navient Corp, 6,750%, fällig 15.06.2026	271	340	Range Resources Corp, 9,250%, fällig 01.02.2026	372	0,14
860	Gartner Inc, 144 A 3,625%, fällig 15.06.2029	0,34	180	Navient Corp, 5,000%, fällig 15.03.2027	189	600	Range Resources Corp, 144 A 8,250%, fällig 15.01.2029	667	0,26
300	Gartner Inc, 144 A 3,750%, fällig 01.10.2030	0,12	700	NCL Corp Ltd, 144 A 12,250%, fällig 15.05.2024	827	220	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144 A 0,250%, fällig 15.06.2026	220	0,09
620	GEO Group Inc/The, 5,875%, fällig 15.10.2024	0,22	1.640	NCL Corp Ltd, 144 A 3,625%, fällig 15.12.2024	1.552	1.020	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144 A 5,750%, fällig 15.01.2029	1.069	0,42
1.390	GEO Group Inc/The, 6,000%, fällig 15.04.2026	0,46	490	NCL Corp Ltd, 144 A 10,250%, fällig 01.02.2026	567	290	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc, 144 A 9,750%, fällig 01.12.2026	309	0,12
390	Greif Inc, 144 A 6,500%, fällig 01.03.2027	0,16	350	NCL Corp Ltd, 144 A 5,875%, fällig 15.03.2026	351	530	Rent-A-Center Inc/TX, 144 A 6,375%, fällig 15.02.2029	572	0,22
830	H&E Equipment Services Inc, 144 A 3,875%, fällig 15.12.2028	0,32	500	NCR Corp, 144 A 5,125%, fällig 15.04.2029	519	750	Resideo Funding Inc, 144 A 4,000%, fällig 01.09.2029	751	0,29
280	Halozyne Therapeutics Inc, 144 A 0,250%, fällig 01.03.2027	0,10	860	Netflix Inc, 6,375%, fällig 15.05.2029	1.103	500	Rocket Mortgage LLC, 144 A 5,250%, fällig 15.01.2028	528	0,21
750	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144 A 5,750%, fällig 20.01.2026	0,31	220	Netflix Inc, 144 A 5,375%, fällig 15.11.2029	271	270	Rocket Software Inc, 144 A 6,500%, fällig 15.02.2029	255	0,10
140	HCA Inc, 5,625%, fällig 01.09.2028	0,06	140	Netflix Inc, 144 A 4,875%, fällig 15.06.2030	168	600	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144 A 4,250%, fällig 01.07.2026	586	0,23
207	HCA Inc, 7,500%, fällig 15.11.2095	0,12	660	News Corp, 144 A 3,875%, fällig 15.05.2029	679	680	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144 A 5,500%, fällig 31.08.2026	690	0,27
810	Helios Software Holdings Inc / ION Corporate Solutions Finance Sarl, 144 A 4,625%, fällig 01.05.2028	0,31	1.040	NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC, 144 A 7,125%, fällig 01.04.2026	1.102	780	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144 A 5,500%, fällig 01.04.2028	787	0,31
560	iHeartCommunications Inc, 144 A 5,250%, fällig 15.08.2027	0,23	590	NMI Holdings Inc, 144 A 7,375%, fällig 01.06.2025	668	1.090	Scientific Games International Inc, 144 A 7,000%, fällig 15.05.2028	1.176	0,46
240	iHeartCommunications Inc, 144 A 4,750%, fällig 15.01.2028	0,10	860	Nordstrom Inc, 5,000%, fällig 15.01.2044	856	950	Sensata Technologies BV, 144 A 4,000%, fällig 15.04.2029	985	0,38
310	IP Operating Partnership LP, 144 A 5,500%, fällig 25.05.2026	0,13	380	Northern Oil and Gas Inc, 144 A 8,125%, fällig 01.03.2028	395	222	Service Corp International/US, 7,500%, fällig 01.04.2027	272	0,11
450	Installed Building Products Inc, 144 A 5,750%, fällig 01.02.2028	0,18	760	Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144 A 7,125%, fällig 01.11.2022 †	–	600	Service Properties Trust, 5,500%, fällig 15.12.2027	644	0,25
540	International Game Technology Plc, 144 A 4,125%, fällig 15.04.2026	0,22	1.030	Oasis Petroleum Inc, 144 A 6,375%, fällig 01.06.2026	1.076	840	Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144 A 4,625%, fällig 01.11.2026	872	0,34
620	Kennedy-Wilson Inc, 5,000%, fällig 01.03.2031	0,25	20	Occidental Petroleum Corp, 1,575%, fällig 15.08.2022 *	20	660	Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 144 A 4,625%, fällig 01.03.2029	672	0,26
560	Kraft Heinz Foods Co, 5,200%, fällig 15.07.2045	0,28	700	Occidental Petroleum Corp, 8,875%, fällig 15.07.2030	962	550	Sizzling Platter LLC / Sizzling Platter Finance Corp, 144 A 8,500%, fällig 28.11.2025	568	0,22
820	Kraft Heinz Foods Co, 5,500%, fällig 01.06.2050	0,43	510	Occidental Petroleum Corp, 6,125%, fällig 01.01.2031	617	810	Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144 A 4,875%, fällig 01.11.2027	831	0,32
600	Kraton Polymers LLC / Kraton Polymers Capital Corp, 144 A 4,250%, fällig 15.12.2025	0,24	150	Occidental Petroleum Corp, Zero coupon, fällig 10.10.2036	82	930	Spirit Airlines Inc, 1,000%, fällig 15.05.2026	863	0,34
540	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144 A 4,250%, fällig 01.02.2027	0,21	500	Olin Corp, 5,000%, fällig 01.02.2030	537	648	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144 A 8,000%, fällig 20.09.2025	735	0,29
460	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144 A 4,750%, fällig 15.06.2029	0,18	600	Par Pharmaceutical Inc, 144 A 7,500%, fällig 01.04.2027	608	350	Spotify USA Inc, 144 A Zero coupon, fällig 15.03.2026	317	0,12
450	LD Holdings Group LLC, 144 A 6,500%, fällig 01.11.2025	0,18	550	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer, 144 A 5,875%, fällig 01.10.2028	586	700	Sprint Capital Corp, 8,750%, fällig 15.03.2032	1.073	0,42
1.170	LD Holdings Group LLC, 144 A 6,125%, fällig 01.04.2028	0,45	640	Park-Ohio Industries Inc, 6,625%, fällig 15.04.2027	636				
500	Legacy LifePoint Health LLC, 144 A 4,375%, fällig 15.02.2027	0,19	780	Party City Holdings Inc, 144 A 8,750%, fällig 15.02.2026	814				
1.010	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144 A 5,000%, fällig 01.02.2026	0,40	1.130	Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144 A 4,000%, fällig 15.06.2029	1.090				

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)								
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)								
920 Sprint Corp, 7,625%, fällig 15.02.2025	1.090	0,42	2.790 VOC Escrow Ltd, 144 A 5,000%, fällig 15.02.2028	2.762	1,07	396 Eyecare Partners LLC, 3,857%, fällig 05.02.2027 *	392	0,15
650 Square Inc, 144 A 3,500%, fällig 01.06.2031	677	0,26	910 Western Midstream Operating LP, 5,500%, fällig 15.08.2048	1.044	0,41	94 Focus Financial Partners LLC, 1,250%, fällig 24.06.2028 *	93	0,04
1.110 SRM Escrow Issuer LLC, 144 A 6,000%, fällig 01.11.2028	1.178	0,46	240 Western Midstream Operating LP, 6,500%, fällig 01.02.2050	283	0,11	406 Focus Financial Partners LLC, 3,000%, fällig 24.06.2028 *	404	0,16
1.240 Starwood Property Trust Inc, 144 A 3,625%, fällig 15.07.2026	1.249	0,49	1.250 WW International Inc, 144 A 4,500%, fällig 15.04.2029	1.238	0,48	692 Gannett Holdings LLC, 7,750%, fällig 08.02.2026 *	699	0,27
970 StoneMor Inc, 144 A 8,500%, fällig 15.05.2029	993	0,39	490 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144 A 7,750%, fällig 15.04.2025	521	0,20	587 GFL Environmental Inc., 3,500%, fällig 31.05.2025 *	588	0,23
240 StoneX Group Inc, 144 A 8,625%, fällig 15.06.2025	260	0,10	690 XPO CNW Inc, 6,700%, fällig 01.05.2034	833	0,32	506 Global Tel'Link Corp, 4,342%, fällig 29.11.2025 *	470	0,18
380 Suburban Propane Partners LP/ Suburban Energy Finance Corp, 144 A 5,000%, fällig 01.06.2031	392	0,15	920 ZoomInfo Technologies LLC/ ZoomInfo Finance Corp, 144 A 3,875%, fällig 01.02.2029	928	0,36	249 iHeartCommunications Inc, 3,092%, fällig 01.05.2026 *	247	0,10
				183.041	71,13	400 Jazz Financing Lux S.a.r.l., 4,000%, fällig 22.04.2028 *	400	0,16
230 Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP / Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp, 144 A 5,875%, fällig 15.05.2025	230	0,09	Sambia – 1,23 % (28. Februar 2021: 1,20 %)			400 Magenta Buyer LLC, 5,750%, fällig 03.05.2028 *	400	0,16
730 Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp, 144 A 5,250%, fällig 15.01.2029	774	0,30	350 First Quantum Minerals Ltd, 144 A 7,500%, fällig 01.04.2025	363	0,14	400 Mister Car Wash, 3,088%, fällig 14.05.2026 *	398	0,15
600 Sunnova Energy Corp, 144 A 5,875%, fällig 01.09.2026	605	0,23	600 First Quantum Minerals Ltd, 144 A 6,875%, fällig 01.03.2026	628	0,24	620 PetSmart Inc, 4,500%, fällig 29.01.2028 *	622	0,24
540 Switch Ltd, 144 A 3,750%, fällig 15.09.2028	550	0,21	2.010 First Quantum Minerals Ltd, 144 A 6,875%, fällig 15.10.2027	2.178	0,85	470 Phoenix Guarantor Inc, 3,339%, fällig 05.03.2026 *	467	0,18
130 Talen Energy Supply LLC, 144 A 7,250%, fällig 15.05.2027	113	0,04		3.169	1,23	60 Precision Medicine Group LLC, 3,750%, fällig 20.11.2027 *	60	0,02
350 Talen Energy Supply LLC, 144 A 6,625%, fällig 15.01.2028	301	0,12	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 207.277 USD)			468 Precision Medicine Group LLC, 3,750%, fällig 20.11.2027 *	466	0,18
70 Talen Energy Supply LLC, 144 A 7,625%, fällig 01.06.2028	61	0,02		215.187	83,63	357 Prime Security, 3,500%, fällig 23.09.2026 *	356	0,14
870 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144 A 6,000%, fällig 31.12.2030	886	0,34	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,31 % (28. Februar 2021: 0,29 %)			84 Redstone Holdco 2 LP, 5,500%, fällig 27.04.2028 *	84	0,03
400 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875%, fällig 01.02.2031	436	0,17	Argentinien – 0,31 % (28. Februar 2021: 0,29 %)			216 Redstone Holdco 2 LP, 5,500%, fällig 16.04.2028 *	216	0,08
860 Tenet Healthcare Corp, 144 A 4,625%, fällig 15.06.2028	891	0,35	55 Argentine Republic Government International Bond, 1,000%, fällig 09.07.2029	23	0,01	708 Rent-A-Center, 4,750%, fällig 04.02.2028 *	713	0,28
355 Terminix Co LLC/The, 7,450%, fällig 15.08.2027	425	0,17	650 Argentine Republic Government International Bond, 0,500%, fällig 09.07.2030	255	0,10	437 Spencer Spirit IH LLC, 6,092%, fällig 14.06.2026 *†	436	0,17
270 Time Warner Cable LLC, 7,300%, fällig 01.07.2038	394	0,15	514 Argentine Republic Government International Bond, 1,125%, fällig 09.07.2035	181	0,07	908 Symplr Software, Inc, 5,250%, fällig 23.11.2027 *	910	0,35
780 Titan International Inc, 144 A 7,000%, fällig 30.04.2028	816	0,32	640 Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 7,875%, fällig 15.06.2027 *	348	0,13	68 Terrier Media Buyer, Inc., 3,592%, fällig 17.12.2026 *	68	0,03
820 T-Mobile USA Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.04.2031	874	0,34		807	0,31	140 TruGreen LP, 9,250%, fällig 30.10.2028 *	143	0,06
640 T-Mobile USA Inc, 3,500%, fällig 15.04.2031	682	0,26	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 1.307 USD)			400 U.S. Renal Care Inc, 5,125%, fällig 26.06.2026 *	401	0,16
960 TopBuild Corp, 144 A 3,625%, fällig 15.03.2029	962	0,37		807	0,31	400 United Airlines, 6,250%, fällig 25.06.2027 *	425	0,16
340 TransDigm Inc, 144 A 8,000%, fällig 15.12.2025	364	0,14	Schuldscheindarlehen - 7,42 % (28. Februar 2021: 9,85 %)			203 Vericast Corp, 5,750%, fällig 03.11.2023 *†	192	0,07
460 TransDigm Inc, 144 A 6,250%, fällig 15.03.2026	484	0,19	365 Acisure LLC, 3,607%, fällig 15.02.2027 *	360	0,14	400 Verscend Holding Corp., 4,092%, fällig 27.08.2025 *	400	0,15
810 TransDigm Inc, 144 A 4,625%, fällig 15.01.2029	801	0,31	930 Adtalem Global Education Inc, 5,250%, fällig 12.02.2028 *	933	0,36	400 Virgin Pulse Inc, 4,750%, fällig 30.03.2028 *	400	0,16
680 Triton Water Holdings Inc, 144 A 6,250%, fällig 01.04.2029	674	0,26	400 Allied Universal Holdco LLC, 4,250%, fällig 14.05.2028 *	400	0,16	1.110 Whatabrands LLC, 3,750%, fällig 21.07.2028 *	1.108	0,43
346 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875%, fällig 15.01.2026	364	0,14	119 Amerilife Holdings LLC, 4,096%, fällig 06.02.2027 *	119	0,05	438 Zywave, 5,250%, fällig 30.10.2027 *	437	0,17
150 United Airlines Inc, 144 A 4,375%, fällig 15.04.2026	156	0,06	510 Athenahealth Inc, 4,410%, fällig 11.02.2026 *	513	0,20	Summe Schuldverschreibungen (Kosten 18.950 USD)		
1.550 United Airlines Inc, 144 A 4,625%, fällig 15.04.2029	1.610	0,63	358 Bass Pro Group LLC, 5,000%, fällig 26.02.2028 *	360	0,14	Kollektive Kapitalanlagen - 1,69 % (28. Februar 2021: 2,37 %)		
1.050 United Rentals North America Inc, 5,250%, fällig 15.01.2030	1.152	0,45	294 Beta Sub LLC, 3,864%, fällig 06.08.2026 *	294	0,11	4.347 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)		
630 Univision Communications Inc, 144 A 9,500%, fällig 01.05.2025	688	0,27	480 Caesars Resort Collection LLC, 2,842%, fällig 22.12.2024 *	477	0,18	4.347		
530 Urban One Inc, 144 A 7,375%, fällig 01.02.2028	572	0,22	678 CNT Holdings I Corp, 4,500%, fällig 16.10.2027 *	679	0,26	Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 4.347 USD)		
1.310 US Renal Care Inc, 144 A 10,625%, fällig 15.07.2027	1.377	0,53	231 CoreCivic Inc, 5,500%, fällig 18.12.2024 *	229	0,09	Stammaktien - 0,66 % (28. Februar 2021: 0,72 %)		
780 Vericast Corp, 144 A 11,000%, fällig 15.09.2026	830	0,32	570 DCert Buyer, Inc., 7,092%, fällig 16.02.2029 *	576	0,22	Vereinigte Staaten - 0,66 % (28. Februar 2021: 0,72 %)		
800 Viking Cruises Ltd, 144 A 13,000%, fällig 15.05.2025	927	0,36	992 DCert Buyer, Inc., 4,092%, fällig 16.10.2026 *	992	0,39	90 Berry Corp 542 0,21		
400 Viking Cruises Ltd, 144 A 5,875%, fällig 15.09.2027	388	0,15	190 Deerfield Dakota Holding LLC, 7,500%, fällig 14.04.2028 *	195	0,08	96 Hercules Offshore Inc †∞ 3 –		
980 Viking Cruises Ltd, 144 A 7,000%, fällig 15.02.2029	992	0,39	292 Endo Luxembourg Finance I Company S.a.r.l., 5,750%, fällig 11.03.2028 *	285	0,11	9 Oasis Petroleum Inc 811 0,31		
			347 Equinox Holdings Inc, 10,000%, fällig 08.03.2024 *	349	0,14	14 Party City Holdings Inc 95 0,04		
			330 Eyecare Partners LLC, 8,357%, fällig 21.01.2027 *	327	0,13	56 Southwestern Energy Co 254 0,10		
						1.705 0,66		
						Summe Stammaktien (Kosten 3.748 USD)		
						1.705 0,66		
						Vorzugsaktien - 0,85 % (28. Februar 2021: 1,21 %)		
						Vereinigte Staaten - 0,85 % (28. Februar 2021: 1,21 %)		
						18 B Riley Financial Inc 461 0,18		
						3 B Riley Financial Inc 81 0,03		
						12 B Riley Financial Inc 297 0,12		
						3 GMAC Capital Trust I, Series 2 67 0,03		
						20 MPLX LP, Series Axx 704 0,27		
						1 Targa Resources Corp, Series A 572 0,22		
						2.182 0,85		

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Summe Vorzugsaktien (Kosten 2.094 USD)	2.182	0,85	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(50)	(0,02)
Summe Kapitalanlagen ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Kosten 249.736 USD)	255.384	99,25	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	255.380	99,25
Credit Default Swaps - 0,01 % (28. Februar 2021: 0,02 %)			Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	1.941	0,75
Nicht realisierte Wertsteigerungen von Verträgen (siehe unten)	21	0,01	Gesamtnettvermögen	\$257.321	100,00
Devisentermingeschäfte - 0,01 % (28. Februar 2021: 0,01 %)			-		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	13	0,01	144A		
Termingeschäfte - 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 179.174.000 USD oder 69,61 % des Nettovermögens.		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	12	-	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	255.430	99,27	† Illiquid.		
Credit Default Swaps - (0,01 %) (28. Februar 2021: (0,01 %))			∞ Das Wertpapier wurde vom Manager oder dem jeweiligen Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(32)	(0,01)	ε Die Sicherheitsleistung ist zum 31. August 2021 in Verzug (entweder mit dem Kapital und/oder den Zinsen).		
Devisentermingeschäfte - (0,01 %) ^ (28. Februar 2021: 0,00 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(18)	(0,01)			

ABKÜRZUNGEN:

Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

Analyse des Gesamtvermögens	% von Gesamt Vermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	88,95
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	7,32
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,67
Finanzderivate	1,02
Sonstige Vermögenswerte	2,04
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kauf-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Ford Motor Credit Co LLC, 5,000%	Verkauf	20.06.2023	300	\$ 21
Goldman Sachs	Occidental Petroleum Corporation, 1,000%	Verkauf	20.06.2026	920	(32)
Nicht realisierter Wertzuwachs von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 39 USD)					\$ 21
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (26) USD)					(32)
Nettoabschreibung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 13 USD)					\$ (11)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 5	Verkauf EUR 4	\$ –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 980	Verkauf GBP 719	(8)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 96	Verkauf SGD 131	(1)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf SGD 897	Verkauf USD 663	5
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf GBP 793	Verkauf USD 1.099	(9)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 1.711	Verkauf USD 2.012	8
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf USD 7	Verkauf CAD 8	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisentermingeschäften (28. Februar 2021 (in Tsd.): 28 USD)				\$ 13
Nicht realisierte Wertminderung von Devisentermingeschäften (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1) USD)				(18)
Nettoabschreibung von Devisentermingeschäften (28. Februar 2021 (in Tsd.): 27 USD)				\$ (5)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021 Goldman Sachs	76	\$ 9.403	\$ 12
Nicht realisierter Wertzuwachs von Terminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): - USD)			\$ 12
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (85) USD)			-
Nicht realisierte Wertminderung von Devisentermingeschäften (28. Februar 2021 (in Tsd.): (85) USD)			\$ 12

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 62,42 % (28. Februar 2021: 60,10 %)			Indonesien - 4,03 % (28. Februar 2021: 4,26 %)			Peru - 1,35 % (28. Februar 2021: 2,10 %)		
Brasilien - 3,25 % (28. Februar 2021: 3,48 %)			400 Hutama Karya Persero PT, 3,750%, fällig 11.05.2030			200 Petroleos del Peru SA, 5,625%, fällig 19.06.2047		
460 Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 6,125%, Perpetual *			460 Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, 6,530%, fällig 15.11.2028			460 Volcan Cia Minera SAA, 4,375%, fällig 11.02.2026		
470			566			448		
360 Petrobras Global Finance BV, 6,850%, fällig 05.06.2115			460 Minejasa Capital BV, 5,625%, fällig 10.08.2037			657		
400			500			1,35		
200 Suzano Austria GmbH, 3,125%, fällig 15.01.2032			460 Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4,000%, fällig 30.06.2050					
201			459			0,42		
460 Ultrapar International SA, 5,250%, fällig 06.10.2026			1.962					
509			4,03					
1.580								
3,25								
Chile - 2,63 % (28. Februar 2021: 0,94 %)			Israel - 1,96 % (28. Februar 2021: 1,82 %)			Katar - 0,42 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
580 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050%, fällig 27.04.2026			460 Bank Leumi Le-Israel BM, 144 A 3,275%, fällig 29.01.2031 *			200 Ooredoo International Finance Ltd, 2,625%, fällig 08.04.2031		
593			472			207		
200 Inversiones CMPC SA, 3,000%, fällig 06.04.2031			460 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,000%, fällig 15.04.2024			0,42		
204			482					
460 VTR Comunicaciones SpA, 5,125%, fällig 15.01.2028			954					
481			1,96					
1.278								
2,63								
China - 7,26 % (28. Februar 2021: 8,36 %)			Kasachstan - 2,29 % (28. Februar 2021: 2,11 %)			Russland - 2,53 % (28. Februar 2021: 3,00 %)		
450 China Aoyuan Group Ltd, 7,950%, fällig 19.02.2023			460 KazMunayGas National Co JSC, 6,375%, fällig 24.10.2048			430 Lukoil International Finance BV, 6,656%, fällig 07.06.2022		
445			607			449		
200 China SCE Group Holdings Ltd, 7,375%, fällig 09.04.2024			460 KazTransGas JSC, 4,375%, fällig 26.09.2027			690 Russian Agricultural Bank OJSC Via RSHB Capital SA, 8,500%, fällig 16.10.2023		
207			508			781		
200 CMB International Leasing Management Ltd, 2,750%, fällig 12.08.2030			1.115			1,61		
198			2,29			2,53		
200 Coastal Emerald Ltd, 4,300%, Perpetual *			Kuwait - 2,66 % (28. Februar 2021: 1,94 %)			Singapur - 3,98 % (28. Februar 2021: 3,72 %)		
205			460 MEGlobal Canada ULC, 5,875%, fällig 18.05.2030			200 BOC Aviation Ltd, 2,625%, fällig 17.01.2025		
439			720 NBK Tier 1 Financing Ltd, 3,625%, Perpetual *			250 BOC Aviation Ltd, 3,250%, fällig 29.04.2025		
450 Logan Group Co Ltd, 6,500%, fällig 16.07.2023			1.296			264		
460			2,66			0,54		
200 Pingan Real Estate Capital Ltd, 3,450%, fällig 29.07.2026			Macau - 0,96 % (28. Februar 2021: 0,92 %)			460 DBS Group Holdings Ltd, 3,300%, Perpetual *		
198			460 Wynn Macau Ltd, 5,625%, fällig 26.08.2028			474		
530 Prosus NV, 144 A 3,061%, fällig 13.07.2031			460 Xiyata Spv5 Labuan Ltd, 3,064%, fällig 19.08.2050			0,97		
519			563			1,03		
200 Shimao Group Holdings Ltd, 6,125%, fällig 21.02.2024			200 Gohi Capital Ltd, 4,250%, fällig 24.01.2027			500		
206			212			1,01		
200 Times China Holdings Ltd, 6,750%, fällig 08.07.2025			775			3,98		
200			1,59					
460 Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6,000%, fällig 25.01.2022			Mexiko - 5,23 % (28. Februar 2021: 4,71 %)			460 United Overseas Bank Ltd, 3,750%, fällig 15.04.2029 *		
458			460 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 7,625%, Perpetual *			490		
3.535			523			1,01		
7,26			480			3,98		
			460 Fresno Plc, 4,250%, fällig 02.10.2050					
			460 Orbia Advance Corp SAB de CV, 5,875%, fällig 17.09.2044					
			460 Petroleos Mexicanos, 4,500%, fällig 23.01.2026					
			466					
			2.542					
			5,23					
			Malaysia - 1,59 % (28. Februar 2021: 1,02 %)			Südafrika - 2,26 % (28. Februar 2021: 0,95 %)		
			570 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064%, fällig 19.08.2050			460 Eskom Holdings SOC Ltd, 6,350%, fällig 10.08.2028		
			563			510		
			200			1,05		
			460			1,21		
			460			2,26		
			775					
			1,59					
			Malta - 0,96 % (28. Februar 2021: 0,92 %)			Südkorea - 0,41 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
			460 Wynn Macau Ltd, 5,625%, fällig 26.08.2028			200 Shinhan Financial Group Co Ltd, 2,875%, Perpetual *		
			467			199		
			0,96			0,41		
			1,54					
			Marokko - 1,54 % (28. Februar 2021: 0,95 %)			Supranational - 3,09 % (28. Februar 2021: 2,45 %)		
			260 OCP SA, 4,500%, fällig 22.10.2025			200 African Export-Import Bank/The, 3,994%, fällig 21.09.2029		
			282			213		
			460			0,44		
			466			0,52		
			748			0,63		
			1,54					
			Niederlande - 1,09 % (28. Februar 2021: 1,03 %)			Türkei - 1,10 % (28. Februar 2021: 1,01 %)		
			520 VEON Holdings BV, 3,375%, fällig 25.11.2027			510 Turk Telekomunikasyon AS, 4,875%, fällig 19.06.2024		
			530			534		
			1,09			1,10		
			Oman - 0,98 % (28. Februar 2021: 0,91 %)			Vereinigte Staaten - 1,14 % (28. Februar 2021: 0,29 %)		
			460 OmGrid Funding Ltd, 5,196%, fällig 16.05.2027			20 General Electric Co, 3,450%, fällig 01.05.2027		
			478			22		
			0,98			0,05		
			Panama - 2,42 % (28. Februar 2021: 1,79 %)			10 Mastercard Inc, 3,850%, fällig 26.03.2050		
			460 Banco General SA, 5,250%, Perpetual *			12		
			476			0,02		
			0,98					
			200 Empresa de Transmision Electrica SA, 5,125%, fällig 02.05.2049			30 New York Life Insurance Co, 3,750%, fällig 15.05.2050		
			230			35		
			460 ENA Master Trust, 4,000%, fällig 19.05.2048			460 Sagico Financial Co Ltd, 5,300%, fällig 13.05.2028		
			472			487		
			1.178			556		
			2,42			1,14		
						Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 29.731 USD)		
						30.374		
						62,42		

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen - 24,17 % (28. Februar 2021: 28,65 %)			Panama - 0,47 % (28. Februar 2021: 1,26 %)			Devisentermingeschäfte - 0,07 % (28. Februar 2021: 0,28 %)		
Bahamas - 1,51 % (28. Februar 2021: 1,76 %)			200 Panama Government International Bond, 4,500%, fällig 01.04.2056			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
720 Bahamas Government International Bond, 5,750%, fällig 16.01.2024	734	1,51		229	0,47		35	0,07
Bahrain - 1,03 % (28. Februar 2021: 0,98 %)			Republik Ruanda - 0,51 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Termingeschäfte - 0,02 % (28. Februar 2021: 0,34 %)		
460 Bahrain Government International Bond, 6,750%, fällig 20.09.2029			240 Rwanda International Government Bond, 5,500%, fällig 09.08.2031			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	500	1,03		248	0,51		9	0,02
Chile - 0,40 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Russland - 1,03 % (28. Februar 2021: 1,77 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
200 Chile Government International Bond, 3,100%, fällig 22.01.2061			RUB 2.650 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6209X 7,600%, fällig 20.07.2022			47.047		
	195	0,40		37	0,08	96,69		
Elfenbeinküste (Côte d'Ivoire) - 2,01 % (28. Februar 2021: 1,90 %)			RUB 33.383 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212X 7,050%, fällig 19.01.2028			Gezeichnete Optionen - (0,02 %) (28. Februar 2021: (0,06 %))		
EUR 390 Ivory Coast Government International Bond, 4,875%, fällig 30.01.2032						(500) USD Call/BRL Put 5,50X fällig 25.10.2021 –JP Morgan		
498 Ivory Coast Government International Bond, 5,750%, fällig 31.12.2032	507	1,04		463	0,95	(235) USD Call/CNH Put 7,00X fällig 17.03.2022 JP Morgan		
	978	2,01		500	1,03	(300) USD Call/CNH Put 7,11X fällig 13.11.2021 JP Morgan		
Dominikanische Republik - 0,65 % (28. Februar 2021: 0,98 %)			Senegal - 0,99 % (28. Februar 2021: 0,94 %)			(500) USD Put/BRL Call 5,00X fällig 25.10.2021 –JP Morgan		
300 Dominican Republic International Bond, 144 A 4,875%, fällig 23.09.2032			460 Senegal Government International Bond, 6,750%, fällig 13.03.2048			(4) (0,01)		
	316	0,65		480	0,99	Summe gezeichnete Optionen (Kosten 20) USD		
Ecuador - 0,41 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Südafrika - 0,58 % (28. Februar 2021: 0,49 %)			(9) (0,02)		
280 Ecuador Government International Bond, 1,000%, fällig 31.07.2035			ZAR 4.690 Republic of South Africa Government Bond, Series 2037X 8,500%, fällig 31.01.2037			Credit Default Swaps - (0,02 %) (28. Februar 2021: (0,05 %))		
	202	0,41		280	0,58	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
Ägypten - 1,54 % (28. Februar 2021: 0,94 %)			Türkei - 1,24 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			(11) (0,02)		
EGP 3.980 Egypt Government Bond, Series 2 YR, 14,138%, fällig 20.10.2022			600 Türkiye İhracat Kredi Bankası AS, 5,750%, fällig 06.07.2026			Devisentermingeschäfte - (0,09 %) (28. Februar 2021: (0,06 %))		
460 Egypt Government International Bond, 7,625%, fällig 29.05.2032	495	1,02		605	1,24	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	750	1,54				(45) (0,09)		
Ghana - 1,19 % (28. Februar 2021: 1,15 %)			Ukraine - 1,55 % (28. Februar 2021: 1,45 %)			Termingeschäfte - (0,02 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)		
460 Ghana Government International Bond, 10,750%, fällig 14.10.2030			450 Ukraine Government International Bond, 8,994%, fällig 01.02.2024			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	578	1,19		502	1,03	(11) (0,02)		
Indonesien - 0,89 % (28. Februar 2021: 0,80 %)			Vereinigte Arabische Emirate - 0,86 % (28. Februar 2021: 0,81 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
IDR 5.401.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR68X 8,375%, fällig 15.03.2034			460 Finance Department Government of Sharjah, 4,000%, fällig 28.07.2050			(76) (0,15)		
	434	0,89		419	0,86	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Jamaika - 1,11 % (28. Februar 2021: 1,03 %)			Usbekistan - 0,41 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			46.971		
460 Jamaica Government International Bond, 6,750%, fällig 28.04.2028			200 Republic of Uzbekistan International Bond, 3,900%, fällig 19.10.2031			96,54		
	540	1,11		200	0,41	Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
Jordanien - 1,00 % (28. Februar 2021: 0,94 %)			Vietnam - 0,46 % (28. Februar 2021: 0,99 %)			1.687		
460 Jordan Government International Bond, 5,850%, fällig 07.07.2030			200 Vietnam Government International Bond, 144 A 4,800%, fällig 19.11.2024			3,46		
	486	1,00		223	0,46	Gesamtvermögen		
Kenia - 1,07 % (28. Februar 2021: 0,97 %)			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 11.729 USD)			\$48.658		
460 Republic of Kenya Government International Bond, 7,250%, fällig 28.02.2028			11.758			100,00		
	519	1,07		11.758	24,17			
Mexiko - 0,41 % (28. Februar 2021: 1,24 %)			Kollektive Kapitalanlagen - 9,97 % (28. Februar 2021: 9,15 %)					
MXN 3.920 Mexican Bonos, Series M, 7,750%, fällig 13.11.2042			47 Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US\$ Distributing (M)					
	199	0,41		4.854	9,97			
Marokko - 0,88 % (28. Februar 2021: 0,82 %)			Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 4.663 USD)					
460 Morocco Government International Bond, 4,000%, fällig 15.12.2050			4.854					
	429	0,88		4.854	9,97			
Nigeria - 1,00 % (28. Februar 2021: 0,94 %)			Summe Kapitalanlagen ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Kosten 46.123 USD)					
460 Nigeria Government International Bond, 6,500%, fällig 28.11.2027			46.986					
	487	1,00		46.986	96,56			
Oman - 0,97 % (28. Februar 2021: 0,90 %)			Verträge (in Tsd.)					
460 Oman Government International Bond, 4,125%, fällig 17.01.2023			471					
	471	0,97	Gekaufte Optionen - 0,04 % (28. Februar 2021: 0,03 %)					
			500 USD Put/BRL Call 5,20X fällig 25.10.2021 – JP Morgan					
			235 USD Put/CNY Call 6,45X fällig 17.03.2022 – JP Morgan					
			300 USD Put/CNY Call 6,55X fällig 13.11.2021 – JP Morgan					
			17					
			17					
			0,04					

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Analyse des Gesamtvermögens	% von Gesamtvermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	86,24
Organismen für gemeinsame Anlagen	9,93
Finanzderivate	0,13
Sonstige Vermögenswerte	3,70
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

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	(6)
Nicht realisierter Wertzuwachs von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): - USD)					\$ -
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (12) USD)					(11)
Nettoabschreibung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (12) USD)					\$ (11)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
15.09.2021	Bank of America Merrill Lynch	Buy	USD	584	Sell	RUB	42.931	\$ (2)
15.09.2021	Bank of America Merrill Lynch	Buy	RUB	19.342	Sell	USD	263	2
15.09.2021	Bank of America Merrill Lynch	Buy	RUB	7.908	Sell	USD	108	-
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD	27	Sell	EUR	23	-
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD	-	Sell	GBP	-	-
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD	-	Sell	SGD	-	-
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	SGD	11	Sell	USD	8	-
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	GBP	97	Sell	USD	135	(1)
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	EUR	3.110	Sell	USD	3.659	14
15.09.2021	Goldman Sachs	Buy	USD	501	Sell	EUR	411	15
15.09.2021	JP Morgan	Buy	USD	20	Sell	CNH	127	-
15.09.2021	JP Morgan	Buy	USD	59	Sell	RUB	4.308	-
15.09.2021	JP Morgan	Buy	CNH	2.678	Sell	USD	415	(1)
30.09.2021	Citi	Buy	KRW	568.579	Sell	USD	489	2
14.10.2021	JP Morgan	Buy	USD	549	Sell	INR	41.436	(16)
15.10.2021	Bank of America Merrill Lynch	Buy	USD	21	Sell	BRL	110	-
15.10.2021	Goldman Sachs	Buy	USD	277	Sell	ZAR	4.035	1
15.10.2021	JP Morgan	Buy	USD	740	Sell	IDR	10.877.817	(22)
15.10.2021	JP Morgan	Buy	USD	229	Sell	MXN	4.597	1
26.10.2021	JP Morgan	Buy	USD	244	Sell	BRL	1.286	(3)
15.12.2021	Bank of America Merrill Lynch	Buy	USD	540	Sell	SAR	2.028	-
15.12.2021	Goldman Sachs	Buy	USD	1.306	Sell	SAR	4.901	-
Nicht realisierter Wertzuwachs von Devisentermingeschäften (28. Februar 2021 (in Tsd.): 62 USD)						\$ 35		
Nicht realisierte Wertminderung von Devisentermingeschäften (28. Februar 2021 (in Tsd.): (13) USD)						(45)		
Nettoabschreibung von Devisentermingeschäften (28. Februar 2021 (in Tsd.): 49 USD)						\$ (10)		

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Goldman Sachs	(53)	\$ (7.073)	\$ 9
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2021	Goldman Sachs	(22)	(3.585)	(11)
Nicht realisierter Wertzuwachs von Terminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 77 USD)				\$ 9
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): - USD)				(11)
Nettoabschreibung von Terminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 77 USD)				\$ (2)

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 85,82 % (28. Februar 2021: 89,01 %)								
Argentinien - 0,93 % (28. Februar 2021: 0,49 %)								
200 MercadoLibre Inc, 3,125%, fällig 14.01.2031	198	0,44	200 Sunac China Holdings Ltd, 6,500%, fällig 09.07.2023	200	0,44	400 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800%, fällig 21.07.2023	395	0,88
200 Pan American Energy LLC/ Argentina, 9,125%, fällig 30.04.2027	223	0,49	200 Tencent Holdings Ltd, 3,925%, fällig 19.01.2038	217	0,48	750 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125%, fällig 31.01.2025	820	1,82
	421	0,93	200 Times China Holdings Ltd, 6,750%, fällig 16.07.2023	203	0,45		1.724	3,83
Brasilien - 7,04 % (28. Februar 2021: 9,01 %)								
200 Braskem Finance Ltd, 6,450%, fällig 03.02.2024	224	0,50	400 Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6,000%, fällig 25.10.2023	354	0,79			
200 CSN Inova Ventures, 6,750%, fällig 28.01.2028	220	0,49		3.811	8,46			
200 Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 5,650%, fällig 19.03.2022	203	0,45	Kolumbien - 6,42 % (28. Februar 2021: 6,29 %)					
300 Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island, 6,125%, Perpetual *	307	0,68	200 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA, 4,875%, fällig 21.04.2025	210	0,47	Kasachstan - 1,51 % (28. Februar 2021: 1,70 %)		
200 Nexa Resources SA, 6,500%, fällig 18.01.2028	223	0,49	200 Ecopetrol SA, 6,875%, fällig 29.04.2030	241	0,54	200 KazMunayGas National Co JSC, 5,375%, fällig 24.04.2030	240	0,53
360 Petrobras Global Finance BV, 6,250%, fällig 17.03.2024	406	0,90	230 Ecopetrol SA, 5,875%, fällig 28.05.2045	247	0,55	400 KazTransGas JSC, 4,375%, fällig 26.09.2027	442	0,98
100 Petrobras Global Finance BV, 5,999%, fällig 27.01.2028	115	0,25	200 Grupo de Inversiones Suramericana SA, 5,500%, fällig 29.04.2026	216	0,48		682	1,51
200 Petrobras Global Finance BV, 5,600%, fällig 03.01.2031	225	0,50	200 Grupo Energia Bogota SA ESP, 4,875%, fällig 15.05.2030	226	0,50	Kuwait - 1,96 % (28. Februar 2021: 2,67 %)		
560 Petrobras Global Finance BV, 6,850%, fällig 05.06.2115	622	1,38	630 Millicom International Cellular SA, 6,250%, fällig 25.03.2029	692	1,54	200 Equate Petrochemical BV, 4,250%, fällig 03.11.2026	223	0,50
200 Suzano Austria GmbH, 5,000%, fällig 15.01.2030	228	0,51	400 Oleoducto Central SA, 4,000%, fällig 14.07.2027	414	0,92	200 MEGlobal Canada ULC, 5,875%, fällig 18.05.2030	249	0,55
280 Vale Overseas Ltd, 6,875%, fällig 10.11.2039	401	0,89	200 Promigas SA ESP / Gases del Pacífico SAC, 3,750%, fällig 16.10.2029	201	0,44	410 NBK Tier 1 Financing Ltd, 3,625%, Perpetual *	411	0,91
	3.174	7,04	200 SURA Asset Management SA, 4,375%, fällig 11.04.2027	217	0,48		883	1,96
Chile - 5,96 % (28. Februar 2021: 4,81 %)								
590 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050%, fällig 27.04.2026	603	1,34	200 Transportadora de Gas Internacional SA ESP, 5,550%, fällig 01.11.2028	227	0,50			
200 Enel Chile SA, 4,875%, fällig 12.06.2028	231	0,51		2.891	6,42	Macau - 2,66 % (28. Februar 2021: 2,44 %)		
200 Engie Energia Chile SA, 3,400%, fällig 28.01.2030	207	0,46	Hongkong - 3,02 % (28. Februar 2021: 2,90 %)					
188 GNL Quintero SA, 4,634%, fällig 31.07.2029	204	0,45	200 AIA Group Ltd, 2,700%, Perpetual *	204	0,45	200 MGM China Holdings Ltd, 5,375%, fällig 15.05.2024	205	0,46
200 Inversiones CMPC SA, 4,750%, fällig 15.09.2024	218	0,48	500 Goodman HK Finance, 4,375%, fällig 19.06.2024	542	1,20	400 Sands China Ltd, 5,400%, fällig 08.08.2028	461	1,02
400 Inversiones CMPC SA, 3,000%, fällig 06.04.2031	407	0,90	400 Melco Resorts Finance Ltd, 4,875%, fällig 06.06.2025	407	0,91	200 Wynn Macau Ltd, 5,625%, fällig 26.08.2028	203	0,45
350 Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 4,250%, fällig 07.05.2029	395	0,88	200 Melco Resorts Finance Ltd, 144 A 5,375%, fällig 04.12.2029	207	0,46	330 Wynn Macau Ltd, 5,125%, fällig 15.12.2029	328	0,73
200 Transelec SA, 4,625%, fällig 26.07.2023	213	0,47		1.360	3,02		1.197	2,66
200 VTR Comunicaciones SpA, 5,125%, fällig 15.01.2028	209	0,47	Indien - 3,42 % (28. Februar 2021: 4,34 %)					
	2.687	5,96	200 Adani Ports & Special Economic Zone Ltd, 3,100%, fällig 02.02.2031	194	0,43	Malaysia - 2,04 % (28. Februar 2021: 1,69 %)		
China - 8,46 % (28. Februar 2021: 6,35 %)								
200 Alibaba Group Holding Ltd, 4,000%, fällig 06.12.2037	224	0,50	400 Bharti Airtel Ltd, 4,375%, fällig 10.06.2025	434	0,96	500 Axiata Spvs Labuan Ltd, 3,064%, fällig 19.08.2050	493	1,10
200 China Aoyuan Group Ltd, 7,950%, fällig 19.02.2023	198	0,44	200 Oil India Ltd, 5,375%, fällig 17.04.2024	220	0,49	400 Gohh Capital Ltd, 4,250%, fällig 24.01.2027	425	0,94
200 China SCE Group Holdings Ltd, 7,250%, fällig 19.04.2023	206	0,46	204 ONGC Videsh Ltd, 4,625%, fällig 15.07.2024	222	0,49		918	2,04
400 Country Garden Holdings Co Ltd, 5,400%, fällig 27.05.2025	425	0,94	200 REC Ltd, 2,250%, fällig 01.09.2026	198	0,44	Mexiko - 6,71 % (28. Februar 2021: 6,63 %)		
200 Fuqing Investment Management Ltd, 3,250%, fällig 23.06.2025	198	0,44	250 Reliance Industries Ltd, 3,667%, fällig 30.11.2027	275	0,61	200 Alpek SAB de CV, 4,250%, fällig 108.09.2029	220	0,49
400 Huarong Finance 2019 Co Ltd, 2,125%, fällig 30.09.2023	382	0,85		1.543	3,42	200 Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman, 7,500%, Perpetual *	227	0,50
200 Logan Group Co Ltd, 6,500%, fällig 16.07.2023	205	0,45	Indonesien - 1,47 % (28. Februar 2021: 1,65 %)					
200 Logan Group Co Ltd, 4,250%, fällig 12.07.2025	196	0,44	200 Cikarang Litrindo Tbk PT, 4,950%, fällig 14.09.2026	205	0,46	200 Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman, 6,875%, Perpetual *	207	0,46
200 Longfor Group Holdings Ltd, 3,900%, fällig 16.04.2023	208	0,46	200 Minejesa Capital BV, 4,625%, fällig 10.08.2030	209	0,46	200 BBVA Bancomer SA/Texas, 6,750%, fällig 30.09.2022	212	0,47
190 Prosperous Ray Ltd, 4,625%, fällig 12.11.2023	203	0,45	230 Minejesa Capital BV, 5,625%, fällig 10.08.2037	250	0,55	200 BBVA Bancomer SA/Texas, 1,875%, fällig 108.09.2025	203	0,45
Irland - 0,19 % (28. Februar 2021: 0,21 %)								
			80 Avolon Holdings Funding Ltd, 144 A 4,250%, fällig 15.04.2026	87	0,19	250 BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125%, fällig 18.01.2033*	261	0,58
Israel - 3,83 % (28. Februar 2021: 2,97 %)								
			200 Bank Leumi Le-Israel BM, 144 A 3,275%, fällig 29.01.2031*	205	0,46	200 Cemex SAB de CV, 3,875%, fällig 11.07.2031	206	0,46
			300 Mizrahi Tefahot Bank Ltd, 144 A 3,077%, fällig 07.04.2031*	304	0,67	280 Comision Federal de Electricidad, 3,875%, fällig 26.07.2033	281	0,62
						300 Fresnillo Plc, 4,250%, fällig 02.10.2050	320	0,71
						200 Grupo Bimbo SAB de CV, 4,700%, fällig 10.11.2047	243	0,54
						200 Orbia Advance Corp SAB de CV, 4,000%, fällig 04.10.2027	220	0,49
						200 Orbia Advance Corp SAB de CV, 2,875%, fällig 11.05.2031	204	0,45
						200 Trust Fibra Uno, 4,869%, fällig 15.01.2030	220	0,49
							3.024	6,71
						Marokko - 1,17 % (28. Februar 2021: 1,22 %)		
						520 OCP SA, 5,125%, fällig 23.06.2051	527	1,17
						Niederlande - 1,46 % (28. Februar 2021: 1,64 %)		
						200 VEON Holdings BV, 4,000%, fällig 09.04.2025	211	0,47
						440 VEON Holdings BV, 3,375%, fällig 25.11.2027	449	0,99
							660	1,46

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Türkei - 2,78 % (28. Februar 2021: 2,61 %)			Nigeria - 0,48 % (28. Februar 2021: 0,54 %)		
Panama - 3,20 % (28. Februar 2021: 2,59 %)			400 Mersin Uluslararası Liman Isletmeciligi AS, 5,375%, fällig 15.11.2024			200 Nigeria Government International Bond, 7,875%, fällig 16.02.2032		
400 Banco General SA, 5,250%, Perpetual *	414	0,92	200 TC Ziraat Bankasi AS, 5,125%, fällig 03.05.2022	204	0,45	Oman - 0,93 % (28. Februar 2021: 1,02 %)		
400 Banco Nacional de Panama, 2,500%, fällig 11.08.2030	384	0,85	200 TC Ziraat Bankasi AS, 5,125%, fällig 29.09.2023	206	0,46	200 Oman Government International Bond, 4,125%, fällig 17.01.2023		
200 Banistmo SA, 3,650%, fällig 19.09.2022	204	0,45	400 Turk Telekomunikasyon AS, 4,875%, fällig 19.06.2024	419	0,93	200 Oman Government International Bond, 5,625%, fällig 17.01.2028		
220 Cable Onda SA, 4,500%, fällig 30.01.2030	234	0,52		1.252	2,78	212		
200 ENA Master Trust, 4,000%, fällig 19.05.2048	205	0,46	Vereinigte Arabische Emirate - 1,91 % (28. Februar 2021: 3,08 %)			417		
	1.441	3,20	400 Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC, 4,600%, fällig 02.11.2047			0,93		
Peru - 4,13 % (28. Februar 2021: 5,92 %)			300 DP World Ltd/United Arab Emirates, 5,625%, fällig 25.09.2048			0,93		
200 Banco BBVA Peru SA, 5,250%, fällig 22.09.2029*	212	0,47	400 General Electric Co, 3,450%, fällig 01.05.2027			0,48		
190 Banco de Credito del Peru, 3,125%, fällig 01.07.2030*	190	0,42	300 Hilton Domestic Operating Co Inc, 144 A 3,625%, fällig 15.02.2032			0,48		
200 Consorcio Transmataro SA, 4,700%, fällig 16.04.2034	225	0,50	400 Sagicor Financial Co Ltd, 5,300%, fällig 13.05.2028			0,47		
200 Kallpa Generacion SA, 4,125%, fällig 16.08.2027	204	0,45	400 First Quantum Minerals Ltd, 6,875%, fällig 15.10.2027			0,47		
150 Southern Copper Corp, 3,875%, fällig 23.04.2025	163	0,36	Sambia - 0,96 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			0,44		
105 Southern Copper Corp, 7,500%, fällig 27.07.2035	153	0,34	400 First Quantum Minerals Ltd, 6,875%, fällig 15.10.2027			0,44		
300 Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250%, fällig 30.04.2028	322	0,72	Summe der Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 36.775 USD)			0,44		
400 Volcan Cia Minera SAA, 4,375%, fällig 11.02.2026	390	0,87	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen - 10,27 % (28. Februar 2021: 9,01 %)			0,46		
	1.859	4,13	Bahamas - 0,45 % (28. Februar 2021: 0,50 %)			0,46		
Katar - 1,74 % (28. Februar 2021: 2,52 %)			200 Bahamas Government International Bond, 5,750%, fällig 16.01.2024			0,46		
200 Ooredoo International Finance Ltd, 2,625%, fällig 08.04.2031	206	0,46	Bahrain - 0,42 % (28. Februar 2021: 0,48 %)			0,46		
300 QNB Finance Ltd, 1,625%, fällig 22.09.2025	304	0,67	200 Bahrain Government International Bond, 6,250%, fällig 25.01.2051			0,42		
240 Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3X 5,838%, fällig 30.09.2027	276	0,61	Costa Rica - 0,41 % (28. Februar 2021: 0,44 %)			0,42		
	786	1,74	200 Costa Rica Government International Bond, 5,625%, fällig 30.04.2043			0,41		
Russland - 2,45 % (28. Februar 2021: 3,72 %)			Côte d'Ivoire (Elfenbeinküste) - 0,76 % (28. Februar 2021: 0,84 %)			0,41		
200 Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA, 4,950%, fällig 23.03.2027	224	0,49	100 Ivory Coast Government International Bond, 4,875%, fällig 30.01.2032			0,76		
200 Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA, 4,950%, fällig 06.02.2028	224	0,50	200 Ivory Coast Government International Bond, 6,125%, fällig 15.06.2033			0,76		
400 Lukoil International Finance BV, 4,750%, fällig 02.11.2026	449	1,00	Dominikanische Republik - 0,70 % (28. Februar 2021: 0,76 %)			0,70		
200 MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC, 4,100%, fällig 11.04.2023	208	0,46	310 Dominican Republic International Bond, 5,300%, fällig 21.01.2041			0,70		
	1.105	2,45	Ägypten - 0,48 % (28. Februar 2021: 0,53 %)			0,48		
Singapur - 2,91 % (28. Februar 2021: 3,81 %)			200 Egypt Government International Bond, 7,625%, fällig 29.05.2032			0,48		
200 BOC Aviation Ltd, 1,750%, fällig 21.01.2026	200	0,44	Ghana - 0,46 % (28. Februar 2021: 0,54 %)			0,46		
200 DBS Group Holdings Ltd, 4,520%, fällig 11.12.2028*	215	0,48	200 Ghana Government International Bond, 7,875%, fällig 26.03.2027			0,46		
530 Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250%, fällig 19.06.2024	577	1,28	Indien - 0,47 % (28. Februar 2021: 0,53 %)			0,47		
300 United Overseas Bank Ltd, 3,750%, fällig 15.04.2029*	319	0,71	200 Export-Import Bank of India, 3,375%, fällig 05.08.2026			0,47		
	1.311	2,91	Kenia - 0,46 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			0,46		
Südafrika - 3,38 % (28. Februar 2021: 1,74 %)			200 Republic of Kenya Government International Bond, 144 A 6,300%, fällig 23.01.2034			0,46		
400 Eskom Holdings SOC Ltd, 6,350%, fällig 10.08.2028	444	0,99	Kontrakte (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) \$		
470 Liquid Telecommunications Financing Plc, 5,500%, fällig 04.09.2026	489	1,09	Gekaufte Optionen - 0,02 % (28. Februar 2021: 0,02 %)			% des Nettoinventarwerts		
350 Sasol Financing USA LLC, 4,375%, fällig 10.09.2026	362	0,80	400 USD Put/CNY Call 6,45X fällig 17.03.2022 – JP Morgan			3		
200 Sasol Financing USA LLC, 6,500%, fällig 27.09.2028	226	0,50	570 USD Put/CNY Call 6,55X fällig 13.11.2021 – JP Morgan			7		
	1.521	3,38	Summe gekaufte Optionen (Kosten 9 USD)			10		
Südkorea - 2,41 % (28. Februar 2021: 3,76 %)			Devisentermingeschäfte - 0,03 % (28. Februar 2021: 0,01 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten		
330 Hana Bank, 4,250%, fällig 14.10.2024	362	0,80	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			16		
660 Shinhan Bank Co Ltd, 3,875%, fällig 24.03.2026	726	1,61	Termingeschäfte - 0,01 % (28. Februar 2021: 0,16 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten		
	1.088	2,41	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			5		
			Summe gezeichnete Optionen (Kosten (10) USD)			43.336		
			Kontrakte (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) \$		
			Gezeichnete Optionen - 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			% des Nettoinventarwerts		
			(400) USD Call/CNH Put 7,00X fällig 17.03.2022 – JP Morgan			(1)		
			(570) USD Call/CNH Put 7,11X fällig 13.11.2021 – JP Morgan			-		
			Summe gezeichnete Optionen (Kosten (10) USD)			(1)		

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts		% von Gesamt Vermögen
Devisentermingeschäfte - 0,00 % (28. Februar 2021: (0,01 %))				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1)	–		
Termingeschäfte - 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(2)	–		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(4)	–		
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	43.332	96,15		
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	1.737	3,85		
Gesamtvermögen	\$45.069	100,00		
			144A	
				Analyse des Gesamtvermögens
				Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden
				Finanzderivate
				Sonstige Vermögenswerte
				Gesamtvermögen
				100,00
			*	
				ABKÜRZUNGEN:
			Fortwährend	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
			EUR	– Euro

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	EUR 22	19
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	EUR 2.272	2.673
15.09.2021	Goldman Sachs	Buy	EUR 129	106
15.09.2021	Goldman Sachs	Buy	EUR 106	124
15.09.2021	JP Morgan	Buy	USD 45	289
15.10.2021	JP Morgan	Buy	USD 26	375.549
15.10.2021	JP Morgan	Buy	IDR 375.549	26
15.12.2021	Bank of America Merrill Lynch	Buy	USD 721	2.708
15.12.2021	Goldman Sachs	Buy	USD 1.182	4.435
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisentermingeschäften (28. Februar 2021 (in Tsd.): 6 USD)				\$ 16
Nicht realisierte Wertminderung von Devisentermingeschäften (28. Februar 2021 (in Tsd.): (5) USD)				(1)
Nettowertsteigerung von Devisentermingeschäften (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1 USD)				\$ 15

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	UBS (30)	\$ (4,004)	\$ 5
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	UBS (2)	(394)	(2)
Nicht realisierter Wertzuwachs von Terminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 65 USD)			\$ 5
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): - USD)			(2)
Nettowertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 65 USD)			\$ 3

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	
Forderungsbesicherte Wertpapiere - 0,26 % (28. Februar 2021: 0,24 %)			Deutschland - 0,99 % (28. Februar 2021: 0,58 %)			Großbritannien - 5,30 % (28. Februar 2021: 4,80 %)			
250 Magnetite XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144 A 5,806%, fällig 15.10.2031 *	248	0,26	EUR 220 Renk AG/Frankfurt am Main, 5,750%, fällig 15.07.2025	272	0,29	EUR 510 INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750%, fällig 15.07.2026	622	0,65	
Summe Forderungsbesicherte Wertpapiere (Kosten 246 USD)	248	0,26	EUR 310 TK Elevator Midco GmbH, 4,375%, fällig 15.07.2027	385	0,40	EUR 110 INEOS Quattro Finance 1 Plc, 144 A 3,750%, fällig 15.07.2026	134	0,14	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 64,84 % (28. Februar 2021: 71,80 %)			EUR 240 TUI Cruises GmbH, 6,500%, fällig 15.05.2026	291	0,30	GBP 250 Marks & Spencer Plc, 3,750%, fällig 19.05.2026	360	0,38	
Argentinien - 2,93 % (28. Februar 2021: 2,22 %)			Hongkong - 0,28 % (28. Februar 2021: 0,27 %)	260 Melco Resorts Finance Ltd, 5,375%, fällig 04.12.2029	269	0,28	GBP 510 Marston's Issuer Plc, Series B1X 2,628%, fällig 16.07.2035 *	568	0,59
1.300 MercadoLibre Inc, 3,125%, fällig 14.01.2031	1.285	1,35	Indonesien - 0,29 % (28. Februar 2021: 0,47 %)	260 Minejasa Capital BV, 144 A 4,625%, fällig 10.08.2030	272	0,29	GBP 284 Saga Plc, 3,375%, fällig 12.05.2024	378	0,40
210 Pampa Energia SA, 144 A 7,500%, fällig 24.01.2027	194	0,20	Israel - 3,06 % (28. Februar 2021: 3,72 %)	3.060 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, fällig 01.10.2026	2.926	3,06	GBP 1.530 Saga Plc, 5,500%, fällig 15.07.2026	2.063	2,16
810 Transportadora de Gas del Sur SA, 144 A 6,750%, fällig 02.05.2025	768	0,80	Italien - 0,37 % (28. Februar 2021: 1,26 %)	220 Intesa Sanpaolo SpA, 144 A 4,198%, fällig 01.06.2032	227	0,24	349 Virgin Media Secured Finance Plc, 144 A 5,500%, fällig 15.05.2029	374	0,39
280 YPF SA, 144 A 8,500%, fällig 28.07.2025	241	0,25	100 Telecom Italia Capital SA, 7,200%, fällig 18.07.2036	126	0,13	310 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144 A 4,750%, fällig 15.07.2031	319	0,33	
350 YPF SA, 144 A 4,000%, fällig 12.02.2026	317	0,33	Luxemburg - 0,75 % (28. Februar 2021: 0,69 %)	220 ARD Finance SA, 144 A 6,500%, fällig 30.06.2027	411	0,43	GBP 180 Wheel Bidco Ltd, 6,750%, fällig 15.07.2026	251	0,26
Belgien - 0,25 % (28. Februar 2021: 0,00 %)	2.805	2,93	220 Citron Aida Finco Sarl, 6,250%, fällig 01.04.2028	309	0,32	Vereinigte Staaten - 34,70 % (28. Februar 2021: 41,90 %)	5.069	5,30	
EUR 210 Ideal Standard International SA, 6,375%, fällig 30.07.2026	242	0,25	Macau - 1,39 % (28. Februar 2021: 1,56 %)	840 MGM China Holdings Ltd, 144 A 4,750%, fällig 01.02.2027	488	0,51	200 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144 A 5,000%, fällig 01.05.2028	199	0,21
Brasilien - 2,53 % (28. Februar 2021: 2,75 %)	434	0,46	840 Wynn Macau Ltd, 144 A 5,125%, fällig 15.12.2029	836	0,88	290 Adient Global Holdings Ltd, 144 A 4,875%, fällig 15.08.2026	298	0,31	
400 Braskem Netherlands Finance BV, 144 A 4,500%, fällig 10.01.2028	1.681	1,76	Mexiko - 3,92 % (28. Februar 2021: 3,64 %)	1.330 BBVA Bancomer SA/Texas, 144 A 5,125%, fällig 18.01.2033 *	1.388	1,45	210 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144 A 6,000%, fällig 01.06.2029	210	0,22
1.470 Petrobras Global Finance BV, 5,750%, fällig 01.02.2029	299	0,31	470 Cemex SAB de CV, 144 A 7,375%, fällig 05.06.2027	529	0,55	540 Allied Universal Holdco LLC/ Allied Universal Finance Corp/ Atlas Luxco 4 Sarl, 144 A 4,625%, fällig 01.06.2028	542	0,57	
270 Ultrarap International SA, 144 A 5,250%, fällig 06.10.2026	2.414	2,53	1.310 Petroleos Mexicanos, 6,625%, fällig 15.06.2035	1.271	1,33	460 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000%, fällig 01.10.2029	461	0,48	
Kanada - 1,38 % (28. Februar 2021: 2,89 %)	339	0,35	600 Petroleos Mexicanos, 6,625%, fällig 15.06.2038	558	0,59	170 Apache Corp, 5,100%, fällig 01.09.2040	189	0,20	
340 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.02.2029	201	0,21	Peru - 0,82 % (28. Februar 2021: 0,08 %)	750 Petroleos del Peru SA, 144 A 4,750%, fällig 19.06.2032	785	0,82	440 Ball Corp, 2,875%, fällig 15.08.2030	442	0,46
200 Air Canada, 144 A 3,875%, fällig 15.08.2026	454	0,48	Südafrika - 0,53 % (28. Februar 2021: 0,00 %)	480 Sasol Financing USA LLC, 5,500%, fällig 18.03.2031	508	0,53	70 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144 A 7,625%, fällig 15.12.2025	76	0,08
440 ATS Automation Tooling Systems Inc, 144 A 4,125%, fällig 15.12.2028	104	0,11	Schweiz - 0,69 % (28. Februar 2021: 1,03 %)	300 Credit Suisse Group AG, 144 A 7,500%, Perpetual *	324	0,34	270 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144 A 6,625%, fällig 15.07.2026	282	0,29
100 Open Text Corp, 144 A 3,875%, fällig 15.02.2028	74	0,08	300 Credit Suisse Group AG, 144 A 7,250%, Perpetual *	337	0,35	340 Boise Cascade Co, 144 A 4,875%, fällig 01.07.2030	363	0,38	
70 Open Text Holdings Inc, 144 A 4,125%, fällig 15.02.2030	147	0,15	Türkei - 1,37 % (28. Februar 2021: 1,28 %)	320 TC Ziraat Bankasi AS, 144 A 5,125%, fällig 03.05.2022	326	0,34	190 Boyne USA Inc, 144 A 4,750%, fällig 15.05.2029	196	0,21
EUR 120 Primo Water Holdings Inc, 3,875%, fällig 30.10.2028	1.319	1,38	300 TC Ziraat Bankasi AS, 144 A 5,125%, fällig 29.09.2023	310	0,33	330 BWX Technologies Inc, 144 A 4,125%, fällig 30.06.2028	340	0,35	
Kaimaninseln - 0,93 % (28. Februar 2021: 0,79 %)	892	0,93	610 Turk Telekomunikasyon AS, 144 A 6,875%, fällig 28.02.2025	672	0,70	150 Carnival Corp, 144 A 7,625%, fällig 01.03.2026	160	0,17	
899 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144 A 6,500%, fällig 15.09.2024	1.533	1,60	Frankreich - 0,32 % (28. Februar 2021: 0,51 %)	297 Altice France SA/France, 144 A 7,375%, fällig 01.05.2026	309	0,32	350 Carnival Corp, 144 A 5,750%, fällig 01.03.2027	358	0,37
China - 1,60 % (28. Februar 2021: 0,00 %)	532	0,56					EUR 250 Carnival Plc, 1,000%, fällig 28.10.2029	233	0,24
400 China Aoyuan Group Ltd, 6,350%, fällig 08.02.2024	374	0,39					500 Carriage Services Inc, 144 A 4,250%, fällig 15.05.2029	501	0,52
200 China SCE Group Holdings Ltd, 6,000%, fällig 04.02.2026	193	0,20					170 Carrols Restaurant Group Inc, 144 A 5,875%, fällig 01.07.2029	164	0,17
250 Huarong Finance 2019 Co Ltd, 2,125%, fällig 30.09.2023	239	0,25					130 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 4,250%, fällig 01.02.2031	134	0,14
200 Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3,750%, fällig 29.05.2024	195	0,20					2.560 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500%, fällig 01.05.2032	2.679	2,80
600 Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6,000%, fällig 25.10.2023	532	0,56							

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			420 NCL Corp Ltd, 144 A 12,250%, fällig 15.05.2024			496		
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)			360 NCL Corp Ltd, 144 A 10,250%, fällig 01.02.2026			416		
300 Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144 A 7,500%, fällig 01.06.2029	311	0,32	370 Oasis Petroleum Inc, 144 A 6,375%, fällig 01.06.2026			387		
260 CoreCivic Inc, 8,250%, fällig 15.04.2026	275	0,29	380 Occidental Petroleum Corp, 6,125%, fällig 01.01.2031			460		
100 CoreCivic Inc, 4,750%, fällig 15.10.2027	92	0,10	200 Party City Holdings Inc, 144 A 8,750%, fällig 15.02.2026			209		
290 CSC Holdings LLC, 144 A 6,500%, fällig 01.02.2029	320	0,34	340 Rackspace Technology Global Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.02.2028			327		
220 CSC Holdings LLC, 144 A 4,500%, fällig 15.11.2031	222	0,23	340 Range Resources Corp, 4,875%, fällig 15.05.2025			352		
810 Delta Air Lines Inc, 144 A 7,000%, fällig 01.05.2025	948	0,99	70 Rocket Software Inc, 144 A 6,500%, fällig 15.02.2029			66		
500 Delta Air Lines Inc, 7,375%, fällig 15.01.2026	589	0,62	340 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144 A 4,250%, fällig 01.07.2026			332		
290 DIRECTV Holdings LLC / DIRECTV Financing Co Inc, 144 A 5,875%, fällig 15.08.2027	304	0,32	290 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144 A 5,500%, fällig 31.08.2026			294		
230 DISH DBS Corp, 5,875%, fällig 15.11.2024	248	0,26	340 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144 A 5,500%, fällig 01.04.2028			343		
360 DISH DBS Corp, 7,750%, fällig 01.07.2026	413	0,43	440 Sensata Technologies Inc, 144 A 4,375%, fällig 15.02.2030			473		
280 DISH DBS Corp, 144 A 5,125%, fällig 01.06.2029	279	0,29	100 Sensata Technologies Inc, 4,375%, fällig 15.02.2030			107		
800 DISH Network Corp, 3,375%, fällig 15.08.2026	836	0,87	390 Sirius XM Radio Inc, 144 A 4,125%, fällig 01.07.2030			400		
100 Diversified Healthcare Trust, 4,375%, fällig 01.03.2031	98	0,10	340 Spirit Airlines Inc, 1,000%, fällig 15.05.2026			316		
80 Energy Transfer LP, Series H, 6,500%, Perpetual *	82	0,09	660 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144 A 8,000%, fällig 20.09.2025			748		
150 EnLink Midstream LLC, 144 A 5,625%, fällig 15.01.2028	157	0,16	270 StoneMor Inc, 144 A 8,500%, fällig 15.05.2029			277		
90 EQM Midstream Partners LP, 144 A 6,500%, fällig 01.07.2027	100	0,11	240 Sunnova Energy Corp, 144 A 5,875%, fällig 01.09.2026			242		
90 EQT Corp, 144 A 3,125%, fällig 15.05.2026	93	0,10	110 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 6,500%, fällig 15.07.2027			119		
1.190 EQT Corp, 3,900%, fällig 01.10.2027	1.286	1,35	500 T-Mobile USA Inc, 2,625%, fällig 15.02.2029			507		
290 EQT Corp, 5,000%, fällig 15.01.2029	330	0,35	1.855 United Airlines Inc, 144 A 4,625%, fällig 15.04.2029			1.927		
90 EQT Corp, 144 A 3,625%, fällig 15.05.2031	95	0,10	150 Univision Communications Inc, 144 A 9,500%, fällig 01.05.2025			164		
1.100 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900%, fällig 16.02.2028	1.097	1,15	780 Viking Cruises Ltd, 144 A 7,000%, fällig 15.02.2029			790		
400 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000%, fällig 13.11.2030	423	0,44	220 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144 A 5,625%, fällig 15.02.2029			219		
950 Ford Motor Credit Co LLC, 3,625%, fällig 17.06.2031	980	1,02	665 VOC Escrow Ltd, 144 A 5,000%, fällig 15.02.2028			658		
620 H&E Equipment Services Inc, 144 A 3,875%, fällig 15.12.2028	623	0,65	360 Western Midstream Operating LP, 4,650%, fällig 01.07.2026			389		
260 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144 A 5,750%, fällig 20.01.2026	274	0,29	250 Western Midstream Operating LP, 4,750%, fällig 15.08.2028			275		
350 Helios Software Holdings Inc / ION Corporate Solutions Finance Sarl, 144 A 4,625%, fällig 01.05.2028	347	0,36	20 Western Midstream Operating LP, 5,300%, fällig 01.02.2030			22		
810 JB Poindexter & Co Inc, 144 A 7,125%, fällig 15.04.2026	856	0,89	400 WW International Inc, 144 A 4,500%, fällig 15.04.2029			396		
320 Kraft Heinz Foods Co, 144 A 7,125%, fällig 01.08.2039	486	0,51				33.189		
750 Level 3 Financing Inc, 144 A 3,625%, fällig 15.01.2029	729	0,76	Sambia - 0,44 % (28. Februar 2021: 0,41 %)					
260 Lumen Technologies Inc, 144 A 4,500%, fällig 15.01.2029	254	0,27	390 First Quantum Minerals Ltd, 144 A 6,875%, fällig 15.10.2027			423		
160 Michaels Cos Inc/The, 144 A 5,250%, fällig 01.05.2028	164	0,17	Summe der Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 59.296 USD)			62.015		
330 Michaels Cos Inc/The, 144 A 7,875%, fällig 01.05.2029	340	0,36				64,84		
						Staatsanleihen und Schuldverschreibungen - 17,74 % (28. Februar 2021: 15,65 %)		
						Angola - 0,28 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
						250 Angolan Government International Bond, 144 A 8,250%, fällig 09.05.2028		
						267		
						0,28		
						Argentinien - 1,64 % (28. Februar 2021: 1,22 %)		
						161 Argentine Republic Government International Bond, 1,000%, fällig 09.07.2029		
						67		
						0,07		
						467 Argentine Republic Government International Bond, 0,500%, fällig 09.07.2030		
						183		
						0,19		
						1.631 Argentine Republic Government International Bond, 1,125%, fällig 09.07.2035		
						573		
						0,60		
						910 Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 0,000%, fällig 09.06.2022z		
						513		
						0,54		
						340 Provincia de Cordoba, 144 A 5,000%, fällig 01.06.2027		
						233		
						0,24		
						1.569		
						1,64		
						Bahrain - 0,30 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
						310 Bahrain Government International Bond, 144 A 6,000%, fällig 19.09.2044		
						292		
						0,30		
						Brasilien - 0,40 % (28. Februar 2021: 1,39 %)		
						350 Brazilian Government International Bond, 4,625%, fällig 13.01.2028		
						378		
						0,40		
						Costa Rica - 0,22 % (28. Februar 2021: 0,20 %)		
						200 Costa Rica Government International Bond, 6,125%, fällig 19.02.2031		
						213		
						0,22		
						Dominikanische Republik - 0,82 % (28. Februar 2021: 0,53 %)		
						750 Dominican Republic International Bond, 144 A 4,500%, fällig 30.01.2030		
						782		
						0,82		
						Ecuador - 0,41 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
						550 Ecuador Government International Bond, 144 A 1,000%, fällig 31.07.2035		
						397		
						0,41		
						Ägypten - 0,74 % (28. Februar 2021: 0,36 %)		
						300 Egypt Government International Bond, 6,588%, fällig 21.02.2028		
						319		
						0,34		
						350 Egypt Government International Bond, 144 A 7,600%, fällig 01.03.2029		
						385		
						0,40		
						704		
						0,74		
						El Salvador - 0,18 % (28. Februar 2021: 0,19 %)		
						200 El Salvador Government International Bond, 144 A 6,375%, fällig 18.01.2027		
						175		
						0,18		
						Ghana - 0,68 % (28. Februar 2021: 0,66 %)		
						360 Ghana Government International Bond, 144 A 10,750%, fällig 14.10.2030		
						452		
						0,47		
						200 Ghana Government International Bond, 144 A 8,125%, fällig 26.03.2032		
						201		
						0,21		
						653		
						0,68		
						Indonesien - 0,98 % (28. Februar 2021: 1,79 %)		
						220 Indonesia Government International Bond, 1,850%, fällig 12.03.2031		
						215		
						0,22		
						IDR10.034.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR61X 7,000%, fällig 15.05.2022		
						723		
						0,76		
						938		
						0,98		
						Jamaika - 0,25 % (28. Februar 2021: 0,23 %)		
						200 Jamaica Government International Bond, 6,750%, fällig 28.04.2028		
						235		
						0,25		

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Schuldverschreibungen - 4,88 % (28. Februar 2021: 3,03 %)			Devisentermingeschäfte - (0,09 %) (28. Februar 2021: (0,07 %))		
Jordanien - 0,23 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			400 AAdvantage Loyalty IP Ltd, 0,000%, fällig 20.04.2028 *			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (83) (0,09)		
			748 Clear Channel Outdoor Holdings, Inc., 3,686%, fällig 21.08.2026 *			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten (83) (0,09)		
Kenia - 0,24 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			1.150 DIRECTV Financing LLC, 5,750%, fällig 22.07.2027 *			Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 92.683 96,90		
			400 Ineos U.S. Petrochemical, 3,250%, fällig 21.01.2026 *			Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen 2.958 3,10		
			310 PetSmart Inc, 4,500%, fällig 29.01.2028 *			Gesamt Nettovermögen \$ 95.641 100,00		
			290 Royal Caribbean Cruises Ltd, 0,000%, fällig 05.04.2022 *					
Mexiko - 2,04 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			250 SkyMiles IP Ltd, 4,750%, fällig 16.09.2027 *					
			340 United Airlines, 6,250%, fällig 25.06.2027 *					
			748 United Airlines Inc, 4,500%, fällig 14.04.2028 *					
			Summe Schuldverschreibungen (Kosten 4.617 USD) 4.666 4,88					
Nigeria - 0,34 % (28. Februar 2021: 0,32 %)			Kollektive Kapitalanlagen - 8,56 % (28. Februar 2021: 8,85 %)					
			20 Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US\$ Distributing (M)					
			EUR 22 Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Euro High Yield Fund – LM Class Euro (Accumulating)					
Oman - 0,55 % (28. Februar 2021: 0,50 %)			EUR 9 Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating					
			Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 6.709 USD) 8.182 8,56					
Paraguay - 0,66 % (28. Februar 2021: 0,84 %)			Stammaktien - 0,12 % (28. Februar 2021: 0,31 %)					
			Vereinigte Staaten - 0,12 % (28. Februar 2021: 0,31 %)					
			12 EG Acquisition Corp			117 0,12		
			57 Hercules Offshore Inc †∞			2 –		
Peru - 0,93 % (28. Februar 2021: 0,00 %)						119 0,12		
			Summe Stammaktien (Kosten 746 USD) 119 0,12					
			Vorzugsaktien - 0,28 % (28. Februar 2021: 0,26 %)					
Russland - 1,90 % (28. Februar 2021: 0,94 %)			Vereinigte Staaten - 0,28 % (28. Februar 2021: 0,26 %)					
			– Targa Resources Corp, Series A			270 0,28		
			Summe Vorzugsaktien (Kosten 263 USD) 270 0,28					
			Optionsschein - 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)					
			Vereinigte Staaten - 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)					
			4 EG Acquisition Corp			3 –		
Senegal - 0,25 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Summe Optionsschein (Kosten 4 USD) 3 –					
			Gesamt Kapitalanlagen ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Kosten 88.344 USD) 92.465 96,68					
Südafrika - 0,51 % (28. Februar 2021: 0,64 %)			Devisentermingeschäfte - 0,07 % (28. Februar 2021: 0,15 %)					
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			67 0,07		
			Termingeschäfte - 0,24 % (28. Februar 2021: 0,05 %)					
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			234 0,24		
Türkei - 1,60 % (28. Februar 2021: 1,68 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 92.766 96,99					
Ukraine - 0,82 % (28. Februar 2021: 0,74 %)								
Vereinigte Staaten - 0,77 % (28. Februar 2021: 2,64 %)								
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 16.463 USD)								

- 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. Zum 31. August 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 39.057.000 USD oder 40,81 % des Nettovermögens.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

† Illiquid.

∞ Das Wertpapier wurde vom Manager oder dem jeweiligen Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.

∞ Die Sicherheitsleistung ist zum 31. August 2021 in Verzug (entweder mit dem Kapital und/oder den Zinsen).

ABKÜRZUNGEN:		% von Gesamt Vermögen
Fortwährend	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.	
EUR	– Euro	
GBP	– Britisches Pfund Sterling	
IDR	– Indonesische Rupiah	
MXN	– Mexikanischer Peso	
RUB	– Russischer Rubel	
Analyse des Gesamtvermögens		
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		81,79
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden		4,79
Organismen für gemeinsame Anlagen		8,41
Finanzderivate		0,31
Sonstige Vermögenswerte		4,70
Gesamtvermögen		100,00

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD	35	Sell	AUD	47	\$ –
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD	28	Sell	AUD	39	–
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD	–	Sell	EUR	–	–
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD	20	Sell	GBP	15	–
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD	20	Sell	SGD	27	–
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	USD	–	Sell	SGD	–	–
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	GBP	2.603	Sell	USD	3.607	(30)
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	SGD	3.788	Sell	USD	2.795	23
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	AUD	3	Sell	USD	2	–
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	AUD	12.027	Sell	USD	8.844	(45)
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	EUR	1.605	Sell	USD	1.889	7
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	GBP	17	Sell	USD	24	–
19.10.2021	BNP Paribas	Buy	USD	108	Sell	EUR	90	1
19.10.2021	Citi	Buy	USD	235	Sell	EUR	200	(2)
19.10.2021	Citi	Buy	USD	237	Sell	EUR	200	1
19.10.2021	Citi	Buy	USD	222	Sell	GBP	160	2
19.10.2021	Citi	Buy	USD	370	Sell	GBP	270	(1)
19.10.2021	Goldman Sachs	Buy	USD	177	Sell	CAD	220	3
19.10.2021	Goldman Sachs	Buy	USD	3.203	Sell	GBP	2.314	21
19.10.2021	Goldman Sachs	Buy	CAD	220	Sell	USD	173	2
19.10.2021	Morgan Stanley	Buy	USD	345	Sell	EUR	290	2
18.11.2021	Citi	Buy	EUR	549	Sell	USD	644	5
18.11.2021	Goldman Sachs	Buy	USD	866	Sell	EUR	737	(5)
Nicht realisierter Wertzuwachs von Devisentermingeschäften (28. Februar 2021 (in Tsd.): 158 USD)								\$ 67
Nicht realisierte Wertminderung von Devisentermingeschäften (28. Februar 2021 (in Tsd.): (76) USD)								(83)
Nettoabschreibung von Devisentermingeschäften (28. Februar 2021 (in Tsd.): 82 USD)								\$ (16)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro FX Currency September 2021	UBS	(47)	\$ (6.941)	\$ 227
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	UBS	(39)	(5.205)	7
Nicht realisierter Wertzuwachs von Terminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 52 USD)				\$ 234
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): - USD)				–
Nettowertzuwachs von Terminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 52 USD)				\$ 234

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen - 0,47 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Mexiko - 3,54 % (28. Februar 2021: 3,51 %)			Devisenterminkontrakte - 0,15 % (28. Februar 2021: 0,36 %)		
Vereinigte Arabische Emirate - 0,47 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			MXN 2.310 Mexican Bonos, Series M, 7,750%, fällig 13.11.2042			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
EUR	200	0,47	MXN	117	0,23	EUR	79	0,15
	200 MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000%, fällig 10.03.2034			883	1,73	Futures - 0,07 % (28. Februar 2021: 0,57 %)		
			EUR	650	1,58	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
				806	1,58	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
				1.806	3,54		49.994	98,11
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 237 USD)			Neuseeland - 0,37 % (28. Februar 2021: 0,40 %)			Verträge (in Tsd.)		
	238	0,47	NZD 190 New Zealand Government Inflation Linked Bond, Series 0930X 3,000%, fällig 20.09.2030			Wert (in Tsd.) \$		
						% des Netto- inventar- werts		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen - 91,39 % (28. Februar 2021: 95,06 %)			Katar - 0,51 % (28. Februar 2021: 0,51 %)			Verkaufte Optionen - (0,01 %) (28. Februar 2021: (0,03 %))		
Australien - 0,73 % (28. Februar 2021: 1,52 %)			200 Qatar Government International Bond, 4,817%, fällig 14.03.2049			EUR (360) EUR Call/NOK Put 10,30X fällig 208.09.2021 - JP Morgan		
AUD	310	0,73		262	0,51	(3)	(0,01)	
	310 Australia Government Bond, Series 30 CI, 2,500%, fällig 20.09.2030		Rumänien - 0,49 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Summe verkaufte Optionen (Kosten (4) USD)		
			EUR 210 Romanian Government International Bond, 2,000%, fällig 14.04.2033			(3)		
						Zinsswaps - (0,03 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)		
						Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
						(15)		
						Devisenterminkontrakte - (0,25 %) (28. Februar 2021: (0,25 %))		
						Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
						(129)		
						Futures - (0,43 %) (28. Februar 2021: (0,21 %))		
						Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
						(216)		
						Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
						(363)		
						Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
						49.631		
						97,39		
						Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigende Vermögen		
						1.325		
						2,61		
						Gesamtnettovermögen		
						\$50.956		
						100,00		
						-		
						Die mit „-“ gekennzeichneten Beträge sind entweder 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. Zum 31. August 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 4.945.000 USD oder 9,70 % des Nettovermögens.		
						β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.		
						ABKÜRZUNGEN:		
						CPI - Verbraucherpreisindex.		
						AUD - Australischer Dollar		
						CAD - Kanadischer Dollar		
						EUR - Euro		
						IDR - Indonesische Rupiah		
						JPY - Japanischer Yen		
						MXN - Mexikanischer Peso		
						NZD - Neuseeländischer Dollar		
						ZAR - Südafrikanischer Rand		
						Analyse des Gesamtvermögens		
						Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
						91,11		
						Organismen für gemeinsame Anlagen		
						5,96		
						Finanzderivate		
						0,24		
						Sonstige Vermögenswerte		
						2,69		
						Gesamtvermögen		
						100,00		
						Gesamt		
						Vermögen		
						97,87		
						Gekaufte Optionen - 0,01 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
						1.020 USD Call/AUD		
						Put 0,72X fällig 07.10.2021 - JP Morgan		
						5		
						0,01		
						Summe gekaufte Optionen (Kosten 9 USD)		
						5		
						0,01		
						Zinsswaps - 0,01 % (28. Februar 2021: 0,12 %)		
						Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
						6		
						0,01		

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	Pay Floating EUR 6M Euribor Reuters, Receive Fixed -0,250%	30.06.2026	1.250	\$ 6
Citi	Pay Fixed 0,500%, Receive Floating EUR 6M Euribor Reuters	30.06.2051	220	(15)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 56 USD)				\$ 6
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(15)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 56 USD)				\$ (9)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
10.09.2021	JP Morgan	Kauf	USD 490	Verkauf	RUB 35.820	\$ 1
10.09.2021	JP Morgan	Kauf	KRW 551.960	Verkauf	USD 499	(23)
10.09.2021	JP Morgan	Kauf	RUB 36.880	Verkauf	USD 496	7
10.09.2021	Morgan Stanley	Kauf	BRL 2.140	Verkauf	USD 404	9
18.11.2021	BNP Paribas	Kauf	USD 347	Verkauf	EUR 295	(3)
18.11.2021	BNP Paribas	Kauf	GBP 20	Verkauf	USD 28	–
18.11.2021	Citi	Kauf	USD 64	Verkauf	EUR 55	(1)
18.11.2021	Citi	Kauf	USD 809	Verkauf	JPY 89.571	(5)
18.11.2021	Citi	Kauf	AUD 531	Verkauf	USD 389	(1)
18.11.2021	Citi	Kauf	PLN 1.830	Verkauf	USD 467	11
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD 459	Verkauf	CAD 575	4
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD 2.775	Verkauf	EUR 2.360	(16)
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD 2.503	Verkauf	JPY 276.300	(10)
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD 54	Verkauf	NZD 76	–
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	AUD 360	Verkauf	USD 266	(2)
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	NOK 3.246	Verkauf	USD 368	5
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD 863	Verkauf	ZAR 12.870	(14)
18.11.2021	HSBC	Kauf	USD 546	Verkauf	EUR 465	(4)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD 1.268	Verkauf	AUD 1.719	10
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD 1.628	Verkauf	EUR 1.385	(10)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD 55	Verkauf	GBP 40	–
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD 1.308	Verkauf	JPY 144.421	(5)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD 1.511	Verkauf	USD 75	–
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	HUF 417.240	Verkauf	USD 1.379	30
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	ZAR 605	Verkauf	USD 40	1
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	AUD 190	Verkauf	USD 139	–
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	AUD 100	Verkauf	USD 73	1
18.11.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD 488	Verkauf	JPY 54.020	(3)
18.11.2021	UBS	Kauf	USD 4.642	Verkauf	EUR 3.952	(32)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 175 USD)						\$ 79
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (119) USD)						(129)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 56 USD)						\$ (50)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro\$ Dezember 2021	Citi (25)	\$ (6.239)	\$ (3)
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Citi 30	7.428	(10)
Canadian 5 Year Bond Dezember 2021	Citi 2	200	–
Euro-Bobl September 2021	Citi 9	1.434	11
Euro-BTP September 2021	Citi (4)	(724)	(23)
Euro-Bund Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch (14)	(2.852)	10
Euro-Bund September 2021	Citi (23)	(4.765)	(30)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2021	Citi (7)	(1.757)	(120)
Euro-OAT September 2021	Citi (4)	(761)	(14)
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2021	Citi (2)	(2.766)	(11)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Citi (19)	(2.536)	(1)
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2021	Citi (37)	(5.477)	12
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021	Citi 10	1.237	2
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2021	Citi 7	1.141	(4)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Citi 3	592	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 281 USD)			\$ 35
Nicht realisierte Wertminderung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (104) USD)			(216)
Nettowertminderung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 177 USD)			\$ (181)

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	560.919	98,64
Devisenterminkontrakte – (0,19 %) (28. Februar 2021: (0,15 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.070)	(0,19)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(1.070)	(0,19)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	559.849	98,45
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	8.838	1,55
Gesamt Nettovermögen	\$568.687	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 2021.
- ∞ Das Wertpapier wurde vom Manager oder dem jeweiligen Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.

- ABKÜRZUNGEN:**
- Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige 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

Analise des Gesamtvermögens	% von Gesamt Vermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,32
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,21
Finanzderivate	0,21
Sonstige Vermögenswerte	3,26
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
13.09.2021	Citi	Kauf KRW 13.600.000	Verkauf USD 12.192	\$ (461)
13.09.2021	JP Morgan	Kauf USD 11.673	Verkauf KRW 13.600.000	(58)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 89	Verkauf AUD 121	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 637	Verkauf AUD 880	(8)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 253	Verkauf CNH 1.644	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 17	Verkauf EUR 14	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD –	Verkauf SGD –	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 346	Verkauf SGD 470	(3)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 13.460	Verkauf USD 15.835	64
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf AUD 35.880	Verkauf USD 26.384	(134)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf AUD 473	Verkauf USD 346	1
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf CHF 312	Verkauf USD 342	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf SGD 45.133	Verkauf USD 6.947	35
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf SGD 12.753	Verkauf USD 9.393	91
15.09.2021	State Street Bank & Trust Co	Kauf USD 14.520	Verkauf SGD 19.600	(58)
27.09.2021	JP Morgan	Kauf KRW 16.500.000	Verkauf USD 14.529	(296)
29.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 7.461	Verkauf SGD 10.000	23
29.09.2021	BNY Mellon	Kauf SGD 18.320	Verkauf USD 13.604	21
12.11.2021	State Street Bank & Trust Co	Kauf USD 6.210	Verkauf SGD 8.419	(52)
12.11.2021	State Street Bank & Trust Co	Kauf SGD 8.419	Verkauf USD 6.203	58
19.11.2021	Citi	Kauf SGD 21.090	Verkauf USD 15.541	144
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 310 USD)				\$ 437
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (948) USD)				(1.070)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (638) USD)				\$ (633)

Aufstellung der Terminkontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Korea 10 Year Bond September 2021	UBS	410	\$ 795
Nicht realisierte Wertsteigerung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)			\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.195) USD)			795
Nettowertsteigerung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.195) USD)			\$ 795

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 79,87 % (28. Februar 2021: 76,86 %)			6.350 Credit Agricole SA/London, 1,907%, fällig 16.06.2026 *			EUR 120 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 0,680%, fällig 26.01.2023		
Australien – 2,17 % (28. Februar 2021: 2,15 %)			EUR 300 Credit Agricole SA/London, 1,750%, fällig 05.03.2029			EUR 750 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 0,980%, fällig 09.10.2023		
GBP 1.770 BHP Billiton Finance Ltd, Series 11X 3,250%, fällig 25.09.2024	2.625	0,52	EUR 1.000 Engie SA, 1,375%, fällig 27.03.2025	1.242	0,25	EUR 550 Mizuho Financial Group Inc, 1,598%, fällig 10.04.2028	710	0,14
EUR 300 BHP Billiton Finance USA Ltd, 2,875%, fällig 24.02.2022	304	0,06	EUR 400 Engie SA, 1,000%, fällig 13.03.2026	495	0,10	EUR 1.790 Nidec Corp, 0,046%, fällig 30.03.2026	2.119	0,42
EUR 720 Optus Finance Pty Ltd, 1,000%, fällig 20.06.2029	890	0,18	EUR 400 Engie SA, 2,375%, fällig 19.05.2026	528	0,10	EUR 3.370 NTT Finance Corp, 0,010%, fällig 03.03.2025	4.005	0,80
EUR 287 Telstra Corp Ltd, 3,750%, fällig 16.05.2022	348	0,07	EUR 1.100 Engie SA, 0,500%, fällig 24.10.2030	1.323	0,26	EUR 270 Sumitomo Mitsui Banking Corp, 2,750%, fällig 24.07.2023	338	0,07
EUR 1.670 Toyota Finance Australia Ltd, 1,584%, fällig 21.04.2022	1.998	0,40	EUR 2.200 EssilorLuxottica SA, 0,000%, fällig 27.05.2023	2.615	0,52	EUR 2.000 Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0,632%, fällig 23.10.2029	2.404	0,48
GBP 550 Toyota Finance Australia Ltd, 1,625%, fällig 11.07.2022	765	0,15	GBP 3.200 LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 1,000%, fällig 11.02.2023	4.432	0,88		12.101	2,41
GBP 230 Westpac Banking Corp, 2,625%, fällig 14.12.2022	325	0,06	EUR 600 RTE Réseau de Transport d'Electricité SADIR, 1,000%, fällig 19.10.2026	745	0,15	Luxemburg – 0,59 % (28. Februar 2021: 0,58 %)		
EUR 3.000 Westpac Banking Corp, 0,625%, fällig 22.11.2024	3.646	0,73	EUR 300 Sanofi, Series 5 FXD, 0,500%, fällig 21.03.2023	359	0,07	EUR 2.275 Prologis International Funding II SA, 1,750%, fällig 15.03.2028		
	10.901	2,17	EUR 400 Sanofi, 1,000%, fällig 01.04.2025	494	0,10	Niederlande – 3,13 % (28. Februar 2021: 3,21 %)		
Belgien – 0,35 % (28. Februar 2021: 0,35 %)			1.040 Sanofi, 3,625%, fällig 19.06.2028			EUR 3.000 ABN AMRO Bank NV, 0,875%, fällig 15.01.2024		
EUR 650 Euroclear Bank SA, 0,500%, fällig 10.07.2023	780	0,16	EUR 1.100 TotalEnergies Capital International SA, 1,023%, fällig 04.03.2027	1.377	0,27	EUR 220 ABN AMRO Bank NV, 1,000%, fällig 16.04.2025	272	0,05
EUR 400 Euroclear Investments SA, 1,125%, fällig 07.12.2026	504	0,10	GBP 1.700 Vinci SA, 2,250%, fällig 15.03.2027	2.491	0,50	EUR 150 Cooperatieve Rabobank UA, 3,875%, fällig 08.02.2022	152	0,03
EUR 400 KBC Group NV, 0,750%, fällig 01.03.2022	475	0,09		44.005	8,75	EUR 200 Cooperatieve Rabobank UA, 0,750%, fällig 29.08.2023	241	0,05
	1.759	0,35	Deutschland – 4,96 % (28. Februar 2021: 3,81 %)			GBP 2.500 Cooperatieve Rabobank UA, 1,250%, fällig 14.01.2025	3.475	0,69
Kanada – 2,48 % (28. Februar 2021: 2,54 %)			EUR 900 adidas AG, 0,000%, fällig 09.09.2024			EUR 270 Cooperatieve Rabobank UA/ NY, 3,375%, fällig 21.05.2025	296	0,06
GBP 2.970 Bank of Nova Scotia/The, 1,375%, fällig 05.12.2023	4.154	0,83	EUR 900 Allianz Finance II BV, 0,000%, fällig 14.01.2025	1.073	0,21	EUR 2.010 Enxsis Holding NV, 0,750%, fällig 02.07.2031	2.496	0,50
EUR 2.200 Bank of Nova Scotia/The, 0,500%, fällig 30.04.2024	2.649	0,53	EUR 700 Allianz Finance II BV, 1,500%, fällig 15.01.2030	929	0,18	EUR 400 ING Groep NV, 0,750%, fällig 09.03.2022	475	0,09
1.300 Royal Bank of Canada, 3,700%, fällig 05.10.2023	1.389	0,28	GBP 200 BASF SE, 1,375%, fällig 21.06.2022	277	0,06	EUR 200 ING Groep NV, 1,000%, fällig 20.09.2023	242	0,05
GBP 1.230 Royal Bank of Canada, 1,375%, fällig 09.12.2024	1.723	0,34	EUR 300 BASF SE, 0,875%, fällig 15.11.2027	376	0,07	EUR 300 ING Groep NV, 2,125%, fällig 10.01.2026	388	0,08
EUR 2.110 Toronto-Dominion Bank/The, 0,375%, fällig 25.04.2024	2.531	0,50	EUR 600 Clearstream Banking AG, 0,000%, fällig 01.12.2025	713	0,14	EUR 1.780 Shell International Finance BV, 3,250%, fällig 11.05.2025	1.929	0,38
	12.446	2,48	EUR 500 Deutsche Boerse AG, 1,125%, fällig 26.03.2028	638	0,13	EUR 1.700 Shell International Finance BV, 2,750%, fällig 06.04.2030	1.819	0,36
Dänemark – 1,82 % (28. Februar 2021: 1,79 %)			EUR 500 SAP SE, 0,250%, fällig 10.03.2022			EUR 220 TenneT Holding BV, 1,375%, fällig 05.06.2028	283	0,06
EUR 550 Danske Bank A/S, 0,875%, fällig 22.05.2023	661	0,13	EUR 300 SAP SE, 1,750%, fällig 22.02.2027	389	0,08		15.712	3,13
1.580 Danske Bank A/S, 144 A 5,375%, fällig 12.01.2024	1.743	0,34	GBP 1.200 Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0,875%, fällig 05.06.2023	1.661	0,33	Norwegen – 0,78 % (28. Februar 2021: 0,77 %)		
EUR 5.700 Nykredit Realkredit AS, 0,250%, fällig 13.01.2026	6.772	1,35	EUR 200 Vier Gas Transport GmbH, 1,500%, fällig 25.09.2028	259	0,05	EUR 940 Avinor AS, 0,750%, fällig 01.10.2030	1.148	0,23
	9.176	1,82	EUR 200 Volkswagen Bank GmbH, 0,625%, fällig 08.09.2021	236	0,05	EUR 1.000 Equinor ASA, 0,750%, fällig 22.05.2026	1.230	0,24
Finnland – 0,23 % (28. Februar 2021: 0,23 %)			EUR 360 Volkswagen Bank GmbH, 0,750%, fällig 15.06.2023	432	0,09	EUR 540 Equinor ASA, 1,250%, fällig 17.02.2027	681	0,14
EUR 950 Nordea Bank Abp, 0,875%, fällig 26.06.2023	1.146	0,23	EUR 920 Volkswagen Financial Services AG, 1,500%, fällig 01.10.2024	1.137	0,23	EUR 390 Sparebank 1 Oestlandet, 0,875%, fällig 13.03.2023	470	0,09
Frankreich – 8,75 % (28. Februar 2021: 8,91 %)			GBP 900 Volkswagen Financial Services NV, 1,625%, fällig 30.11.2022	1.252	0,25	EUR 330 Sparebanken Vest, 0,500%, fällig 29.11.2022	394	0,08
EUR 300 Air Liquide Finance SA, 1,000%, fällig 02.04.2025	370	0,07	EUR 2.200 Vonovia SE, 0,375%, fällig 16.06.2027	2.619	0,52		3.923	0,78
EUR 1.000 APRR SA, 0,000%, fällig 20.01.2023	1.188	0,24	EUR 2.500 Vonovia SE, 0,750%, fällig 01.09.2032	2.932	0,58	Singapur – 0,17 % (28. Februar 2021: 0,16 %)		
EUR 2.300 APRR SA, 0,125%, fällig 18.01.2029	2.748	0,55		24.943	4,96	810 Temasek Financial I Ltd, 2,375%, fällig 23.01.2023		
EUR 800 APRR SA, 1,500%, fällig 25.01.2030	1.061	0,21	Italien – 0,46 % (28. Februar 2021: 0,46 %)			EUR 2.400 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0,875%, fällig 10.09.2023		
GBP 2.600 Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1,500%, fällig 07.10.2026	3.660	0,73	EUR 1.960 Enel Finance International NV, 0,000%, fällig 17.06.2024	2.331	0,46	800 Banco Santander SA, 3,848%, fällig 12.04.2023	842	0,17
EUR 670 BNP Paribas SA, 3,250%, fällig 03.03.2023	701	0,14	Japan – 2,41 % (28. Februar 2021: 1,96 %)			GBP 500 Banco Santander SA, 2,750%, fällig 12.09.2023	715	0,14
EUR 230 BNP Paribas SA, 4,705%, fällig 10.01.2025 *	250	0,05	EUR 1.450 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,218%, fällig 07.03.2022	1.472	0,29	EUR 1.700 Banco Santander SA, 0,625%, fällig 24.06.2029 *	2.026	0,40
EUR 2.700 BNP Paribas SA, 0,375%, fällig 14.10.2027 *	3.216	0,64					5.995	1,19
EUR 1.100 BNP Paribas SA, 1,375%, fällig 28.05.2029	1.392	0,28						
EUR 1.000 BPCE SA, 1,000%, fällig 01.04.2025	1.223	0,24						
GBP 2.600 BPCE SA, 1,375%, fällig 23.12.2026	3.638	0,72						
EUR 300 Credit Agricole SA/London, 1,250%, fällig 14.04.2026	377	0,07						

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts						
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			EUR	1.630	HSBC Holdings Plc, Series GEN, 0,309%, fällig 13.11.2026 *	1.939	0,38	1.276	Bristol-Myers Squibb Co, 2,900%, fällig 26.07.2024	1.360	0,27			
Supranational – 2,54 % (28. Februar 2021: 2,49 %)			GBP	3.000	European Investment Bank, 0,750%, fällig 14.07.2023	443	0,09	1.900	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400%, fällig 26.07.2029	2.139	0,43			
GBP	6.300	Inter-American Development Bank, 0,500%, fällig 15.09.2026	8.634	1,72	1.500	Lloyds Bank Corporate Markets Plc, 1,500%, fällig 23.06.2023	2.097	0,42	200	Caterpillar Financial Services Corp, 1,931%, fällig 01.10.2021	200	0,04		
	12.792	2,54	GBP	270	Lloyds Bank Plc, 2,500%, fällig 01.06.2022	377	0,07	1.700	Caterpillar Inc, 2,600%, fällig 09.04.2030	1.815	0,36			
Schweden – 2,54 % (28. Februar 2021: 1,98 %)			EUR	1.000	Lloyds Banking Group Plc, 0,500%, fällig 12.11.2025 *	1.201	0,24	7.500	Charles Schwab Corp/The, 1,950%, fällig 01.12.2031	7.511	1,49			
EUR	2.190	Hemso Treasury Oyj, 0,000%, fällig 19.01.2028	2.557	0,51	890	Lloyds Banking Group Plc, 3,500%, fällig 01.04.2026 *	1.182	0,23	800	Chevron Corp, 2,355%, fällig 05.12.2022	817	0,16		
EUR	1.240	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,050%, fällig 01.07.2024	1.480	0,29	200	London Stock Exchange Group Plc, 0,875%, fällig 19.09.2024	243	0,05	2.400	Chevron Corp, 1,554%, fällig 11.05.2025	2.462	0,49		
	540	Svenska Handelsbanken AB, 1,875%, fällig 07.09.2021	540	0,11	690	London Stock Exchange Group Plc, 1,750%, fällig 06.12.2027	900	0,18	310	Chubb INA Holdings Inc, 3,350%, fällig 03.05.2026	341	0,07		
GBP	500	Svenska Handelsbanken AB, 1,625%, fällig 18.06.2022	695	0,14	1.250	London Stock Exchange Group Plc, 1,625%, fällig 06.04.2030	1.738	0,35	1.300	Chubb INA Holdings Inc, 0,875%, fällig 15.06.2027	1.605	0,32		
EUR	450	Swedbank AB, 0,300%, fällig 06.09.2022	535	0,11	1.560	Motability Operations Group Plc, 0,125%, fällig 20.07.2028	1.848	0,37	800	Chubb INA Holdings Inc, 1,550%, fällig 15.03.2028	1.027	0,20		
EUR	3.050	Swedbank AB, 0,250%, fällig 09.10.2024	3.644	0,72	650	Nationwide Building Society, 144 A 3,622%, fällig 26.04.2023 *	663	0,13	150	Citigroup Inc, 1,085%, fällig 25.04.2022 *	151	0,03		
EUR	2.250	Swedbank AB, 0,300%, fällig 20.05.2027 *	2.676	0,53	680	Reckitt Benckiser Treasury Services Plc, 2,375%, fällig 24.06.2022	691	0,14	230	Citigroup Inc, 2,750%, fällig 24.01.2024	331	0,07		
EUR	550	Volvo Treasury AB, 0,125%, fällig 17.09.2024	656	0,13	580	Standard Chartered Plc, 144 A 1,214%, fällig 23.03.2025 *	583	0,12	7.940	Citigroup Inc, 3,300%, fällig 27.04.2025	8.614	1,71		
	12.783	2,54			850	Unilever Capital Corp, 3,250%, fällig 07.03.2024	906	0,18	860	Colgate-Palmolive Co, 0,000%, fällig 12.11.2021	1.016	0,20		
Schweiz – 3,66 % (28. Februar 2021: 3,20 %)			EUR	800	Cloerie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500%, fällig 15.12.2028	1.040	0,21	1.300	Colgate-Palmolive Co, 0,500%, fällig 06.03.2026	1.583	0,32			
GBP	3.530	Credit Suisse AG/London, 1,125%, fällig 15.12.2025	4.843	0,96	480	Unilever Finance Netherlands BV, 1,250%, fällig 25.03.2025	598	0,12	1.000	Comcast Corp, 3,700%, fällig 15.04.2024	1.080	0,21		
	2.130	Credit Suisse AG/New York NY, 2,800%, fällig 08.04.2022	2.164	0,43	550	Unilever Finance Netherlands BV, 1,125%, fällig 12.02.2027	695	0,14	2.640	Comcast Corp, 3,100%, fällig 01.04.2025	2.840	0,57		
	500	Credit Suisse AG/New York NY, 3,625%, fällig 09.09.2024	542	0,11	810	Wellcome Trust Ltd/The, 1,125%, fällig 21.01.2027	1.020	0,20	390	Comcast Corp, 3,150%, fällig 01.03.2026	424	0,08		
GBP	1.050	Credit Suisse Group AG, 2,125%, fällig 12.09.2025 *	1.480	0,29			29.745	5,92	1.800	Costco Wholesale Corp, 1,375%, fällig 20.06.2027	1.821	0,36		
GBP	320	Nestle Finance International Ltd, 2,250%, fällig 30.11.2023	459	0,09	Vereinigte Staaten – 35,72 % (28. Februar 2021: 35,72 %)			1.600	Deere & Co, 3,100%, fällig 15.04.2030	1.772	0,35			
EUR	680	Nestle Finance International Ltd, 1,500%, fällig 01.04.2030	898	0,18	2.100	3M Co, 2,375%, fällig 26.08.2029	2.214	0,44	2.000	Estee Lauder Cos Inc/The, 2,375%, fällig 01.12.2029	2.106	0,42		
EUR	180	Novartis Finance SA, 0,500%, fällig 14.08.2023	216	0,04	EUR	2.260	Abbott Ireland Financing DAC, 0,100%, fällig 19.11.2024	2.698	0,54	EUR	5.860	Exxon Mobil Corp, 0,142%, fällig 26.06.2024	6.989	1,39
EUR	3.000	Novartis Finance SA, 0,000%, fällig 23.09.2028	3.539	0,70	1.900	Abbott Laboratories, 3,750%, fällig 30.11.2026	2.150	0,43	2.200	Exxon Mobil Corp, 2,992%, fällig 19.03.2025	2.355	0,47		
EUR	200	UBS Group AG, 1,750%, fällig 16.11.2022	242	0,05	1.240	Adobe Inc, 1,900%, fällig 01.02.2025	1.287	0,26	780	Exxon Mobil Corp, 3,043%, fällig 01.03.2026	846	0,17		
EUR	2.400	UBS Group AG, 2,125%, fällig 04.03.2024	3.000	0,60	1.700	Adobe Inc, 2,150%, fällig 01.02.2027	1.788	0,36	1.830	Gilead Sciences Inc, 3,650%, fällig 01.03.2026	2.019	0,40		
	18.423	3,66			4.500	Alphabet Inc, 0,800%, fällig 15.08.2027	4.400	0,88	2.100	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,625%, fällig 22.01.2023	2.197	0,44		
Großbritannien – 5,92 % (28. Februar 2021: 5,78 %)			EUR	1.980	Amazon.com Inc, 3,800%, fällig 05.12.2024	2.173	0,43	EUR	1.750	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,125%, fällig 19.08.2024	2.078	0,41		
	2.055	BP Capital Markets Plc, 3,506%, fällig 17.03.2025	2.237	0,44	2.200	Amazon.com Inc, 1,200%, fällig 03.06.2027	2.212	0,44	4.500	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,600%, fällig 07.02.2030	4.693	0,93		
GBP	1.700	British Land Co Plc/The, 2,375%, fällig 14.09.2029	2.425	0,48	340	Apple Inc, 3,200%, fällig 13.05.2025	369	0,07	2.800	Home Depot Inc/The, 2,500%, fällig 15.04.2027	2.997	0,60		
EUR	400	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 1,250%, fällig 13.04.2025	494	0,10	EUR	1.520	Apple Inc, 0,000%, fällig 15.11.2025	1.815	0,36	180	Home Depot Inc/The, 2,700%, fällig 15.04.2030	193	0,04	
GBP	150	Close Brothers Group Plc, 2,750%, fällig 26.04.2023	213	0,04	GBP	1.500	Apple Inc, 3,050%, fällig 31.07.2029	2.388	0,48	EUR	1.020	Illinois Tool Works Inc, 0,250%, fällig 05.12.2024	1.222	0,24
GBP	1.440	Experian Finance Plc, 0,739%, fällig 29.10.2025	1.968	0,39	200	Bank of America Corp, 3,300%, fällig 11.01.2023	208	0,04	EUR	350	Johnson & Johnson, 0,250%, fällig 20.01.2022	414	0,08	
	190	GlaxoSmithKline Capital Plc, 2,850%, fällig 08.05.2022	193	0,04	646	Bank of America Corp, 3,004%, fällig 20.12.2023 *	667	0,13	110	Johnson & Johnson, 3,375%, fällig 05.12.2023	118	0,02		
EUR	270	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,250%, fällig 21.05.2026	340	0,07	7.680	Bank of America Corp, 3,550%, fällig 05.03.2024 *	8.022	1,60	310	JPMorgan Chase & Co, 3,200%, fällig 25.01.2023	323	0,06		
EUR	550	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,000%, fällig 12.09.2026	687	0,14	EUR	800	Bank of America Corp, 3,648%, fällig 31.03.2029 *	1.144	0,23	3.090	JPMorgan Chase & Co, 4,023%, fällig 05.12.2024 *	3.320	0,66	
EUR	520	HSBC Holdings Plc, 0,875%, fällig 06.09.2024	633	0,13	5.000	Bank of New York Mellon Corp/The, 0,350%, fällig 07.12.2023	4.999	0,99	EUR	320	JPMorgan Chase & Co, 1,500%, fällig 29.10.2026	407	0,08	
	1.660	HSBC Holdings Plc, 3,803%, fällig 11.03.2025 *	1.781	0,35	EUR	500	Berkshire Hathaway Inc, 1,125%, fällig 16.03.2027	625	0,12	4.400	JPMorgan Chase & Co, 1,045%, fällig 19.11.2026 *	4.363	0,87	
	390	HSBC Holdings Plc, 1,645%, fällig 18.04.2026 *	395	0,08	EUR	530	BlackRock Inc, 1,250%, fällig 06.05.2025	660	0,13	240	Kimberly-Clark Corp, 1,050%, fällig 15.09.2027	238	0,05	
	1.220	HSBC Holdings Plc, 2,099%, fällig 04.06.2026 *	1.255	0,25	EUR	550	Blackstone Holdings Finance Co LLC, 1,000%, fällig 05.10.2026	679	0,14	910	Kimberly-Clark Corp, 3,950%, fällig 01.11.2028	1.060	0,21	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			4.000 Visa Inc, 1,900%, fällig 15.04.2027	4.159	0,83	Devisenterminkontrakte – 0,20 % (28. Februar 2021: 1,45 %)		
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			1.900 Walmart Inc, 3,250%, fällig 08.07.2029	2.135	0,42	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 1.009 0,20		
1.150 Mars Inc, 2,700%, fällig 01.04.2025	1.221	0,24	2.130 Walmart Inc, 2,375%, fällig 24.09.2029	2.272	0,45	Futures – 0,07 % (28. Februar 2021: 0,27 %)		
1.700 Mars Inc, 144 A 2,700%, fällig 01.04.2025	1.805	0,36	39 Wells Fargo & Co, 3,500%, fällig 08.03.2022	40	0,01	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 359 0,07		
280 Mastercard Inc, 3,375%, fällig 01.04.2024	301	0,06	2.940 Wells Fargo & Co, 3,196%, fällig 17.06.2027 *	3.185	0,63	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 502.752 100,00		
EUR 500 Medtronic Global Holdings SCA, Series 0000X 0,375%, fällig 07.03.2023	597	0,12		179.573	35,72	Credit Default Swaps – (0,23 %) (28. Februar 2021: (0,23 %))		
EUR 1.400 Medtronic Global Holdings SCA, 0,250%, fällig 02.07.2025	1.679	0,33	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 384.549 USD) 401.542 79,87			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (1.147) (0,23)		
EUR 2.550 Medtronic Global Holdings SCA, 0,000%, fällig 15.10.2025	3.029	0,60	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 14,89 % (28. Februar 2021: 15,74 %)			Devisenterminkontrakte – (0,71 %) (28. Februar 2021: (0,29 %))		
570 Microsoft Corp, 2,700%, fällig 12.02.2025	608	0,12	Kanada – 0,33 % (28. Februar 2021: 0,32 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (3.588) (0,71)		
2.400 Microsoft Corp, 2,400%, fällig 08.08.2026	2.566	0,51	Deutschland – 0,24 % (28. Februar 2021: 0,24 %)			Futures – (0,20 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)		
EUR 330 Morgan Stanley, 1,375%, fällig 27.10.2026	416	0,08	EUR 990 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, fällig 15.08.2029	1.220	0,24	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (1.020) (0,20)		
EUR 2.790 Morgan Stanley, 0,495%, fällig 26.10.2029 *	3.303	0,66	Südkorea – 0,40 % (28. Februar 2021: 0,39 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten (5.755) (1,14)		
5.410 NIKE Inc, 2,400%, fällig 27.03.2025	5.734	1,14	EUR 1.000 Export-Import Bank of Korea, 0,625%, fällig 11.07.2023	1.202	0,24	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 496.997 98,86		
2.080 Nuveen LLC, 4,000%, fällig 01.11.2028	2.390	0,48	EUR 660 Korea Development Bank/ The, 0,000%, fällig 10.07.2024	785	0,16	Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen 5.734 1,14		
1.600 NVIDIA Corp, 2,850%, fällig 01.04.2030	1.734	0,35		1.987	0,40	Gesamtnettovermögen \$502.731 100,00		
GBP 300 PepsiCo Inc, 2,500%, fällig 01.11.2022	423	0,08	Vereinigte Staaten – 13,92 % (28. Februar 2021: 14,79 %)			- Die mit „-“ gekennzeichneten Beträge sind entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
EUR 1.510 PepsiCo Inc, 0,250%, fällig 06.05.2024	1.812	0,36	11.690 United States Treasury Note/ Bond, 1,375%, fällig 15.02.2023	11.903	2,37	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 4.794.000 USD und machten 0,95 % des Nettovermögens aus.		
EUR 310 PepsiCo Inc, 0,750%, fällig 18.03.2027	383	0,08	590 United States Treasury Note/ Bond, 0,250%, fällig 31.07.2025	582	0,12	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.		
EUR 1.250 Procter & Gamble Co/The, 0,625%, fällig 30.10.2024	1.521	0,30	5.340 United States Treasury Note/ Bond, 0,750%, fällig 31.03.2026	5.348	1,06	ABKÜRZUNGEN:		
EUR 350 Prologis Euro Finance LLC, 1,875%, fällig 05.01.2029	462	0,09	19.510 United States Treasury Note/ Bond, 2,250%, fällig 15.11.2027	21.033	4,18	EUR – Euro		
2.120 Prudential Financial Inc, 1,500%, fällig 10.03.2026	2.161	0,43	9.510 United States Treasury Note/ Bond, 1,500%, fällig 15.02.2030	9.737	1,94	GBP – Britisches Pfund Sterling		
570 salesforce.com Inc, 3,250%, fällig 11.04.2023	596	0,12	22.480 United States Treasury Note/ Bond, 0,625%, fällig 15.05.2030	21.354	4,25	Analyse des Gesamtvermögens		
430 Schlumberger Holdings Corp, 4,000%, fällig 21.12.2025	478	0,10		69.957	13,92	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 92,20		
EUR 1.000 Schneider Electric SE, 0,000%, fällig 12.06.2023	1.190	0,24	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 75.712 USD) 74.835 14,89			Organismen für gemeinsame Anlagen 4,84		
560 Texas Instruments Inc, 1,375%, fällig 12.03.2025	571	0,11	Organismen für gemeinsame Anlagen – 4,97 % (28. Februar 2021: 4,64 %)			Finanzderivate 0,26		
1.150 Texas Instruments Inc, 2,900%, fällig 03.11.2027	1.260	0,25	25.007 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing) 25.007 4,97			Sonstige Vermögenswerte 2,70		
1.630 TJX Cos Inc/The, 1,600%, fällig 15.05.2031	1.595	0,32	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Kosten 25.007 USD) 25.007 4,97			Gesamtvermögen 100,00		
538 Toyota Motor Credit Corp, 3,400%, fällig 15.09.2021	539	0,11	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 485.268 USD) 501.384 99,73					
GBP 1.340 Toyota Motor Credit Corp, 0,750%, fällig 19.11.2026	1.824	0,36						
EUR 2.000 United Parcel Service Inc, 1,625%, fällig 15.11.2025	2.535	0,50						
2.150 UnitedHealth Group Inc, 3,750%, fällig 15.07.2025	2.389	0,48						
4.043 Verizon Communications Inc, 4,329%, fällig 21.09.2028	4.725	0,94						
540 Visa Inc, 3,150%, fällig 14.12.2025	590	0,12						

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzinheit	Kaufs-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000%	Kauf	20.06.2026	36.330	\$ (1.147)
Nicht realisierter Wertzuwachs von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): - USD)					\$ -
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.036) USD)					(1.147)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.036) USD)					\$ (1.147)

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)			
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	115	Verkauf	EUR	98	\$	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	5.615	Verkauf	GBP	4.061		32
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	1.352	Verkauf	GBP	989		(7)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	367	Verkauf	SEK	3.195		(3)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	6	Verkauf	SEK	49		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	725	Verkauf	USD	990		5
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SEK	431	Verkauf	USD	50		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SEK	88.624	Verkauf	USD	10.208		64
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	51.500	Verkauf	USD	60.585		242
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	217.366	Verkauf	USD	301.318		(2.460)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	15.500	Verkauf	USD	11.247		93
18.11.2021	Citi	Kauf	USD	30.647	Verkauf	EUR	26.116		(238)
18.11.2021	Citi	Kauf	USD	15.851	Verkauf	GBP	11.477		70
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	13.805	Verkauf	EUR	11.742		(81)
18.11.2021	HSBC	Kauf	USD	27.740	Verkauf	EUR	23.619		(192)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD	51.664	Verkauf	EUR	43.955		(317)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD	1.940	Verkauf	GBP	1.400		15
18.11.2021	Royal Bank of Canada	Kauf	USD	424	Verkauf	GBP	306		3
18.11.2021	UBS	Kauf	USD	42.143	Verkauf	EUR	35.881		(290)
18.11.2021	UBS	Kauf	USD	59.898	Verkauf	GBP	43.208		485
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 7.530 USD)								\$	1.009
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.529) USD)									(3.588)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 6.001 USD)								\$	(2.579)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(361)	\$(57.531)	\$ (430)
Euro-Bund Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(82)	(16.706)	59
Euro-Bund September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(115)	(23.824)	(590)
Long Gilt Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(255)	(44.959)	283
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(152)	(20.285)	17
Nicht realisierte Wertsteigerung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.417 USD)				\$ 359
Nicht realisierte Wertminderung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (6) USD)				(1.020)
Nettowertminderung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.411 USD)				\$ (661)

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere – 9,42 % (28. Februar 2021: 9,04 %)			275 Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000%, fällig 01.09.2049	307	0,13	99 Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500%, fällig 01.07.2051	104	0,04
500 Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 1,500% ±	508	0,22	105 Fannie Mae Pool 'FM3215', 3,500%, fällig 01.01.2049	113	0,05	118 Freddie Mac Pool 'ZA6680', 4,000%, fällig 01.04.2049	129	0,06
4.500 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000% ±	4.562	1,93	556 Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500%, fällig 01.05.2047	595	0,25	66 Freddie Mac Pool 'ZM5146', 4,000%, fällig 01.12.2047	72	0,03
8 Fannie Mae Pool '255984', 4,500%, fällig 01.11.2025	8	-	1.234 Fannie Mae Pool 'FM3830', 3,000%, fällig 01.04.2050	1.306	0,55	104 Freddie Mac Pool 'ZS3204', 5,000%, fällig 01.06.2041	117	0,05
16 Fannie Mae Pool '975097', 5,000%, fällig 01.06.2038	18	0,01	52 Fannie Mae Pool 'FM3957', 5,000%, fällig 01.03.2050	58	0,02	185 Freddie Mac Pool 'ZS3940', 4,500%, fällig 01.06.2038	204	0,09
80 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500%, fällig 01.01.2043	86	0,04	110 Fannie Mae Pool 'FM3978', 4,000%, fällig 01.07.2050	118	0,05	153 Freddie Mac Pool 'ZS4699', 4,000%, fällig 01.01.2047	166	0,07
14 Fannie Mae Pool 'AL3572', 5,000%, fällig 01.07.2041	16	0,01	72 Fannie Mae Pool 'FM4737', 3,500%, fällig 01.09.2050	76	0,03	59 Freddie Mac Pool 'ZS4720', 4,500%, fällig 01.05.2047	64	0,03
104 Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000%, fällig 01.05.2045	115	0,05	128 Fannie Mae Pool 'FM5475', 4,500%, fällig 01.03.2050	140	0,06	72 Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000%, fällig 15.09.2042	77	0,03
33 Fannie Mae Pool 'AS4271', 4,500%, fällig 01.01.2045	37	0,02	263 Fannie Mae Pool 'FM5828', 4,000%, fällig 01.10.2048	284	0,12	518 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500%, fällig 15.06.2048	555	0,24
330 Fannie Mae Pool 'AS8359', 3,000%, fällig 01.11.2046	349	0,15	395 Fannie Mae Pool 'FM7210', 2,000%, fällig 01.04.2051	403	0,17	25 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000%, fällig 15.09.2042	26	0,01
76 Fannie Mae Pool 'AS8951', 3,500%, fällig 01.03.2047	81	0,03	1.591 Fannie Mae Pool 'FM7740', 2,500%, fällig 01.06.2051	1.680	0,71	15 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000%, fällig 15.09.2042	16	0,01
28 Fannie Mae Pool 'AS9760', 4,500%, fällig 01.06.2047	30	0,01	398 Fannie Mae Pool 'FM7751', 2,000%, fällig 01.05.2051	405	0,17	61 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000%, fällig 15.10.2042	64	0,03
329 Fannie Mae Pool 'AX0756', 3,500%, fällig 01.07.2044	352	0,15	452 Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000%, fällig 01.01.2049	489	0,21	40 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000%, fällig 15.10.2042	43	0,02
46 Fannie Mae Pool 'BC9077', 3,500%, fällig 01.12.2046	49	0,02	100 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500%, fällig 01.07.2051	105	0,04	37 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000%, fällig 15.11.2042	40	0,02
387 Fannie Mae Pool 'BH7558', 4,500%, fällig 01.08.2047	422	0,18	100 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500%, fällig 01.07.2051	104	0,04	49 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500%, fällig 20.10.2049	51	0,02
147 Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000%, fällig 01.12.2037	155	0,07	95 Fannie Mae Pool 'FM8275', 3,500%, fällig 01.06.2049	102	0,04	97 Ginnie Mae II Pool '785218', 2,000%, fällig 20.12.2050	99	0,04
171 Fannie Mae Pool 'BK7700', 4,500%, fällig 01.10.2048	188	0,08	350 Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000%, fällig 01.02.2050	370	0,16	192 Ginnie Mae II Pool '785219', 2,000%, fällig 20.12.2050	196	0,08
51 Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500%, fällig 01.12.2046	55	0,02	400 Fannie Mae Pool 'FM8685', 3,000%, fällig 01.09.2051	424	0,18	97 Ginnie Mae II Pool '785220', 2,000%, fällig 20.12.2050	99	0,04
94 Fannie Mae Pool 'BM5521', 3,500%, fällig 01.07.2048	101	0,04	28 Fannie Mae Pool 'MA3211', 4,000%, fällig 01.12.2047	31	0,01	191 Ginnie Mae II Pool '785221', 2,000%, fällig 20.12.2050	195	0,08
72 Fannie Mae Pool 'BN0341', 5,000%, fällig 01.12.2048	79	0,03	29 Fannie Mae Pool 'MA3239', 4,000%, fällig 01.01.2048	31	0,01	97 Ginnie Mae II Pool 'B58546', 2,500%, fällig 20.12.2050	102	0,04
42 Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500%, fällig 01.11.2048	47	0,02	28 Fannie Mae Pool 'MA3305', 3,500%, fällig 01.03.2048	29	0,01	97 Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500%, fällig 20.12.2050	101	0,04
48 Fannie Mae Pool 'BO6985', 3,500%, fällig 01.11.2049	51	0,02	44 Fannie Mae Pool 'MA3332', 3,500%, fällig 01.04.2048	47	0,02	99 Ginnie Mae II Pool 'B24350', 2,500%, fällig 20.03.2051	103	0,04
48 Fannie Mae Pool 'BP1585', 3,500%, fällig 01.01.2050	51	0,02	130 Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000%, fällig 01.02.2038	137	0,06	202 Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500%, fällig 20.06.2044	218	0,09
74 Fannie Mae Pool 'BP7009', 3,000%, fällig 01.08.2050	78	0,03	97 Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000%, fällig 01.04.2038	102	0,04	54 Ginnie Mae II Pool 'MA2677', 3,000%, fällig 20.03.2045	57	0,02
96 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000%, fällig 01.02.2051	98	0,04	35 Freddie Mac Gold Pool 'G67721', 4,500%, fällig 01.04.2049	39	0,02	23 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500%, fällig 20.04.2046	24	0,01
97 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000%, fällig 01.02.2051	99	0,04	29 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,090%, fällig 01.03.2047 *	30	0,01	24 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500%, fällig 20.06.2046	26	0,01
42 Fannie Mae Pool 'CA0148', 4,500%, fällig 01.08.2047	46	0,02	58 Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500%, fällig 01.02.2050	62	0,03	30 Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000%, fällig 20.11.2046	31	0,01
77 Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500%, fällig 01.07.2048	85	0,04	97 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000%, fällig 01.02.2051	99	0,04	23 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000%, fällig 20.06.2047	24	0,01
145 Fannie Mae Pool 'CA2199', 4,500%, fällig 01.08.2048	160	0,07	100 Freddie Mac Pool 'QC6768', 3,000%, fällig 01.09.2051	105	0,04	6 Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000%, fällig 20.11.2047	7	-
22 Fannie Mae Pool 'CA2251', 5,000%, fällig 01.08.2048	24	0,01	112 Freddie Mac Pool 'RA2140', 3,500%, fällig 01.02.2050	120	0,05	26 Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000%, fällig 20.11.2047	28	0,01
53 Fannie Mae Pool 'CA2471', 4,000%, fällig 01.10.2048	57	0,02	44 Freddie Mac Pool 'RA2358', 4,000%, fällig 01.03.2050	47	0,02	88 Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500%, fällig 20.02.2048	93	0,04
79 Fannie Mae Pool 'CA2482', 4,500%, fällig 01.10.2048	86	0,04	108 Freddie Mac Pool 'RA2362', 3,500%, fällig 01.03.2050	114	0,05	20 Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000%, fällig 20.04.2048	22	0,01
25 Fannie Mae Pool 'CA2652', 5,000%, fällig 01.11.2048	28	0,01	44 Freddie Mac Pool 'RA2608', 4,500%, fällig 01.05.2050	48	0,02	113 Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500%, fällig 20.05.2048	121	0,05
44 Fannie Mae Pool 'CA4122', 3,500%, fällig 01.09.2049	48	0,02	398 Freddie Mac Pool 'RA5576', 2,500%, fällig 01.07.2051	417	0,18	40 Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500%, fällig 20.06.2048	43	0,02
33 Fannie Mae Pool 'FM1193', 3,500%, fällig 01.06.2049	35	0,02	99 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000%, fällig 01.04.2051	101	0,04	57 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500%, fällig 20.07.2048	61	0,03
32 Fannie Mae Pool 'FM1539', 4,500%, fällig 01.09.2049	35	0,02	96 Freddie Mac Pool 'SD0633', 3,500%, fällig 01.02.2051	103	0,04	19 Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500%, fällig 20.09.2048	21	0,01
200 Fannie Mae Pool 'FM1578', 3,500%, fällig 01.09.2034	215	0,09						
134 Fannie Mae Pool 'FM1579', 3,500%, fällig 01.10.2034	144	0,06						

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)								
80 Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500%, fällig 20.10.2048	85	0,04	EUR 1.420 Volkswagen Financial Services AG, 1,500%, fällig 01.10.2024	1.755	0,74	GBP 280 BAE Systems Plc, 4,125%, fällig 08.06.2022	396	0,17
51 Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500%, fällig 20.01.2049	54	0,02		2.971	1,25	GBP 470 BUPA Finance Plc, 5,000%, fällig 25.04.2023	688	0,29
600 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000% ±	613	0,26	Israel – 0,11 % (28. Februar 2021: 0,26 %)			565 HSBC Holdings Plc, 4,250%, fällig 18.08.2025	625	0,26
800 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500% ±	830	0,35	30 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, fällig 01.10.2026	29	0,01	GBP 100 HSBC Holdings Plc, 7,000%, fällig 07.04.2038	213	0,09
3 Government National Mortgage Association, Series 2019 123X Class A, 3,000%, fällig 20.10.2049	3	–	200 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,750%, fällig 01.03.2028	226	0,10	GBP 1.000 Lloyds Bank Plc, 7,625%, fällig 22.04.2025	1.697	0,72
				255	0,11	EUR 210 Lloyds Banking Group Plc, 3,500%, fällig 01.04.2026 *	279	0,12
						GBP 260 Scottish Widows Ltd, 5,500%, fällig 16.06.2023	385	0,16
Summe hypothekarisch gesicherte Wertpapiere (Kosten 22.145 USD)	22.323	9,42					5.569	2,35
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 23,59 % (28. Februar 2021: 25,41 %)								
Australien – 0,54 % (28. Februar 2021: 0,42 %)								
EUR 871 Glencore Finance Europe Ltd, 1,875%, fällig 13.09.2023	1.065	0,45	Italien – 0,71 % (28. Februar 2021: 0,60 %)			Vereinigte Staaten – 13,13 % (28. Februar 2021: 13,57 %)		
200 Glencore Funding LLC, 144 A 4,000%, fällig 27.03.2027	221	0,09	EUR 1.100 UniCredit SpA, 1,200%, fällig 20.01.2026 *	1.330	0,56	100 3M Co, 3,700%, fällig 15.04.2050	119	0,05
	1.286	0,54		1.688	0,71	30 AbbVie Inc, 2,900%, fällig 06.11.2022	31	0,01
Belgien – 0,33 % (28. Februar 2021: 0,45 %)								
260 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900%, fällig 01.02.2046	332	0,14	Luxemburg – 0,33 % (28. Februar 2021: 0,28 %)			EUR 120 AbbVie Inc, 1,500%, fällig 15.11.2023	147	0,06
150 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350%, fällig 01.06.2040	180	0,08	EUR 620 Logicor Financing Sarl, 1,625%, fällig 15.07.2027	778	0,33	100 AbbVie Inc, 3,800%, fällig 15.03.2025	109	0,05
220 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500%, fällig 01.06.2050	274	0,11	Macau – 0,09 % (28. Februar 2021: 0,07 %)			170 AbbVie Inc, 3,200%, fällig 21.11.2029	186	0,08
	786	0,33	200 Wynn Macau Ltd, 144 A 5,625%, fällig 26.08.2028	203	0,09	100 AbbVie Inc, 4,875%, fällig 14.11.2048	437	0,18
Brasilien – 0,11 % (28. Februar 2021: 0,23 %)								
230 Petrobras Global Finance BV, 5,750%, fällig 01.02.2029	263	0,11	Niederlande – 1,28 % (28. Februar 2021: 1,59 %)			360 AbbVie Inc, 4,250%, fällig 21.11.2049	437	0,18
Kanada – 0,11 % (28. Februar 2021: 0,10 %)								
130 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144 A 3,875%, fällig 15.01.2028	132	0,06	EUR 800 ABN AMRO Bank NV, 7,125%, fällig 06.07.2022	1.002	0,42	510 Allied Universal Holdco LLC/ Allied Universal Finance Corp/ Atlas Luxco 4 Sarl, 144 A 4,625%, fällig 01.06.2028	512	0,22
130 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.02.2029	129	0,05	250 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625%, fällig 01.12.2023	272	0,11	80 Amazon.com Inc, 4,250%, fällig 22.08.2057	104	0,04
	261	0,11	EUR 200 ING Groep NV, 3,000%, fällig 11.04.2028 *	247	0,10	150 AT&T Inc, 2,250%, fällig 01.02.2032	149	0,06
China – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,00 %)								
20 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144 A 2,700%, fällig 01.05.2025	21	0,01	EUR 900 ING Groep NV, 2,500%, fällig 15.02.2029 *	1.123	0,47	184 AT&T Inc, 4,500%, fällig 09.03.2048	218	0,09
Dänemark – 0,09 % (28. Februar 2021: 0,07 %)								
200 Danske Bank A/S, 144 A 5,000%, fällig 12.01.2022	203	0,09	80 Shell International Finance BV, 2,750%, fällig 06.04.2030	86	0,04	34 AT&T Inc, 144 A 3,650%, fällig 15.09.2059	35	0,01
Frankreich – 0,36 % (28. Februar 2021: 0,66 %)								
200 BNP Paribas SA, 144 A 2,219%, fällig 09.06.2026 *	206	0,09	200 Shell International Finance BV, 4,375%, fällig 11.05.2045	250	0,11	20 Bank of America Corp, 3,300%, fällig 11.01.2023	21	0,01
300 BNP Paribas SA, 1,875%, fällig 14.12.2027	424	0,18	60 Shell International Finance BV, 3,250%, fällig 06.04.2050	65	0,03	150 Bank of America Corp, 4,200%, fällig 26.08.2024	164	0,07
200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144 A 4,750%, fällig 17.09.2044	224	0,09		3.045	1,28	160 Bank of America Corp, 4,250%, fällig 22.10.2026	182	0,08
	854	0,36	Südafrika – 0,34 % (28. Februar 2021: 0,29 %)			945 Bank of America Corp, 2,592%, fällig 29.04.2031 *	979	0,41
Deutschland – 1,25 % (28. Februar 2021: 1,10 %)								
250 E.ON International Finance BV, 5,625%, fällig 06.12.2023	382	0,16	EUR 640 Anglo American Capital Plc, 1,625%, fällig 108.09.2025	803	0,34	27 Becton Dickinson and Co, 3,734%, fällig 15.12.2024	29	0,01
100 Muenchener Rueckversicherungs Gesellschaft AG in Muenchen, 6,625%, fällig 26.05.2042 *	143	0,06	Spanien – 0,34 % (28. Februar 2021: 0,28 %)			590 Boeing Co/The, 5,150%, fällig 01.05.2030	699	0,30
500 Muenchener Rueckversicherungs Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250%, fällig 26.05.2049 *	691	0,29	EUR 600 Banco Santander SA, 3,250%, fällig 04.04.2026	801	0,34	100 Boeing Co/The, 3,300%, fällig 01.03.2035	102	0,04
			Schweden – 0,33 % (28. Februar 2021: 0,28 %)			350 Boeing Co/The, 5,805%, fällig 01.05.2050	476	0,20
			EUR 660 Svenska Handelsbanken AB, 1,250%, fällig 02.03.2028 *	795	0,33	370 BP Capital Markets America Inc, 3,633%, fällig 06.04.2030	418	0,18
			Schweiz – 1,11 % (28. Februar 2021: 1,19 %)			26 Bristol-Myers Squibb Co, 2,900%, fällig 26.07.2024	28	0,01
			EUR 390 Credit Suisse Group AG, 3,250%, fällig 02.04.2026 *	509	0,22	140 Broadcom Inc, 3,150%, fällig 15.11.2025	150	0,06
			250 Credit Suisse Group AG, 144 A 4,194%, fällig 01.04.2031 *	283	0,12	140 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500%, fällig 01.05.2032	146	0,06
			EUR 1.470 UBS Group AG, 1,500%, fällig 30.11.2024	1.801	0,76	200 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 4,500%, fällig 01.06.2033	208	0,09
			GBP 20 Zurich Finance UK Plc, 6,625%, Perpetual *	29	0,01	130 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908%, fällig 23.07.2025	147	0,06
				2.622	1,11			
			Vereinigte Arabische Emirate – 0,53 % (28. Februar 2021: 0,15 %)					
			420 MDGH – GMTN BV, 2,875%, fällig 21.05.2030	445	0,19			
			EUR 690 MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000%, fällig 10.03.2034	822	0,34			
				1.267	0,53			
			Großbritannien – 2,35 % (28. Februar 2021: 2,38 %)					
			GBP 670 Aviva Plc, 6,125%, fällig 14.11.2036 *	1.121	0,47			
			GBP 100 Aviva Plc, 5,125%, fällig 04.06.2050 *	165	0,07			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			20 Enterprise Products Operating LLC, 3,350%, fällig 15.03.2023	21	0,01	29 Medtronic Inc, 4,625%, fällig 15.03.2045	39	0,02	
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			210 Enterprise Products Operating LLC, 2,800%, fällig 31.01.2030	223	0,09	40 MetLife Inc, 6,400%, fällig 15.12.2036	51	0,02	
100 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200%, fällig 15.03.2028	113	0,05	370 Enterprise Products Operating LLC, 5,100%, fällig 15.02.2045	470	0,20	10 Morgan Stanley, 4,431%, fällig 23.01.2030 *	12	0,01	
290 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050%, fällig 30.03.2029	344	0,15	10 EQT Corp, 6,625%, fällig 01.02.2025	11	0,01	490 Morgan Stanley, 3,622%, fällig 01.04.2031 *	549	0,23	
140 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750%, fällig 01.04.2048	180	0,08	10 Exelon Corp, 5,625%, fällig 15.06.2035	13	0,01	170 NGPL PipeCo LLC, 144 A 4,875%, fällig 15.08.2027	195	0,08	
290 Cigna Corp, 4,375%, fällig 15.10.2028	339	0,14	100 Exxon Mobil Corp, 3,452%, fällig 15.04.2051	111	0,05	80 Northrop Grumman Corp, 5,250%, fällig 01.05.2050	114	0,05	
310 Cigna Corp, 3,200%, fällig 15.03.2040	327	0,14	520 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000%, fällig 13.11.2030	549	0,23	150 NVIDIA Corp, 3,500%, fällig 01.04.2050	173	0,07	
30 Citigroup Inc, 3,500%, fällig 15.05.2023	32	0,01	110 Fox Corp, 5,476%, fällig 25.01.2039	143	0,06	70 Occidental Petroleum Corp, 3,500%, fällig 15.08.2029	73	0,03	
EUR 290 Citigroup Inc, 1,750%, fällig 28.01.2025	364	0,15	325 GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418%, fällig 15.11.2035	395	0,17	80 Occidental Petroleum Corp, 6,600%, fällig 15.03.2046	101	0,04	
130 Citigroup Inc, 5,500%, fällig 13.09.2025	151	0,06	68 General Electric Co, 6,875%, fällig 10.01.2039	103	0,04	320 Occidental Petroleum Corp, 4,400%, fällig 15.04.2046	328	0,14	
290 Citigroup Inc, 4,600%, fällig 09.03.2026	331	0,14	50 General Motors Co, 6,600%, fällig 01.04.2036	68	0,03	600 Occidental Petroleum Corp, 4,400%, fällig 15.08.2049	606	0,26	
350 Citigroup Inc, 4,300%, fällig 20.11.2026	397	0,17	10 General Motors Co, 5,200%, fällig 01.04.2045	12	0,01	80 PayPal Holdings Inc, 1,350%, fällig 01.06.2023	81	0,03	
420 Citigroup Inc, 4,450%, fällig 29.09.2027	481	0,20	70 General Motors Co, 6,750%, fällig 01.04.2046	101	0,04	80 PayPal Holdings Inc, 1,650%, fällig 01.06.2025	82	0,03	
120 Citigroup Inc, 4,412%, fällig 31.03.2031 *	141	0,06	120 General Motors Financial Co Inc, 4,375%, fällig 25.09.2021	120	0,05	70 Raytheon Technologies Corp, 2,250%, fällig 01.07.2030	72	0,03	
93 Citigroup Inc, 5,300%, fällig 06.05.2044	127	0,05	150 Gilead Sciences Inc, 4,800%, fällig 01.04.2044	193	0,08	384 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144 A 8,000%, fällig 20.09.2025	435	0,18	
85 Citigroup Inc, 4,650%, fällig 30.07.2045	111	0,05	30 Gilead Sciences Inc, 4,750%, fällig 01.03.2046	39	0,02	10 Sprint Capital Corp, 8,750%, fällig 15.03.2032	15	0,01	
20 Coca-Cola Co/The, 2,500%, fällig 01.06.2040	20	0,01	201 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,500%, fällig 12.10.2021	278	0,12	4 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850%, fällig 16.12.2039	6	–	
20 Coca-Cola Co/The, 2,600%, fällig 01.06.2050	20	0,01	280 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,850%, fällig 08.07.2024	303	0,13	90 Texas Instruments Inc, 1,750%, fällig 04.05.2030	90	0,04	
80 Coca-Cola Co/The, 2,500%, fällig 15.03.2051	78	0,03	170 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500%, fällig 01.04.2025	184	0,08	100 Time Warner Cable LLC, 7,300%, fällig 01.07.2038	146	0,06	
66 Comcast Corp, 3,999%, fällig 01.11.2049	79	0,03	620 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750%, fällig 01.10.2037	905	0,38	40 Time Warner Cable LLC, 6,750%, fällig 15.06.2039	56	0,02	
51 Comcast Corp, 4,049%, fällig 01.11.2052	62	0,03	640 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250%, fällig 01.02.2041	951	0,40	30 T-Mobile USA Inc, 2,250%, fällig 15.02.2026	31	0,01	
57 Comcast Corp, 144 A 2,987%, fällig 01.11.2063	56	0,02	350 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150%, fällig 22.05.2045	470	0,20	90 T-Mobile USA Inc, 2,625%, fällig 15.02.2029	91	0,04	
440 CVS Health Corp, 3,750%, fällig 01.04.2030	497	0,21	340 HCA Inc, 5,000%, fällig 15.03.2024	374	0,16	280 T-Mobile USA Inc, 3,875%, fällig 15.04.2030	314	0,13	
200 CVS Health Corp, 2,700%, fällig 21.08.2040	197	0,08	380 HCA Inc, 5,250%, fällig 15.06.2026	439	0,19	60 T-Mobile USA Inc, 2,875%, fällig 15.02.2031	62	0,03	
200 CVS Health Corp, 5,050%, fällig 25.03.2048	265	0,11	200 HCA Inc, 4,500%, fällig 15.02.2027	227	0,10	100 T-Mobile USA Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.04.2031	107	0,05	
120 Delta Air Lines Inc, 3,800%, fällig 19.04.2023	124	0,05	130 Home Depot Inc/The, 3,300%, fällig 15.04.2040	144	0,06	200 T-Mobile USA Inc, 3,000%, fällig 15.02.2041	199	0,08	
550 Delta Air Lines Inc, 144 A 7,000%, fällig 01.05.2025	644	0,27	130 Home Depot Inc/The, 3,350%, fällig 15.04.2050	145	0,06	480 United Airlines Inc, 144 A 4,625%, fällig 15.04.2029	499	0,21	
170 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,500%, fällig 20.10.2025	182	0,08	80 JPMorgan Chase & Co, 3,625%, fällig 13.05.2024	87	0,04	190 Verizon Communications Inc, 4,500%, fällig 10.08.2033	230	0,10	
150 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,750%, fällig 20.10.2028	167	0,07	70 JPMorgan Chase & Co, 4,125%, fällig 15.12.2026	80	0,03	50 Verizon Communications Inc, 5,250%, fällig 16.03.2037	66	0,03	
140 Devon Energy Corp, 144 A 8,250%, fällig 01.08.2023	158	0,07	300 JPMorgan Chase & Co, 4,452%, fällig 05.12.2029 *	351	0,15	10 Verizon Communications Inc, 4,862%, fällig 21.08.2046	13	0,01	
590 Devon Energy Corp, 5,850%, fällig 15.12.2025	687	0,29	520 JPMorgan Chase & Co, 2,522%, fällig 22.04.2031 *	538	0,23	10 Verizon Communications Inc, 5,500%, fällig 16.03.2047	14	0,01	
120 DISH DBS Corp, 5,875%, fällig 15.11.2024	129	0,05	440 JPMorgan Chase & Co, 2,956%, fällig 13.05.2031 *	466	0,20	90 Visa Inc, 2,050%, fällig 15.04.2030	93	0,04	
70 DISH DBS Corp, 144 A 5,125%, fällig 01.06.2029	70	0,03	180 JPMorgan Chase & Co, 3,109%, fällig 22.04.2051 *	189	0,08	90 Visa Inc, 2,700%, fällig 15.04.2040	94	0,04	
60 Duke Energy Progress LLC, 4,375%, fällig 30.03.2044	75	0,03	177 Lehman Escrow Receipt, Zero coupon, Perpetual t=2	–	–	340 VOC Escrow Ltd, 144 A 5,000%, fällig 15.02.2028	337	0,14	
1.100 Energy Transfer LP, 3,750%, fällig 15.05.2030	1.195	0,50	30 McDonald's Corp, 3,625%, fällig 01.09.2049	34	0,01	43 Wells Fargo & Co, 4,480%, fällig 16.01.2024	47	0,02	
			110 McDonald's Corp, 4,200%, fällig 01.04.2050	135	0,06	860 Wells Fargo & Co, 5,013%, fällig 04.04.2051 *	1.200	0,51	
						790 Western Midstream Operating LP, 5,300%, fällig 01.02.2030	887	0,37	
						550 Western Midstream Operating LP, 6,500%, fällig 01.02.2050	649	0,27	
							31.101	13,13	
						Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 51.735 USD)		55.894	23,59

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts			
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 56,74 % (28. Februar 2021: 54,39 %)			1.090 Mexico Government International Bond, 5,550%, fällig 21.01.2045	1.346	0,57	1.960 United States Treasury Note/Bond, 0,750%, fällig 31.05.2026	1.961	0,83			
Belgien – 0,75 % (28. Februar 2021: 0,68 %)			1.640 Mexico Government International Bond, 4,600%, fällig 23.01.2046	1.803	0,76	6.140 United States Treasury Note/Bond, 2,750%, fällig 15.11.2047	7.207	3,04			
EUR	690 Kingdom of Belgium Government Bond, Series 71X 3,750%, fällig 22.06.2045	1,389	0,59	8.788	3,71	3.940 United States Treasury Note/Bond, 2,875%, fällig 15.05.2049	4.759	2,01			
EUR	260 Kingdom of Belgium Government Bond, Series 88X 144 A 1,700%, fällig 22.06.2050	384	0,16	Katar – 0,87 % (28. Februar 2021: 0,77 %)			1.420 United States Treasury Note/Bond, 2,000%, fällig 15.02.2050	1.443	0,61		
		1.773	0,75	1.570 Qatar Government International Bond, 4,817%, fällig 14.03.2049	2.056	0,87	3.960 United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 15.08.2050	3.465	1,46		
Kanada – 1,32 % (28. Februar 2021: 1,25 %)			Rumänien – 0,58 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 131.734 USD)			134.411	56,74	
CAD	1.640 Canadian Government Bond, 2,250%, fällig 01.06.2025	1.374	0,58	EUR	1.170 Romanian Government International Bond, 2,000%, fällig 14.04.2033	1.378	0,58				
CAD	1.030 Province of Ontario Canada, 3,450%, fällig 02.06.2045	949	0,40	Russland – 1,05 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Kollektive Kapitalanlagen – 9,88 % (28. Februar 2021: 10,05 %)				
CAD	860 Province of Quebec Canada, 3,500%, fällig 01.12.2045	804	0,34	RUB	180.580 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224X 6,900%, fällig 23.05.2029	2.476	1,05	1.612 Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	23.402	9,88	
		3.127	1,32	Südafrika – 1,49 % (28. Februar 2021: 1,14 %)			Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 21.249 USD)			23.402	9,88
Frankreich – 3,67 % (28. Februar 2021: 3,51 %)			ZAR	75.222 Republic of South Africa Government Bond, Series R2 14X 6,500%, fällig 28.02.2041	3.528	1,49	Erfolgswirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 226.863 USD)			236.030	99,63
EUR	5.180 French Republic Government Bond OAT, 1,000%, fällig 25.05.2027	6.634	2,80	Südkorea – 0,93 % (28. Februar 2021: 0,80 %)							
EUR	700 French Republic Government Bond OAT, 144 A 1,500%, fällig 25.05.2050	996	0,42	KRW	2.533.840 Korea Treasury Bond, Series 2606X 1,875%, fällig 10.06.2026	2.205	0,93				
EUR	440 French Republic Government Bond OAT, 4,000%, fällig 25.04.2060	1.065	0,45	Spanien – 2,15 % (28. Februar 2021: 2,30 %)							
		8.695	3,67	EUR	640 Spain Government Bond, 144 A 5,150%, fällig 30.11.2044	1.402	0,59				
Deutschland – 3,75 % (28. Februar 2021: 3,69 %)			EUR	2.300 Spain Government Bond, Series 30 Y, 144 A 2,700%, fällig 30.11.2048	3.686	1,56					
EUR	400 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 98X 4,750%, fällig 04.07.2028	651	0,27				5.088	2,15			
EUR	5.060 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250%, fällig 15.02.2029	6.351	2,68	Türkei – 0,61 % (28. Februar 2021: 0,51 %)							
EUR	980 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,500%, fällig 15.08.2046	1.884	0,80	750 Turkey Government International Bond, 4,750%, fällig 26.01.2026	750	0,31					
		8.886	3,75	700 Turkey Government International Bond, 5,950%, fällig 15.01.2031	703	0,30					
Indonesien – 4,33 % (28. Februar 2021: 4,13 %)						1.453	0,61				
IDR	3.430 Indonesia Government International Bond, 4,200%, fällig 15.10.2050	3.980	1,68	Vereinigte Arabische Emirate – 0,89 % (28. Februar 2021: 0,61 %)							
IDR	77.875.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR79X 8,375%, fällig 15.04.2039	6.290	2,65	480 Abu Dhabi Government International Bond, 3,125%, fällig 16.04.2030	530	0,22					
		10.270	4,33	1.350 Abu Dhabi Government International Bond, 3,875%, fällig 16.04.2050	1.581	0,67					
Italien – 1,52 % (28. Februar 2021: 1,45 %)						2.111	0,89				
EUR	2.270 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144 A 3,250%, fällig 01.09.2046	3.591	1,52	Großbritannien – 2,34 % (28. Februar 2021: 3,04 %)							
Japan – 5,38 % (28. Februar 2021: 5,33 %)			GBP	1.640 United Kingdom Gilt, 4,250%, fällig 07.12.2040	3.528	1,49					
JPY	86.500 Japan Government Thirty Year Bond, Series 59X 0,700%, fällig 20.06.2048	812	0,34	GBP	940 United Kingdom Gilt, 2,500%, fällig 22.07.2065	2.008	0,85				
JPY	534.400 Japan Government Thirty Year Bond, Series 66X 0,400%, fällig 20.03.2050	4.584	1,93				5.536	2,34			
JPY	63.350 Japan Government Twenty Year Bond, Series 128X 1,900%, fällig 20.06.2031	682	0,29	Vereinigte Staaten – 21,40 % (28. Februar 2021: 19,74 %)							
JPY	24.400 Japanese Government CPI Linked Bond, Series 19X 0,100%, fällig 10.09.2024	229	0,10	1.670 United States Treasury Note/Bond, 2,375%, fällig 15.08.2024	1.768	0,75					
JPY	684.900 Japanese Government CPI Linked Bond, Series 21X 0,100%, fällig 10.03.2026	6.442	2,72	13.100 United States Treasury Note/Bond, 0,375%, fällig 30.04.2025	13.016	5,49					
		12.749	5,38	4.460 United States Treasury Note/Bond, 0,250%, fällig 30.06.2025	4.404	1,86					
Mexiko – 3,71 % (28. Februar 2021: 4,28 %)			7.830 United States Treasury Note/Bond, 0,250%, fällig 31.08.2025	7.716	3,26						
MXN	91.000 Mexican Bonos, Series M, 7,750%, fällig 13.11.2042	4.623	1,95	130 United States Treasury Note/Bond, 0,375%, fällig 31.01.2026	128	0,05					
EUR	820 Mexico Government International Bond, 2,875%, fällig 08.04.2039	1.016	0,43	4.830 United States Treasury Note/Bond, 0,750%, fällig 30.04.2026	4.834	2,04					
						Verträge (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	
						Gekaufte Optionen – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,00 %)					
						4.730 USD Call/AUD Put 0,72X fällig 07.10.2021 – JP Morgan			24	0,01	
						Summe gekaufte Optionen (Kosten 40 USD)			24	0,01	
						Zinsswaps – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,19 %)					
						Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			32	0,01	
						Devisenterminkontrakte – 0,42 % (28. Februar 2021: 0,58 %)					
						Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			996	0,42	
						Termingeschäfte – 0,15 % (28. Februar 2021: 0,43 %)					
						Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			349	0,15	
						Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			237.431	100,22	
						Verträge (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	
						Verkaufte Optionen – (0,01 %) (28. Februar 2021: (0,03 %))					
						EUR (2.360) EUR Call/NOK Put 10,30X fällig 208.09.2021 – JP Morgan			(20)	(0,01)	
						Summe verkaufte Optionen (Kosten (27) USD)			(20)	(0,01)	
						Inflationsswaps – (0,09 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)					
						Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(215)	(0,09)	
						Zinsswaps – (0,03 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)					
						Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(74)	(0,03)	
						Devisenterminkontrakte – (0,44 %) (28. Februar 2021: (0,43 %))					
						Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(1.052)	(0,44)	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts			% von Gesamt Vermögen
Termingeschäfte – (0,19 %) (28. Februar 2021: (0,26 %))			*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.	
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(441)	(0,19)	+	Illiquid.	
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(1.802)	(0,76)	≠	Die Wertpapiere (in ihrer Gesamtheit oder in Teilen) sind zum 31. August 2021 als Sicherheit für den Handel mit Derivaten verpfändet.	
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	235.629	99,46	±	Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.	
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	1.289	0,54	β	Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.	
Gesamtvermögen	\$236.918	100,00		ABKÜRZUNGEN:	
			CPI	– Verbraucherpreisindex.	
			Fortwährend	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.	
			TBA	– Wird noch bekanntgegeben.	
			CAD	– Kanadischer Dollar	
			EUR	– Euro	
			GBP	– Britisches Pfund Sterling	
			IDR	– Indonesische Rupiah	
			JPY	– Japanischer Yen	
			KRW	– Südkoreanischer Won	
			MXN	– Mexikanischer Peso	
			RUB	– Russischer Rubel	
			ZAR	– Südafrikanischer Rand	
				Analyse des Gesamtvermögens	
				Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	85,05
				Organismen für gemeinsame Anlagen	9,36
				Finanzderivate	0,56
				Sonstige Vermögenswerte	5,03
				Gesamtvermögen	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 15.644.000 USD und machten 6,61 % des Nettovermögens aus.				

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitsstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating EUR 6MEuribor Reuters, Receive Fixed -0,250%	30.06.2026	6.080	\$ 32
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,500%, Receive Floating EUR 6M Euribor Reuters	30.06.2051	1.050	(74)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 531 USD)				\$ 32
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(74)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 531 USD)				\$ (42)

Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitsstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	USD-USA-CPI-U	28.04.2026	6.930	\$ (215)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(215)
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ (215)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
10.09.2021	Citi	Kauf	USD	2.303	Verkauf	CNH	14.760	\$ 18
10.09.2021	Citi	Kauf	USD	239	Verkauf	RUB	17.620	(1)
10.09.2021	Citi	Kauf	RUB	212.460	Verkauf	USD	2.856	41
10.09.2021	JP Morgan	Kauf	USD	3.285	Verkauf	CNH	21.400	(28)
10.09.2021	JP Morgan	Kauf	USD	16.567	Verkauf	CNH	106.230	124
10.09.2021	JP Morgan	Kauf	USD	1.174	Verkauf	IDR	17.005.090	(18)
10.09.2021	JP Morgan	Kauf	USD	332	Verkauf	KRW	375.300	9
10.09.2021	JP Morgan	Kauf	USD	2.461	Verkauf	RUB	183.350	(39)
10.09.2021	JP Morgan	Kauf	USD	3.633	Verkauf	RUB	265.680	11
10.09.2021	JP Morgan	Kauf	CNH	23.010	Verkauf	USD	3.543	18
10.09.2021	JP Morgan	Kauf	RUB	364.911	Verkauf	USD	4.904	71
10.09.2021	JP Morgan	Kauf	KRW	504.845	Verkauf	USD	456	(21)
10.09.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	517	Verkauf	BRL	2.570	21
10.09.2021	Morgan Stanley	Kauf	BRL	14.190	Verkauf	USD	2.791	(50)
10.09.2021	Morgan Stanley	Kauf	BRL	1.020	Verkauf	USD	196	1
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	27	Verkauf	EUR	23	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CAD	139.893	Verkauf	USD	111.299	(421)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	43.165	Verkauf	USD	50.780	203
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD	14.178	Verkauf	USD	9.940	51
18.11.2021	Citi	Kauf	PLN	10.210	Verkauf	USD	2.605	61
18.11.2021	Citi	Kauf	EUR	1.800	Verkauf	USD	2.112	17
18.11.2021	Citi	Kauf	AUD	5.176	Verkauf	USD	3.796	(8)
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.599	Verkauf	CAD	3.253	21

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	14.896	Verkauf	EUR	12.669\$ (87)
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	3.593	Verkauf	JPY	396.738 (15)
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	822	Verkauf	MXN	16.633 2
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	NOK	22.331	Verkauf	USD	2.531 37
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	CAD	257	Verkauf	USD	204 –
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	AUD	1.461	Verkauf	USD	1.077 (8)
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	3.421	Verkauf	ZAR	51.000 (54)
18.11.2021	HSBC	Kauf	USD	14.378	Verkauf	EUR	12.242 (100)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD	8.181	Verkauf	AUD	11.093 62
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD	776	Verkauf	CAD	972 6
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD	3.702	Verkauf	EUR	3.150 (22)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD	10.566	Verkauf	GBP	7.626 80
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD	239	Verkauf	HUF	72.000 (4)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD	7.493	Verkauf	JPY	827.213 (31)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD	251	Verkauf	PLN	980 (5)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	JPY	121.390	Verkauf	USD	1.101 3
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	HUF	1.678.980	Verkauf	USD	5.548 119
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	EUR	1.166	Verkauf	USD	1.372 7
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	GBP	170	Verkauf	USD	235 (1)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	AUD	1.800	Verkauf	USD	1.321 (4)
18.11.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	252	Verkauf	EUR	215 (2)
18.11.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	2.017	Verkauf	GBP	1.460 10
18.11.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	5.307	Verkauf	JPY	587.200 (34)
18.11.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	237	Verkauf	MXN	4.770 2
18.11.2021	Morgan Stanley	Kauf	AUD	2.530	Verkauf	USD	1.856 (5)
18.11.2021	Morgan Stanley	Kauf	MXN	15.520	Verkauf	USD	764 1
18.11.2021	UBS	Kauf	USD	11.988	Verkauf	EUR	10.207 (82)
18.11.2021	UBS	Kauf	USD	1.739	Verkauf	JPY	192.000 (8)
18.11.2021	UBS	Kauf	USD	437	Verkauf	MXN	8.901 (1)
18.11.2021	UBS	Kauf	MXN	9.000	Verkauf	USD	446 (3)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.652 USD)							\$ 996
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.236) USD)							(1.052)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 416 USD)							\$ (56)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro\$ Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(125)	\$(31.195)	\$ (16)
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	144	35.652	(34)
Australia 10 Year Bond September 2021	Bank of America Merrill Lynch	26	2.773	96
Canadian 10 Year Bond Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	19	2.201	(10)
Canadian 5 Year Bond Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	1	100	–
Euro-Bobl September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(956)	(7)
Euro-BTP September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(7)	(1.267)	(40)
Euro-Bund Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(48)	(9.779)	34
Euro-Bund September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(90)	(18.644)	67
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(12)	(3.011)	(206)
Euro-OAT September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(33)	(6.281)	(115)
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2021	Bank of America Merrill Lynch	4	5.532	27
Long Gilt Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(19)	(3.350)	21
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(412)	(54.983)	71
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(58)	(8.585)	18
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	35	7.712	5
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	60	7.423	10
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(26)	(4.237)	(13)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	3	592	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.236 USD)				\$ 349
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (742) USD)				(441)
Nettowertminderung von Termingeschäftskontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 494 USD)				\$ (92)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere – 0,41 % (28. Februar 2021: 0,66 %)			EUR	200 Terega SA, 0,875%, fällig 17.09.2030	0,28	Luxemburg – 2,11 % (28. Februar 2021: 2,30 %)		
140 Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Series 2018 4X Class A, 4,060%, fällig 15.11.2030	161	0,19	EUR	200 Terega SASU, 0,625%, fällig 27.02.2028	0,27	EUR	100 ArcelorMittal SA, 6,750%, fällig 01.03.2041	0,16
195 SLM Student Loan Trust 2006-10X Series 2006 10X Class A6X 0,275%, fällig 25.03.2044 *	193	0,22	EUR	300 Valeo, 1,000%, fällig 03.08.2028	0,40	EUR	340 Logisor Financing Sarl, 1,625%, fällig 15.07.2027	0,49
				200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 4,750%, fällig 17.09.2044	0,26	EUR	350 Logisor Financing Sarl, 3,250%, fällig 13.11.2028	0,56
						EUR	125 Prologis International Funding II SA, 1,750%, fällig 15.03.2028	0,19
Summe hypothekarisch gesicherte Wertpapiere (Kosten 329 USD)	354	0,41		4.527	5,19	EUR	240 SELP Finance Sarl, 1,500%, fällig 20.11.2025	0,34
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 86,16 % (28. Februar 2021: 88,60 %)			Deutschland – 6,86 % (28. Februar 2021: 6,21 %)			EUR	260 SELP Finance Sarl, 1,500%, fällig 20.12.2026	0,37
Australien – 0,92 % (28. Februar 2021: 0,63 %)			EUR	400 Allianz SE, 4,750%, Perpetual *	0,60		1.840	2,11
EUR	240 AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1,625%, fällig 11.03.2081 *	0,33	EUR	200 Allianz SE, 2,625%, Perpetual *	0,28	Macau – 0,26 % (28. Februar 2021: 0,28 %)		
EUR	370 Glencore Finance Europe Ltd, 1,875%, fällig 13.09.2023	0,52	EUR	300 alstria office REIT-AG, 1,500%, fällig 23.06.2026	0,43	EUR	200 Sands China Ltd, 5,400%, fällig 08.08.2028	0,26
60 Westpac Banking Corp, 2,668%, fällig 15.11.2035 *	60	0,07		360 Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750%, fällig 15.06.2030	0,62	Mexiko – 0,29 % (28. Februar 2021: 0,31 %)		
	804	0,92	EUR	200 Evonik Industries AG, 1,375%, fällig 02.09.2081 *	0,27	EUR	240 BBVA Bancomer SA/Texas, 6,750%, fällig 30.09.2022	0,29
Österreich – 0,28 % (28. Februar 2021: 0,29 %)			EUR	200 Grand City Properties SA, 1,500%, Perpetual *	0,27	Niederlande – 3,71 % (28. Februar 2021: 4,43 %)		
EUR	200 CA Immobilien Anlagen AG, 0,875%, fällig 05.02.2027	0,28	EUR	400 Hannover Rueck SE, 1,125%, fällig 09.10.2039 *	0,55	EUR	194 ABN AMRO Bank NV, 7,125%, fällig 06.07.2022	0,28
Belgien – 1,25 % (28. Februar 2021: 0,89 %)			EUR	400 Muenchener Rueckversicherungs Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250%, fällig 26.05.2049 *	0,63	EUR	300 ABN AMRO Bank NV, 4,750%, Perpetual *	0,45
EUR	220 Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3,700%, fällig 02.04.2040	0,41	EUR	200 Sirius Real Estate Ltd, 1,125%, fällig 22.06.2026	0,27	EUR	270 CTP NV, 2,125%, fällig 01.10.2025	0,39
10 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600%, fällig 15.04.2048	12	0,01	EUR	200 Vantage Towers AG, 0,750%, fällig 31.03.2030	0,28	EUR	260 CTP NV, 1,250%, fällig 21.06.2029	0,36
EUR	300 KBC Group NV, 1,875%, fällig 11.03.2027 *	0,41	EUR	380 Volkswagen Financial Services AG, 1,500%, fällig 01.10.2024	0,54	EUR	100 Enexis Holding NV, 0,750%, fällig 02.07.2031	0,14
EUR	300 UCB SA, 1,000%, fällig 30.03.2028	0,42	EUR	400 Volkswagen Financial Services NV, 4,250%, fällig 09.10.2025	0,71	EUR	140 Euronext NV, 1,000%, fällig 18.04.2025	0,20
	1.087	1,25	GBP	200 Vonovia Finance BV, 2,250%, fällig 07.04.2030	0,31	EUR	200 ING Groep NV, 3,000%, fällig 11.04.2028 *	0,28
Brasilien – 0,47 % (28. Februar 2021: 1,80 %)			EUR	200 Vonovia SE, 0,375%, fällig 16.06.2027	0,27	EUR	300 ING Groep NV, 2,500%, fällig 15.02.2029 *	0,43
EUR	300 Suzano Austria GmbH, 7,000%, fällig 16.03.2047	0,47	EUR	100 Vonovia SE, 1,625%, fällig 01.09.2051	0,13	EUR	200 Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1,750%, fällig 02.04.2027	0,30
China – 0,08 % (28. Februar 2021: 1,09 %)			EUR	300 ZF Finance GmbH, 3,000%, fällig 21.09.2025	0,43	EUR	110 Koninklijke Philips NV, 2,000%, fällig 30.03.2030	0,17
EUR	60 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 3,400%, fällig 01.05.2030	0,08		5.986	6,86	EUR	490 Vesteda Finance BV, 1,500%, fällig 24.05.2027	0,71
Kolumbien – 0,21 % (28. Februar 2021: 0,22 %)			Hongkong – 0,48 % (28. Februar 2021: 0,26 %)				3.235	3,71
EUR	170 Ecopetrol SA, 5,875%, fällig 28.05.2045	0,21	EUR	200 AIA Group Ltd, 144 A 3,200%, fällig 11.03.2025	0,24	Peru – 0,24 % (28. Februar 2021: 0,27 %)		
Dänemark – 1,28 % (28. Februar 2021: 1,54 %)			EUR	200 JMH Co Ltd, 2,500%, fällig 09.04.2031	0,24	EUR	200 Petroleos del Peru SA, 5,625%, fällig 19.06.2047	0,24
EUR	270 Danske Bank A/S, 5,375%, fällig 12.01.2024	0,34		206	0,24	Portugal – 0,55 % (28. Februar 2021: 0,37 %)		
EUR	200 Danske Bank A/S, 2,500%, fällig 21.06.2029 *	0,29	EUR	200 AIA Group Ltd, 144 A 3,200%, fällig 11.03.2025	0,24	EUR	400 EDP – Energias de Portugal SA, 1,875%, fällig 02.08.2081 *	0,55
EUR	470 Danske Bank A/S, 1,375%, fällig 12.02.2030 *	0,65		419	0,48	Russland – 0,45 % (28. Februar 2021: 0,48 %)		
	1.115	1,28	Israel – 0,31 % (28. Februar 2021: 0,33 %)			EUR	350 Lukoil International Finance BV, 4,750%, fällig 02.11.2026	0,45
Finnland – 0,55 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			EUR	240 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,125%, fällig 15.10.2024	0,31	Singapur – 0,28 % (28. Februar 2021: 0,30 %)		
EUR	400 Neste Oyj, 0,750%, fällig 25.03.2028	0,55	EUR	270 Enel Finance International NV, 6,000%, fällig 07.10.2039	0,44	EUR	200 Cromwell Ereit Lux Finco Sarl, 2,125%, fällig 19.11.2025	0,28
Frankreich – 5,19 % (28. Februar 2021: 5,77 %)			Italien – 3,11 % (28. Februar 2021: 3,67 %)			Südafrika – 0,47 % (28. Februar 2021: 0,49 %)		
EUR	490 AXA SA, 3,250%, fällig 28.05.2049 *	0,77	EUR	290 FCA Bank SpA/Ireland, 0,500%, fällig 13.09.2024	0,40	GBP	270 Anglo American Capital Plc, 3,375%, fällig 11.03.2029	0,47
400 BNP Paribas SA, 4,705%, fällig 10.01.2025 *	436	0,50	EUR	380 Intesa Sanpaolo SpA, 1,000%, fällig 04.07.2024	0,53	Spanien – 2,26 % (28. Februar 2021: 2,13 %)		
GBP	400 BNP Paribas SA, 1,875%, fällig 14.12.2027	0,65	EUR	200 Intesa Sanpaolo SpA, 144 A 4,198%, fällig 01.06.2032	0,24	GBP	500 Banco Santander SA, 1,750%, fällig 17.02.2027	0,80
410 BNP Paribas SA, 144 A 3,052%, fällig 13.01.2031 *	435	0,50	EUR	250 Intesa Sanpaolo SpA, 5,500%, Perpetual *	0,37	EUR	200 Banco Santander SA, 5,250%, Perpetual *	0,29
GBP	200 BNP Paribas SA, 2,000%, fällig 24.05.2031 *	0,32	EUR	250 UniCredit SpA, 1,200%, fällig 20.01.2026 *	0,35	EUR	100 Cellnex Finance Co SA, 2,000%, fällig 15.02.2033	0,13
EUR	200 Eiffage SA, 1,625%, fällig 14.01.2027	0,28	EUR	340 UniCredit SpA, 2,000%, fällig 23.09.2029 *	0,46	EUR	200 Cellnex Telecom SA, 1,875%, fällig 26.06.2029	0,28
EUR	200 Engie SA, 0,500%, fällig 24.10.2030	0,28	EUR	200 UniCredit SpA, 7,500%, Perpetual *	0,32	EUR	140 Telefonica Emisiones SA, 7,045%, fällig 20.06.2036	0,23
EUR	310 GELF Bond Issuer I SA, 1,125%, fällig 18.07.2029	0,44		282	0,32	EUR	400 Telefonica Europe BV, 2,376%, Perpetual *	0,53
EUR	150 Orange SA, 5,000%, Perpetual *	0,24		2.717	3,11		1.976	2,26

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			GBP	180 Lloyds Banking Group Plc, 1,985%, fällig 15.12.2031 *	0,29	EUR	200 Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 1,336%, fällig 13.08.2041	0,27
Schweden – 1,50 % (28. Februar 2021: 1,45 %)			GBP	200 Lloyds Banking Group Plc, 5,125%, Perpetual *	0,33	EUR	310 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,200%, fällig 15.08.2048	0,44
EUR	140 H&M Finance BV, 0,250%, fällig 25.08.2029	0,19	GBP	290 Marks & Spencer Plc, 3,750%, fällig 19.05.2026	0,48	EUR	250 Boeing Co/The, 4,875%, fällig 01.05.2025	0,32
EUR	100 Heimstaden AB, 4,250%, fällig 09.03.2026	0,14	GBP	200 Marston's Issuer Plc, Series B1X 2,628%, fällig 16.07.2035 *	0,26	EUR	120 Boeing Co/The, 3,950%, fällig 01.08.2059	0,14
EUR	350 Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,624%, Perpetual *	0,48	EUR	450 Natwest Group Plc, 2,500%, fällig 22.03.2023	0,63	EUR	570 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400%, fällig 26.07.2029	0,74
EUR	320 Svenska Handelsbanken AB, 1,250%, fällig 02.03.2028 *	0,44	EUR	200 Natwest Group Plc, 4,269%, fällig 22.03.2025 *	0,25	EUR	380 Broadcom Inc, 4,300%, fällig 15.11.2032	0,50
	200 Svenska Handelsbanken AB, 6,250%, Perpetual *	0,25	GBP	420 Natwest Group Plc, 3,754%, fällig 01.11.2029 *	0,51	EUR	140 Carlyle Holdings II Finance LLC, 144 A 5,625%, fällig 30.03.2043	0,22
		1,310	GBP	180 Natwest Group Plc, 2,105%, fällig 28.11.2031 *	0,29	EUR	190 Centene Corp, 4,625%, fällig 15.12.2029	0,24
		1,50	GBP	290 Natwest Group Plc, 4,500%, Perpetual *	0,47	EUR	80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500%, fällig 01.06.2041	0,09
Schweiz – 3,39 % (28. Februar 2021: 4,02 %)			EUR	120 RELX Finance BV, 0,500%, fällig 10.03.2028	0,17	EUR	210 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, fällig 01.05.2047	0,30
EUR	340 Credit Suisse Group AG, 3,250%, fällig 02.04.2026 *	0,51	EUR	100 RELX Finance BV, 0,875%, fällig 10.03.2032	0,14	EUR	190 Chevron USA Inc, 3,850%, fällig 15.01.2028	0,25
GBP	300 Credit Suisse Group AG, 2,250%, fällig 09.06.2028 *	0,49	EUR	260 Standard Chartered Plc, 3,950%, fällig 11.01.2023	0,31	EUR	580 Cigna Corp, 2,400%, fällig 15.03.2030	0,69
	230 Credit Suisse Group AG, 6,375%, Perpetual *	0,29	EUR	270 Standard Chartered Plc, 3,516%, fällig 12.02.2030 *	0,32	EUR	400 Cigna Corp, 3,400%, fällig 15.03.2050	0,49
	200 Credit Suisse Group AG, 7,250%, Perpetual *	0,26	EUR	270 Standard Chartered Plc, 2,500%, fällig 09.09.2030 *	0,39	EUR	150 Cimarex Energy Co, 3,900%, fällig 15.05.2027	0,19
	280 Glencore Finance Canada Ltd, 6,000%, fällig 15.11.2041	0,43	GBP	190 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500%, fällig 02.05.2025	0,32	EUR	500 Citigroup Inc, 8,125%, fällig 15.07.2039	0,99
EUR	320 UBS Group AG, 1,750%, fällig 16.11.2022	0,44	EUR	150 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 0,375%, fällig 27.07.2029	0,20	EUR	40 Coca-Cola Co/The, 2,500%, fällig 15.03.2051	0,04
EUR	300 UBS Group AG, 1,500%, fällig 30.11.2024	0,42	GBP	100 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,750%, fällig 27.04.2030	0,17	EUR	510 Comcast Corp, 3,100%, fällig 01.04.2025	0,63
EUR	200 UBS Group AG, 4,253%, fällig 23.03.2028	0,26	EUR	130 Tritax EuroBox Plc, 0,950%, fällig 02.06.2026	0,18	EUR	70 Comcast Corp, 4,950%, fällig 15.10.2058	0,12
	230 UBS Group AG, 7,000%, Perpetual *	0,29	GBP	190 UNITE Group Plc/The, 3,500%, fällig 15.10.2028	0,33	EUR	230 CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 144 A 3,875%, fällig 30.06.2028	0,27
		2,958	GBP	100 Whitbread Group Plc, 3,000%, fällig 31.05.2031	0,16	EUR	440 CVS Health Corp, 5,050%, fällig 25.03.2048	0,67
		3,39	EUR	12.025	13,78	EUR	130 Danaher Corp, 2,500%, fällig 30.03.2030	0,21
Großbritannien – 13,78 % (28. Februar 2021 12,21 %)			Vereinigte Staaten – 35,88 % (28. Februar 2021: 34,79 %)					
GBP	130 Anglian Water Osprey Financing Plc, 2,000%, fällig 31.07.2028	0,21	EUR	410 Abbott Ireland Financing DAC, 0,375%, fällig 19.11.2027	0,57	EUR	150 DCP Midstream Operating LP, 5,625%, fällig 15.07.2027	0,20
EUR	400 Annington Funding Plc, 1,650%, fällig 12.07.2024	0,57	EUR	230 AbbVie Inc, 1,250%, fällig 01.06.2024	0,32	EUR	20 Devon Energy Corp, 144 A 5,250%, fällig 15.10.2027	0,02
EUR	350 Barclays Plc, 3,375%, fällig 02.04.2025 *	0,51	GBP	830 AbbVie Inc, 3,200%, fällig 21.11.2029	1,04	EUR	78 Devon Energy Corp, 144 A 4,500%, fällig 15.01.2030	0,10
GBP	130 Barclays Plc, 1,700%, fällig 03.11.2026 *	0,21	GBP	380 AbbVie Inc, 4,875%, fällig 14.11.2048	0,57	EUR	90 Devon Energy Corp, 5,000%, fällig 15.06.2045	0,12
EUR	280 Barclays Plc, 2,000%, fällig 07.02.2028 *	0,39	GBP	140 Aetna Inc, 2,800%, fällig 15.06.2023	0,17	EUR	70 Energy Transfer LP, 6,250%, fällig 15.04.2049	0,11
GBP	210 Barclays Plc, 6,375%, Perpetual *	0,37	GBP	210 Air Lease Corp, 1,875%, fällig 15.08.2026	0,24	EUR	60 Energy Transfer LP, 5,000%, fällig 15.05.2050	0,08
GBP	150 BUPA Finance Plc, 5,000%, fällig 25.04.2023	0,25	EUR	160 American Airlines Inc/ AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144 A 5,500%, fällig 20.04.2026	0,19	EUR	40 Enterprise Products Operating LLC, 3,950%, fällig 31.01.2060	0,05
EUR	170 Cadent Finance Plc, 0,750%, fällig 11.03.2032	0,23	EUR	150 American Airlines Inc/ AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144 A 5,750%, fällig 20.04.2029	0,19	EUR	250 Enterprise Products Operating LLC, 5,375%, fällig 15.02.2078 *	0,30
GBP	190 Close Brothers Group Plc, 2,750%, fällig 26.04.2023	0,31	EUR	190 American International Group Inc, 1,500%, fällig 08.06.2023	0,26	EUR	280 Equinix Inc, 1,000%, fällig 15.03.2033	0,38
GBP	250 Co-Operative Bank Plc/The, 4,750%, fällig 11.11.2021	0,40	EUR	90 Anthem Inc, 3,650%, fällig 01.12.2027	0,12	EUR	220 Exelon Corp, 3,400%, fällig 15.04.2026	0,27
GBP	220 CPUK Finance Ltd, 7,239%, fällig 28.02.2024	0,40	EUR	160 Apple Inc, 2,650%, fällig 11.05.2050	0,18	EUR	450 FedEx Corp, 0,950%, fällig 04.05.2033	0,61
GBP	220 CPUK Finance Ltd, 3,588%, fällig 28.08.2025	0,38	EUR	170 AT&T Inc, 2,600%, fällig 19.05.2038	0,27	EUR	190 Fidelity & Guaranty Life Holdings Inc, 5,500%, fällig 01.05.2025	0,25
EUR	190 easyJet FinCo BV, 1,875%, fällig 03.03.2028	0,26	GBP	125 AT&T Inc, 4,250%, fällig 01.06.2043	0,25	EUR	200 FirstEnergy Corp, Series C, 7,375%, fällig 15.11.2031	0,32
GBP	160 Gatwick Airport Finance Plc, 4,375%, fällig 07.04.2026	0,25	EUR	400 AT&T Inc, Series B, 2,875%, Perpetual *	0,55	EUR	380 Ford Motor Credit Co LLC, 3,625%, fällig 17.06.2031	0,45
GBP	100 Gatwick Funding Ltd, 2,500%, fällig 15.04.2030	0,16	EUR	340 Bank of America Corp, 3,550%, fällig 05.03.2024 *	0,41	EUR	170 Forestar Group Inc, 144 A 3,850%, fällig 15.05.2026	0,20
GBP	180 Grainger Plc, 3,000%, fällig 03.07.2030	0,30	EUR	140 Bank of America Corp, 4,443%, fällig 20.01.2048 *	0,20			
EUR	200 HSBC Holdings Plc, 2,357%, fällig 18.08.2031 *	0,23						
GBP	260 HSBC Holdings Plc, 5,875%, Perpetual *	0,46						
EUR	250 HSBC Holdings Plc, 6,000%, Perpetual *	0,37						
GBP	160 Legal & General Group Plc, 4,500%, fällig 01.11.2050 *	0,29						
EUR	240 Lloyds Banking Group Plc, 3,500%, fällig 01.04.2026 *	0,37						
EUR	200 Lloyds Banking Group Plc, 4,375%, fällig 22.03.2028	0,26						

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			60 NRG Energy Inc, 144 A	2,450%, fällig 02.12.2027	0,07	EUR	200 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,250%, fällig 15.08.2048	312	0,36
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			100 Nuveen LLC, 4,000%, fällig 01.11.2028	115	0,13		2.025	2,32	
GBP	200 GE Capital UK Funding Unlimited Co, 8,000%, fällig 14.01.2039	0,56	80 Pioneer Natural Resources Co, 2,150%, fällig 15.01.2031	78	0,09	Indonesien – 0,49 % (28. Februar 2021: 0,52 %)			
	42 General Electric Co, 6,875%, fällig 10.01.2039	0,07	420 Prologis Euro Finance LLC, 0,625%, fällig 10.09.2031	500	0,57	EUR	350 Indonesia Government International Bond, 1,400%, fällig 30.10.2031	425	0,49
	80 General Motors Co, 5,400%, fällig 02.10.2023	0,10	220 Prudential Financial Inc, 3,000%, fällig 10.03.2040	231	0,26	Mexiko – 0,21 % (28. Februar 2021: 0,22 %)			
	110 General Motors Co, 6,125%, fällig 01.10.2025	0,15	410 Schlumberger Holdings Corp, 4,000%, fällig 21.12.2025	456	0,52	MXN	3.570 Mexican Bonos, Series M, 7,750%, fällig 13.11.2042	181	0,21
	50 General Motors Co, 6,600%, fällig 01.04.2036	0,08	220 Service Corp International/US, 3,375%, fällig 15.08.2030	222	0,25	Panama – 0,22 % (28. Februar 2021: 0,23 %)			
	130 General Motors Co, 6,750%, fällig 01.04.2046	0,22	360 Stellantis NV, 5,250%, fällig 15.04.2023	385	0,44	200 Panama Government International Bond, 2,252%, fällig 29.09.2032	196	0,22	
	200 Genting New York LLC / GENNY Capital Inc, 144 A 3,300%, fällig 15.02.2026	0,23	70 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,000%, fällig 15.01.2028	74	0,08	Rumänien – 0,40 % (28. Februar 2021: 0,43 %)			
	16 Goldman Sachs Capital II, 4,000%, Perpetual *	0,02	340 Texas Instruments Inc, 3,875%, fällig 15.03.2039	412	0,47	EUR	290 Romanian Government International Bond, 2,000%, fällig 28.01.2032	346	0,40
EUR	280 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,875%, fällig 03.06.2026	0,43	310 Time Warner Cable LLC, 7,300%, fällig 01.07.2038	452	0,52	Russland – 0,63 % (28. Februar 2021: 0,67 %)			
	110 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800%, fällig 15.03.2030	0,14	150 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850%, fällig 01.02.2022	189	0,22	RUB	11.680 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224X 6,900%, fällig 23.05.2029	160	0,18
	460 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150%, fällig 22.05.2045	0,71	28 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875%, fällig 15.01.2026	30	0,03	EUR	300 Russian Foreign Bond – Eurobond, 2,875%, fällig 04.12.2025	390	0,45
	70 Halliburton Co, 5,000%, fällig 15.11.2045	0,10	290 United Airlines Inc, 144 A 4,375%, fällig 15.04.2026	301	0,35		550	0,63	
	370 HCA Inc, 3,500%, fällig 01.09.2030	0,46	300 United Rentals North America Inc, 3,750%, fällig 15.01.2032	307	0,35	Großbritannien – 0,79 % (28. Februar 2021: 0,65 %)			
EUR	270 Honeywell International Inc, 0,750%, fällig 10.03.2032	0,38	420 UnitedHealth Group Inc, 4,450%, fällig 15.12.2048	547	0,63	GBP	170 United Kingdom Gilt, 1,000%, fällig 22.04.2024	239	0,27
	150 Humana Inc, 3,125%, fällig 15.08.2029	0,19	290 US Bancorp, 0,850%, fällig 07.06.2024	352	0,40	GBP	80 United Kingdom Gilt, 4,250%, fällig 07.06.2032	150	0,17
	180 Intel Corp, 3,050%, fällig 12.08.2051	0,21	210 Verizon Communications Inc, 2,100%, fällig 22.03.2028	216	0,25	GBP	120 United Kingdom Gilt, 4,250%, fällig 07.03.2036	240	0,28
	20 Intercontinental Exchange Inc, 4,250%, fällig 21.09.2048	0,03	60 Verizon Communications Inc, 5,250%, fällig 16.03.2037	80	0,09	GBP	26 United Kingdom Gilt, 4,500%, fällig 07.12.2042	59	0,07
	450 International Lease Finance Corp, 5,875%, fällig 15.08.2022	0,54	310 Verizon Communications Inc, 3,550%, fällig 22.03.2051	337	0,39		688	0,79	
EUR	250 JPMorgan Chase & Co, 1,090%, fällig 11.03.2027 *	0,35	260 VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 4,125%, fällig 15.08.2030	278	0,32	Vereinigte Staaten – 4,18 % (28. Februar 2021: 3,79 %)			
	150 Lam Research Corp, 1,900%, fällig 15.06.2030	0,17	200 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144 A 5,625%, fällig 15.02.2029	199	0,23	160 United States Treasury Note/Bond, 0,375%, fällig 30.11.2025	158	0,18	
	270 Las Vegas Sands Corp, 3,500%, fällig 18.08.2026	0,32	100 Walmart Inc, 4,050%, fällig 29.06.2048	127	0,14	120 United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 30.04.2028	264	0,30	
	140 Lithia Motors Inc, 144 A 3,875%, fällig 01.06.2029	0,17	250 Wells Fargo & Co, 2,250%, fällig 02.05.2023	308	0,35	10 United States Treasury Note/Bond, 2,625%, fällig 15.02.2029	11	0,01	
	30 Lowe's Cos Inc, 3,000%, fällig 15.10.2050	0,03	590 Wells Fargo & Co, 1,338%, fällig 04.05.2025 *	722	0,83	40 United States Treasury Note/Bond, 1,500%, fällig 15.02.2030	41	0,05	
	130 Mars Inc, 4,200%, fällig 01.04.2059	0,19	200 Wells Fargo & Co, 4,875%, fällig 29.11.2035	364	0,42	80 United States Treasury Note/Bond, 0,625%, fällig 15.05.2030	76	0,09	
	20 Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144 A 3,375%, fällig 15.04.2050	0,02	150 Western Midstream Operating LP, 4,650%, fällig 01.07.2026	162	0,19	270 United States Treasury Note/Bond, 0,625%, fällig 15.08.2030	256	0,29	
	370 McDonald's Corp, 3,700%, fällig 30.01.2026	0,47	130 Western Midstream Operating LP, 6,500%, fällig 01.02.2050	153	0,18	400 United States Treasury Note/Bond, 0,875%, fällig 15.11.2030	387	0,44	
	30 MDC Holdings Inc, 2,500%, fällig 15.01.2031	0,03	400 Williams Cos Inc/The, 4,300%, fällig 04.03.2024	432	0,49	200 United States Treasury Note/Bond, 1,625%, fällig 15.05.2031	206	0,24	
	150 MDC Holdings Inc, 6,000%, fällig 15.01.2043	0,22	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 69.521 USD)		75,166	86,16	60 United States Treasury Note/Bond, 1,875%, fällig 15.02.2041	60	0,07
	500 Microsoft Corp, 2,921%, fällig 17.03.2052	0,62	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 9,24 % (28. Februar 2021: 7,75 %)				80 United States Treasury Note/Bond, 2,250%, fällig 15.05.2041	86	0,10
	170 MPLX LP, 4,500%, fällig 15.04.2038	0,22	Deutschland – 2,32 % (28. Februar 2021: 1,24 %)				420 United States Treasury Note/Bond, 2,000%, fällig 15.02.2050	427	0,49
	250 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000%, fällig 15.10.2027	0,30	EUR	240 Bundesobligation, Series 179X 0,000%, fällig 05.04.2024	289	0,33	790 United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 15.05.2050	670	0,77
GBP	530 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692%, fällig 05.06.2028	0,90	EUR	770 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, fällig 15.02.2030	949	1,09	335 United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 15.08.2050	293	0,33
	112 MUFG Americas Holdings Corp, 3,000%, fällig 10.02.2025	0,14	EUR	230 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, fällig 15.02.2031	283	0,32			
EUR	290 Netflix Inc, 3,625%, fällig 15.06.2030	0,47	EUR	90 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 2007X 4,250%, fällig 04.07.2039	192	0,22			
	180 Northrop Grumman Corp, 3,250%, fällig 15.01.2028	0,23							
	270 Northwest Pipeline LLC, 4,000%, fällig 01.04.2027	0,35							

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)					
260 United States Treasury Note/ Bond , 1,625%, fällig 15.11.2050	242	0,28	Devisenterminkontrakte – 0,14 % (28. Februar 2021: 0,13 %) Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
360 United States Treasury Note/ Bond , 1,875%, fällig 15.02.2051	355	0,41	120	0,14	
	3.650	4,18	Termingeschäfte – 0,05 % (28. Februar 2021: 0,16 %) Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
			42	0,05	
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
			86.259	98,88	
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 8.096 USD)					
	8.061	9,24	Credit Default Swaps – (0,96 %) (28. Februar 2021: (0,77 %)) Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
Schuldverschreibungen – 0,33 % (28. Februar 2021: 0,09 %)					
176 ICON Luxembourg S.a.r.l., 3,000%, fällig 01.07.2028 *	176	0,20	(836)	(0,96)	
44 Indigo Merger Sub, Inc., 3,000%, fällig 01.07.2028 *	44	0,05	Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten – (0,29 %) (28. Februar 2021: (0,23 %)) Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
70 Murphy USA Inc., 0,000%, fällig 21.01.2028 *	70	0,08	(251)	(0,29)	
			Termingeschäfte – (0,12 %) (28. Februar 2021: (0,18 %)) Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
			(100)	(0,12)	
Summe Schuldverschreibungen (Kosten 289 USD)					
	290	0,33	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,55 % (28. Februar 2021: 1,14 %)					
2.226 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	2.226	2,55	(1.187)	(1,37)	
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Kosten 2.226 USD)					
	2.226	2,55	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 80.461 USD)					
	86.097	98,69	85.072	97,51	
			Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
			2.172	2,49	
			Gesamtnettvermögen		
			\$87.244	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 2.819.000 USD und machten 3,24 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

ABKÜRZUNGEN:

Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

EUR – Euro

GBP – Britisches Pfund Sterling

MXN – Mexikanischer Peso

RUB – Russischer Rubel

	% von Gesamt Vermögen
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,96
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	0,32
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,48
Finanzderivate	0,18
Sonstige Vermögenswerte	4,06
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000%	Kauf	20.06.2026	4.200	\$ (107)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 5,000%	Kauf	20.06.2026	3.530	(509)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000%	Kauf	20.06.2026	6.970	(220)
Nicht realisierter Wertzuwachs von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): - USD)					\$ -
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (636) USD)					(836)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (636) USD)					\$ (836)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
10.09.2021	Morgan Stanley	Kauf	BRL 1.600	Verkauf 7
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR 4.858	Verkauf 22
18.11.2021	BNP Paribas	Kauf	USD 1.324	Verkauf (10)
18.11.2021	Citi	Kauf	USD 10.170	Verkauf (80)
18.11.2021	Citi	Kauf	USD 1.727	Verkauf 8
18.11.2021	Citi	Kauf	EUR 500	Verkauf 3
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD 10.139	Verkauf (59)
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD 2.697	Verkauf 20
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD 8.484	Verkauf (52)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD 6.082	Verkauf 46
18.11.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD 1.908	Verkauf (15)
18.11.2021	Royal Bank of Canada	Kauf	USD 204	Verkauf (1)
18.11.2021	UBS	Kauf	USD 4.894	Verkauf (34)
18.11.2021	UBS	Kauf	USD 1.653	Verkauf 13
18.11.2021	UBS	Kauf	EUR 85	Verkauf 1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 110 USD)				\$ 120
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (193) USD)				(251)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (83) USD)				\$ (131)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(12)	\$ (1.912)	\$ (2)
Euro-Bund Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(12)	(2.445)	9
Euro-Bund September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(17)	(3.522)	(82)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(251)	5
Long Gilt Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(20)	(3.526)	22
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(5)	(667)	1
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	34	4.206	5
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(2)	(326)	(1)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	22	4.340	(15)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 128 USD)				\$ 42
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (147) USD)				(100)
Nettowertminderung von Termingeschäftskontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (19) USD)				\$ (58)

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Kollektive Kapitalanlagen – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,62 %)			Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen. GBP – Britisches Pfund Sterling USD – US-Dollar
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			USD 5 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing) 5 0,01			
GBP 190 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 2,550%, fällig 05.12.2023	227	0,46	Summe kollektiver Kapitalanlagen (Kosten 5 EUR) 5 0,01			ABKÜRZUNGEN: Analyse des Gesamtvermögens Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 92,11 Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden 1,54 Organismen für gemeinsame Anlagen 0,01 Finanzderivate 0,31 Sonstige Vermögenswerte 6,03 Gesamtvermögen 100,00
520 Netflix Inc, 3,625%, fällig 15.06.2030	625	1,26	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 44.847 EUR) 46.393 93,75			
250 OI European Group BV, 2,875%, fällig 15.02.2025	254	0,51	Devisenterminkontrakte – 0,31 % (28. Februar 2021: 0,01 %)			
300 Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 3,000%, fällig 15.06.2029	294	0,59	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 154 0,31			
150 TI Automotive Finance Plc, 3,750%, fällig 15.04.2029	154	0,31	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 46.547 94,06			
	5.287	10,68	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: (0,20 %))			
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 43.969 EUR)	45.512	91,97	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (1) –			
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,23 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten (1) –			
Großbritannien – 0,23 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 46.546 94,06			
GBP 100 United Kingdom Gilt, 0,625%, fällig 31.07.2035	112	0,23	Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen 2.942 5,94			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 110 EUR)	112	0,23	Gesamtnettvermögen €49.488 100,00			
Schuldverschreibungen – 1,54 % (28. Februar 2021: 1,97 %)			- –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 %.			
270 Froneri Lux FinCo SARL, 2,375%, fällig 30.01.2027 *	265	0,54	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.			
200 Hestia Holding, 4,000%, fällig 01.06.2027 *	201	0,40				
300 Ineos 226 Ltd, 2,750%, fällig 21.01.2026 *	298	0,60				
Summe Schuldverschreibungen (Kosten 763 EUR)	764	1,54				

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 6	Sell	EUR 7	€	–
18.11.2021	BNP Paribas	Kauf	EUR 2.651	Verkauf	GBP 2.247		38
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	EUR 408	Verkauf	GBP 346		6
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	EUR 150	Verkauf	USD 176		1
18.11.2021	Royal Bank of Canada	Kauf	EUR 924	Verkauf	GBP 784		13
18.11.2021	Societe Generale	Kauf	EUR 146	Verkauf	GBP 124		2
18.11.2021	UBS	Kauf	USD 200	Verkauf	EUR 171		(1)
18.11.2021	UBS	Kauf	EUR 6.318	Verkauf	GBP 5.352		94
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 4 EUR)						€	154
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (109) EUR)							(1)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (105) EUR)						€	153

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 2,55 % (28. Februar 2021: 0,99 %)			48 Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500%, fällig 01.12.2047	52	–	China – 0,42 % (28. Februar 2021: 0,41 %)		
16.250 Apidos CLOXXXVI, Series 2021 36A, Class D, 144 A 0,000%, fällig 20.07.2034 *	16.256	0,27	196 Flagstar Mortgage Trust 2018-2X Series 2018 2X Class A4X 144 A 3,500%, fällig 25.04.2048 *	197	–	8.430 Prosus NV, 144 A 3,061%, fällig 13.07.2031	8.255	0,14
15.430 Bain Capital Credit CLO 2021-4 Ltd, Series 2021 4A, Class D, 144 A 0,000%, fällig 20.10.2034 *	15.438	0,26	194 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA5X Series 2020 DNA5X Class M1X 144 A 1,350%, fällig 25.10.2050 *	194	–	18.720 Prosus NV, 144 A 3,832%, fällig 08.02.2051	16.985	0,28
7.369 Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016- 1X Series 2016 1A, Class AA, 144 A 2,487%, fällig 16.12.2041	7.426	0,12	9.850 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3X Series 2021 DNA3X Class M2X 144 A 2,150%, fällig 25.10.2033 *	10.064	0,17	Kolumbien – 0,36 % (28. Februar 2021: 0,33 %)		
8.270 Canyon Capital CLO2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Class DR, 144 A 3,112%, fällig 15.07.2030 *	8.274	0,14	2.119 MortgageIT Trust 2005-3X Series 2005 3X Class A1X 0,684%, fällig 25.08.2035 *	2.106	0,04	9.010 Ecopetrol SA, 5,375%, fällig 26.06.2026	9.949	0,17
4.407 CSMC2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1X Class A1X 144 A 2,750%, fällig 25.07.2057 *	4.563	0,08	4.645 New Residential Mortgage Loan Trust 2017-4X Series 2017 4A, Class A1X 144 A 4,000%, fällig 25.05.2057 *	4.974	0,08	10.720 Ecopetrol SA, 5,875%, fällig 28.05.2045	11.509	0,19
14.410 CSMC2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1X Class A2X 144 A 3,003%, fällig 25.07.2057 *	15.483	0,26	996 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Series 2021 NQ2R, Class A3X 144 A 1,353%, fällig 25.09.2058 *	999	0,02	Dänemark – 0,49 % (28. Februar 2021: 0,46 %)		
4.811 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006- I, Series 2006 I, Class 2A, 0,236%, fällig 15.01.2037 *	4.598	0,08	Summe hypothekarisch gesicherte Wertpapiere (Kosten 84.606 USD)			89.610	1,49	
8.000 Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Series 2018 4X Class A, 4,060%, fällig 15.11.2030	9.216	0,15	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 45,05 % (28. Februar 2021: 43,42 %)			Australien – 0,11 % (28. Februar 2021: 0,10 %)		
7.790 ICG US CLO2014-1 Ltd, Series 2014 1A, Class CR2X 144 A 0,000%, fällig 20.10.2034 *	7.751	0,13	210 Glencore Funding LLC, 144 A 4,125%, fällig 12.03.2024	226	0,01	Belgien – 0,73 % (28. Februar 2021: 0,62 %)		
2.485 Loanpal Solar Loan Ltd, Series 2020 3GS, Class B, 144 A 3,450%, fällig 20.12.2047	2.614	0,04	5.640 Glencore Funding LLC, 144 A 3,875%, fällig 27.10.2027	6.233	0,10	Brasilien – 1,02 % (28. Februar 2021: 0,94 %)		
4.407 Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS, Series 2018 2GS, Class A, 144 A 4,200%, fällig 22.02.2044	4.819	0,08	4.690 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350%, fällig 01.06.2040			5.633	0,10	
4.407 Nassau LLC, Series 2021 IA, Class D, 144 A 3,892%, fällig 26.08.2034 *∞	8.025	0,13	17.840 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550%, fällig 23.01.2049	24.847	0,41	Deutschland – 0,10 % (28. Februar 2021: 0,09 %)		
19.586 Sonic Capital LLC, Series 2020 1A, Class A2I, 144 A 3,845%, fällig 20.01.2050	20.984	0,35	7.800 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500%, fällig 01.06.2050	9.714	0,16	Indien – 0,43 % (28. Februar 2021: 0,39 %)		
4.496 Store Master Funding I-VII XIV XIX XX, Series 2021 1A, Class A3X 144 A 2,860%, fällig 20.06.2051	4.606	0,08	2.570 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,800%, fällig 23.01.2059	3.815	0,06	Indonesien – 0,13 % (28. Februar 2021: 0,13 %)		
7.200 VentureXXVI CLO Ltd, Series 2017 26A, Class D, 144 A 4,384%, fällig 20.01.2029 *	7.190	0,12	44.009			44.009	0,73	
10.000 Vibrant Clo VII Ltd, Series 2017 7A, Class C, 144 A 3,734%, fällig 15.09.2030 *	9.873	0,16	Brasilien – 1,02 % (28. Februar 2021: 0,94 %)			Indonesien – 0,13 % (28. Februar 2021: 0,13 %)		
6.100 Vibrant CLO XI Ltd, Series 2019 11A, Class C, 144 A 3,984%, fällig 20.07.2032 *	6.092	0,10	9.700 Petrobras Global Finance BV, 7,375%, fällig 17.01.2027	11.892	0,20	Indonesien – 0,13 % (28. Februar 2021: 0,13 %)		
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Kosten 148.546 USD)			27.820 Petrobras Global Finance BV, 5,999%, fällig 27.01.2028			31.985	0,53	
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere – 1,49 % (28. Februar 2021: 1,37 %)			13.890 Petrobras Global Finance BV, 6,850%, fällig 05.06.2115			15.418	0,26	
18.790 BBCCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Class D, 144 A 4,715%, fällig 10.08.2033 *	19.387	0,32	1.820 Suzano Austria GmbH, 3,750%, fällig 15.01.2031	1.913	0,03	Israel – 2,02 % (28. Februar 2021: 1,50 %)		
7.000 CSAIL 2016-C7 Commercial Mortgage Trust, Series 2016 C7X Class D, 144 A 4,534%, fällig 15.11.2049 *	5.417	0,09	61.208			61.208	1,02	
4.505 CSMC Series 2015-12R, Series 2015 12R, Class 2A1X 144 A 0,592%, fällig 30.11.2037 *	4.506	0,08	Kanada – 0,15 % (28. Februar 2021: 0,17 %)			Indonesien – 0,13 % (28. Februar 2021: 0,13 %)		
40.828 CSMC Trust 2018-11X Series 2018 11X Class B2X 144 A 3,617%, fällig 25.02.2048 *	41.714	0,69	1.450 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144 A 3,875%, fällig 15.01.2028	1.470	0,02	Indonesien – 0,13 % (28. Februar 2021: 0,13 %)		
			1.440 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.02.2029	1.435	0,02	Indonesien – 0,13 % (28. Februar 2021: 0,13 %)		
			510 MEG Energy Corp, 144 A 5,875%, fällig 01.02.2029	526	0,01	Indonesien – 0,13 % (28. Februar 2021: 0,13 %)		
			5.220 Yamana Gold Inc, 4,625%, fällig 15.12.2027	5.851	0,10	Indonesien – 0,13 % (28. Februar 2021: 0,13 %)		
			9.282			9.282	0,15	

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Spanien – 0,39 % (28. Februar 2021: 0,69 %)			1.880 Altria Group Inc, 2,450%, fällig 04.02.2032		
Israel – (Fortsetzung)			EUR 19.800 Banco Santander SA, 6,250%, Perpetual *			1.839 0,03		
67.261 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100%, fällig 01.10.2046	58.637	0,97	23.415 0,39			3.000 Altria Group Inc, 5,950%, fällig 14.02.2049		
	121.262	2,02	Supranational – 0,21 % (28. Februar 2021: 0,19 %)			3.265 Altria Group Inc, 6,200%, fällig 14.02.2059		
Italien – 0,47 % (28. Februar 2021: 0,98 %)			IDR 175.900.000 International Bank for Reconstruction & Development, 8,400%, fällig 12.10.2021			2.540 Amazon.com Inc, 4,950%, fällig 05.12.2044		
8.930 Enel Finance International NV, 144 A 6,000%, fällig 07.10.2039	12.610	0,21	12.405 0,21			40.420 Amazon.com Inc, 4,050%, fällig 22.08.2047		
2.675 Intesa Sanpaolo SpA, 144 A 5,017%, fällig 26.06.2024	2.905	0,05	Schweden – 0,24 % (28. Februar 2021: 0,22 %)			45.097 Amazon.com Inc, 4,250%, fällig 22.08.2057		
1.690 Intesa Sanpaolo SpA, 144 A 5,710%, fällig 15.01.2026	1.902	0,03	13.600 Svenska Handelsbanken AB, 4,750%, Perpetual *			58.898 0,98		
2.210 Telecom Italia SpA/ Milano, 144 A 5,303%, fällig 30.05.2024	2.402	0,04	14.620 0,24			77.830 Amazon.com Inc, 2,700%, fällig 03.06.2060		
8.490 UniCredit SpA, 144 A 6,572%, fällig 14.01.2022	8.671	0,14	Schweiz – 1,58 % (28. Februar 2021: 1,38 %)			4.990 American International Group Inc, 3,400%, fällig 30.06.2030		
	28.490	0,47	2.970 Credit Suisse Group AG, 144 A 4,194%, fällig 01.04.2031 *			61 Apache Corp, 4,875%, fällig 15.11.2027		
Japan – 0,37 % (28. Februar 2021: 0,33 %)			3.510 Credit Suisse Group AG, 3,091%, fällig 14.05.2032 *			61 Apache Corp, 4,375%, fällig 15.10.2028		
8.580 Nissan Motor Co Ltd, 144 A 4,345%, fällig 17.09.2027	9.553	0,16	2.520 Credit Suisse Group AG, 4,875%, fällig 15.05.2045			560 Apache Corp, 6,000%, fällig 15.01.2037		
11.190 Nissan Motor Co Ltd, 144 A 4,810%, fällig 17.09.2030/12.687	0,21		8.680 Credit Suisse Group AG, 144 A 7,500%, Perpetual *			28.226 Apache Corp, 5,100%, fällig 01.09.2040		
	22.240	0,37	23.330 Credit Suisse Group AG, 144 A 5,250%, Perpetual *			4.550 Apache Corp, 5,250%, fällig 01.02.2042		
Luxemburg – 0,04 % (28. Februar 2021: 0,17 %)			200 Credit Suisse Group AG, 144 A 6,375%, Perpetual *			6.480 Apache Corp, 4,750%, fällig 15.04.2043		
1.550 ArcelorMittal SA, 7,000%, fällig 15.10.2039	2.230	0,04	770 Credit Suisse Group AG, 144 A 7,250%, Perpetual *			7.120 Apache Corp, 4,250%, fällig 15.01.2044		
Macau – 0,21 % (28. Februar 2021: 0,19 %)			EUR 9.400 UBS Group AG, 5,750%, Perpetual *			740 Apache Corp, 7,375%, fällig 15.08.2047		
2.980 Sands China Ltd, 4,600%, fällig 08.08.2023	3.150	0,05	7.050 UBS Group AG, 7,000%, Perpetual *			1.970 Apache Corp, 5,350%, fällig 01.07.2049		
4.380 Sands China Ltd, 5,125%, fällig 08.08.2025	4.876	0,08	15.800 UBS Group AG, 144 A 7,000%, Perpetual *			3.250 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144 A 5,250%, fällig 15.08.2027		
3.920 Wynn Macau Ltd, 144 A 5,625%, fällig 26.08.2028	3.976	0,07	11.160 UBS Group AG, 6,875%, Perpetual *			21.670 BAC Capital Trust XIV, Series G, 4,000%, Perpetual *		
400 Wynn Macau Ltd, 144 A 5,125%, fällig 15.12.2029	398	0,01	27.500 MDGH - GMTN BV, 3,950%, fällig 21.05.2050			3.387 0,06		
	12.400	0,21	27.260 0,45			3.270 Bank of America Corp, 2,592%, fällig 29.04.2031 *		
Malaysia – 0,31 % (28. Februar 2021: 0,26 %)			Großbritannien – 1,48 % (28. Februar 2021: 2,57 %)			550 Bank of America Corp, 4,083%, fällig 20.03.2051 *		
18.750 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064%, fällig 19.08.2050	18.507	0,31	588 Barclays Bank Plc, 7,625%, fällig 21.11.2022			29.340 Bank of America Corp, Series FF, 5,875%, Perpetual *		
Mexiko – 0,44 % (28. Februar 2021: 0,41 %)			9.340 Barclays Plc, 4,972%, fällig 16.05.2029 *			15.985 Bank of America Corp, Series AA, 6,100%, Perpetual *		
3.400 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144 A 6,875%, Perpetual *	3.510	0,06	340 Barclays Plc, 5,088%, fällig 20.06.2030 *			20.180 Bank of America Corp, Series X, 6,250%, Perpetual *		
8.900 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144 A 7,625%, Perpetual *	10.117	0,17	11.720 Barclays Plc, 8,000%, Perpetual *			1.504 Bausch Health Americas Inc, 144 A 8,500%, fällig 31.01.2027		
15.280 Petroleos Mexicanos, 6,375%, fällig 23.01.2045	13.109	0,21	9.260 Barclays Plc, 7,750%, Perpetual *			2.600 Bausch Health Cos Inc, 144 A 5,500%, fällig 01.11.2025		
	26.736	0,44	13.360 BAT Capital Corp, 3,557%, fällig 15.08.2027			5.210 Bausch Health Cos Inc, 144 A 4,875%, fällig 01.06.2028		
Niederlande – 0,74 % (28. Februar 2021: 1,02 %)			10.340 BAT Capital Corp, 4,540%, fällig 15.08.2047			1.416 Bausch Health Cos Inc, 144 A 5,250%, fällig 30.01.2030		
EUR 27.600 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625%, Perpetual *	36.250	0,60	10.750 HSBC Holdings Plc, 4,583%, fällig 19.06.2029 *			2.978 Berry Petroleum Co LLC, 144 A 7,000%, fällig 15.02.2026		
1.300 Shell International Finance BV, 2,750%, fällig 06.04.2030	1.391	0,02	8.028 HSBC Holdings Plc, 6,500%, Perpetual *			2.510 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144 A 7,625%, fällig 15.12.2025		
6.580 Shell International Finance BV, 3,250%, fällig 06.04.2050	7.127	0,12	3.280 Lloyds Banking Group Plc, 7,500%, Perpetual *			4.210 Boeing Co/The, 5,150%, fällig 01.05.2030		
	44.768	0,74	900 Reynolds American Inc, 6,150%, fällig 15.09.2043			9.590 Boeing Co/The, 3,250%, fällig 01.02.2035		
Südafrika – 0,10 % (28. Februar 2021: 0,09 %)			1.530 Virgin Media Secured Finance Plc, 144 A 5,500%, fällig 15.05.2029			780 Boeing Co/The, 3,550%, fällig 01.03.2038		
1.400 AngloAmericanCapital Plc, 144 A 4,000%, fällig 11.09.2027	1.565	0,03	89.092 1,48			600 Boeing Co/The, 3,750%, fällig 01.02.2050		
3.950 AngloAmericanCapital Plc, 144 A 4,500%, fällig 15.03.2028	4.515	0,07	Vereinigte Staaten – 31,00 % (28. Februar 2021: 28,03 %)			10.000 Boeing Co/The, 5,805%, fällig 01.05.2050		
	6.080	0,10	2.150 3M Co, 3,700%, fällig 15.04.2050			3.000 Boeing Co/The, 3,950%, fällig 01.08.2059		
			6.550 AbbVie Inc, 2,950%, fällig 21.11.2026			8.862 Boeing Co/The, 5,930%, fällig 01.05.2060		
			14.790 AbbVie Inc, 4,050%, fällig 21.11.2039					
			1.204 Altria Group Inc, 4,400%, fällig 14.02.2026					
			1.045 Altria Group Inc, 4,800%, fällig 14.02.2029					

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			5.060 Continental Resources Inc/OK, 144 A 5,750%, fällig 15.01.2031	6.173	0,10	1.530 Energy Transfer LP, 6,850%, fällig 15.02.2040	1.979	0,03
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			8.260 Continental Resources Inc/OK, 144 A 5,750%, fällig 01.06.2044	9.316	0,15	2.520 Energy Transfer LP, 6,500%, fällig 01.02.2042	3.302	0,06
2.500 Broadcom Inc, 4,150%, fällig 15.11.2030	2.815	0,05	5.110 CSC Holdings LLC, 144 A 6,500%, fällig 01.02.2029	5.647	0,09	2.135 Energy Transfer LP, 6,100%, fällig 15.02.2042	2.687	0,04
4.540 California Institute of Technology, 3,650%, fällig 01.09.2119	5.370	0,09	3.070 CSC Holdings LLC, 144 A 4,500%, fällig 15.11.2031	3.094	0,05	4.065 Energy Transfer LP, 5,950%, fällig 01.10.2043	5.072	0,08
8.870 Cameron LNG LLC, 144 A 3,302%, fällig 15.01.2035	9.636	0,16	1.400 CVS Health Corp, 4,780%, fällig 25.03.2038	1.744	0,03	16.485 Energy Transfer LP, 5,300%, fällig 15.04.2047	19.535	0,32
5.230 Cameron LNG LLC, 144 A 3,701%, fällig 15.01.2039	5.903	0,10	3.870 CVS Health Corp, 4,125%, fällig 01.04.2040	4.508	0,08	8.342 Energy Transfer LP, 5,400%, fällig 01.10.2047	10.144	0,17
1.670 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 5,000%, fällig 01.02.2028	1.752	0,03	33.380 CVS Health Corp, 5,050%, fällig 25.03.2048	44.256	0,74	4.980 Energy Transfer LP, 6,000%, fällig 15.06.2048	6.374	0,11
600 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 4,500%, fällig 15.08.2030	628	0,01	160 CVS Health Corp, 4,250%, fällig 01.04.2050	195	–	4.610 Energy Transfer LP, 6,250%, fällig 15.04.2049	6.114	0,10
2.910 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500%, fällig 01.05.2032	3.045	0,05	4.342 DCP Midstream LP, Series A, 7,375%, Perpetual *	4.201	0,07	4.240 Energy Transfer LP, 5,000%, fällig 15.05.2050	4.977	0,08
13.380 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200%, fällig 15.03.2028	15.158	0,25	2.405 DCP Midstream Operating LP, 144 A 6,450%, fällig 03.11.2036	2.919	0,05	12.320 Energy Transfer LP, Series H, 6,500%, Perpetual *	12.662	0,21
5.740 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, fällig 01.04.2038	7.106	0,12	5.990 DCP Midstream Operating LP, 144 A 6,750%, fällig 15.09.2037	7.467	0,12	12.990 Energy Transfer LP, Series B, 6,625%, Perpetual *	12.552	0,21
1.540 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800%, fällig 01.03.2050	1.803	0,03	6.530 Delta Air Lines Inc, 3,625%, fällig 15.03.2022	6.599	0,11	11.830 Energy Transfer LP, Series F, 6,750%, Perpetual *	11.978	0,20
10.730 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,834%, fällig 23.10.2055	16.059	0,27	2.940 Delta Air Lines Inc, 3,800%, fällig 19.04.2023	3.048	0,05	15.060 Energy Transfer LP, Series G, 7,125%, Perpetual *	15.527	0,26
1.780 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 5,125%, fällig 30.06.2027	2.072	0,03	3.916 Delta Air Lines Inc, 2,900%, fällig 28.10.2024	3.992	0,07	2.568 Enterprise Products Operating LLC, 6,125%, fällig 15.10.2039	3.599	0,06
1.620 Cheniere Energy Inc, 4,625%, fällig 15.10.2028	1.711	0,03	7.440 Delta Air Lines Inc, 144 A 7,000%, fällig 01.05.2025	8.708	0,14	4.131 Enterprise Products Operating LLC, 6,450%, fällig 01.09.2040	5.993	0,10
1.000 Chevron Corp, 3,078%, fällig 11.05.2050	1.057	0,02	4.020 Delta Air Lines Inc, 7,375%, fällig 15.01.2026	4.735	0,08	1.566 Enterprise Products Operating LLC, 5,950%, fällig 01.02.2041	2.184	0,04
2.000 Chevron USA Inc, 3,850%, fällig 15.01.2028	2.273	0,04	354 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,500%, fällig 20.10.2025	380	0,01	2.330 Enterprise Products Operating LLC, 5,100%, fällig 15.02.2045	2.959	0,05
2.650 Cimarex Energy Co, 3,900%, fällig 15.05.2027	2.928	0,05	11.030 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,500%, fällig 20.10.2025	11.835	0,20	2.995 Enterprise Products Operating LLC, 4,250%, fällig 15.02.2048	3.484	0,06
5.690 Cimarex Energy Co, 4,375%, fällig 15.03.2029	6.474	0,11	354 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,750%, fällig 20.10.2028	395	0,01	4.680 Enterprise Products Operating LLC, 5,375%, fällig 15.02.2078 *	4.835	0,08
6.095 Citigroup Inc, 8,125%, fällig 15.07.2039	10.525	0,18	4.920 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,750%, fällig 20.10.2028	5.489	0,09	420 EOG Resources Inc, 4,375%, fällig 15.04.2030	497	0,01
4.834 Citigroup Inc, 5,300%, fällig 06.05.2044	6.579	0,11	6.980 Devon Energy Corp, 144 A 8,250%, fällig 01.08.2023	7.876	0,13	1.320 EOG Resources Inc, 4,950%, fällig 15.04.2050	1.780	0,03
990 Citigroup Inc, 4,750%, fällig 18.05.2046	1.278	0,02	8.660 Devon Energy Corp, 5,850%, fällig 15.12.2025	10.085	0,17	380 EQT Corp, 3,000%, fällig 01.10.2022	388	0,01
2.600 Citigroup Inc, 4,650%, fällig 23.07.2048	3.458	0,06	1.736 Devon Energy Corp, 144 A 5,250%, fällig 15.10.2027	1.847	0,03	200 EQT Corp, 6,625%, fällig 01.02.2025	229	–
45.695 Citigroup Inc, Series P, 5,950%, Perpetual *	50.264	0,84	1.670 Devon Energy Corp, 144 A 5,875%, fällig 15.06.2028	1.839	0,03	2.610 EQT Corp, 144 A 3,125%, fällig 15.05.2026	2.685	0,04
1.660 Comcast Corp, 3,400%, fällig 01.04.2030	1.847	0,03	1.436 Devon Energy Corp, 144 A 4,500%, fällig 15.01.2030	1.569	0,03	2.870 EQT Corp, 3,900%, fällig 01.10.2027	3.103	0,05
320 Comcast Corp, 3,750%, fällig 01.04.2040	368	0,01	1.690 Devon Energy Corp, 7,875%, fällig 30.09.2031	2.401	0,04	700 EQT Corp, 5,000%, fällig 15.01.2029	797	0,01
370 Comcast Corp, 3,400%, fällig 15.07.2046	404	0,01	1.440 Devon Energy Corp, 7,950%, fällig 15.04.2032	2.077	0,03	730 EQT Corp, 7,500%, fällig 01.02.2030	949	0,02
940 Comcast Corp, 3,450%, fällig 01.02.2050	1.035	0,02	3.942 Devon Energy Corp, 5,600%, fällig 15.07.2041	4.936	0,08	2.120 EQT Corp, 144 A 3,625%, fällig 15.05.2031	2.244	0,04
810 Comcast Corp, 2,800%, fällig 15.01.2051	788	0,01	5.512 Devon Energy Corp, 4,750%, fällig 15.05.2042	6.340	0,11	5.690 Exxon Mobil Corp, 4,327%, fällig 19.03.2050	7.137	0,12
760 Comcast Corp, 144 A 2,937%, fällig 01.11.2056	754	0,01	5.305 Devon Energy Corp, 5,000%, fällig 15.06.2045	6.288	0,10	2.920 Exxon Mobil Corp, 3,452%, fällig 15.04.2051	3.237	0,05
8.789 CommonSpirit Health, 4,350%, fällig 01.11.2042	10.393	0,17	1.380 Diamondback Energy Inc, 2,875%, fällig 01.12.2024	1.451	0,02	28.515 FirstEnergy Corp, Series C, 7,375%, fällig 15.11.2031	39.896	0,66
2.890 CommonSpirit Health, 3,817%, fällig 01.10.2049	3.320	0,06	2.100 Diamondback Energy Inc, 3,250%, fällig 01.12.2026	2.251	0,04	90 FirstEnergy Corp, Series C, 5,350%, fällig 15.07.2047	113	–
6.107 ConocoPhillips, 144 A 4,850%, fällig 15.08.2048	8.093	0,13	400 Diamondback Energy Inc, 3,500%, fällig 01.12.2029	431	0,01	200 Ford Motor Credit Co LLC, 5,125%, fällig 16.06.2025	220	–
60 Continental Resources Inc/OK, 4,375%, fällig 15.01.2028	67	–	2.520 Diamondback Energy Inc, 4,400%, fällig 24.03.2051	2.895	0,05	3.310 Ford Motor Credit Co LLC, 3,375%, fällig 13.11.2025	3.430	0,06
			3.720 Dignity Health, 5,267%, fällig 01.11.2064	5.289	0,09	4.445 Ford Motor Credit Co LLC, 4,125%, fällig 17.08.2027	4.762	0,08
			4.760 DISH DBS Corp, 5,875%, fällig 15.11.2024	5.123	0,09	1.040 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900%, fällig 16.02.2028	1.038	0,02
			170 DISH DBS Corp, 7,750%, fällig 01.07.2026	195	–	3.770 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000%, fällig 13.11.2030	3.982	0,07
			1.220 DISH DBS Corp, 144 A 5,125%, fällig 01.06.2029	1.215	0,02	2.510 Ford Motor Credit Co LLC, 3,625%, fällig 17.06.2031	2.589	0,04
						5.200 Fox Corp, 5,476%, fällig 25.01.2039	6.757	0,11

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			6.450 Kinder Morgan Inc, 5,300%, fällig 01.12.2034	7.994	0,13	5.500 Occidental Petroleum Corp, 4,400%, fällig 15.04.2046	5.629	0,09
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			170 Kraft Heinz Foods Co, 6,750%, fällig 15.03.2032	230	–	2.360 Occidental Petroleum Corp, 4,100%, fällig 15.02.2047	2.311	0,04
70 Freeport-McMoRan Inc, 3,875%, fällig 15.03.2023	72	–	480 Kraft Heinz Foods Co, 6,875%, fällig 26.01.2039	718	0,01	14.270 Occidental Petroleum Corp, 4,200%, fällig 15.03.2048	13.995	0,23
250 Freeport-McMoRan Inc, 4,550%, fällig 14.11.2024	271	–	120 Kraft Heinz Foods Co, 144 A 7,125%, fällig 01.08.2039	182	–	2.860 Pacific Gas and Electric Co, 2,500%, fällig 01.02.2031	2.697	0,04
1.120 Freeport-McMoRan Inc, 4,625%, fällig 01.08.2030	1.236	0,02	120 Kraft Heinz Foods Co, 4,625%, fällig 01.10.2039	143	–	890 Pacific Gas and Electric Co, 3,300%, fällig 01.08.2040	823	0,01
4.450 Freeport-McMoRan Inc, 5,450%, fällig 15.03.2043	5.696	0,09	60 Kraft Heinz Foods Co, 5,000%, fällig 04.06.2042	76	–	3.190 Pacific Gas and Electric Co, 3,500%, fällig 01.08.2050	2.880	0,05
5.370 GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418%, fällig 15.11.2035	6.526	0,11	1.750 Kraft Heinz Foods Co, 4,375%, fällig 01.06.2046	2.033	0,03	2.180 Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700%, fällig 15.05.2036	2.734	0,05
180 General Dynamics Corp, 4,250%, fällig 01.04.2040	224	–	1.930 Kraft Heinz Foods Co, 4,875%, fällig 01.10.2049	2.404	0,04	1.980 Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144 A 5,750%, fällig 15.04.2026	2.145	0,04
840 General Dynamics Corp, 4,250%, fällig 01.04.2050	1.091	0,02	1.550 Lamb Weston Holdings Inc, 144 A 4,875%, fällig 01.11.2026	1.596	0,03	1.420 Procter & Gamble Co/The, 3,000%, fällig 25.03.2030	1.577	0,03
590 General Electric Co, 3,450%, fällig 01.05.2027	651	0,01	8.050 Las Vegas Sands Corp, 3,200%, fällig 08.08.2024	8.367	0,14	2.325 PulteGroup Inc, 6,375%, fällig 15.05.2033	3.119	0,05
1.220 General Electric Co, 3,625%, fällig 01.05.2030	1.373	0,02	610 Las Vegas Sands Corp, 2,900%, fällig 25.06.2025	630	0,01	835 Range Resources Corp, 5,875%, fällig 01.07.2022	854	0,01
1.440 General Electric Co, 6,875%, fällig 10.01.2039	2.182	0,04	348 Levi Strauss & Co, 5,000%, fällig 01.05.2025	357	0,01	1.809 Range Resources Corp, 5,000%, fällig 15.03.2023	1.859	0,03
675 Goldman Sachs Capital II, 4,000%, Perpetual *	676	0,01	1.190 Lowe's Cos Inc, 4,500%, fällig 15.04.2030	1.414	0,02	4.760 Range Resources Corp, 4,875%, fällig 15.05.2025	4.933	0,08
14.970 Goldman Sachs Group Inc/The, Series DMTN, 2,383%, fällig 21.07.2032 *	15.141	0,25	7.940 Mastercard Inc, 3,850%, fällig 26.03.2050	9.714	0,16	6.910 Rockies Express Pipeline LLC, 144 A 6,875%, fällig 15.04.2040	7.628	0,13
12.340 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750%, fällig 01.10.2037	18.003	0,30	4.050 McDonald's Corp, 4,450%, fällig 01.03.2047	5.063	0,08	2.262 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144 A 8,000%, fällig 20.09.2025	2.565	0,04
1.300 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,210%, fällig 22.04.2042 *	1.375	0,02	3.370 McDonald's Corp, 4,450%, fällig 01.09.2048	4.230	0,07	2.740 Sprint Capital Corp, 8,750%, fällig 15.03.2032	4.201	0,07
16.590 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150%, fällig 22.05.2045	22.299	0,37	340 McDonald's Corp, 3,625%, fällig 01.09.2049	383	0,01	2.220 Sprint Communications Inc, 11,500%, fällig 15.11.2021	2.268	0,04
14.880 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750%, fällig 20.10.2045	19.669	0,33	1.090 McDonald's Corp, 4,200%, fällig 01.04.2050	1.340	0,02	210 Sprint Corp, 7,875%, fällig 15.09.2023	238	–
2.490 H&E Equipment Services Inc, 144 A 3,875%, fällig 15.12.2028	2.504	0,04	270 MDC Holdings Inc, 6,000%, fällig 15.01.2043	348	0,01	310 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,375%, fällig 01.02.2027	322	0,01
5.990 Hackensack Meridian Health Inc, 4,211%, fällig 01.07.2048	7.495	0,12	3.140 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144 A 6,500%, fällig 20.06.2027	3.415	0,06	3.810 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500%, fällig 01.03.2030	4.205	0,07
610 HCA Inc, 5,375%, fällig 01.02.2025	688	0,01	910 Morgan Stanley, 5,597%, fällig 24.03.2051 *	1.373	0,02	1.970 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875%, fällig 01.02.2031	2.145	0,04
2.370 HCA Inc, 7,690%, fällig 15.06.2025	2.885	0,05	3.930 MPLX LP, 4,800%, fällig 15.02.2029	4.604	0,08	280 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144 A 4,000%, fällig 15.01.2032	294	–
380 HCA Inc, 5,625%, fällig 01.09.2028	454	0,01	7.720 MPLX LP, 5,200%, fällig 01.03.2047	9.516	0,16	1.730 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144 A 4,900%, fällig 15.09.2044	2.282	0,04
1.110 HCA Inc, 5,875%, fällig 01.02.2029	1.347	0,02	4.580 MPLX LP, 4,700%, fällig 15.04.2048	5.362	0,09	11.910 The Vanguard Group Inc, 3,050%, fällig 22.08.2050 t=	11.701	0,19
1.610 HCA Inc, 3,500%, fällig 01.09.2030	1.730	0,03	8.730 MPLX LP, 5,500%, fällig 15.02.2049	11.292	0,19	1.300 Time Warner Cable LLC, 7,300%, fällig 01.07.2038	1.896	0,03
5.130 Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875%, fällig 01.04.2027	5.329	0,09	2.490 Northern Oil and Gas Inc, 144 A 8,125%, fällig 01.03.2028	2.590	0,04	670 T-Mobile USA Inc, 2,250%, fällig 15.02.2026	685	0,01
550 Home Depot Inc/The, 3,350%, fällig 15.04.2050	613	0,01	10.130 Northrop Grumman Corp, 5,250%, fällig 01.05.2050	14.427	0,24	2.100 T-Mobile USA Inc, 2,625%, fällig 15.02.2029	2.129	0,04
6.290 ILFC E-Capital Trust I, 144 A 3,660%, fällig 21.12.2065 *	5.128	0,09	1.060 NVIDIA Corp, 3,500%, fällig 01.04.2040	1.208	0,02	2.940 T-Mobile USA Inc, 3,875%, fällig 15.04.2030	3.298	0,05
3.140 JPMorgan Chase & Co, 2,522%, fällig 22.04.2031 *	3.251	0,05	5.070 NVIDIA Corp, 3,500%, fällig 01.04.2050	5.832	0,10	1.550 T-Mobile USA Inc, 2,875%, fällig 15.02.2031	1.595	0,03
10.480 JPMorgan Chase & Co, 2,956%, fällig 13.05.2031 *	11.105	0,18	1.890 NVIDIA Corp, 3,700%, fällig 01.04.2060	2.261	0,04	2.340 T-Mobile USA Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.04.2031	2.494	0,04
4.320 JPMorgan Chase & Co, 3,109%, fällig 22.04.2051 *	4.527	0,08	6.040 Occidental Petroleum Corp, 6,950%, fällig 01.07.2024	6.811	0,11	3.630 T-Mobile USA Inc, 4,500%, fällig 15.04.2050	4.357	0,07
1.265 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,950%, fällig 15.01.2038	1.813	0,03	1.940 Occidental Petroleum Corp, 5,550%, fällig 15.03.2026	2.166	0,04	10.190 Toll Road Investors Partnership II LP, 144 A Zero coupon, fällig 15.02.2024	9.465	0,16
6.189 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,500%, fällig 01.09.2039	8.718	0,15	13.300 Occidental Petroleum Corp, 6,625%, fällig 01.09.2030	16.610	0,28	2.100 Toll Road Investors Partnership II LP, 144 A Zero coupon, fällig 15.02.2038	852	0,01
5.130 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,550%, fällig 15.09.2040	7.245	0,12	24.830 Occidental Petroleum Corp, 6,125%, fällig 01.01.2031	30.059	0,50			
5.250 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,375%, fällig 01.03.2041	7.322	0,12	120.933 Occidental Petroleum Corp, Zero coupon, fällig 10.10.2036	65.758	1,09			
			5.320 Occidental Petroleum Corp, 6,200%, fällig 15.03.2040	6.352	0,11			
			11.725 Occidental Petroleum Corp, 4,500%, fällig 15.07.2044	11.976	0,20			
			17.150 Occidental Petroleum Corp, 4,625%, fällig 15.06.2045	17.774	0,30			
			7.820 Occidental Petroleum Corp, 6,600%, fällig 15.03.2046	9.904	0,16			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 36,58 % (28. Februar 2021: 42,35 %)			Indien – 2,61 % (28. Februar 2021: 1,88 %)		
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			Australien – 1,63 % (28. Februar 2021: 1,56 %)			INR 300.000 Export-Import Bank of India, Series P-03X 9,300%, fällig 11.05.2022		
5.580 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850%, fällig 01.02.2026	7.025	0,12	AUD 77.080 Australia Government Bond, Series 150X 3,000%, fällig 21.03.2047	68.005	1,13	INR 1.580.000 India Government Bond, Series SPB, 8,130%, fällig 21.09.2022	4.260	0,07
1.640 United Airlines Inc, 144 A 4,375%, fällig 15.04.2026	1.705	0,03	AUD 43.330 Australia Government Bond, Series 162X 1,750%, fällig 21.06.2051	29.826	0,50	INR 500.000 India Government Bond, 7,160%, fällig 20.05.2023	7.187	0,12
10.630 United Airlines Inc, 144 A 4,625%, fällig 15.04.2029	11.042	0,18		97.831	1,63	INR 1.200.000 India Government Bond, 8,830%, fällig 25.11.2023	17.980	0,30
920 United Rentals North America Inc, 5,875%, fällig 15.09.2026	949	0,02	Brasilien – 0,81 % (28. Februar 2021: 2,06 %)			INR 900.000 India Government Bond, 6,180%, fällig 04.11.2024	12.827	0,21
1.750 United Rentals North America Inc, 3,875%, fällig 15.11.2027	1.841	0,03	6.730 Brazilian Government International Bond, 4,250%, fällig 07.01.2025	7.302	0,12	INR 1.000.000 India Government Bond, 5,630%, fällig 12.04.2026	13.713	0,23
3.340 United Rentals North America Inc, 5,250%, fällig 15.01.2030	3.666	0,06	41.800 Brazilian Government International Bond, 5,000%, fällig 27.01.2045	41.389	0,69	INR 1.480.000 India Government Bond, 8,150%, fällig 24.11.2026	22.311	0,37
320 United Rentals North America Inc, 3,875%, fällig 15.02.2031	332	0,01		48.691	0,81	INR 300.000 India Government Bond, 7,170%, fällig 08.01.2028	4.338	0,07
8.460 Verizon Communications Inc, 3,400%, fällig 22.03.2041	9.079	0,15	China – 2,35 % (28. Februar 2021: 3,58 %)			INR 1.300.000 India Government Bond, 7,590%, fällig 20.03.2029	19.203	0,32
530 Verizon Communications Inc, 4,000%, fällig 22.03.2050	616	0,01	CNY 54.500 China Government Bond, 3,380%, fällig 21.11.2024	8.712	0,14	INR 1.500.000 India Government Bond, 5,790%, fällig 11.05.2030	19.847	0,33
2.760 Verizon Communications Inc, 3,550%, fällig 22.03.2051	3.004	0,05	CNY 121.000 China Government Bond, 3,480%, fällig 29.06.2027	19.798	0,33	INR 1.000.000 India Government Bond, 6,190%, fällig 16.09.2034	13.015	0,22
8.500 Verizon Communications Inc, 3,700%, fällig 22.03.2061	9.367	0,16	CNY 11.000 China Government Bond, 3,600%, fällig 27.06.2028	1.819	0,03		157.275	2,61
1.890 Wells Fargo & Co, 4,478%, fällig 04.04.2031 *	2.241	0,04	CNY 490.000 China Government Bond, Series INBK, 3,390%, fällig 16.03.2050	74.518	1,24	Indonesien – 7,15 % (28. Februar 2021: 6,60 %)		
7.400 Wells Fargo & Co, 4,650%, fällig 04.11.2044	9.237	0,15	CNY 222.000 China Government Bond, Series INBK, 3,810%, fällig 14.09.2050	36.457	0,61	IDR 18.941.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR56X 8,375%, fällig 15.09.2026	1.517	0,03
5.420 Wells Fargo & Co, 4,400%, fällig 14.06.2046	6.626	0,11		141.304	2,35	IDR 676.862.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR59X 7,000%, fällig 15.05.2027	51.219	0,85
2.930 Wells Fargo & Co, 4,750%, fällig 07.12.2046	3.738	0,06	Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 0,49 % (28. Februar 2021: 0,38 %)			IDR 547.847.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR71X 9,000%, fällig 15.03.2029	45.383	0,76
36.230 Wells Fargo & Co, 5,013%, fällig 04.04.2051 *	50.553	0,84	EUR 4.010 Ivory Coast Government International Bond, 4,875%, fällig 30.01.2032	4.842	0,08	IDR 1.186.761.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR78X 8,250%, fällig 15.05.2029	94.879	1,58
3.926 Wells Fargo & Co, Series U, 5,875%, Perpetual *	4.431	0,07	EUR 4.020 Ivory Coast Government International Bond, 144 A 4,875%, fällig 30.01.2032	4.855	0,08	IDR 1.057.630.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR82X 7,000%, fällig 15.09.2030	78.604	1,31
3.490 Wesleyan University, 4,781%, fällig 01.07.2116	4.892	0,08	1.350 Ivory Coast Government International Bond, 5,750%, fällig 31.12.2032	1.376	0,02	IDR 500.248.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR87X 6,500%, fällig 15.02.2031	36.135	0,60
1.460 Western Midstream Operating LP, 4,350%, fällig 01.02.2025	1.536	0,03	4.164 Ivory Coast Government International Bond, 6,125%, fällig 15.06.2033	4.576	0,08	IDR 1.145.620.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR68X 8,375%, fällig 15.03.2034	92.091	1,53
4.630 Western Midstream Operating LP, 3,950%, fällig 01.06.2025	4.856	0,08	12.540 Ivory Coast Government International Bond, 144 A 6,125%, fällig 15.06.2033	13.780	0,23	IDR 276.928.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR72X 8,250%, fällig 15.05.2036	21.834	0,36
765 Western Midstream Operating LP, 4,650%, fällig 01.07.2026	826	0,01		29.429	0,49	IDR 39.561.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR79X 8,375%, fällig 15.04.2039	3.195	0,05
5.100 Western Midstream Operating LP, 4,500%, fällig 01.03.2028	5.502	0,09	Dominikanische Republik – 0,18 % (28. Februar 2021: 0,16 %)			IDR 69.231.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR76X 7,375%, fällig 15.05.2048	5.051	0,08
5.040 Western Midstream Operating LP, 4,750%, fällig 15.08.2028	5.552	0,09	10.420 Dominican Republic International Bond, 144 A 5,875%, fällig 30.01.2060	10.629	0,18		429.908	7,15
9.610 Western Midstream Operating LP, 5,300%, fällig 01.02.2030	10.785	0,18	Ägypten – 0,28 % (28. Februar 2021: 0,29 %)			Mexiko – 7,10 % (28. Februar 2021: 6,69 %)		
8.751 Western Midstream Operating LP, 5,450%, fällig 01.04.2044	9.963	0,17	EGP 22.000 Egypt Government Bond, Series 7 YR, 18,400%, fällig 30.05.2024	1.533	0,02	MXN 6.476.784 MexicanBonos, Series M, 7,750%, fällig 13.11.2042	329.032	5,47
3.370 Western Midstream Operating LP, 5,300%, fällig 01.03.2048	3.796	0,06	11.140 Egypt Government International Bond, 144 A 7,625%, fällig 29.05.2032	11.981	0,20	MXN 1.890.270 MexicanBonos, Series M, 8,000%, fällig 07.11.2047	98.172	1,63
7.650 Western Midstream Operating LP, 5,500%, fällig 15.08.2048	8.777	0,15	EGP 57.275 Egypt Treasury Bills, Zero coupon, fällig 12.04.2022	3.398	0,06		427.204	7,10
1.330 Western Midstream Operating LP, 6,500%, fällig 01.02.2050	1.570	0,03		16.912	0,28	Russland – 9,94 % (28. Februar 2021: 10,07 %)		
7.630 Williams Cos Inc/The, 3,750%, fällig 15.06.2027	8.483	0,14	Ghana – 0,17 % (28. Februar 2021: 0,17 %)			RUB 1.043.860 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6219X 7,750%, fällig 16.09.2026	14.912	0,25
7.350 Williams Cos Inc/The, Series A, 7,500%, fällig 15.01.2031	10.279	0,17	2.180 Ghana Government International Bond, 144 A 7,875%, fällig 26.03.2027	2.244	0,04	RUB 1.043.840 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6226X 7,950%, fällig 07.10.2026	15.002	0,25
9.840 Williams Cos Inc/The, 8,750%, fällig 15.03.2032	15.256	0,25	2.670 Ghana Government International Bond, 144 A 10,750%, fällig 14.10.2030	3.354	0,05	RUB 8.373.531 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6207X 8,150%, fällig 03.02.2027	121.609	2,02
3.600 Williams Cos Inc/The, 6,300%, fällig 15.04.2040	4.944	0,08	4.700 Ghana Government International Bond, 144 A 8,950%, fällig 26.03.2051	4.628	0,08	RUB 443.320 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6232X 6,000%, fällig 06.10.2027	5.833	0,10
8.940 Williams Cos Inc/The, 5,750%, fällig 24.06.2044	11.960	0,20		10.226	0,17	RUB 11.647.347 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6212X 7,050%, fällig 19.01.2028	161.636	2,69
665 Williams Cos Inc/The, 5,100%, fällig 15.09.2045	832	0,01	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen			RUB 6.896.700 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6224X 6,900%, fällig 23.05.2029	94.563	1,57
3.980 Willis-Knighton Medical Center, Series 2018X 4,813%, fällig 01.09.2048	5.258	0,09						
7.313 XPO CNW Inc, 6,700%, fällig 01.05.2034	8.825	0,15						
	1.864.312	31,00						
	2.709.470	45,05						
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 2.423.018 USD)								

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)						Gekaufte Optionen – 0,40 % (28. Februar 2021: 0,48 %)		
Russland – (Fortsetzung)			4.834			- Canadian Dollar Currency Future September 2021 Call 80,00X fällig 03.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch		
RUB 1.396.220			6.177	4.829	0,08			
	20.066	0,33				9		–
RUB 514.670			2.118	6.163	0,10	- Euro Currency Future September 2021 Call 1,17X fällig 03.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch		
	7.418	0,12	2.841	2.116	0,03	632		0,01
RUB 5.294.380			1.447	2.843	0,05	- Euro Currency Future September 2021 Call 1,18X fällig 03.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch		
	73.415	1,22	2.249	1.442	0,02	49		–
RUB 5.774.750			683	2.219	0,04	- Euro Currency Future September 2021 Call 1,19X fällig 03.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch		
	83.395	1,39	2.163	679	0,01	17		–
	597.849	9,94	1.637	2.142	0,04	1 Japanese Yen Currency Future September 2021 Call 91,00X fällig 03.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch		
Ukraine – 0,11 % (28. Februar 2021: 0,10 %)			4.206			116		–
			4.171	4.151	0,07	- Japanese Yen Currency Future September 2021 Call 92,00X fällig 03.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch		
6.370			4.171	4.164	0,07	1		–
	6.826	0,11	1.346	4.164	0,07	- U.S. 10 Year Oktober 2021 Call 133,00X fällig 24.09.2021 Bank of America Merrill Lynch		
Vereinigte Staaten – 3,76 % (28. Februar 2021: 5,64 %)			5.816			369		0,01
1.820			3.814	5.812	0,10	- U.S. 10 Year Oktober 2021 Call 133,50X fällig 24.09.2021 Bank of America Merrill Lynch		
	2.438	0,04	1.640	3.792	0,06	265		–
382			1.630	1.630	0,03	1 U.S. Bond Oktober 2021 Call 163,00X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch		
	383	0,01	1.051	1.047	0,02	1.890		0,03
42.970			6.733	6.684	0,11	1 U.S. Bond Oktober 2021 Call 163,50X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch		
	43.091	0,72	4.343	4.311	0,07	756		0,01
7.650			2.139	2.121	0,03	- U.S. Bond Oktober 2021 Put 164,00X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch		
	10.697	0,18	7.868	7.860	0,13	862		0,01
12.130			1.226	1.223	0,02	64.170 USD Call/ RUB Put 72,00X fällig 20.09.2021 – Goldman Sachs		
	12.983	0,22	420	418	0,01	1.516		0,02
29.440			1.550	1.537	0,03	63.650 USD Call/ RUB Put 73,20X fällig 16.09.2021 – Goldman Sachs		
	0,60		Summe Schuldverschreibungen (Kosten 89.476 USD)			562		0,01
44.370			4.240	4.109	0,07	62.340 USD Call/ RUB Put 74,30X fällig 20.10.2021 – Goldman Sachs		
	53.833	0,89	950	1.046	0,02	738		0,01
9.820			16.530	19.648	0,32	27.780 USD Put/AUD Call 0,7270X fällig 23.11.2021 – Goldman Sachs		
	11.862	0,20	Summe kommunale Anleihen (Kosten 20.675 USD)			570		0,01
15.770			9.927	144.145	2,40	57.300 USD Put/ BRL Call 5,25X fällig 24.11.2021 – BNP Paribas		
	16.889	0,28	122	15.336	0,25	62.340 USD Put/ BRL Call 5,25X fällig 10.10.2021 – Morgan Stanley		
10.710			Kollektive Kapitalanlagen – 2,65 % (28. Februar 2021: 2,38 %)			1.676		0,03
	11.781	0,20	9.927	159.481	2,65	54.700 USD Put/ CAD Call 1,2685X fällig 23.11.2021 – BNP Paribas		
11.990			Erfolgswirksame Gesamtinvestitionen und verpfändete Investitionen zum beizulegenden Zeitwert (Kosten 5.159.457 USD)			912		0,01
	12.187	0,20	5.457	5.425.288	90,20	127.400 USD Put/ EUR Call 1,1873X fällig 01.10.2021 – Morgan Stanley		
5.130						528		0,01
	4.489	0,07				121.989		0,01
3.310						63.700 USD Put/ JPY Call 110,00X fällig 01.10.2021 – Goldman Sachs		
	3.268	0,05				395		0,01
5.780						58.420 USD Put/ MXN Call 20,2415X fällig 19.11.2021 – Morgan Stanley		
	5.884	0,10				998		0,02
	225.870	3,76				56.020 USD Put/ MXN Call 20,42X fällig 24.11.2021 – Morgan Stanley		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 2.242.343 USD)						1.261		0,02
	2.199.954	36,58				27.780 USD Put/NZD Call 0,6955X fällig 23.11.2021 – Goldman Sachs		
Schuldverschreibungen – 1,47 % (28. Februar 2021: 1,47 %)						715		0,01
5.457						64.196 USD Put/ RUB Call 73,00X fällig 21.09.2021 Goldman Sachs		
	5.372	0,09				344		0,01
1.446						64.974 USD Put/ RUB Call 73,50X fällig 06.10.2021 Goldman Sachs		
	1.443	0,02				731		0,01
4								
	4	–						
234								
	230	–						
2.802								
	2.759	0,05						
1.169								
	1.174	0,02						
1.388								
	1.378	0,02						
6.313								
	6.269	0,10						

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Gekaufte Optionen – (Fortsetzung)								
31.890 USD Put/ RUB Call 73,50X fällig 12.10.2021 Morgan Stanley	374	0,01	(1) Euro \$2 Year Midcurve Dezember 2021 Call 98,75X fällig 10.12.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(1.040)	(0,02)	(1) U.S. 5 Year W1 September 2021 Call 123,50X fällig 03.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(319)	(0,01)
64.930 USD Put/ RUB Call 74,00X fällig 01.10.2021 Citi	959	0,02	(2) Euro \$2 Year Midcurve Dezember 2021 Call 99,1250X fällig 10.12.2021 Bank of America Merrill Lynch	(470)	(0,01)	(1) U.S. Bond November 2021 Call 164,00X fällig 22.10.2021 – Bank of America Merrill Lynch – U.S. Bond November 2021 Call 165,00X fällig 22.10.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(1.028)	(0,02)
63.780 USD Put/ RUB Call 74,70X fällig 14.01.2022 Goldman Sachs	1.638	0,03	(4) Euro \$2 Year Midcurve Dezember 2021 Call 99,25X fällig 10.12.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(529)	(0,01)	(1) U.S. Bond November 2021 Put 160,00X fällig 22.10.2021 Bank of America Merrill Lynch	(605)	(0,01)
60.520 USD Put/ RUB Call 74,83X fällig 29.10.2021 JP Morgan	1.444	0,02	(10) Euro \$2 Year Midcurve Dezember 2021 Put 98,75X fällig 10.12.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(1.418)	(0,02)	(2) U.S. Bond Oktober 2021 Call 164,00X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(311)	(0,01)
63.910 USD Put/ RUB Call 74,91X fällig 19.11.2021 JP Morgan	1.661	0,03	(1) Euro – Bund Oktober 2021 Call 173,50X fällig 24.09.2021 Bank of America Merrill Lynch	(305)	(0,01)	(2) U.S. Bond Oktober 2021 Call 165,00X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(1.289)	(0,02)
Summe gekaufte Optionen (Kosten 28.040 USD)	24.238	0,40	– Euro – Bund Oktober 2021 Call 174,00X fällig 24.09.2021 Bank of America Merrill Lynch	(92)	–	(1) U.S. Bond Oktober 2021 Call 166,00X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(525)	(0,01)
Credit Default Swaps – 0,43 % (28. Februar 2021: 0,30 %)			– Euro – Bund Oktober 2021 Call 174,50X fällig 24.09.2021 Bank of America Merrill Lynch	(56)	–	(1) U.S. Bond Oktober 2021 Call 167,00X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(195)	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	25.993	0,43	EUR			– U.S. Bond Oktober 2021 Call 168,00X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(17)	–
Zinsswaps – 6,41 % (28. Februar 2021: 9,24 %)			EUR			(1) U.S. Bond Oktober 2021 Put 160,00X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(643)	(0,01)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	385.612	6,41	EUR			(1) U.S. Bond Oktober 2021 Put 161,00X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(441)	(0,01)
Optionen auf ein Swap – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			EUR			– U.S. Bond Oktober 2021 Put 162,00X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(217)	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	235	–	EUR			(1) U.S. Bond Oktober 2021 Put 162,50X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(776)	(0,01)
Devisenterminkontrakte – 0,45 % (28. Februar 2021: 1,37 %)			EUR			(2) U.S. Bond Oktober 2021 Put 163,00X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(2.487)	(0,04)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	26.803	0,45	EUR			– U.S. Long Bond W1 September 2021 Call 164,00X fällig 03.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(80)	–
Termingeschäfte – 0,57 % (28. Februar 2021: 1,77 %)			EUR			– U.S. Long Bond W1 September 2021 Call 164,50X fällig 03.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(34)	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	34.000	0,57	EUR			(63.700) USD Call/ JPY Put 112,50X fällig 01.10.2021 – Goldman Sachs	(33)	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	5.922.169	98,46				(128.340) USD Call/ RUB Put 74,75X fällig 208.09.2021 – Goldman Sachs	(691)	(0,01)
						(127.300) USD Call/ RUB Put 76,00X fällig 16.09.2021 – Goldman Sachs	(120)	–
						(124.680) USD Call/ RUB Put 77,30X fällig 20.10.2021 – Goldman Sachs	(473)	(0,01)
						(124.680) USD Put/ BRL Call 5,06X fällig 10.10.2021 – Morgan Stanley	(1.160)	(0,02)
Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts						
Schriftliche Optionen – (0,47 %) (28. Februar 2021: (0,51 %))								
(1) Australian Dollar Currency Future Oktober 2021 Call 72,50X fällig 08.10.2021 Bank of America Merrill Lynch	(816)	(0,01)	(1) U.S. 10 Year November 2021 Call 134,00X fällig 22.10.2021 Bank of America Merrill Lynch	(510)	(0,01)	(1) U.S. Bond Oktober 2021 Put 162,50X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(776)	(0,01)
- Australian Dollar Currency Future Oktober 2021 Call 73,00X fällig 08.10.2021 Bank of America Merrill Lynch	(205)	–	(2) U.S. 10 Year November 2021 Call 136,00X fällig 22.10.2021 Bank of America Merrill Lynch	(270)	(0,01)	(2) U.S. Bond Oktober 2021 Put 163,00X fällig 24.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(2.487)	(0,04)
- Australian Dollar Currency Future Oktober 2021 Call 73,50X fällig 08.10.2021 Bank of America Merrill Lynch	(147)	–	(2) U.S. 10 Year Oktober 2021 Call 134,00X fällig 24.09.2021 Bank of America Merrill Lynch	(664)	(0,01)	– U.S. Long Bond W1 September 2021 Call 164,00X fällig 03.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(80)	–
(1) Australian Dollar Currency Future September 2021 Call 74,00X fällig 03.09.2021 Bank of America Merrill Lynch	(20)	–	(2) U.S. 10 Year Oktober 2021 Call 134,50X fällig 24.09.2021 Bank of America Merrill Lynch	(426)	(0,01)	– U.S. Long Bond W1 September 2021 Call 164,50X fällig 03.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(34)	–
- Canadian Dollar Currency Future Oktober 2021 Call 80,00X fällig 08.10.2021 Bank of America Merrill Lynch	(91)	–	(3) U.S. 10 Year Oktober 2021 Call 135,00X fällig 24.09.2021 Bank of America Merrill Lynch	(274)	(0,01)	(63.700) USD Call/ JPY Put 112,50X fällig 01.10.2021 – Goldman Sachs	(33)	–
– Canadian Dollar Currency Future September 2021 Call 80,50X fällig 03.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(1)	–	(1) U.S. 10 Year Oktober 2021 Put 132,00X fällig 24.09.2021 Bank of America Merrill Lynch	(120)	–	(128.340) USD Call/ RUB Put 74,75X fällig 208.09.2021 – Goldman Sachs	(691)	(0,01)
– Canadian Dollar Currency Future September 2021 Call 81,00X fällig 03.09.2021 Bank of America Merrill Lynch	(1)	–	(3) U.S. 10 Year Oktober 2021 Put 133,00X fällig 24.09.2021 Bank of America Merrill Lynch	(1.149)	(0,02)	(127.300) USD Call/ RUB Put 76,00X fällig 16.09.2021 – Goldman Sachs	(120)	–
			(3) U.S. 10 Year Oktober 2021 Put 133,50X fällig 24.09.2021 Bank of America Merrill Lynch	(1.651)	(0,03)	(124.680) USD Call/ RUB Put 77,30X fällig 20.10.2021 – Goldman Sachs	(473)	(0,01)
			(1) U.S. 10 Year W1 September 2021 Call 133,50X fällig 03.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(215)	–	(124.680) USD Put/ BRL Call 5,06X fällig 10.10.2021 – Morgan Stanley	(1.160)	(0,02)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
Verkaufte Optionen – (Fortsetzung)			Optionen auf ein Swap – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
(114.600) USD Put/ BRL Call 5,07X fällig 24.11.2021 – BNP Paribas	(1.829)	(0,03)	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(120)	–
(112.040) USD Put/ MXN Call 20,00X fällig 24.11.2021 – Morgan Stanley	(1.301)	(0,02)	Devisenterminkontrakte – (0,54 %) (28. Februar 2021: (0,60 %))		
(61.250) USD Put/NOK Call 8,70X fällig 24.11.2021 – Morgan Stanley	(1.283)	(0,02)	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(32.481)	(0,54)
(128.392) USD Put/ RUB Call 71,4550X fällig 21.09.2021 – Goldman Sachs	(91)	–	Termingeschäfte – (0,99 %) (28. Februar 2021: (2,93 %))		
(63.780) USD Put/ RUB Call 72,00X fällig 12.10.2021 – Morgan Stanley	(242)	–	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(59.551)	(0,99)
(129.860) USD Put/ RUB Call 72,30X fällig 01.10.2021 – Citi	(508)	(0,01)	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
Summe geschriebene Optionen (Kosten (43.679) USD)	(28.164)	(0,47)		(206.415)	(3,43)
Credit Default Swaps – (0,29 %) (28. Februar 2021: (0,13 %))			Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(17.472)	(0,29)		5.715.754	95,03
Inflationsswaps – (0,03 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)			Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.876)	(0,03)		298.709	4,97
Zinsswaps – (1,11 %) (28. Februar 2021: (0,33 %))			Gesamtvermögen		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(66.751)	(1,11)		\$6.014.463	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 678.064.000 USD und machten 11,28 % des Nettovermögens aus.					
* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.					
† Illiquid.					

∞ Das Wertpapier wurde vom Manager oder dem jeweiligen Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.
 ≠ Die Wertpapiere (in ihrer Gesamtheit oder in Teilen) sind zum 31. August 2021 als Sicherheit für den Handel mit Derivaten verpfändet.

ABKÜRZUNGEN:

- Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
- REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.
- AUD – Australischer Dollar
- CNY – Chinesischer Renminbi
- EGP – Ägyptisches Pfund
- EUR – Euro
- GBP – Britisches Pfund Sterling
- IDR – Indonesische Rupiah
- INR – Indische Rupie
- MXN – Mexikanischer Peso
- RUB – Russischer Rubel

	% von Gesamtvermögen
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	78,25
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	1,34
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,41
Finanzderivate	7,51
Sonstige Vermögenswerte	10,49
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzinheit	Kaufs-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000%	Kauf	20.06.2026	165.103	\$ (16.271)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000%	Verkauf	20.06.2026	1.021.884	25.993
Bank of America Merrill Lynch	Teva Pharmaceutical Industries Ltd, 1,000%	Verkauf	20.06.2026	12.479	(1.201)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 19.851 USD)					\$ 25.993
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (9.000) USD)					(17.472)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 10.851 USD)					\$ 8.521

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	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	\$ 342
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,190%	03.01.2024	1.569.360	(8.814)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,820%	04.06.2024	1.153.974	(411)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 1,410%	01.03.2025	3.835.937	9.432
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 1,515%	21.06.2025	1.284.450	3.368
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,260%, Receive Floating USD Fed Funds Rate	15.05.2027	490.643	14.430
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,450%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.05.2027	4.504.080	130.926
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,250%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2028	615.037	(7.488)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,350%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2028	341.330	(6.316)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,713%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	20.05.2030	644.729	29.723
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,689%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	24.06.2030	681.080	33.506
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,680%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	08.07.2030	678.310	34.172
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,560%, Receive Floating USD SOFR Compound	20.07.2045	21.760	3.788
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,800%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.2045	476.231	86.417
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,000%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	209.330	30.714
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,200%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	30.447	3.147
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,225%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	14.842	1.454
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520%, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2047	102.439	(2.535)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,600%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	34.952	581

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Zinsswaps – (Fortsetzung)

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,630%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	51.633	\$ 583
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,729%, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2047	54.316	(3.894)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,000%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	125.773	(8.821)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,250%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	59.574	(7.408)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,200%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	07.10.2050	23.117	2.691
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,000%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	03.06.2051	5.929	(463)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,050%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	07.06.2051	17.796	(1.610)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,671%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	09.07.2051	132.484	338
Goldman Sachs	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,400%	02.01.2024	1.139.622	(5.611)
Goldman Sachs	Pay Floating RUB 3M MosPrime Reuters, Receive Fixed 7,020%	02.03.2031	2.905.700	(874)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 6,520%	02.01.2024	955.170	(6.562)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 6,917%	02.01.2024	763.700	(3.891)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,280%	03.01.2024	516.537	(2.053)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 614.088 USD)				\$ 385.612
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (21.745) USD)				(66.751)
Nettoaufwertung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 592.343 USD)				\$ 318.861

Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	USD-USA-CPI-U	12.05.2026	129.530	\$ (1.876)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(1.876)
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ (1.876)

Aufstellung der Swaptions

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
BNP Paribas	Swaption Receiver Strike 1,10%	201.10.2021	59.540	\$ 235
BNP Paribas	Swaption Payer Strike 1,06%	201.10.2021	59.540	(120)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Swaptions (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 235
Nicht realisierte Wertminderung von Swaptions (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(120)
Nettowertsteigerung von Swaptions (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 115

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	183.900	Verkauf	BRL 962.610 \$ (2.263)
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf	BRL	962.610	Verkauf	USD 184.590 1.573
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	1.916	Verkauf	AUD 2.646 (22)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	1.435	Verkauf	AUD 1.951 6
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	331	Verkauf	CHF 302 1
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	181	Verkauf	CHF 166 –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	267	Verkauf	CNH 1.732 (1)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	26.270	Verkauf	EUR 22.312 (87)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	9.887	Verkauf	GBP 7.225 (46)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	4.632	Verkauf	GBP 3.348 23
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	10	Verkauf	NOK 91 –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	86	Verkauf	NOK 780 (2)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	18	Verkauf	SEK 165 –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	1.543	Verkauf	SGD 2.083 (8)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	PLN	14.262	Verkauf	USD 3.667 57
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	253.786	Verkauf	USD 186.619 (943)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CHF	86.186	Verkauf	USD 94.239 (84)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SEK	578.758	Verkauf	USD 66.699 376
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	6.182	Verkauf	USD 4.489 35
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NOK	107	Verkauf	USD 12 –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SEK	6.871	Verkauf	USD 797 –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CNH	49.466	Verkauf	USD 7.615 39
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SGD	110.392	Verkauf	USD 81.453 655
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	JPY	134.228	Verkauf	USD 1.223 (3)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	457.184	Verkauf	USD 633.718 (5.128)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CHF	169	Verkauf	USD 183 –

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währungskauf		Währungsverkauf		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten	
			(in Tsd.)		(in Tsd.)		(in Tsd.)	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	878	Verkauf	USD	1.202	\$ 1
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.619.624	Verkauf	USD	1.905.476	7.505
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NOK	47.120	Verkauf	USD	5.288	134
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	JPY	10.819.094	Verkauf	USD	98.196	159
01.10.2021	BNY Mellon	Kauf	BRL	955.883	Verkauf	USD	181.904	2.155
01.10.2021	Citi	Kauf	RUB	850.084	Verkauf	USD	11.488	68
04.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	65.660	Verkauf	EUR	55.302	316
06.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	32.036	Verkauf	RUB	2.380.447	(298)
12.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	RUB	74.819	Verkauf	USD	981	34
14.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	BRL	54.423	Verkauf	USD	10.406	53
18.10.2021	Citi	Kauf	USD	123.332	Verkauf	INR	9.329.046	(3.850)
19.10.2021	BNP Paribas	Kauf	USD	19.159	Verkauf	EUR	16.130	95
19.10.2021	BNP Paribas	Kauf	USD	54.330	Verkauf	JPY	5.967.180	68
19.10.2021	Citi	Kauf	USD	7.476	Verkauf	CNH	48.707	(39)
19.10.2021	Citi	Kauf	USD	51.860	Verkauf	EUR	44.000	(144)
19.10.2021	Citi	Kauf	USD	33.255	Verkauf	EUR	28.000	161
19.10.2021	Citi	Kauf	USD	73.023	Verkauf	MXN	1.481.760	(255)
19.10.2021	Citi	Kauf	USD	65.834	Verkauf	TWD	1.823.458	38
19.10.2021	Citi	Kauf	CNH	652.170	Verkauf	USD	99.981	641
19.10.2021	Citi	Kauf	CAD	76.555	Verkauf	USD	60.950	(276)
19.10.2021	Citi	Kauf	RUB	1.232.500	Verkauf	USD	16.504	205
19.10.2021	Citi	Kauf	EUR	36.000	Verkauf	USD	42.318	230
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	69.099	Verkauf	BRL	352.660	1.381
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	9.296	Verkauf	CAD	11.616	90
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	12.667	Verkauf	GBP	9.151	84
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	COP	1.869.816	Verkauf	USD	481	14
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	BRL	212.747	Verkauf	USD	40.391	460
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	CAD	45.040	Verkauf	USD	36.284	(587)
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	GBP	506	Verkauf	USD	703	(8)
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	ZAR	42.370	Verkauf	USD	2.913	(15)
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	RUB	10.910.754	Verkauf	USD	146.942	974
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	91.671	Verkauf	AUD	122.228	2.231
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	88.714	Verkauf	CNH	578.053	(472)
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	236.355	Verkauf	IDR	3.486.868.814	(7.788)
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	143.351	Verkauf	JPY	15.732.856	285
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	KRW	73.896.127	Verkauf	USD	65.151	(1.418)
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	JPY	895.842	Verkauf	USD	8.137	9
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	RUB	4.821.129	Verkauf	USD	64.194	1.167
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	AUD	26.500	Verkauf	USD	19.234	158
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	74.435	Verkauf	EUR	62.581	469
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	331.575	Verkauf	MXN	6.700.636	207
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	322.944	Verkauf	RUB	24.394.500	(7.768)
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	BRL	1.516.543	Verkauf	USD	288.008	3.201
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	JPY	858.772	Verkauf	USD	7.886	(77)
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	MXN	129.987	Verkauf	USD	6.456	(28)
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	NOK	34.112	Verkauf	USD	3.910	13
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	COP	204.215.214	Verkauf	USD	53.328	712
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	RUB	754	Verkauf	USD	10	-
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	EUR	47.270	Verkauf	USD	55.419	450
29.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	35.614	Verkauf	RUB	2.664.972	(461)
19.11.2021	JP Morgan	Kauf	USD	37.433	Verkauf	RUB	2.804.106	(410)
22.11.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	33.754	Verkauf	MXN	683.227	115
26.11.2021	BNP Paribas	Kauf	BRL	23.506	Verkauf	USD	4.408	77
26.11.2021	Morgan Stanley	Kauf	MXN	187.234	Verkauf	USD	9.136	78
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 90.962 USD)							\$	26.803
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (39.458) USD)								(32.481)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 51.504 USD)							\$	(5.678)

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro\$ Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(4.022)	\$ (1.003.740)	\$ (647)
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	50.892	12.600.223	15.109
90 Day Euro\$ Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	2.438	605.599	714
90 Day Euro\$ September 2023	Bank of America Merrill Lynch	6.817	1.689.764	1.700
Australia 10 Year Bond September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(1.079)	(115.093)	32
Australian Dollar Currency September 2021	Bank of America Merrill Lynch	3.590	262.824	(10.786)
British Pound Currency September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(72)	(6.191)	162
Canadian Dollar Currency September 2021	Bank of America Merrill Lynch	1.327	105.258	(3.975)
Euro FX Currency September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(940)	(138.832)	449
Euro-BTP September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(2.445)	(442.539)	(6.983)
Euro-Bund Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(8.566)	(1.745.124)	6.250
Euro-Bund September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(8.489)	(1.758.605)	(17.822)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(605)	(151.815)	42
Japanese Yen Currency September 2021	Bank of America Merrill Lynch	3.356	381.410	114
Long Gilt Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(3.432)	(605.099)	3.950
Mexican Peso Currency September 2021	Bank of America Merrill Lynch	10.265	255.188	(978)
RUB/USD September 2021	Bank of America Merrill Lynch	3.454	117.652	234
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(21.770)	(2.905.275)	(935)
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(693)	(102.575)	215
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	5.830	1.284.513	780
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	27.590	3.413.400	4.249
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	27.635	4.503.641	(14.230)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	6.502	1.282.723	(3.195)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 117.968 USD)				\$ 34.000
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (194.870) USD)				(59.551)
Nettowertminderung von Termingeschäftskontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (76.902) USD)				\$ (25.551)

[^] 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 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 10,55 % (28. Februar 2021: 8,70 %)			1.000 Cumberland Park CLO Ltd, Series 2015 2A, Class DR, 144 A 2,834%, fällig 20.07.2028 *	1.005	0,09	3.330 Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2005-C, Series 2005 C, Class M2X 0,834%, fällig 25.10.2035 *	3.331	0,30
252 ABFC 2003-OPT1 Trust, Series 2003 OPT1X Class A3X 0,764%, fällig 25.04.2033 *	246	0,02	500 Cumberland Park CLO Ltd, Series 2015 2A, Class ER, 144 A 5,784%, fällig 20.07.2028 *	501	0,05	1.300 LCM XXII Ltd 22A, Class DR, 144 A 5,634%, fällig 20.10.2028 *	1.247	0,11
4.034 ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 2005-HE3X Series 2005 HE3X Class M4X 1,029%, fällig 25.05.2035 *	3.973	0,36	1.138 CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004- B, Series 2004 B, Class 2A, 0,316%, fällig 15.02.2029 *	1.081	0,10	1.080 Long Beach Mortgage Loan Trust 2005-1X Series 2005 1X Class M4X 1,359%, fällig 25.02.2035 *	1.084	0,10
2.230 Aegis Asset Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Cfcs Ser 2005-4X Series 2005 4X Class M2X 0,789%, fällig 25.10.2035 *	2.196	0,20	107 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005- D, Series 2005 D, Class 2A, 0,286%, fällig 15.11.2035 *	104	0,01	1.880 Magnetite XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144 A 5,806%, fällig 15.10.2031 *	1.866	0,17
1.200 AGL CLO 12 Ltd, Series 2021 12A, Class D, 144 A 2,980%, fällig 20.07.2034 *	1.197	0,11	650 Dewolf Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Class C, 144 A 2,276%, fällig 15.10.2030 *	651	0,06	1.250 Marble Point Clo X Ltd, Series 2017 1A, Class C, 144 A 2,476%, fällig 15.10.2030 *	1.250	0,11
2.570 Allegro CLO XIII Ltd, Series 2021 1A, Class E, 144 A 6,761%, fällig 20.07.2034 *	2.546	0,23	600 Dewolf Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Class D, 144 A 3,276%, fällig 15.10.2030 *	601	0,05	1.270 Marble Point CLO XIV Ltd, Series 2018 2A, Class D, 144 A 3,664%, fällig 20.01.2032 *	1.253	0,11
400 Ammc Clo 20 Ltd, Series 2017 20A, Class E, 144 A 5,944%, fällig 17.04.2029 *	393	0,04	2.531 Dividend Solar Loans 20182 LLC, Series 2018 2X Class B, 144 A 4,250%, fällig 20.12.2038	2.724	0,24	2.076 Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE2X Series 2007 HE2X Class A1X 1,234%, fällig 25.08.2037 *	2.020	0,18
500 AMMCCLOXLtd, Series 2012 11A, Class A1R2X 144 A 1,139%, fällig 30.04.2031 *	500	0,05	1.150 Dryden 70 CLO Ltd, Series 2018 70A, Class E, 144 A 6,176%, fällig 16.01.2032 *	1.142	0,10	500 MKS CLO 2017-2 Ltd, Series 2017 2A, Class D, 144 A 2,784%, fällig 20.01.2031 *	484	0,04
450 Anchorage Capital CLO 3-R Ltd, Series 2014 3RA, Class E, 144 A 5,632%, fällig 28.01.2031 *	438	0,04	2.163 Educational Funding Co LLC/ The, Series 2006 1A, Class A3X 144 A 0,475%, fällig 25.04.2033 *	1.804	0,16	1.194 Mosaic Solar Loan Trust 2018- 1X Series 2018 1A, Class CERT, 144 A 0,000%, fällig 22.06.2043∞	664	0,06
1.700 Apex Credit CLO2019-II Ltd, Series 2019 2A, Class D, 144 A 4,175%, fällig 25.10.2032 *	1.701	0,15	2.090 Encore Credit Receivables Trust 2005-2X Series 2005 2X Class M4X 1,014%, fällig 25.11.2035 *	2.097	0,19	1.330 Mountain View CLO IX Ltd, Series 2015 9A, Class CR, 144 A 3,246%, fällig 15.07.2031 *	1.288	0,12
1.250 Apidos CLO XII, Series 2013 12A, Class ER, 144 A 5,526%, fällig 15.04.2031 *	1.164	0,10	5.050 FBR Securitization Trust 2005- 2X Series 2005 2X Class M4X 1,014%, fällig 25.09.2035 *	4.721	0,42	2.250 National Collegiate II Commutation Trust, Series 2005 AR15X Class AR15X 0,000%, fällig 01.06.2045	431	0,04
1.750 Ares XXXIIR CLO Ltd, Series 2014 32RA, Class C, 144 A 3,025%, fällig 15.05.2030 *	1.733	0,16	346 First Franklin Mortgage Loan Trust 2003-FF4X Series 2003 FF4X Class M1X 1,896%, fällig 25.10.2033 *	348	0,03	2.000 National Collegiate Student Loan Trust 2005-1X Series 2005 1X Class B, 0,464%, fällig 26.03.2035 *	1.819	0,16
300 Ballyrock CLO 16 Ltd, Series 2021 16A, Class D, 144 A 6,385%, fällig 20.07.2034 *	296	0,03	2.490 Golub Capital Partners CLO 21M Ltd, Series 2014 21A, Class CR, 144 A 2,575%, fällig 25.01.2031 *	2.454	0,22	382 National Collegiate Student Loan Trust 2006-1X Series 2006 1X Class A5X 0,434%, fällig 25.03.2033 *	374	0,03
2.225 Ballyrock CLO2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Class C, 144 A 3,284%, fällig 20.04.2031 *	2.221	0,20	2.750 Golub Capital Partners CLO 53B Ltd, Series 2021 53A, Class E, 144 A 6,830%, fällig 20.07.2034 *	2.749	0,25	2.500 National Collegiate Student Loan Trust 2006-3X Series 2006 3X Class B, 0,444%, fällig 26.01.2032 *	2.069	0,19
750 Benefit Street Partners CLO VIII Ltd, Series 2015 8A, Class A1AR, 144 A 1,234%, fällig 20.01.2031 *	752	0,07	550 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 20214X Series 2021 4GS, Class A, 144 A 1,930%, fällig 20.07.2048	553	0,05	2.342 National Collegiate Student Loan Trust 2007-2X Series 2007 2X Class A4X 0,374%, fällig 25.01.2033 *	2.236	0,20
500 BlueMountain CLO 2015-2 Ltd, Series 2015 2A, Class ER, 144 A 5,334%, fällig 18.07.2027 *	491	0,04	250 Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Class E, 144 A 5,076%, fällig 15.04.2031 *	242	0,02	4.373 National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A6X Class 10, 144 A 0,000%, fällig 25.03.2038 *	1.347	0,12
1.000 BlueMountain CLO XXII Ltd, Series 2018 22A, Class A1X 144 A 1,206%, fällig 15.07.2031 *	1.000	0,09	1.600 Grippen Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Class D, 144 A 3,434%, fällig 20.01.2030 *	1.602	0,14	7.663 National Collegiate VI 20074 Class A-3L Commutation Trust, Series 2007 4VL, Class Q, 144 A 0,934%, fällig 29.03.2038 **†	1.861	0,17
2.200 Canyon CLO2020-1 Ltd, Series 2020 1A, Class ER, 144 A 0,000%, fällig 15.07.2034 *	2.202	0,20	72 Halcyon Loan Advisors Funding 2015-2 Ltd, Series 2015 2A, Class AR, 144 A 1,205%, fällig 25.07.2027 *	72	0,01	500 Neuberger Berman CLO XVIII Ltd, Series 2014 18A, Class DR2X 144 A 6,054%, fällig 20.10.2030 *	487	0,04
1.386 Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-3 Ltd, Series 2015 3A, Class A1R, 144 A 1,132%, fällig 28.07.2028 *	1.387	0,12	1.400 Harriman Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class ER, 144 A 6,534%, fällig 20.04.2034 *	1.404	0,13	1.000 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 35 Ltd, Series 2019 35A, Class E, 144 A 7,134%, fällig 19.01.2033 *	999	0,09
700 Catskill Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Class D, 144 A 6,134%, fällig 20.04.2029 *	700	0,06	475 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1X Class C, 144 A 1,796%, fällig 16.06.2036 *	477	0,04	250 Oaktree CLO 2015-1 Ltd, Series 2015 1A, Class DR, 144 A 5,334%, fällig 20.10.2027 *	246	0,02
1.000 Cedar Funding VIII Clo Ltd, Series 2017 8A, Class A1X 144 A 1,384%, fällig 17.10.2030 *	1.001	0,09	540 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1X Class D, 144 A 2,446%, fällig 16.06.2036 *	542	0,05	790 Ocean Trails CLO IX, Series 2020 9A, Class A1X 144 A 1,996%, fällig 15.10.2029 *	793	0,07
1.000 Cook Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Class E, 144 A 5,534%, fällig 17.04.2030 *	986	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 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)								
895 Ocean Trails CLO IX, Series 2020 9A, Class A2X 144 A 2,396%, fällig 15.10.2029 *	896	0,08	600 Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Class DRR, 144 A 2,946%, fällig 15.04.2027 *	579	0,05	3.220 BXMT2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2X Class A, 144 A 1,064%, fällig 15.02.2038 *	3.221	0,29
1.470 Ocean Trails CLO V, Series 2014 5A, Class DRR, 144 A 3,579%, fällig 13.10.2031 *	1.411	0,13	500 Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Class ERR, 144 A 5,866%, fällig 15.04.2027 *	442	0,04	2.160 CHT2017-COSMO Mortgage Trust, Series 2017 CSMD, Class E, 144 A 3,096%, fällig 15.11.2036 *	2.168	0,20
1.170 Ocean Trails Clo X, Series 2020 10A, Class C, 144 A 3,326%, fällig 15.10.2031 *	1.171	0,11	750 Voya CLO 2016-3 Ltd, Series 2016 3A, Class A1R, 144 A 1,324%, fällig 18.10.2031 *	752	0,07	36.091 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8X Series 2017 P8X Class XA, 1,038%, fällig 15.09.2050 *	1.621	0,15
700 Octagon Investment Partners 33 Ltd, Series 2017 1A, Class C, 144 A 2,884%, fällig 20.01.2031 *	695	0,06	1.500 Voya CLO2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Class C, 144 A 3,464%, fällig 17.04.2030 *	1.495	0,13	2.260 COMM2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1X Class C, 4,451%, fällig 10.02.2048 *	2.345	0,21
650 OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, Series 2018 1A, Class C, 144 A 2,734%, fällig 20.01.2031 *	643	0,06	200 VOYA CLO 2017-2X Series 2017 2A, Class D, 144 A 6,146%, fällig 07.06.2030 *	197	0,02	2.310 Connecticut Avenue Securities Trust 2018-R07X Series 2018 R07X Class 1B1X 144 A 4,434%, fällig 25.04.2031 *	2.399	0,22
2.980 Option One Mortgage Loan Trust 2005-3X Series 2005 3X Class M4X 1,014%, fällig 25.08.2035 *	2.847	0,26	1.000 Voya CLO2018-3 Ltd, Series 2018 3A, Class A1A, 144 A 1,276%, fällig 15.10.2031 *	1.001	0,09	1.050 CSAIL 2017-C8 Commercial Mortgage Trust, Series 2017 C8X Class C, 4,457%, fällig 15.06.2050 *	1.099	0,10
1.005 Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1X Series 2007 FXD1X Class 1A1X 5,866%, fällig 25.01.2037	1.015	0,09	2.335 WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE4 Trust, Series 2007 HE4X Class 1A, 0,254%, fällig 25.07.2047 *	1.977	0,18	4.690 CSMC2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class F, 144 A 4,373%, fällig 15.09.2037	3.694	0,33
2.046 Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1X Series 2007 FXD1X Class 2A1X 5,866%, fällig 25.01.2037	2.070	0,19	1.000 Webster Park CLO Ltd, Series 2015 1A, Class CR, 144 A 3,034%, fällig 20.07.2030 *	999	0,09	2.000 CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class F, 144 A 4,696%, fällig 15.07.2032 *	1.838	0,17
1.080 OZLM VII Ltd, Series 2014 7RA, Class CR, 144 A 3,134%, fällig 17.07.2029 *	1.065	0,10	1.050 Wellfleet CLO2017-2A Ltd, Series 2017 2A, Class C, 144 A 3,534%, fällig 20.10.2029 *	1.050	0,09	1.400 CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class H, 144 A 7,696%, fällig 15.07.2032 *	984	0,09
900 OZLM XI Ltd, Series 2015 11A, Class BR, 144 A 2,429%, fällig 30.10.2030 *	900	0,08	600 Wellfleet CLO 2017-3 Ltd, Series 2017 3A, Class C, 144 A 2,884%, fällig 17.01.2031 *	591	0,05	1.502 CSWF 2018-TOP, Series 2018 TOP, Class D, 144 A 1,896%, fällig 15.08.2035 *	1.504	0,14
781 OZLM XXII Ltd, Series 2018 22A, Class C, 144 A 2,784%, fällig 17.01.2031 *	749	0,07	890 Whitehorse XII Ltd, Series 2018 12A, Class D, 144 A 3,776%, fällig 15.10.2031 *	867	0,08	2.282 DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1X Series 2007 AR1X Class 1A1B, 0,227%, fällig 19.04.2047 *	2.046	0,18
1.370 Point Au Roche Park CLO Ltd, Series 2021 1A, Class E, 144 A 6,276%, fällig 20.07.2034 *	1.372	0,12	1.560 Z Capital Credit Partners CLO 2021-1 Ltd, Series 2021 1A, Class D, 144 A 4,350%, fällig 15.07.2033 *	1.512	0,14	2.220 Eagle RE2020-1 Ltd, Series 2020 1X Class M1C, 144 A 1,884%, fällig 25.01.2030 *	2.204	0,20
2.600 RAMP Series 2006-NC3 Trust, Series 2006 NC3X Class M1X 0,594%, fällig 25.03.2036 *	2.571	0,23	Summe forderungsbesicherter Wertpapiere (Kosten 114.321 USD)			117.126	10,55	
445 RBSSP Resecuritization Trust 2010-4X Series 2010 4X Class 6A2X 144 A 5,825%, fällig 26.02.2036	453	0,04	Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere – 12,00 % (28. Februar 2021: 11,67 %)					
1.000 Romark CLO Ltd, Series 2017 1A, Class D, 144 A 6,788%, fällig 23.10.2030 *	985	0,09	1.193 Alternative Loan Trust 20074CB, Series 2007 4CB, Class 1A5X 5,750%, fällig 25.04.2037	1.192	0,11	2.500 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05X Class 1B1X 3,684%, fällig 25.01.2030 *	2.616	0,24
1.320 Saranac CLO III Ltd, Series 2014 3A, Class DR, 144 A 3,385%, fällig 22.06.2030 *	1.275	0,12	1.192 BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10X Series 2016 GG10X Class AJA, 144 A 6,024%, fällig 10.08.2045 *	543	0,05	2.107 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05X Class 1M2X 2,284%, fällig 25.01.2030 *	2.155	0,19
378 Shackleton 2014-VI-R CLO Ltd, Series 2014 6RA, Class A, 144 A 1,154%, fällig 17.07.2028 *	378	0,03	1.901 Banc of America Funding Corp, Series 2015 R3X Class 1A2X 144 A 0,502%, fällig 27.03.2036 *	1.791	0,16	3.400 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C06X Class 1B1X 4,234%, fällig 25.02.2030 *	3.532	0,32
1.000 SMB Private Education Loan Trust 2015-C, Series 2015 C, Class C, 144 A 4,500%, fällig 17.09.2046	1.079	0,10	440 BBCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Class D, 144 A 4,715%, fällig 10.08.2033 *	454	0,04	2.000 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C07X Class 1B1X 4,084%, fällig 25.05.2030 *	2.077	0,19
650 Stewart Park CLO Ltd, Series 2015 1A, Class DR, 144 A 2,726%, fällig 15.01.2030 *	649	0,06	2.660 BBSG2016-MRP Mortgage Trust, Series 2016 MRP, Class A, 144 A 3,275%, fällig 05.06.2036	2.720	0,24	3.000 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C01X Class 1B1X 3,634%, fällig 25.07.2030 *	3.078	0,28
530 Symphony CLO XIX Ltd, Series 2018 19A, Class E, 144 A 5,326%, fällig 16.04.2031 *	510	0,05	1.620 BHMS2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Class C, 144 A 1,996%, fällig 15.07.2035 *	1.623	0,15	3.320 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05X Class 1B1X 4,334%, fällig 25.01.2031 *	3.481	0,31
530 TCI-Symphony CLO 2016-1 Ltd, Series 2016 1A, Class DR, 144 A 3,129%, fällig 13.10.2029 *	535	0,05	530 BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA, Series 2018 BIOA, Class A, 144 A 0,767%, fällig 15.03.2037 *	531	0,05	1.640 Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1X Series 2020 DNA1X Class B1X 144 A 2,384%, fällig 25.01.2050 *	1.638	0,15
450 TCI-Symphony CLO 2016-1 Ltd, Series 2016 1A, Class ER, 144 A 5,629%, fällig 13.10.2029 *	445	0,04	2.161 BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA, Series 2018 BIOA, Class E, 144 A 2,047%, fällig 15.03.2037 *	2.168	0,19	2.170 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6X Series 2020 DNA6X Class B1X 144 A 3,050%, fällig 25.12.2050 *	2.197	0,20
800 Treman Park CLO Ltd, Series 2015 1A, Class DRR, 144 A 2,784%, fällig 20.10.2028 *	804	0,07	1.650 BX Trust 2021-VIEW, Series 2021 VIEW, Class C, 144 A 2,446%, fällig 15.06.2023 *	1.654	0,15	1.420 Freddie Mac STACR Trust 2018-DNA2X Series 2018 DNA2X Class B1X 144 A 3,784%, fällig 25.12.2030 *	1.478	0,13

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)								
2.898 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA3X Class M3X 5,084%, fällig 25.12.2028 *	3.021	0,27	530 Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-2AR, Series 2005 2AR, Class B1X 0,584%, fällig 25.04.2035 *	399	0,04	701 Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series 2007 C33X Series 2007 C33X Class AJ, 5,842%, fällig 15.02.2051 *	538	0,05
579 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2017 SPI1X Class B, 144 A 4,041%, fällig 25.09.2047 *	567	0,05	2.407 Motel 6 Trust 2017-MTL6X Series 2017 MTL6X Class F, 144 A 4,346%, fällig 15.08.2034 *	2.417	0,22	409 WaMu Mortgage PassThrough Certificates Series 2005-AR17 Trust, Series 2005 AR17X Class A1C3X 1,044%, fällig 25.12.2045 *	268	0,02
1.190 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2021 DNA2X Class M2X 144 A 2,350%, fällig 25.08.2033 *	1.219	0,11	2.800 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class D, 144 A 4,544%, fällig 15.08.2036 *	2.587	0,23	2.768 WaMu Mortgage PassThrough Certificates Series 2005-AR2 Trust, Series 2005 AR2X Class B1X 0,879%, fällig 25.01.2045 *	2.347	0,21
1.630 GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5X Class C, 144 A 4,096%, fällig 15.09.2031 *	517	0,05	2.450 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class E, 144 A 4,544%, fällig 15.08.2036 *	2.137	0,19	1.324 WaMu Mortgage PassThrough Certificates Series 2006-AR13 Trust, Series 2006 AR13X Class 2A, 1,782%, fällig 25.10.2046 *	1.296	0,12
94 GS Mortgage Securities Trust 2006-GG8X Series 2006 GG8X Class AJ, 5,622%, fällig 10.11.2039	27	-	1.730 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Series 2021 NQ2R, Class A3X 144 A 1,353%, fällig 25.09.2058 *	1.735	0,16	551 WaMu Mortgage PassThrough Certificates Series 2006-AR3 Trust, Series 2006 AR3X Class A1B, 1,098%, fällig 25.02.2046 *	531	0,05
227 GSMPSMortgageLoan Trust 2006-RP1X Series 2006 RP1X Class 1A2X 144 A 7,500%, fällig 25.01.2036	237	0,02	1.852 Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Series 2015 4R, Class 2A2X 144 A 0,369%, fällig 26.10.2036 *	1.676	0,15	Summe hypothekarisch gesicherte Wertpapiere (Kosten 138.949 USD)		
1.050 Hilton USA Trust 2016-HHV, Series 2016 HHV, Class D, 144 A 4,333%, fällig 05.11.2038 *	1.136	0,10	1.627 PMT Credit Risk Transfer Trust 2019-3R, Series 2019 3R, Class A, 144 A 2,788%, fällig 27.10.2022 *	1.633	0,15	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 53,94 % (28. Februar 2021: 54,75 %)		
4.068 Impac Secured Assets Trust 2006-3X Series 2006 3X Class A7X 0,624%, fällig 25.11.2036 *	3.445	0,31	3.980 Radnor Re 2018-1 Ltd, Series 2018 1X Class M2X 144 A 2,784%, fällig 25.03.2028 *	4.020	0,36	Argentinien – 0,59 % (28. Februar 2021: 0,32 %)		
3.190 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Series 2018 PHMZ, Class M, 144 A 8,454%, fällig 15.06.2035*†	1.271	0,11	4.420 Radnor RE 2020-1 Ltd, Series 2020 1X Class M1C, 144 A 1,834%, fällig 25.01.2030 *	4.414	0,40	2.770 Mercadolibre Inc, 3,125%, fällig 14.01.2031	2.738	0,25
14 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007 CIBC19X Series 2007 CB19X Class AJ, 6,261%, fällig 12.02.2049 *	16	-	4.420 Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4X Series 2017 4X Class M, 144 A 4,750%, fällig 25.06.2057 *	4.569	0,41	2.260 Transportadora de Gas del Sur SA, 144 A 6,750%, fällig 02.05.2025	2.144	0,19
4 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007 LDP12X Series 2007 LD12X Class AJ, 6,716%, fällig 15.02.2051 *	4	-	5.365 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-1X Series 2017 1X Class M1X 144 A 4,000%, fällig 25.01.2056 *	5.434	0,49	1.796 YPF SA, 144 A 4,000%, fällig 12.02.2026	1.633	0,15
4.130 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Series 2018 WPT, Class FFL, 144 A 3,240%, fällig 05.07.2033 *	4.080	0,37	4.180 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1X Series 2018 1X Class M, 144 A 4,750%, fällig 25.05.2057 *	4.376	0,39	Belgien – 0,37 % (28. Februar 2021: 0,59 %)		
2.806 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-NNN MZ, Series 2020 NNNZ, Class M, 144 A 8,542%, fällig 16.01.2037	2.318	0,21	2.500 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-4X Series 2018 4X Class M, 144 A 4,750%, fällig 25.03.2058	2.672	0,24	EUR 3.200 KBC Group NV, 4,750%, Perpetual *	4.060	0,37
902 JP Morgan Resecuritization Trust Series 2009-10X Series 2009 10X Class 7A2X 144 A 6,054%, fällig 26.02.2037 *	531	0,05	2.076 Sequoia Mortgage Trust 2007-2X Series 2007 2X Class 1A3X 0,728%, fällig 20.06.2036 *	2.023	0,18	Brasilien – 1,69 % (28. Februar 2021: 1,63 %)		
99 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5X Series 2007 5X Class AJ, 5,450%, fällig 12.08.2048 *	49	-	3.000 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class C, 144 A 2,846%, fällig 15.11.2027 *	147	0,01	2.060 Braskem Netherlands Finance BV, 144 A 4,500%, fällig 10.01.2028	2.237	0,20
99 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5X Series 2007 5X Class AJFL, 144 A 5,450%, fällig 12.08.2048 *	49	-	1.300 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class D, 144 A 3,596%, fällig 15.11.2027*†	-	-	4.550 Petrobras Global Finance BV, 5,299%, fällig 27.01.2025	5.119	0,46
1.211 Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP, Series 2018 MP, Class A, 144 A 4,419%, fällig 11.07.2040 *	1.377	0,12	1.160 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class E, 144 A 4,496%, fällig 15.11.2027*†	-	-	2.190 Petrobras Global Finance BV, 6,850%, fällig 05.06.2115	2.431	0,22
			2.708 Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Class D, 144 A 2,246%, fällig 11.11.2034 *	2.712	0,24	650 Suzano Austria GmbH, 5,750%, fällig 14.07.2026	763	0,07
			2.649 Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Class E, 144 A 3,426%, fällig 11.11.2034 *	2.643	0,24	2.460 Suzano Austria GmbH, 6,000%, fällig 15.01.2029	2.940	0,27
			2.827 Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Class F, 144 A 4,198%, fällig 11.11.2034 *	2.760	0,25	1.900 Suzano Austria GmbH, 3,125%, fällig 15.01.2032	1.908	0,17
						1.480 Vale Overseas Ltd, 6,250%, fällig 10.08.2026	1.787	0,16
						1.110 Vale Overseas Ltd, 6,875%, fällig 10.11.2039	1.589	0,14
						Kanada – 1,97 % (28. Februar 2021: 2,08 %)		
						1.280 Air Canada, 144 A 3,875%, fällig 15.08.2026	1.288	0,12
						1.000 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144 A 5,375%, fällig 15.01.2028	1.055	0,10
						CAD		
						1.320 Doman Building Materials Group Ltd, 144 A 5,250%, fällig 15.05.2026	1.057	0,10
						1.210 GFL Environmental Inc, 144 A 4,250%, fällig 01.06.2025	1.257	0,11
						2.325 GFL Environmental Inc, 144 A 5,125%, fällig 15.12.2026	2.456	0,22
						910 Hudbay Minerals Inc, 144 A 4,500%, fällig 01.04.2026	916	0,08
						1.620 Hudbay Minerals Inc, 144 A 6,125%, fällig 01.04.2029	1.743	0,16

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			330 Avolon Holdings Funding Ltd, 144 A 5,125%, fällig 01.10.2023	356	0,03	Niederlande – 0,38 % (28. Februar 2021: 0,39 %)		
Kanada – (Fortsetzung)			990 Avolon Holdings Funding Ltd, 144 A 4,250%, fällig 15.04.2026	1.074	0,10	EUR 3.200 Cooperative Rabobank UA, 4,625%, Perpetual *	4.203	0,38
518 MEG Energy Corp, 144 A 6,500%, fällig 15.01.2025	535	0,05	153 Park Aerospace Holdings Ltd, 144 A 5,250%, fällig 15.08.2022	159	0,01	Russland – 0,29 % (28. Februar 2021: 0,30 %)		
1.500 MEG Energy Corp, 144 A 7,125%, fällig 01.02.2027	1.580	0,14	730 Park Aerospace Holdings Ltd, 144 A 4,500%, fällig 15.03.2023	766	0,07	1.010 Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA, 144 A 4,950%, fällig 23.03.2027	1.129	0,10
1.600 MEG Energy Corp, 144 A 5,875%, fällig 01.02.2029	1.650	0,15				1.820 Lukoil International Finance BV, 144 A 4,750%, fällig 02.11.2026	2.044	0,19
470 Open Text Corp, 144 A 3,875%, fällig 15.02.2028	491	0,04		3.465	0,31		3.173	0,29
1.200 Open Text Holdings Inc, 144 A 4,125%, fällig 15.02.2030	1.265	0,11	Israel – 0,21 % (28. Februar 2021: 0,23 %)			Singapur – 0,07 % (28. Februar 2021: 0,07 %)		
1.000 Superior Plus LP / Superior General Partner Inc, 144 A 4,500%, fällig 15.03.2029	1.037	0,09	1.150 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150%, fällig 01.02.2036	1.278	0,12	710 Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250%, fällig 19.06.2024	772	0,07
410 Teck Resources Ltd, 6,000%, fällig 15.08.2040	530	0,05	1.060 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, fällig 01.10.2026	1.014	0,09	Südafrika – 0,29 % (28. Februar 2021: 0,04 %)		
1.060 Teck Resources Ltd, 5,400%, fällig 01.02.2043	1.308	0,12		2.292	0,21	1.430 Sasol Financing USA LLC, 4,375%, fällig 108.09.2026	1.479	0,13
3.150 TransAlta Corp, 6,500%, fällig 15.03.2040	3.706	0,33	Italien – 0,34 % (28. Februar 2021: 1,15 %)			1.630 Sasol Financing USA LLC, 5,500%, fällig 18.03.2031	1.726	0,16
	21.874	1,97	720 Intesa Sanpaolo SpA, 144 A 5,710%, fällig 15.01.2026	810	0,07		3.205	0,29
Kaimaninseln – 0,35 % (28. Februar 2021: 0,33 %)			540 UniCredit SpA, 144 A 7,296%, fällig 02.04.2034 *	654	0,06	Spanien – 0,22 % (28. Februar 2021: 0,22 %)		
3.976 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144 A 6,500%, fällig 15.09.2024	3.946	0,35	2.080 UniCredit SpA, 144 A 5,459%, fällig 30.06.2035 *	2.301	0,21	EUR 1.600 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 5,875%, Perpetual *	2.040	0,18
Chile – 0,28 % (28. Februar 2021: 0,10 %)				3.765	0,34	EUR 100 Tendam Brands SAU, 5,000%, fällig 15.09.2024	119	0,01
470 Liberty Latin America Ltd, 2,000%, fällig 15.07.2024	480	0,04	Kasachstan – 0,53 % (28. Februar 2021: 0,55 %)			EUR 230 Tendam Brands SAU, 5,250%, fällig 15.09.2024 *	273	0,03
2.533 VTR Comunicaciones SpA, 144 A 5,125%, fällig 15.01.2028	2.650	0,24	2.570 KazMunayGas National Co JSC, 144 A 4,750%, fällig 19.04.2027	2.918	0,26		2.432	0,22
	3.130	0,28	200 KazMunayGas National Co JSC, 144 A 6,375%, fällig 24.10.2048	264	0,03	Schweiz – 0,48 % (28. Februar 2021: 0,54 %)		
China – 0,27 % (28. Februar 2021: 0,31 %)			2.440 KazTransGas JSC, 144 A 4,375%, fällig 26.09.2027	2.697	0,24	670 Credit Suisse Group AG, 144 A 7,500%, Perpetual *	724	0,07
550 Prosperous Ray Ltd, 4,625%, fällig 12.11.2023	589	0,05		5.879	0,53	200 Credit Suisse Group AG, 144 A 7,250%, Perpetual *	224	0,02
2.430 Prosus NV, 144 A 3,061%, fällig 13.07.2031	2.380	0,22	Kuwait – 0,24 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			200 Credit Suisse Group AG, 144 A 7,500%, Perpetual *	221	0,02
	2.969	0,27	2.170 MEGlobal Canada ULC, 144 A 5,875%, fällig 18.05.2030	2.708	0,24	2.780 UBS Group AG, 144 A 7,000%, Perpetual *	3.050	0,27
Kolumbien – 0,22 % (28. Februar 2021: 0,23 %)			Luxemburg – 0,56 % (28. Februar 2021: 0,54 %)			1.030 VistaJet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc, 144 A 10,500%, fällig 01.06.2024	1.119	0,10
1.143 Millicom International Cellular SA, 144 A 6,625%, fällig 15.10.2026	1.205	0,11	2.540 Altice France Holding SA, 144 A 10,500%, fällig 15.05.2027	2.794	0,25		5.338	0,48
1.098 Millicom International Cellular SA, 144 A 6,250%, fällig 25.03.2029	1.206	0,11	1.360 ARD Finance SA, 144 A 6,500%, fällig 30.06.2027	1.434	0,13	Türkei – 0,24 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
	2.411	0,22	GBP 1.460 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250%, fällig 01.04.2028	2.047	0,18	2.400 Türk Telekomunikasyon AS, 144 A 6,875%, fällig 28.02.2025	2.643	0,24
Frankreich – 0,44 % (28. Februar 2021: 0,78 %)				6.275	0,56	Vereinigte Arabische Emirate – 0,31 % (28. Februar 2021: 0,61 %)		
1.393 Altice France SA/France, 144 A 7,375%, fällig 01.05.2026	1.448	0,13	Macau – 0,35 % (28. Februar 2021: 0,64 %)			2.710 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144 A 5,625%, fällig 25.09.2048	3.416	0,31
500 Altice France SA/France, 144 A 8,125%, fällig 01.02.2027	544	0,05	1.000 Sands China Ltd, 5,125%, fällig 08.08.2025	1.113	0,10	Großbritannien – 2,35 % (28. Februar 2021: 1,60 %)		
1.110 Altice France SA/France, 144 A 5,125%, fällig 15.07.2029	1.123	0,10	1.350 Wynn Macau Ltd, 144 A 5,625%, fällig 26.08.2028	1.369	0,12	EUR 1.730 Barclays Plc, 2,000%, fällig 07.02.2028 *	2.094	0,19
1.500 Credit Agricole SA, 144 A 8,125%, Perpetual *	1.829	0,16	1.410 Wynn Macau Ltd, 144 A 5,125%, fällig 15.12.2029	1.404	0,13	1.000 Barclays Plc, 8,000%, Perpetual *	1.137	0,10
	4.944	0,44		3.886	0,35	540 Barclays Plc, 7,750%, Perpetual *	592	0,05
Deutschland – 0,23 % (28. Februar 2021: 0,22 %)			Malaysia – 0,22 % (28. Februar 2021: 0,22 %)			EUR 1.500 HSBC Holdings Plc, 5,250%, Perpetual *	1.846	0,17
1.640 Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 144 A 5,500%, fällig 15.01.2028	1.679	0,15	2.500 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064%, fällig 19.08.2050	2.468	0,22	EUR 2.100 Lloyds Banking Group Plc, 4,947%, Perpetual *	2.746	0,25
520 Mercer International Inc, 5,125%, fällig 01.02.2029	525	0,05	Mexiko – 0,50 % (28. Februar 2021: 0,26 %)			200 Lloyds Banking Group Plc, 7,500%, Perpetual *	224	0,02
EUR 270 Nidda BondCo GmbH, 5,000%, fällig 30.09.2025	320	0,03	2.400 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144 A 7,500%, Perpetual *	2.720	0,24	1.400 McLaren Finance Plc, 144 A 7,500%, fällig 01.08.2026	1.401	0,13
	2.524	0,23	200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144 A 6,875%, Perpetual *	206	0,02	GBP 3.080 Natwest Group Plc, 4,500%, Perpetual *	4.400	0,40
Hongkong – 0,22 % (28. Februar 2021: 0,23 %)			2.330 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144 A 7,625%, Perpetual *	2.649	0,24	GBP 868 Saga Plc, 3,375%, fällig 12.05.2024	1.154	0,10
2.320 Melco Resorts Finance Ltd, 144 A 5,375%, fällig 04.12.2029	2.404	0,22		5.575	0,50	GBP 2.040 Saga Plc, 5,500%, fällig 15.07.2026	2.750	0,25
Irland – 0,31 % (28. Februar 2021: 0,32 %)						GBP 340 Santander UK Group Holdings Plc, 7,375%, Perpetual *	492	0,04
1.040 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,500%, fällig 15.09.2023	1.110	0,10						

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			3.130 Bath & Body Works Inc, 5,250%, fällig 01.02.2028	3.510	0,32	3.640 Cheniere Energy Inc, 4,250%, fällig 15.03.2045	3.080	0,28
Großbritannien – (Fortsetzung)			910 Bath & Body Works Inc, 144 A 6,625%, fällig 01.10.2030	1.050	0,09	3.080 CHS/Community Health Systems Inc, 144 A 6,875%, fällig 15.04.2029	3.203	0,29
2.500 Virgin Media Secured Finance Plc, 144 A 5,500%, fällig 15.05.2029	2.681	0,24	3.070 Bausch Health Americas Inc, 144 A 8,500%, fällig 31.01.2027	3.305	0,30	2.500 CHS/Community Health Systems Inc, 144 A 6,125%, fällig 01.04.2030	2.523	0,23
1.680 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144 A 4,750%, fällig 15.07.2031	1.727	0,15	40 Bausch Health Cos Inc, 144 A 9,000%, fällig 15.12.2025	43	–	930 Clarivate Science Holdings Corp, 144 A 4,875%, fällig 01.07.2029	960	0,09
GBP 2.060 Wheel Bidco Ltd, 6,750%, fällig 15.07.2026	2.879	0,26	920 BCPE Empire Holdings Inc, 144 A 7,625%, fällig 01.05.2027	922	0,08	3.470 Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144 A 7,500%, fällig 01.06.2029	3.596	0,32
	26.123	2,35	2.430 Bed Bath & Beyond Inc, 5,165%, fällig 01.08.2044	2.315	0,21	2.920 Colgate Energy Partners III LLC, 144 A 5,875%, fällig 01.07.2029	2.960	0,27
Vereinigte Staaten – 38,58 % (28. Februar 2021: 39,02 %)			5.000 Berry Petroleum Co LLC, 144 A 7,000%, fällig 15.02.2026	4.969	0,45	2.230 CommScope Inc, 144 A 8,250%, fällig 01.03.2027	2.354	0,21
1.040 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144 A 5,000%, fällig 01.05.2028	1.034	0,09	1.320 Black Knight InfoServ LLC, 144 A 3,625%, fällig 01.09.2028	1.338	0,12	940 Comstock Resources Inc, 144 A 5,875%, fällig 15.01.2030	944	0,09
1.100 AdaptHealth LLC, 144 A 6,125%, fällig 01.08.2028	1.173	0,11	1.200 Blackboard Inc, 144 A 10,375%, fällig 15.11.2024	1.270	0,11	2.850 CoreCivic Inc, 8,250%, fällig 15.04.2026	3.012	0,27
1.220 AdaptHealth LLC, 144 A 4,625%, fällig 01.08.2029	1.225	0,11	1.650 Blast Motion Inc, Series 2021X 144 A 7,000%, fällig 15.01.2024	1.662	0,15	3.580 CSC Holdings LLC, 144 A 6,500%, fällig 01.02.2029	3.956	0,36
650 AdaptHealth LLC, 144 A 5,125%, fällig 01.03.2030	659	0,06	2.830 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144 A 7,625%, fällig 15.12.2025	3.063	0,28	750 CSC Holdings LLC, 144 A 4,125%, fällig 01.12.2030	752	0,07
2.270 Adtalem Global Education Inc, 144 A 5,500%, fällig 01.03.2028	2.327	0,21	1.580 Boeing Co/The, 2,196%, fällig 04.02.2026	1.586	0,14	2.100 CSC Holdings LLC, 144 A 4,500%, fällig 15.11.2031	2.116	0,19
1.020 AES Corp/The, 2,450%, fällig 15.01.2031	1.031	0,09	500 Boeing Co/The, 5,150%, fällig 01.05.2030	592	0,05	80 DCP Midstream LP Series A, 7,375%, Perpetual *	77	0,01
2.000 Akumin Inc, 144 A 7,000%, fällig 01.11.2025	1.891	0,17	1.310 Boeing Co/The, 3,250%, fällig 01.02.2035	1.341	0,12	325 DCP Midstream Operating LP, 3,875%, fällig 15.03.2023	334	0,03
1.380 Alcoa Nederland Holding BV, 144 A 6,125%, fällig 15.05.2028	1.502	0,14	1.510 Boeing Co/The, 5,930%, fällig 01.05.2060	2.103	0,19	120 DCP Midstream Operating LP, 5,625%, fällig 15.07.2027	137	0,01
3.630 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144 A 10,500%, fällig 15.02.2028	3.513	0,32	2.020 Boyne USA Inc, 144 A 4,750%, fällig 15.05.2029	2.088	0,19	600 DCP Midstream Operating LP, 144 A 6,750%, fällig 15.09.2037	748	0,07
3.660 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144 A 6,625%, fällig 15.07.2026	3.916	0,35	1.133 Brink's Co/The, 144 A 4,625%, fällig 15.10.2027	1.191	0,11	2.170 Delta Air Lines Inc, 3,800%, fällig 19.04.2023	2.249	0,20
875 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144 A 6,000%, fällig 01.06.2029	876	0,08	10 CalAtlantic Group Inc/old, 5,250%, fällig 01.06.2026	10	–	5.070 Delta Air Lines Inc, 144 A 7,000%, fällig 01.05.2029	5.934	0,53
1.150 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp / Atlas Luxco 4 Sarl, 144 A 4,625%, fällig 01.06.2028	1.154	0,10	3.744 Carnival Corp, 144 A 9,875%, fällig 01.08.2027	4.320	0,39	760 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,750%, fällig 20.10.2028	848	0,08
350 Alteryx Inc, 0,500%, fällig 01.08.2024	330	0,03	2.830 Carnival Plc, 7,875%, fällig 01.06.2027	3.358	0,30	1.100 Devon Energy Corp, 144 A 8,250%, fällig 01.08.2023	1.241	0,11
320 Alteryx Inc, 1,000%, fällig 01.08.2026	296	0,03	1.760 Carriage Services Inc, 144 A 4,250%, fällig 15.05.2029	1.765	0,16	84 Devon Energy Corp, 144 A 5,250%, fällig 15.10.2027	89	0,01
1.190 American Airlines Inc / AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144 A 5,500%, fällig 20.04.2026	1.256	0,11	950 Carrols Restaurant Group Inc, 144 A 5,875%, fällig 01.07.2029	918	0,08	1.880 Devon Energy Corp, 5,000%, fällig 15.06.2045	2.228	0,20
1.120 American Airlines Inc / AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144 A 5,750%, fällig 20.04.2029	1.211	0,11	2.530 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 5,000%, fällig 01.02.2028	2.654	0,24	1.650 DIRECTV Holdings LLC / DIRECTV Financing Co Inc, 144 A 5,875%, fällig 15.08.2027	1.727	0,16
650 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000%, fällig 01.10.2029	651	0,06	2.500 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144 A 4,500%, fällig 15.08.2030	2.615	0,24	1.210 DISH DBS Corp, 7,750%, fällig 01.07.2026	1.388	0,13
4.536 American News Co LLC, 144 A 8,500%, fällig 01.09.2026	5.246	0,47	2.800 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500%, fällig 01.05.2032	2.930	0,26	3.030 DISH DBS Corp, 144 A 5,125%, fällig 01.06.2029	3.019	0,27
3.010 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 5,375%, fällig 15.10.2023	3.071	0,28	1.000 CDK Global Inc, 144 A 5,250%, fällig 15.05.2029	1.088	0,10	2.660 DISH Network Corp, 3,375%, fällig 15.08.2026	2.781	0,25
1.760 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144 A 4,625%, fällig 15.06.2029	1.716	0,15	1.220 CDW LLC / CDW Finance Corp, 4,125%, fällig 01.05.2025	1.270	0,11	1.600 Diversified Healthcare Trust, 9,750%, fällig 15.06.2025	1.762	0,16
2.160 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144 A 4,000%, fällig 01.09.2029	2.204	0,20	540 CDW LLC / CDW Finance Corp, 3,250%, fällig 15.02.2029	555	0,05	650 Diversified Healthcare Trust, 4,750%, fällig 15.02.2028	659	0,06
1.150 Aviation Capital Group LLC, 144 A 5,500%, fällig 15.12.2024	1.297	0,12	80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,384%, fällig 23.10.2035	107	0,01	3.270 Downstream Development Authority of the Quapaw Tribe of Oklahoma, 144 A 10,500%, fällig 15.02.2023	3.417	0,31
1.900 Ball Corp, 2,875%, fällig 15.08.2030	1.907	0,17	310 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, fällig 01.04.2038	384	0,03	1.130 DraftKings Inc, 144 A Zero coupon, fällig 15.03.2028	1.088	0,10
			2.800 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125%, fällig 01.07.2049	3.370	0,30	1.140 Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144 A 6,625%, fällig 15.07.2025	1.210	0,11
			800 Cheesecake Factory Inc/The, 0,375%, fällig 15.06.2026	752	0,07	827 Endeavor Energy Resources LP / Charter Finance Inc, 144 A 5,500%, fällig 30.01.2026	857	0,08
						1.183 Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144 A 5,750%, fällig 30.01.2028	1.247	0,11

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			2.800 HCA Inc, 5,625%, fällig 01.09.2028	3.343	0,30	2.600 NCR Corp, 144 A 5,125%, fällig 15.04.2029	2.699	0,24
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			2.020 Hilton Domestic Operating Co Inc, 144 A 5,375%, fällig 01.05.2025	2.122	0,19	2.380 Netflix Inc, 6,375%, fällig 15.05.2029	3.053	0,28
3.660 Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc, 144 A 9,500%, fällig 31.07.2027	3.601	0,32	2.400 iHeartCommunications Inc, 144 A 4,750%, fällig 15.01.2028	2.481	0,22	1.000 Netflix Inc, 144 A 4,875%, fällig 15.06.2030	1.198	0,11
1.990 Endo Luxembourg Finance Co I Sarl / Endo US Inc, 144 A 6,125%, fällig 01.04.2029	1.973	0,18	1.120 IIP Operating Partnership LP, 144 A 5,500%, fällig 25.05.2026	1.177	0,11	3.820 NGPL PipeCo LLC, 144 A 7,768%, fällig 15.12.2037	5.515	0,50
1.000 Energy Transfer LP, 5,350%, fällig 15.05.2045	1.189	0,11	950 International Game Technology Plc, 144 A 5,250%, fällig 15.01.2029	1.015	0,09	1.620 NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC, 144 A 7,125%, fällig 01.04.2026	1.717	0,15
1.120 Entegris Inc, 144 A 4,375%, fällig 15.04.2028	1.186	0,11	1.490 Jazz Securities DAC, 144 A 4,375%, fällig 15.01.2029	1.546	0,14	1.420 NMI Holdings Inc, 144 A 7,375%, fällig 01.06.2025	1.608	0,14
300 Enterprise Products Operating LLC, 3,700%, fällig 31.01.2051	326	0,03	1.020 Kraft Heinz Foods Co, 5,500%, fällig 01.06.2050	1.363	0,12	900 Northern Oil and Gas Inc, 144 A 8,125%, fällig 01.03.2028	936	0,08
1.000 Enterprise Products Operating LLC, 3,950%, fällig 31.01.2060	1.115	0,10	800 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144 A 4,750%, fällig 15.06.2029	819	0,07	2.790 Northwest Acquisitions LLC / Dominion Finco Inc, 144 A 7,125%, fällig 01.11.2022 †∞	–	–
550 EQM Midstream Partners LP, 144 A 6,000%, fällig 01.07.2025	595	0,05	850 Las Vegas Sands Corp, 3,200%, fällig 08.08.2024	883	0,08	1.430 NRG Energy Inc, 144 A 3,625%, fällig 15.02.2031	1.457	0,13
600 EQM Midstream Partners LP, 144 A 6,500%, fällig 01.07.2027	670	0,06	70 Las Vegas Sands Corp, 2,900%, fällig 25.06.2025	72	0,01	2.440 Oasis Petroleum Inc, 144 A 6,375%, fällig 01.06.2026	2.550	0,23
1.000 EQT Corp, 6,625%, fällig 01.02.2025	1.147	0,10	600 Las Vegas Sands Corp, 3,500%, fällig 18.08.2026	631	0,06	600 Occidental Petroleum Corp, Zero coupon, fällig 10.10.2036	326	0,03
540 EQT Corp, 144 A 3,125%, fällig 15.05.2026	556	0,05	1.330 LD Holdings Group LLC, 144 A 6,125%, fällig 01.04.2028	1.309	0,12	500 Olin Corp, 5,000%, fällig 01.02.2030	537	0,05
1.220 EQT Corp, 7,500%, fällig 01.02.2030	1.587	0,14	1.000 Legacy LifePoint Health LLC, 144 A 4,375%, fällig 15.02.2027	999	0,09	1.210 ON Semiconductor Corp, 144 A 3,875%, fällig 01.09.2028	1.273	0,11
520 EQT Corp, 144 A 3,625%, fällig 15.05.2031	550	0,05	2.260 Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144 A 5,000%, fällig 01.02.2026	2.331	0,21	840 Pactiv LLC, 8,375%, fällig 15.04.2027	973	0,09
700 FirstEnergy Corp, Series B, 4,400%, fällig 15.07.2027	786	0,07	2.540 Liberty Interactive LLC, 8,500%, fällig 15.07.2029	2.907	0,26	2.842 Park-Ohio Industries Inc, 6,625%, fällig 15.04.2027	2.823	0,25
430 FirstEnergy Corp, Series C, 7,375%, fällig 15.11.2031	602	0,05	420 Liberty Interactive LLC, 8,250%, fällig 01.02.2030	473	0,04	1.750 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144 A 5,625%, fällig 15.10.2027	1.887	0,17
3.500 Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144 A 7,875%, fällig 15.11.2025	3.665	0,33	2.400 Madison IAQ LLC, 144 A 5,875%, fällig 30.06.2029	2.460	0,22	2.880 Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144 A 4,000%, fällig 15.06.2029	2.778	0,25
3.450 Ford Motor Co, 8,500%, fällig 21.04.2023	3.819	0,34	1.220 Match Group Holdings II LLC, 144 A 4,625%, fällig 01.06.2028	1.275	0,12	130 PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp, 144 A 9,250%, fällig 15.05.2025	126	0,01
1.060 Ford Motor Credit Co LLC, 5,125%, fällig 16.06.2025	1.165	0,11	880 MDC Holdings Inc, 6,000%, fällig 15.01.2043	1.135	0,10	1.900 Penn Virginia Escrow LLC, 144 A 9,250%, fällig 15.08.2026	1.850	0,17
350 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900%, fällig 16.02.2028	349	0,03	750 Michaels Cos Inc/The, 144 A 5,250%, fällig 01.05.2028	771	0,07	500 PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144 A 4,750%, fällig 15.02.2028	521	0,05
3.010 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000%, fällig 13.11.2030	3.179	0,29	1.950 Michaels Cos Inc/The, 144 A 7,875%, fällig 01.05.2029	2.012	0,18	550 PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144 A 7,750%, fällig 15.02.2029	605	0,05
2.120 Freeport Minerals Corp, 7,125%, fällig 01.11.2027	2.684	0,24	1.740 Midcap Financial Issuer Trust, 144 A 6,500%, fällig 01.05.2028	1.823	0,16	600 Plains All American Pipeline LP, Series B, 6,125%, Perpetual *	538	0,05
4.200 Freeport-McMoRan Inc, 5,450%, fällig 15.03.2043	5.376	0,48	900 Midcap Financial Issuer Trust, 144 A 5,625%, fällig 15.01.2030	897	0,08	2.900 PM General Purchaser LLC, 144 A 9,500%, fällig 01.10.2028	3.157	0,28
900 Gartner Inc, 144 A 3,625%, fällig 15.06.2029	928	0,08	1.070 Minerals Technologies Inc, 144 A 5,000%, fällig 01.07.2028	1.123	0,10	4.000 Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144 A 3,375%, fällig 31.08.2027	3.865	0,35
1.090 Gartner Inc, 144 A 3,750%, fällig 01.10.2030	1.142	0,10	1.110 Mohegan Gaming & Entertainment, 144 A 7,875%, fällig 15.10.2024	1.165	0,11	780 Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144 A 6,250%, fällig 15.01.2028	809	0,07
394 General Electric Co, 6,875%, fällig 10.01.2039	597	0,05	2.210 MPH Acquisition Holdings LLC, 144 A 5,750%, fällig 01.11.2028	2.113	0,19	2.030 QVC Inc, 5,450%, fällig 15.08.2034	2.172	0,20
910 GEO Group Inc/The, 5,125%, fällig 01.04.2023	866	0,08	2.850 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000%, fällig 15.10.2027	3.021	0,27	1.810 Rackspace Technology Global Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.02.2028	1.740	0,16
3.370 GEO Group Inc/The, 5,875%, fällig 15.10.2024	3.054	0,28	GBP 1.326 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692%, fällig 05.06.2028	1.955	0,18	1.700 Radiology Partners Inc, 144 A 9,250%, fällig 01.02.2028	1.825	0,16
527 GEO Group Inc/The, 6,000%, fällig 15.04.2026	446	0,04	400 MSCI Inc, 144 A 3,250%, fällig 15.08.2033	413	0,04	1.360 Range Resources Corp, 5,875%, fällig 01.07.2022	1.391	0,13
1.650 Granite Point Mortgage Trust Inc, 144 A 5,625%, fällig 01.12.2022	1.652	0,15	600 Navient Corp, 5,625%, fällig 01.08.2033	582	0,05	767 Range Resources Corp, 5,000%, fällig 15.08.2022	784	0,07
2.650 Granite US Holdings Corp, 144 A 11,000%, fällig 01.10.2027	2.948	0,27	3.200 NCL Corp Ltd, 144 A 12,250%, fällig 15.05.2024	3.780	0,34	404 Range Resources Corp, 5,000%, fällig 15.03.2023	415	0,04
1.940 H&E Equipment Services Inc, 144 A 3,875%, fällig 15.12.2028	1.951	0,18	1.690 NCL Corp Ltd, 144 A 10,250%, fällig 01.02.2026	1.954	0,18	1.350 Range Resources Corp, 4,875%, fällig 15.05.2025	1.399	0,13
470 Halozyme Therapeutics Inc, 144 A 0,250%, fällig 01.03.2027	430	0,04				3.410 Range Resources Corp, 9,250%, fällig 01.02.2026	3.733	0,34
1.380 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144 A 5,750%, fällig 20.01.2026	1.455	0,13						

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			440 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500%, fällig 01.03.2030	486	0,04	460 Verizon Communications Inc, 3,550%, fällig 22.03.2051	501	0,05
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			2.290 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875%, fällig 01.02.2031	2.494	0,22	1.040 Verizon Communications Inc, 3,700%, fällig 22.03.2061	1.146	0,10
1.440 Range Resources Corp, 144 A 8,250%, fällig 15.01.2029	1.600	0,14	420 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144 A 4,000%, fällig 15.01.2032	440	0,04	1.469 VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144 A 4,125%, fällig 15.08.2030	1.570	0,14
790 Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144 A 7,625%, fällig 15.06.2025	852	0,08	1.200 Tenet Healthcare Corp, 144 A 7,500%, fällig 01.04.2025	1.286	0,12	450 Viking Cruises Ltd, 144 A 7,000%, fällig 15.02.2029	456	0,04
1.120 Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144 A 0,250%, fällig 15.06.2026	1.122	0,10	600 Tenet Healthcare Corp, 144 A 5,125%, fällig 01.11.2027	632	0,06	3.116 Viper Energy Partners LP, 144 A 5,375%, fällig 01.11.2027	3.273	0,29
1.310 Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144 A 5,750%, fällig 15.01.2029	1.373	0,12	540 Tenet Healthcare Corp, 144 A 4,625%, fällig 15.06.2028	560	0,05	3.040 VOC Escrow Ltd, 144 A 5,000%, fällig 15.02.2028	3.010	0,27
1.190 Rent-A-Center Inc/TX, 144 A 6,375%, fällig 15.02.2029	1.284	0,12	500 Terminix Co LLC/The, 7,450%, fällig 15.08.2027	599	0,05	1.710 Wendy's International LLC, 7,000%, fällig 15.12.2025	1.929	0,17
1.240 Rocket Software Inc, 144 A 6,500%, fällig 15.02.2029	1.170	0,11	50 Time Warner Cable LLC, 6,550%, fällig 01.05.2037	68	0,01	730 Western Midstream Operating LP, 4,350%, fällig 01.02.2025	768	0,07
828 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144 A 11,500%, fällig 01.06.2025	954	0,09	220 Time Warner Cable LLC, 6,750%, fällig 15.06.2039	308	0,03	3.450 Western Midstream Operating LP, 5,450%, fällig 01.04.2044	3.928	0,35
1.895 RR Donnelley & Sons Co, 144 A 6,125%, fällig 01.11.2026	1.992	0,18	1.690 T-Mobile USA Inc, 4,750%, fällig 01.02.2028	1.807	0,16	1.780 Western Midstream Operating LP, 5,300%, fällig 01.03.2048	2.005	0,18
830 Scientific Games International Inc, 144 A 7,000%, fällig 15.05.2028	896	0,08	1.000 T-Mobile USA Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.04.2031	1.066	0,10	340 WeWork Cos Inc, 144 A 7,875%, fällig 01.05.2025	336	0,03
1.460 Sensata Technologies BV, 144 A 4,000%, fällig 15.04.2029	1.513	0,14	1.470 TopBuild Corp, 144 A 3,625%, fällig 15.03.2029	1.473	0,13	1.736 Williams Cos Inc/The, 8,750%, fällig 15.03.2032	2.692	0,24
510 Sensata Technologies Inc, 144 A 4,375%, fällig 15.02.2030	548	0,05	400 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,250%, fällig 15.05.2030	433	0,04	1.680 VVW International Inc, 144 A 4,500%, fällig 15.04.2029	1.663	0,15
1.930 Service Properties Trust, 5,500%, fällig 15.12.2027	2.071	0,19	2.360 TransDigm Inc, 144 A 6,250%, fällig 15.03.2026	2.481	0,22	2.830 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144 A 7,750%, fällig 15.04.2025	3.011	0,27
2.134 Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144 A 4,625%, fällig 01.11.2026	2.216	0,20	860 TransDigm Inc, 7,500%, fällig 15.03.2027	911	0,08	2.117 XPO CNV Inc, 6,700%, fällig 01.05.2034	2.555	0,23
1.590 Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 144 A 4,625%, fällig 01.03.2029	1.620	0,15	1.250 TransDigm Inc, 5,500%, fällig 15.11.2027	1.280	0,12	1.240 ZoomInfo Technologies LLC/ ZoomInfo Finance Corp, 144 A 3,875%, fällig 01.02.2029	1.251	0,11
1.900 Spirit Airlines Inc, 1,000%, fällig 15.05.2026	1.763	0,16	840 TransDigm Inc, 144 A 4,625%, fällig 15.01.2029	831	0,07	Sambia – 0,84 % (28. Februar 2021: 0,78 %)	428.281	38,58
1.548 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144 A 8,000%, fällig 20.09.2025	1.755	0,16	1.590 Triton Water Holdings Inc, 144 A 6,250%, fällig 01.04.2029	1.576	0,14	647 First Quantum Minerals Ltd, 144 A 7,500%, fällig 01.04.2025	671	0,06
860 Spotify USA Inc, 144 A Zero coupon, fällig 15.03.2026	779	0,07	1.760 Twitter Inc, 144 A 3,875%, fällig 15.12.2027	1.902	0,17	3.590 First Quantum Minerals Ltd, 144 A 6,875%, fällig 01.03.2026	3.756	0,34
3.610 Sprint Capital Corp, 8,750%, fällig 15.03.2032	5.534	0,50	630 Uniquify Inc, 144 A 6,000%, fällig 15.06.2024 / 632 0,06			4.560 First Quantum Minerals Ltd, 144 A 6,875%, fällig 15.10.2027	4.942	0,44
2.090 SRM Escrow Issuer LLC, 144 A 6,000%, fällig 01.11.2028	2.218	0,20	243 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875%, fällig 15.01.2026	256	0,02	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 568,754 USD)	598.819	53,94
2.960 StoneMor Inc, 144 A 8,500%, fällig 15.05.2029	3.031	0,27	340 United Airlines Inc, 144 A 4,375%, fällig 15.04.2026	353	0,03	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen - 11,11 % (28. Februar 2021: 10,34 %)		
870 Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 144 A 5,000%, fällig 01.06.2031	898	0,08	640 United Airlines Inc, 144 A 4,625%, fällig 15.04.2029	665	0,06	Argentinien – 0,79 % (28. Februar 2021: 0,48 %)		
1.370 Sunnova Energy Corp, 144 A 5,875%, fällig 01.09.2026	1.382	0,12	730 United Rentals North America Inc, 5,500%, fällig 15.05.2027	771	0,07	28 Argentine Republic Government International Bond, 1,000%, fällig 09.07.2029	11	-
1.500 Switch Ltd, 144 A 3,750%, fällig 15.09.2028	1.528	0,14	4.700 United Rentals North America Inc, 5,250%, fällig 15.01.2030	5.158	0,46	147 Argentine Republic Government International Bond, 0,500%, fällig 09.07.2030	58	-
1.050 Switch Ltd, 144 A 4,125%, fällig 15.06.2029	1.085	0,10	2.170 Univision Communications Inc, 144 A 9,500%, fällig 01.05.2025	2.368	0,21	270 Argentine Republic Government International Bond, 1,125%, fällig 09.07.2035	95	0,01
630 Talen Energy Supply LLC, 144 A 7,250%, fällig 15.05.2027	546	0,05	1.300 US Renal Care Inc, 144 A 10,625%, fällig 15.07.2027	1.366	0,12	1.600 Ciudad Autonoma De Buenos Aires/Government Bond s, 7,500%, fällig 01.06.2027	1.470	0,13
1.360 Talen Energy Supply LLC, 144 A 6,625%, fällig 15.01.2028	1.169	0,11	880 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144 A 4,125%, fällig 15.08.2031	924	0,08	637 Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 0,000%, fällig 26.01.2022e	359	0,03
200 Talen Energy Supply LLC, 144 A 7,625%, fällig 01.06.2028	173	0,02	790 Vericast Corp, 144 A 11,000%, fällig 15.09.2026	840	0,08	1.770 Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 0,000%, fällig 09.06.2022e	997	0,09
1.080 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144 A 6,000%, fällig 31.12.2030	1.100	0,10	630 Vericast Corp/Harland Clarke/ Checks in the Mail/ Valassis Comm/Valassis Direct, 144 A 13,000%, fällig 15.10.2027	701	0,06	1.190 Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 0,000%, fällig 09.06.2022e	671	0,06
160 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 6,875%, fällig 15.01.2029	180	0,02	330 Verizon Communications Inc, 3,400%, fällig 22.03.2041	354	0,03			
			780 Verizon Communications Inc, 4,522%, fällig 15.09.2048	982	0,09			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts					
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)						Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 124.945 USD)							
Argentinien (Fortsetzung)			IDR 721.000	Indonesias Treasury Bond, Series FR68X 8,375%, fällig 15.03.2034	58	30.909	2,78	123.317	11,11				
5.190	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144 A 6,500%, fällig 15.02.2023	0,25	Israel – 0,19 % (28. Februar 2021: 0,18 %)			Schuldverschreibungen – 8,95 % (28. Februar 2021: 8,83 %)							
1.200	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144 A 9,125%, fällig 16.03.2024	0,06	1.140	Israel Government International Bond, 2,750%, fällig 03.07.2030	1.229	0,11	430	8th Avenue Food & Provisions Inc, 7,839%, fällig 01.10.2026 *	427	0,04			
580	Provincia de Buenos Aires/ Government Bonds, 144 A 7,875%, fällig 15.06.2027	0,03	760	State of Israel, 3,375%, fällig 15.01.2050	831	0,08	195	Academy Ltd, 4,500%, fällig 06.11.2027 *	195	0,02			
2.115	Provincia de Cordoba, 144 A 5,000%, fällig 01.06.2027	0,13	Japan – 0,08 % (28. Februar 2021: 0,08 %)			830			Acrisure LLC, 3,607%, fällig 15.02.2027 *	817	0,07		
			1.449		0,13	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 21X 0,100%, fällig 10.03.2026			353	0,03			
			8.812		0,79	92.200	867	0,08	733	Allied Universal Holdco LLC, 4,250%, fällig 14.05.2028 *	734	0,07	
Brasilien – 0,67 % (28. Februar 2021: 0,83 %)						Kasachstan – 0,28 % (28. Februar 2021: 0,27 %)							
BRL 10.051	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000%, fällig 01.01.2027	0,18	2.660	Kazakhstan Government International Bond, 5,125%, fällig 21.07.2025	3.084	0,28	Mexiko – 0,82 % (28. Februar 2021: 0,79 %)						
BRL 2.800	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000%, fällig 01.01.2029	0,05	Mexiko – 0,82 % (28. Februar 2021: 0,79 %)			58.000			Mexican Bonos, Series M 20X 8,500%, fällig 31.05.2029	3.164	0,28		
4.960	Brazilian Government International Bond, 5,000%, fällig 27.01.2045	0,44	530	Mexico Government International Bond, 2,659%, fällig 24.05.2031	528	0,05	1.260			AMC Entertainment Holdings Inc, 4,080%, fällig 22.04.2026 *	1.123	0,10	
			7.395		0,67	4.800	Mexico Government International Bond, 4,750%, fällig 08.03.2044	5.423	0,49	530	Amentum Government Services Holdings, 3,593%, fällig 31.01.2028 *	530	0,05
Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 0,25 % (28. Februar 2021: 0,26 %)						Panama – 0,20 % (28. Februar 2021: 0,16 %)							
EUR 560	Ivory Coast Government International Bond, 144 A 4,875%, fällig 30.01.2032	0,06	1.900	Panama Government International Bond, 4,500%, fällig 01.04.2056	2.179	0,20	Peru – 0,22 % (28. Februar 2021: 0,23 %)						
491	Ivory Coast Government International Bond, 5,750%, fällig 31.12.2032	0,05	Peru – 0,22 % (28. Februar 2021: 0,23 %)			2.400			Peruvian Government International Bond, 2,783%, fällig 23.01.2031	2.458	0,22		
1.460	Ivory Coast Government International Bond, 6,125%, fällig 15.06.2033	0,14	Katar – 0,43 % (28. Februar 2021: 0,38 %)			1.800			Qatar Government International Bond, 144 A 5,103%, fällig 23.04.2048	2.429	0,22		
			2.781		0,25	1.800	Qatar Government International Bond, 144 A 4,817%, fällig 14.03.2049	2.357	0,21	4.786	0,43		
Ägypten – 0,15 % (28. Februar 2021: 0,15 %)						Russland – 1,58 % (28. Februar 2021: 1,52 %)							
1.490	Egypt Government International Bond, 144 A 7,600%, fällig 01.03.2029	0,15	1.260.672	Russian Federal Bond OFZ, Series 6212X 7,050%, fällig 19.01.2028	17.495	1,58	Vereinigte Arabische Emirate – 0,20 % (28. Februar 2021: 0,17 %)						
Deutschland – 0,10 % (28. Februar 2021: 0,00 %)						1.870			Abu Dhabi Government International Bond, 144 A 4,125%, fällig 10.10.2047	2.256	0,20		
EUR 900	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, fällig 15.08.2026	0,10	Vereinigte Staaten – 2,12 % (28. Februar 2021: 1,98 %)			17.510			United States Treasury Note/Bond, 0,125%, fällig 31.07.2023	17.491	1,57		
Ghana – 0,25 % (28. Februar 2021: 0,24 %)						3.910			United States Treasury Note/Bond, 1,125%, fällig 15.02.2031	3.858	0,35		
470	Ghana Government International Bond, 8,125%, fällig 18.01.2026	0,04	520	United States Treasury Note/Bond, 1,625%, fällig 15.05.2031	536	0,05	1.270			City Brewing Co LLC, 4,250%, fällig 31.03.2028 *	1.268	0,11	
770	Ghana Government International Bond, 144 A 7,625%, fällig 16.05.2029	0,07	120	United States Treasury Note/Bond, 2,250%, fällig 15.05.2041	128	0,01	1.345			Claros Global LP, 3,342%, fällig 30.04.2026 *	1.333	0,12	
1.530	Ghana Government International Bond, 144 A 8,125%, fällig 26.03.2032	0,14	930	United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 15.08.2050	814	0,07	1.197			Claros Mortgage Trust, Inc., 6,000%, fällig 09.08.2026 *	1.201	0,11	
			2.803		0,25	760	United States Treasury Note/Bond, 1,875%, fällig 15.02.2051	751	0,07	2.780	ClubCorp Holdings Inc, 2,897%, fällig 10.09.2024 *	2.621	0,24
Indonesien – 2,78 % (28. Februar 2021: 2,62 %)						Vereinigte Staaten – 2,12 % (28. Februar 2021: 1,98 %)							
360	Indonesia Government International Bond, 5,875%, fällig 15.01.2024	0,04	17.510			United States Treasury Note/Bond, 0,125%, fällig 31.07.2023			17.491			1,57	
2.020	Indonesia Government International Bond, 3,500%, fällig 11.01.2028	0,20	3.910			United States Treasury Note/Bond, 1,125%, fällig 15.02.2031			3.858			0,35	
1.590	Indonesia Government International Bond, 6,625%, fällig 17.02.2037	0,20	520			United States Treasury Note/Bond, 1,625%, fällig 15.05.2031			536			0,05	
3.790	Indonesia Government International Bond, 5,250%, fällig 17.01.2042	0,43	120			United States Treasury Note/Bond, 2,250%, fällig 15.05.2041			128			0,01	
IDR37.154.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR56X 8,375%, fällig 15.09.2026	0,27	930			United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 15.08.2050			814			0,07	
IDR239.961.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR59X 7,000%, fällig 15.05.2027	1,64	760			United States Treasury Note/Bond, 1,875%, fällig 15.02.2051			751			0,07	
IDR 763.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR87X 6,500%, fällig 15.02.2031	55	23.578						2,12				

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			1.320 Project Sky Merger Sub, Inc., 0,000%, fällig 10.08.2029 *	1.320	0,12	Summe Vorzugsaktien (Kosten 8.907 USD)		
933 DCert Buyer, Inc., 4,092%, fällig 16.10.2026 *	932	0,08	1.840 Proofpoint, Inc., 0,000%, fällig 10.06.2028 *	1.831	0,17	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.072.095 USD)		
604 Deerfield Dakota Holding LLC, 4,750%, fällig 05.03.2027 *	606	0,05	2.030 Radiology Partners Inc, 4,357%, fällig 09.07.2025 *	2.021	0,18	1.100.230	99,10	
618 Doosan Bobcat, 2,397%, fällig 18.05.2024 *	617	0,05	8 Radnet Management Inc, 4,750%, fällig 01.07.2023 *	9	–	Kontrakte (in Tsd.)		
253 Entercom Media Corp, 2,588%, fällig 17.11.2024 *	250	0,02	284 Redstone Holdco 2 LP, 5,500%, fällig 27.04.2028 *	284	0,03	Gekaufte Optionen – 0,08 % (28. Februar 2021: 0,08 %)		
653 Equinix Holdings Inc, 10,000%, fällig 08.03.2024 *	658	0,06	726 Redstone Holdco 2 LP, 5,500%, fällig 16.04.2028 *	726	0,07	- S&P 500 E-mini September 2021		
1.300 Eyecare Partners LLC, 8,357%, fällig 21.01.2027 *	1.290	0,12	472 RegionalCare Hospital Partners Holding, 3,842%, fällig 16.11.2025 *	470	0,04	Put 3.850,00X fällig 17.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch		
964 Eyecare Partners LLC, 3,857%, fällig 05.02.2027 *	956	0,09	1.150 Royal Caribbean Cruises Ltd, 0,000%, fällig 05.04.2022 *	1.121	0,10	18	–	
1.686 First Brands Group LLC, 6,000%, fällig 24.03.2027 *	1.703	0,15	1.411 Scientific Games International Inc, 2,842%, fällig 14.08.2024 *	1.401	0,13	- S&P 500 E-mini September 2021		
2.164 Focus Financial Partners LLC, 2,092%, fällig 03.07.2024 *	2.146	0,19	146 Seattle SpinCo Inc, 2,842%, fällig 18.04.2024 *	145	0,01	Put 3.900,00X fällig 17.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch		
EUR 790 Froneri Lux FinCo SARL, 2,375%, fällig 30.01.2027 *	916	0,08	428 Sedgwick Claims Management Services Inc, 5,250%, fällig 03.09.2026 *	430	0,04	26	–	
1.054 Froneri U.S. Inc, 2,342%, fällig 30.01.2027 *	1.040	0,10	975 Sedgwick Claims Management Services Inc, 3,342%, fällig 05.11.2025 *	963	0,09	- S&P 500 E-mini W3 November 2021		
948 Gannett Holdings LLC, 7,750%, fällig 08.02.2026 *	958	0,09	910 Sovos Brands, 5,000%, fällig 03.06.2028 *	913	0,08	155	0,01	
648 Garda World Security Corp, 4,340%, fällig 30.10.2026 *	648	0,06	1.119 Surf Holdings LLC, 3,675%, fällig 14.10.2026 *	1.111	0,10	Put 4.000,00X fällig 19.11.2021 – Bank of America Merrill Lynch		
249 Global Medical Response, Inc, 5,750%, fällig 24.09.2025 *	251	0,02	300 Triton Water Holdings, Inc., 4,000%, fällig 16.03.2028 *	298	0,03	74	0,01	
310 Global Tel'Link Corp, 8,342%, fällig 29.11.2026 *	268	0,02	2.378 U.S. Renal Care Inc, 5,125%, fällig 14.06.2026 *	2.381	0,21	- S&P 500 E-mini W3 Oktober 2021		
1.298 Global Tel'Link Corp, 4,342%, fällig 29.11.2025 *	1.207	0,11	2 UFC Holdings LLC, 3,500%, fällig 29.04.2026 *	2	–	Put 3.900,00X fällig 15.10.2021 – Bank of America Merrill Lynch		
2.010 Greystone Select Financial, 5,750%, fällig 06.05.2028 *	2.020	0,18	369 United Airlines Inc, 4,500%, fällig 14.04.2028 *	370	0,03	58	0,01	
630 Hayward Industries Inc., 3,250%, fällig 14.05.2028 *	628	0,06	1.124 Univision Communications Inc, 4,000%, fällig 24.03.2026 *	1.123	0,10	- S&P 500 E-mini W3 Oktober 2021		
2.682 ICON Luxembourg S.a.r.l., 3,000%, fällig 01.07.2028 *	2.683	0,24	1.234 USI Inc, 3,147%, fällig 16.05.2024 *	1.224	0,11	74	0,01	
1.098 iHeartCommunications Inc, 3,092%, fällig 01.05.2026 *	1.090	0,10	49 VFH Parent LLC, 3,088%, fällig 01.03.2026 *	49	–	Put 4.000,00X fällig 15.10.2021 – Bank of America Merrill Lynch		
668 Indigo Merger Sub, Inc., 3,000%, fällig 01.07.2028 *	668	0,06	800 Virgin Media Bristol LLC, 2,595%, fällig 04.01.2028 *	793	0,07	55	–	
1.130 Ineos U.S. Petrochemical, 3,250%, fällig 21.01.2026 *	1.128	0,10	900 Virgin Pulse Inc, 4,750%, fällig 30.03.2028 *	901	0,08	8.895 USD Call/JPY Put 115,20X fällig 11.11.2021 – Morgan Stanley		
900 Jazz Financing Lux S.a.r.l., 4,000%, fällig 22.04.2028 *	901	0,08	1.641 WP CityMD Bidco LLC, 4,500%, fällig 13.08.2026 *	1.649	0,15	4	–	
178 Leslie's Poolmart Inc, 3,250%, fällig 08.03.2028 *	178	0,02	5 WP CPP Holdings LLC, 4,750%, fällig 30.04.2025 *	5	–	2.590 USD Put/AUD Call 0,7270X fällig 23.11.2021 – Goldman Sachs		
670 LRS Holdings LLC, 0,000%, fällig 12.08.2028 *	671	0,06	1.000 Ziggo BV, 2,595%, fällig 15.04.2028*	991	0,09	53	–	
650 LTR Intermediate Holdings, Inc., 5,500%, fällig 23.04.2028 *	652	0,06	Summe Schuldverschreibungen (Kosten 98.792 USD)			89	0,01	
22 MA FinanceCo. LLC, 2,842%, fällig 18.04.2024 *	21	–	Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,72 % (28. Februar 2021: 1,75 %)			10.320 USD Put/NOK Call 8,6020X fällig 101.10.2021 – Morgan Stanley		
960 Madison IAQ LLC, 3,750%, fällig 16.06.2028 *	955	0,09	94 Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US\$ Distributing (M)	9.723	0,88	94	0,01	
3.220 Michaels Cos Inc/The, 5,000%, fällig 08.04.2028 *	3.226	0,29	EUR 74 Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	9.336	0,84	Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 17.427 USD)		
824 Mister Car Wash, 3,088%, fällig 14.05.2026 *	820	0,07	Vorzugsaktien – 0,83 % (28. Februar 2021: 0,78 %)			Vereinigte Staaten – 0,83 % (28. Februar 2021: 0,78 %)		
1.946 Monitronics International Inc, 7,750%, fällig 29.03.2024 *	1.891	0,17	24 B Riley Financial Inc 600 0,05			24 B Riley Financial Inc 600 0,05		
3.220 One Call Corp, 6,250%, fällig 07.04.2027 *	3.248	0,29	27 B Riley Financial Inc 692 0,06			27 B Riley Financial Inc 692 0,06		
2.863 Option Care Health Inc, 3,842%, fällig 06.08.2026 *	2.861	0,26	70 MPLX LP, Series A∞			2.497 0,23		
948 Particle Investments S.a.r.l., 5,750%, fällig 11.05.2027 *	953	0,09	5 Targa Resources Corp, Series A			5.490 0,49		
860 Peraton Corporation, 4,500%, fällig 22.02.2028 *	861	0,08				9.279 0,83		
531 Phoenix Guarantor Inc, 3,339%, fällig 05.03.2026 *	526	0,05						
980 Planview Parent Inc, 4,750%, fällig 18.12.2027 *	984	0,09						
486 Playa Resorts Holding BV, 3,750%, fällig 27.04.2024 *	469	0,04						
202 Precision Medicine Group LLC, 3,750%, fällig 20.11.2027 *	201	0,02						
1.540 Precision Medicine Group LLC, 3,750%, fällig 20.11.2027 *	1.534	0,14						

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	*
Gekaufte Optionen – (Fortsetzung)						
2.590 USD			- S&P 500 E-mini W3 Oktober 2021			
Put/NZD Call 0,6955X fällig 23.11.2021 – Goldman Sachs	67	0,01	Put 3.700,00X fällig 15.10.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(40)	-	
6.460 USD			(6.370) USD Put/MXN Call 19.5848X fällig 29.09.2021 – Citi	(9)	-	
Put/NZD Call 0,6963X fällig 22.11.2021 – Citi	159	0,01				
Summe gekaufte Optionen (Kosten 2.230 USD)	937	0,08	Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten (952) USD)	(157)	(0,01)	
Zinsswaps – 0,42 % (28. Februar 2021: 0,67 %)			Credit Default Swaps – (0,10 %) (28. Februar 2021: (0,09 %))			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	4.668	0,42	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.135)	(0,10)	
Devisenterminkontrakte – 0,06 % (28. Februar 2021: 2,05 %)			Zinsswaps – (0,05 %) (28. Februar 2021: (0,07 %))			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	698	0,06	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(577)	(0,05)	
Futures – 0,06 % (28. Februar 2021: 0,19 %)			Devisenterminkontrakte – (0,86 %) (28. Februar 2021: (0,09%))			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	686	0,06	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(9.562)	(0,86)	
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	1.107.219	99,72	Futures – (0,06 %) (28. Februar 2021: (0,20%))			
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(692)	(0,06)	
Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(12.123)	(1,08)	
Verkaufte Optionen – (0,01 %) (28. Februar 2021: (0,08 %))			Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.095.096	98,64	
- S&P 500 E-mini September 2021			Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	15.125	1,36	
Put 3.600,00X fällig 17.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(14)	-	Gesamtnettvermögen	\$1.110.221	100,00	
- S&P 500 E-mini September 2021						
Put 3.700,00X fällig 17.09.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(7)	-				
- S&P 500 E-mini W3 November 2021						
Put 3.600,00X fällig 19.11.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(70)	(0,01)				
- S&P 500 E-mini W3 Oktober 2021						
Put 3.500,00X fällig 15.10.2021 – Bank of America Merrill Lynch	(17)	-				

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

† Illiquid.

∞ Das Wertpapier wurde vom Manager oder dem jeweiligen Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.

ε Die Sicherheit ist zum 31. August 2021 (entweder Hauptsumme und/oder Zinsen) voreingestellt.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihenzins entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

ABKÜRZUNGEN:

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

Analyse des Gesamtvermögens

	% von Gesamt Vermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	86,92
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	8,80
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,69
Finanzderivate	0,62
Sonstige Vermögenswerte	1,97
Gesamtvermögen	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 560.122.000 USD und machten 50,46 % des Nettovermögens aus.

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzinheit	Kaufs/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000%	Kauf	20.06.2026	11.523	\$ (1.135)
Nicht realisierter Wertzuwachs von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): - USD)					\$ -
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (982) USD)					(1.135)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (982) USD)					\$ (1.135)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	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	\$ 343
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,450%	18.07.2029	170.990	376
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,440%	20.07.2029	178.050	386
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,560%, Receive Floating USD SOFR Compound	20.07.2045	14.690	2.557
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,740%, Receive Floating USD SOFR Compound	19.08.2045	2.060	282
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,000%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	4.649	682
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,600%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	2.527	42
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,729%, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2047	121	(9)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,000%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	282	(20)
Citi	Pay Floating BRL CDI CETIP, Receive Fixed 7,024%	04.01.2027	9.829	(76)
Citi	Pay Floating BRL CDI CETIP, Receive Fixed 7,024%	04.01.2027	9.200	(71)
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024%	04.01.2027	7.800	(60)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 6,870%	04.01.2027	32.130	(293)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,044%	04.01.2027	6.400	(48)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 7.272 USD)				\$ 4.668
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (802) USD)				(577)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (6.470) USD)				\$ 4.091

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	CHF	–	\$ –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	128	Verkauf	EUR	109	(1)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	111	Verkauf	GBP	81	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	237	Verkauf	GBP	171	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	198	Verkauf	USD	272	1
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	679.722	Verkauf	USD	942.266	(7.707)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	143.586	Verkauf	USD	105.585	(534)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CHF	47	Verkauf	USD	51	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	52.372	Verkauf	USD	61.611	248
30.09.2021	Citi	Kauf	MXN	35.621	Verkauf	USD	1.770	(4)
12.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	3.922	Verkauf	NOK	34.408	(36)
18.10.2021	Citi	Kauf	USD	–	Verkauf	INR	2	–
19.10.2021	BNP Paribas	Kauf	USD	1.895	Verkauf	CAD	2.390	1
19.10.2021	BNP Paribas	Kauf	USD	6.723	Verkauf	EUR	5.660	33
19.10.2021	BNP Paribas	Kauf	EUR	2.300	Verkauf	USD	2.724	(6)
19.10.2021	Citi	Kauf	USD	147	Verkauf	MXN	2.980	(1)
19.10.2021	Citi	Kauf	CAD	9.724	Verkauf	USD	7.742	(35)
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	4.679	Verkauf	GBP	3.380	31
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.525	Verkauf	MXN	30.770	3
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	GBP	540	Verkauf	USD	740	3
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	MXN	62.040	Verkauf	USD	3.036	32
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	CAD	5.720	Verkauf	USD	4.608	(75)
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	1	Verkauf	ZAR	12	–
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	16.287	Verkauf	IDR	240.362.624	(543)
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	865	Verkauf	JPY	94.912	2
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	AUD	17.559	Verkauf	USD	13.170	(321)
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	3.736	Verkauf	BRL	19.641	(35)
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	22.205	Verkauf	EUR	18.670	138
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	667	Verkauf	MXN	13.480	–
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	35	Verkauf	NZD	50	–
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	6.218	Verkauf	RUB	471.968	(181)
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	RUB	24.490	Verkauf	USD	326	6
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	CAD	2.390	Verkauf	USD	1.906	(11)
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	AUD	2.200	Verkauf	USD	1.610	–
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	NOK	222.104	Verkauf	USD	25.421	124
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	CAD	2.220	Verkauf	USD	1.749	11
23.11.2021	Citi	Kauf	USD	2.385	Verkauf	NZD	3.488	(72)
23.11.2021	Morgan Stanley	Kauf	NZD	3.230	Verkauf	USD	2.212	63
13.01.2022	JP Morgan	Kauf	USD	8.538	Verkauf	SAR	32.040	2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 22.104 USD)						\$	698	
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (949) USD)							(9.562)	
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 21.155 USD)						\$	(8.864)	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro\$ Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(105)	\$(26.204)	\$ (16)
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	298	73.781	75
Australia 10 Year Bond September 2021	Bank of America Merrill Lynch	46	4.907	170
Euro-Bund Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(36)	(7.334)	26
Euro-Bund September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(43)	(8.908)	(220)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(2)	(502)	(34)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(1.545)	(206.185)	266
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	5	740	3
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	1.098	241.920	146
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(100)	(12.372)	(29)
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(218)	(35.527)	(110)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	428	84.436	(283)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 2.034 USD)				\$ 686
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (2.125) USD)				(692)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (91) USD)				\$ (6)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Forderungenbesicherte Wertpapiere – 16,90 % (28. Februar 2021: 14,45 %)			1.888			10.796		
1.190 Accredited Mortgage Loan Trust 2005-1X Series 2005 1X Class M5X 3,384%, fällig 25.04.2035 *	1.235	0,10	1.138 CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-B, Series 2004 B, Class 2A, 0,316%, fällig 15.02.2029 *	2.029	0,17	1.865 National Collegiate Student Loan Trust 2006-1X Series 2006 1X Class A5X 0,434%, fällig 25.03.2033 *	1.826	0,16
4.560 Aegis Asset Backed Securities Trust 2005-3X Series 2005 3X Class M3X 0,819%, fällig 25.08.2035 *	4.222	0,36	292 CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-J, Series 2004 J, Class 1A, 0,386%, fällig 15.12.2033 *	1.081	0,09	2.500 National Collegiate Student Loan Trust 2006-3X Series 2006 3X Class B, 0,444%, fällig 26.01.2032 *	2.069	0,18
29 AFC Trust Series 2000-3X Series 2000 3X Class 1A, 144 A 0,834%, fällig 25.10.2030 *	28	-	1.930 Dividend Solar Loans 2018-1 LLC, Series 2018 1X Class D, 144 A 6,390%, fällig 20.07.2038	286	0,02	6.675 National Collegiate Student Loan Trust 2006-4X Series 2006 4X Class A4X 0,394%, fällig 25.05.2032 *	6.510	0,55
2.218 Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2019 1A, Class A2I, 144 A 4,194%, fällig 07.06.2049	2.265	0,19	3.810 Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Series 2018 2X Class D, 144 A 5,910%, fällig 20.12.2038	2.049	0,17	5.987 National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A5X Class 10, 144 A 0,000%, fällig 25.03.2038 *	1.830	0,16
11.910 Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2019 1A, Class A2II, 144 A 4,723%, fällig 07.06.2049	12.670	1,08	4.869 Fieldstone Mortgage Investment Trust Series 2005-2X Series 2005 2X Class M3X 0,864%, fällig 25.12.2035 *	3.931	0,33	6.140 National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A6X Class 10, 144 A 0,000%, fällig 25.03.2038 *	1.892	0,16
4.210 Asset Backed Securities Corp Home Equity Loan Trust Series OOMC 2006-HE5X Series 2006 HE5X Class M1X 0,364%, fällig 25.07.2036 *	3.927	0,33	5 First Franklin Mortgage Loan Trust 2002-FF1X Series 2002 FF1X Class 1A2X 1,221%, fällig 25.04.2032 *	4.774	0,41	9.776 NRZ Excess SpreadCollateralized Notes, Series 2021 FH1X Class A, 144 A 3,104%, fällig 25.07.2026	9.755	0,83
8.500 Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2020 1A, Class D, 144 A 3,340%, fällig 20.08.2026	8.553	0,73	7.114 Fremont Home Loan Trust 2006-B, Series 2006 B, Class 1A, 0,234%, fällig 25.08.2036 *	5	-	1.696 Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1X Series 2007 FXD1X Class 3A4X 5,860%, fällig 25.01.2037	1.730	0,15
2.390 BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Series 1996 1X Class B1X 7,875%, fällig 10.10.2026	228	0,02	2.750 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4X Series 2021 4GS, Class C, 144 A 3,500%, fällig 20.07.2048	3.500	0,30	1.026 Ownit Mortgage Loan Trust Series 2005-3X Series 2005 3X Class M1X 0,759%, fällig 25.06.2036 *	1.015	0,09
849 Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Series 2007 B, Class 1A2X 6,831%, fällig 28.08.2047	840	0,07	4.773 HERO Funding Trust 2016-1X Series 2016 1A, Class R, 144 A 0,000%, fällig 20.09.2041	2.740	0,23	1.350 PFGA Home Equity Investment Trust, Series 2003 IFC6X Class A, 144 A 4,669%, fällig 22.04.2035 *	1.362	0,12
1.244 Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Series 2007 B, Class 1A3X 7,219%, fällig 28.08.2047	484	0,04	1.195 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1X Class C, 144 A 1,796%, fällig 16.06.2036 *	1.199	0,10	2.542 Popular ABS Mortgage PassThrough Trust 2005-2X Series 2005 2X Class M2X 3,969%, fällig 25.04.2035	2.145	0,18
138 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1X Series 2005 CL1X Class A1X 0,500%, fällig 25.09.2034 *	133	0,01	1.190 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1X Class D, 144 A 2,446%, fällig 16.06.2036 *	1.195	0,10	2.562 Popular ABS Mortgage PassThrough Trust 2005-5X Series 2005 5X Class MV2X 0,714%, fällig 25.11.2035 *	2.389	0,20
3.764 Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1X Series 2016 1A, Class B, 144 A 5,682%, fällig 16.12.2041	3.704	0,31	500 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1X Class E, 144 A 3,046%, fällig 16.06.2036 *	502	0,04	4.135 RASC Series 2005-KS12 Trust, Series 2005 KS12X Class M4X 1,044%, fällig 25.01.2036 *	4.062	0,34
4.117 Citigroup Mortgage Loan Trust Inc, Series 2006 WFH2X Class M3X 0,549%, fällig 25.08.2036 *	4.051	0,34	2.650 Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2005-B, Series 2005 B, Class M6X 1,149%, fällig 25.08.2035 *	2.649	0,22	3.900 RASC Series 2006-KS2 Trust, Series 2006 KS2X Class M3X 0,699%, fällig 25.03.2036 *	3.829	0,33
2.025 Citigroup Mortgage Loan Trust Series 2004-OPT1Asset Backed Pass-Through Certifi, Series 2004 OPT1X Class MSX 1,659%, fällig 25.10.2034 *	1.990	0,17	1.700 KeyCorp Student Loan Trust 2004-A, Series 2004 A, Class 1B, 0,559%, fällig 27.01.2043 *	1.618	0,14	3.000 Saxon Asset Securities Trust 2005-3X Series 2005 3X Class M4X 0,984%, fällig 25.11.2035 *	2.851	0,24
5.630 Consec Finance Securitizations Corp, Series 2000 3X Class A, 144 A 8,260%, fällig 01.12.2030 *	2.131	0,18	7.910 KeyCorp Student Loan Trust 2005-A, Series 2005 A, Class 2C, 1,446%, fällig 27.12.2038 *	7.642	0,65	5.435 Saxon Asset Securities Trust 2006-2X Series 2006 2X Class M2X 0,384%, fällig 25.09.2036 *	5.158	0,44
987 Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2007 SD1X Class A1X 144 A 0,984%, fällig 25.03.2047 *	877	0,07	2.520 Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Series 2021 2GS, Class C, 144 A 3,500%, fällig 20.03.2048	2.413	0,21	7.680 SLM Student Loan Trust 2004-10X Series 2004 10X Class B, 0,495%, fällig 25.01.2040 *	7.172	0,61
2.177 Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC, Series 2007 MX1X Class A4X 144 A 6,231%, fällig 25.12.2036	2.255	0,19	41 Long Beach Mortgage Loan Trust 2002-2X Series 2002 2X Class M2X 1,889%, fällig 25.07.2032 *	41	-	120 SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F LLC, Series 2017 F, Class R1X 144 A 0,000%, fällig 25.01.2041	3.275	0,28
4.373 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1X Class B1X 144 A 3,003%, fällig 25.07.2057 *	4.294	0,36	4.849 Magnolia Finance, 0,000%, fällig 09.08.2024 ∞	4.635	0,39	1 Southern Pacific Secured Asset Corp, Series 1998 1X Class A7X 6,510%, fällig 25.12.2027 *	1	-
5.017 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1X Class B2X 144 A 3,003%, fällig 25.07.2057 *	4.624	0,39	118 Mastr Specialized Loan Trust, Series 2006 2X Class A, 144 A 0,604%, fällig 25.02.2036 *	116	0,01	3.280 Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, Series 2005 9XS, Class M2X 1,059%, fällig 25.06.2035 *	3.025	0,26
4.266 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1X Class B3X 144 A 3,003%, fällig 25.07.2057 *	3.303	0,28	5 Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust Series 2003-SD1X Series 2003 SD1X Class A1X 1,084%, fällig 25.03.2033 *	5	-	3.197 Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-WF4X Series 2005 WF4X Class M8X 2,709%, fällig 25.11.2035 *	3.273	0,28
4.590 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1X Class B4X 144 A 3,003%, fällig 25.07.2057 *	899	0,08	1.450 Mosaic Solar Loan Trust 2018-1X Series 2018 1A, Class CERT, 144 A 0,000%, fällig 22.06.2043∞	806	0,07			
			3.000 National Collegiate II Commutation Trust, Series 2005 AR15X Class AR15X 0,000%, fällig 01.06.2045	575	0,05			

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			5.579			4.500		
1.849 Structured Asset Securities Corp Trust 2005-SC1X Series 2005 SC1X Class 1A1X 144 A 0,354%, fällig 25.05.2031 *	1.415	0,12	2016-RRGG10X Series 2016 GG10X Class AJA, 144 A 6,024%, fällig 10.08.2045 *	2.539	0,22	BX Trust 2018-GW MZ, Series 2018 GWMZ, Class MC, 144 A 5,583%, fällig 15.05.2037 *	4.198	0,36
5.290 Sunnova Sol Issuer LLC, Series 2020 1A, Class B, 144 A 5,540%, fällig 01.02.2055	5.505	0,47	8.244 Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3X Series 2017 BNK3X Class E, 144 A 4,684%, fällig 15.02.2050 *	6.844	0,58	1.750 BX Trust 2018-GW, Series 2018 GW, Class G, 144 A 3,016%, fällig 15.05.2035 *	1.751	0,15
3.900 Towd Point Mortgage Trust 2018-2X Series 2018 2X Class B2X 144 A 3,311%, fällig 25.03.2058 *	4.073	0,35	2.796 Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Series 2015 R4X Class 4A2X 144 A 4,500%, fällig 27.01.2030 *	2.916	0,25	2.250 BX Trust 2021-VIEW, Series 2021 VIEW, Class D, 144 A 2,996%, fällig 15.06.2023 *	2.257	0,19
7.118 Towd Point Mortgage Trust 2018-4X Series 2018 4X Class B2X 144 A 3,293%, fällig 25.06.2058 *	6.783	0,58	3.549 Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Series 2015 R4X Class 4A3X 144 A 8,351%, fällig 27.01.2030 *	1.337	0,11	870 BX Trust 2021-VIEW, Series 2021 VIEW, Class E, 144 A 3,696%, fällig 15.06.2023 *	873	0,07
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Kosten 196,578 USD)	199.066	16,90	9.000 Banc of America Funding 2015-R5 Trust, Series 2015 R5X Class 1A3X 144 A 0,219%, fällig 26.10.2036 *	8.478	0,72	1.073 Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2004-4X Series 2004 4A, Class B1X 144 A 0,636%, fällig 25.10.2035 *	816	0,07
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 72,60 % (28. Februar 2021: 73,52 %)			9.000 BBCCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Class F, 144 A 4,715%, fällig 10.08.2033 *	8.437	0,72	464 Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2005-1X Series 2005 1A, Class A2X 144 A 0,284%, fällig 25.01.2036 *	440	0,04
569 Alternative Loan Trust 2005-56X Series 2005 56X Class 4A1X 0,704%, fällig 25.11.2035 *	557	0,05	6.650 BBCMS Trust 2018-BXH, Series 2018 BXH, Class C, 144 A 1,596%, fällig 15.10.2037 *	6.641	0,56	587 Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2005-B, Series 2005 BA, Class B1X 144 A 0,484%, fällig 25.06.2036 *	533	0,05
565 Alternative Loan Trust 2005-59X Series 2005 59X Class 1A1X 0,748%, fällig 20.11.2035 *	544	0,05	974 BCAP LLC 2011-RR2 Trust, Series 2011 RR2X Class 1A4X 144 A 2,933%, fällig 26.07.2036 *	579	0,05	517 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2004-25X Series 2004 25X Class 2A1X 0,764%, fällig 25.02.2035 *	488	0,04
1.521 Alternative Loan Trust 2005-80 CB, Series 2005 80CB, Class 2A1X 6,000%, fällig 25.02.2036	1.546	0,13	6.441 BCAP LLC 2014-RR2X Series 2014 RR2X Class 1A2X 144 A 0,510%, fällig 26.07.2046 *	6.191	0,53	508 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11X Series 2005 11X Class 3A3X 2,535%, fällig 25.04.2035 *	420	0,04
2.511 Alternative Loan Trust 2006-19 CB, Series 2006 19CB, Class A14X 6,000%, fällig 25.08.2036	2.022	0,17	5.841 BCAP LLC 2014-RR2X Series 2014 RR2X Class 11A2X 144 A 0,251%, fällig 26.05.2037 *	5.444	0,46	558 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11X Series 2005 11X Class 6A1X 0,684%, fällig 25.03.2035 *	453	0,04
639 Alternative Loan Trust 2006-19 CB, Series 2006 19CB, Class A15X 6,000%, fällig 25.08.2036	514	0,04	1.331 BCAP LLC Trust 2007-AA3X Series 2007 AA3X Class 1A2X 0,624%, fällig 25.04.2037 *	1.424	0,12	262 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-25X Series 2005 25X Class A15X 28,129%, fällig 25.11.2035 *	285	0,02
654 Alternative Loan Trust 2006-19 CB, Series 2006 19CB, Class A16X 6,000%, fällig 25.08.2036	527	0,04	1.583 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-AC6X Series 2004 AC6X Class A1X 5,750%, fällig 25.11.2034	1.570	0,13	2.210 CHT 2017-COSMO Mortgage Trust, Series 2017 COSMO, Class E, 144 A 3,096%, fällig 15.11.2036 *	2.219	0,19
740 Alternative Loan Trust 2006-19 CB, Series 2006 19CB, Class A20X 36,694%, fällig 25.08.2036 *	1.059	0,09	3.537 Bellemeade Re 2017-1 Ltd, Series 2017 1X Class M2X 144 A 3,434%, fällig 25.10.2027 *	3.574	0,30	1.312 Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2007-3X Series 2007 3X Class 1A4X 6,000%, fällig 25.04.2037	1.320	0,11
716 Alternative Loan Trust 2006-19 CB, Series 2006 19CB, Class A24X 6,000%, fällig 25.08.2036	576	0,05	3.970 Bellemeade Re 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Class M2X 144 A 2,984%, fällig 25.04.2028 *	4.022	0,34	9.200 Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6X Series 2006 AR6X Class 2A4X 0,524%, fällig 25.09.2036 *	3.203	0,27
911 Alternative Loan Trust 2006-19 CB, Series 2006 19CB, Class A3X 6,000%, fällig 25.08.2036 *	733	0,06	6.676 Bellemeade Re 2018-3 Ltd, Series 2018 3A, Class B1X 144 A 3,984%, fällig 25.10.2028 *	6.854	0,58	785 Citigroup Mortgage Loan Trust 2008-3X Series 2008 3X Class A3X 144 A 6,100%, fällig 25.04.2037	402	0,03
97 Alternative Loan Trust 2006-19 CB, Series 2006 19 CB, Class A7X 6,000%, fällig 25.08.2036	78	0,01	5.810 Bellemeade Re 2018-3 Ltd, Series 2018 3A, Class M2X 144 A 2,834%, fällig 25.10.2028 *	5.836	0,50	3.529 Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-J2X Series 2014 J2X Class B5X 144 A 3,889%, fällig 25.11.2044 *	3.768	0,32
434 Alternative Loan Trust 2006-19 CB, Series 2006 19CB, Class A8X 6,000%, fällig 25.08.2036	349	0,03	3.000 BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Class C, 144 A 1,996%, fällig 15.07.2035 *	3.006	0,26	1.908 Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, Series 2014 UBS2X Class E, 144 A 5,171%, fällig 10.03.2047 *	1.606	0,14
5.331 Alternative Loan Trust 2006-28 CB, Series 2006 28CB, Class A12X 5,816%, fällig 25.10.2036 *†	1.555	0,13	24.000 BHMS 2018-MZB, Series 2018 MZB, Class MZB, 144 A 6,732%, fällig 15.07.2020 *	22.934	1,95	6.500 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05X Series 2019 R05X Class 1B1X 144 A 4,184%, fällig 25.07.2039 *	6.626	0,56
7.014 Alternative Loan Trust 2007-12 T1X Series 2007 12T1X Class A3X 6,000%, fällig 25.06.2037	4.910	0,42	2.140 BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA, Series 2018 BIOA, Class A, 144 A 0,767%, fällig 15.03.2037 *	2.143	0,18	8.330 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07X Series 2019 R07X Class 1B1X 144 A 3,484%, fällig 25.10.2039 *	8.434	0,72
1.067 Alternative Loan Trust 2007-23 CB, Series 2007 23CB, Class A8X 28,062%, fällig 25.09.2037 *	1.404	0,12	2.220 BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA, Series 2018 BIOA, Class D, 144 A 1,417%, fällig 15.03.2037 *	2.226	0,19	10.360 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01X Series 2020 R01X Class 1B1X 144 A 3,334%, fällig 25.01.2040 *	10.371	0,88
7.496 Alternative Loan Trust 2007-5 CB, Series 2007 5CB, Class 1A20X 5,376%, fällig 25.04.2037 *†	2.114	0,18	2.210 BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA, Series 2018 BIOA, Class E, 144 A 2,047%, fällig 15.03.2037 *	2.217	0,19	4.500 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1X Series 2020 SBT1X Class 1M2X 144 A 3,734%, fällig 25.02.2040 *	4.660	0,40
4.000 Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF, Series 2018 ASHF, Class E, 144 A 3,196%, fällig 15.04.2035 *	3.933	0,33	3.613 BX Trust 2017-SLCT, Series 2017 SLCT, Class F, 144 A 4,346%, fällig 15.07.2034 *	3.640	0,31	140 Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Series 2005 C2X Class AMFX, 4,877%, fällig 15.04.2037	142	0,01
9.000 Ashford Hospitality Trust 2018-KEYS, Series 2018 KEYS, Class C, 144 A 1,946%, fällig 15.06.2035 *	9.011	0,77						

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			7.175			10.000		
434 CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series 2004-AR5X Series 2004 AR5X Class CB2X 2,633%, fällig 25.06.2034 *	376	0,03	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C06X Class 1B, 9,334%, fällig 25.04.2029 *	7.940	0,67	Freddie Mac Stacr Trust 2019 FTR4X Series 2019 FTR4X Class B2X 144 A 5,084%, fällig 25.11.2047 *	10.056	0,85
12.200 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class E, 144 A 4,373%, fällig 15.09.2037	11.104	0,94	3.500 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C01X Class 1B1X 5,834%, fällig 25.07.2029 *	3.835	0,33	4.936 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA1X Class B, 10,084%, fällig 25.07.2028 *	5.559	0,47
9.200 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class F, 144 A 4,373%, fällig 15.09.2037	7.245	0,62	2.550 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05X Class 1B1X 3,684%, fällig 25.01.2030 *	2.669	0,23	2.512 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA2X Class B, 10,584%, fällig 25.10.2028 *	2.925	0,25
2.429 CSMC 2017-RPL3 Trust, Series 2017 RPL3X Class B3X 144 A 4,445%, fällig 01.08.2057 *	2.683	0,23	8.696 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05X Class 1M2 C, 2,284%, fällig 25.01.2030 *	8.817	0,75	2.554 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA3X Class B, 11,334%, fällig 25.12.2028 *	2.997	0,25
6.537 CSMC 2017-RPL3 Trust, Series 2017 RPL3X Class B4X 144 A 4,445%, fällig 01.08.2057 *	7.163	0,61	6.000 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C06X Class 1B1X 4,234%, fällig 25.02.2030 *	6.232	0,53	5.500 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA4X Class B, 8,684%, fällig 25.03.2029 *	5.925	0,50
8.786 CSMC Mortgage-Backed Trust 2006-7X Series 2006 7X Class 11A2X 6,416%, fällig 25.08.2036 **	3.191	0,27	3.210 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C07X Class 1B1X 4,084%, fällig 25.05.2030 *	3.334	0,28	6.942 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2017 DNA2X Class B2X 11,334%, fällig 25.10.2029 *	7.895	0,67
162 CSMC Resecuritization Trust 2006-1 R, Series 2006 1R, Class 1A2X 144 A 19,283%, fällig 27.07.2036 *	225	0,02	5.060 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03X Class 1B1X 3,834%, fällig 25.10.2030 *	5.272	0,45	6.505 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2017 HRP1X Class B2D, 3,084%, fällig 25.12.2042 *	4.246	0,36
4.632 CSMC Series 2015-2 R, Series 2015 2R, Class 7A2X 144 A 2,566%, fällig 27.08.2036 *	4.095	0,35	3.426 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03X Class 1M2 C, 2,234%, fällig 25.10.2030 *	3.452	0,29	5.500 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SP11X Class B, 144 A 3,731%, fällig 25.02.2048 *	5.260	0,45
4.237 CSMC Trust 2013-IVR5X Series 2013 IVR5X Class B5X 144 A 3,652%, fällig 25.10.2043 *	3.939	0,33	6.088 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05X Class 1B1X 4,334%, fällig 25.01.2031 *	6.384	0,54	5.884 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SP12X Class B, 144 A 3,811%, fällig 25.05.2048 *	5.679	0,48
11.730 CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class F, 144 A 4,696%, fällig 15.07.2032 *	10.781	0,92	7.750 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C06X Class 1B1X 3,834%, fällig 25.03.2031 *	7.950	0,68	13.250 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SP13X Class B, 144 A 4,147%, fällig 25.08.2048 *	13.101	1,11
5.900 CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class H, 144 A 7,696%, fällig 15.07.2032 *	4.146	0,35	2.547 Fannie Mae REMICS, Series 2017 85X Class SC, 6,116%, fällig 25.11.2047 *	464	0,04	31.283 FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Series 2018 SB48X Class B, 144 A 3,780%, fällig 25.02.2038 *	24.364	2,07
26.650 CSMC Trust 2018-J1X Series 2018 J1X Class B7X 144 A 5,915%, fällig 25.02.2048 *	28.876	2,45	6.840 Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Series 2021 MN2X Class M2X 144 A 3,400%, fällig 25.07.2041 *	6.809	0,58	755 Government National Mortgage Association, Series 2010 102X Class IO, 0,010%, fällig 16.06.2052 *	-	-
- CSMC Trust 2018-J1X Series 2018 J1X Class SA, 144 A 0,000%, fällig 25.02.2048	-	-	6.605 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K038X Class X3X 2,568%, fällig 25.06.2042 *	381	0,03	4.015 Government National Mortgage Association, Series 2010 13X Class IO, 0,000%, fällig 16.11.2051 *	-	-
4.000 CSWF 2018-TOP, Series 2018 TOP, Class H, 144 A 3,509%, fällig 15.08.2035 *	3.982	0,34	19.370 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K052X Class X3X 1,668%, fällig 25.01.2044 *	1.220	0,10	7.579 Government National Mortgage Association, Series 2011 127X Class IO, 0,134%, fällig 16.03.2047 *	28	-
2.100 DBUBS 2011-LC3 Mortgage Trust, Series 2011 LC3A, Class G, 144 A 3,750%, fällig 10.08.2044 †	217	0,02	9.000 Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1X Series 2020 DNA1X Class B2X 144 A 5,334%, fällig 25.01.2050 *	9.152	0,78	23.662 Government National Mortgage Association, Series 2011 95X Class IO, 0,010%, fällig 16.04.2051 *	14	-
892 DSLA Mortgage Loan Trust 2004-AR4X Series 2004 AR4X Class 2A2 B, 0,927%, fällig 19.01.2045 *	642	0,05	8.000 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2X Series 2020 DNA2X Class B2X 144 A 4,884%, fällig 25.02.2050 *	8.028	0,68	13.824 Government National Mortgage Association, Series 2012 114X Class IO, 0,645%, fällig 16.01.2053 *	301	0,03
2.138 DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR3X Series 2005 AR3X Class 2A1 B, 0,567%, fällig 19.07.2045 *	2.093	0,18	5.530 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5X Series 2021 DNA5X Class B2X 144 A 5,550%, fällig 25.01.2034 *	5.800	0,49	7.485 Government National Mortgage Association, Series 2013 163X Class IO, 1,160%, fällig 16.02.2046 *	217	0,02
2.844 DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR5X Series 2005 AR5X Class 2A1 B, 0,767%, fällig 19.09.2045 *	2.695	0,23	6.000 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA1X Series 2019 DNA1X Class B2X 144 A 10,834%, fällig 25.01.2049 *	6.997	0,59	9.231 Government National Mortgage Association, Series 2014 16X Class IO, 0,474%, fällig 16.06.2055 *	176	0,02
497 DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1X Series 2007 AR1X Class 2A1 B, 0,267%, fällig 19.04.2047 *	585	0,05	5.250 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA2X Series 2019 DNA2X Class B2X 144 A 10,584%, fällig 25.03.2049 *	5.921	0,50	7.801 Government National Mortgage Association, Series 2014 171X Class IO, 0,459%, fällig 16.11.2055 *	128	0,01
5.340 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C01X Class 1B, 11,834%, fällig 25.08.2028 *	6.071	0,52	4.600 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3X Series 2019 DNA3X Class B1X 144 A 3,334%, fällig 25.07.2049 *	4.656	0,40			
3.664 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C02X Class 1B, 12,334%, fällig 25.09.2028 *	4.287	0,36	6.100 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3X Series 2019 DNA3X Class B2X 144 A 8,234%, fällig 25.07.2049 *	6.638	0,56			
2.941 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C03X Class 1B, 11,834%, fällig 25.10.2028 *	3.418	0,29	5.550 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4X Series 2019 DNA4X Class B2X 144 A 6,334%, fällig 25.10.2049 *	5.782	0,49			
4.884 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C04X Class 1B, 10,334%, fällig 25.01.2029 *	5.544	0,47						

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			2.807			4.192		
1.642			Impac Secured Assets Corp Series 2004-4X Series 2004 4X Class MSX 1,734%, fällig 25.02.2035 *	2.633	0,22	JP Morgan Mortgage Trust 2007-S3X Series 2007 S3X Class 1A18X 0,584%, fällig 25.08.2037 *	1.323	0,11
5.456	20	-	1.268			5.652		
Government National Mortgage Association, Series 2014 47X Class IA, 0,111%, fällig 16.02.2048 *			Impac Secured Assets Trust 2006-2X Series 2006 2X Class 2B, 1,734%, fällig 25.08.2036 *	1.283	0,11	JP Morgan Mortgage Trust 2013-2X Series 2013 2X Class B5X 144 A 3,604%, fällig 25.05.2043 *	5.144	0,44
818	204	0,02	1.548			18.542		
Government National Mortgage Association, Series 2014 50X Class IO, 0,705%, fällig 16.09.2055 *			Impac Secured Assets Trust 2006-2X Series 2006 2X Class 2M3X 1,734%, fällig 25.08.2036 *	1.562	0,13	JP Morgan Mortgage Trust 2018-4X Series 2018 4X Class AX1X 144 A 0,246%, fällig 25.10.2048 *†	44	-
945	237	0,02	5.300			20.777		
Government National Mortgage Association, Series 2016 135X Class SB, 6,005%, fällig 16.10.2046 *			Independence Plaza Trust 2018-INDP, Series 2018 INDP, Class B, 144 A 3,911%, fällig 10.07.2035	5.584	0,47	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5X Series 2018 5X Class AX1X 144 A 0,284%, fällig 25.10.2048 **	72	0,01
5.570	191	0,02	725			6.947		
Government National Mortgage Association, Series 2016 51X Class NS, 5,962%, fällig 20.04.2046 *			IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR13X Series 2005 AR13X Class 1A1X 2,801%, fällig 25.08.2035 *	513	0,04	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5X Series 2018 5X Class B3X 144 A 3,784%, fällig 25.10.2048 *	7.171	0,61
28.679	815	0,07	778			4.228		
GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5X Class D, 144 A 6,346%, fällig 15.09.2031 *	5.524	0,47	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR2X Series 2005 AR2X Class 2A1 B, 0,864%, fällig 25.02.2035 *	643	0,05	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5X Series 2018 5X Class B4X 144 A 3,784%, fällig 25.10.2048 *	4.346	0,37
7.000	6.658	0,57	2.087			1.952		
GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3 PCK, Series 2018 3PCK, Class B, 144 A 2,346%, fällig 15.09.2031 *			IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR6X Series 2005 AR6X Class 2A2X 0,744%, fällig 25.04.2035 *	1.836	0,16	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5X Series 2018 5X Class B5X 144 A 3,784%, fällig 25.10.2048 *	1.984	0,17
1.250	854	0,07	9.650			2.796		
GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26X Series 2014 GC26X Class D, 144 A 4,660%, fällig 10.11.2047 *			J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11X Series 2017 FL11X Class E, 144 A 4,116%, fällig 15.10.2032 *	9.120	0,77	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5X Series 2018 5X Class B6X 144 A 3,784%, fällig 25.10.2048 *	2.248	0,19
4.250	3.857	0,33	2.250			5.420		
GSMSC Resecuritization Trust 2014-2 R, Series 2014 2R, Class 3B, 144 A 0,702%, fällig 26.11.2037 *			J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11X Series 2017 FL11X Class F, 144 A 5,416%, fällig 15.10.2032 *	1.930	0,16	JPMIBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C25X Series 2014 C25X Class D, 144 A 4,094%, fällig 15.11.2047 *	4.374	0,37
5.151	375	0,03	3.000			16		
GSR Mortgage Loan Trust 2006-1 F, Series 2006 1F, Class 6A1X 0,484%, fällig 25.02.2036 *			J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-ASH8X Series 2018 ASH8X Class C, 144 A 1,546%, fällig 15.02.2035 *	3.005	0,26	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-15X Series 2004 15X Class 6A1X 0,414%, fällig 25.12.2034 *	16	-
106	102	0,01	28.545			2.005		
HarborView Mortgage Loan Trust 2004-11X Series 2004 11X Class 3A3X 0,847%, fällig 19.01.2035 *			J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Series 2018 PHMZ, Class M, 144 A 8,454%, fällig 15.06.2035 *†	11.372	0,97	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-6X Series 2004 6X Class B1X 2,301%, fällig 25.07.2034 *	1.985	0,17
73	74	0,01	64			1.345		
HarborView Mortgage Loan Trust 2005-1X Series 2005 1X Class 2A1 A, 0,627%, fällig 19.03.2035 *			J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-CIBC 19X Series 2007 CIB19X Class AJ, 6,261%, fällig 12.02.2049 *	73	0,01	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-8X Series 2004 8X Class B1X 2,388%, fällig 25.09.2034 *	1.223	0,10
319	287	0,02	830			845		
HarborView Mortgage Loan Trust 2005-10X Series 2005 10X Class 2A1 A, 0,707%, fällig 19.11.2035 *			JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-CIBC 19X Series 2007 CIB19X Class AJ, 6,261%, fällig 12.02.2049 *	73	0,01	MASTR Reperforming Loan Trust 2005-1X Series 2005 1X Class 1A1X 144 A 6,000%, fällig 25.08.2034	656	0,06
564	544	0,05	4.509			985		
HarborView Mortgage Loan Trust 2005-2X Series 2005 2X Class 2A1 A, 0,527%, fällig 19.05.2035 *			JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012-C8X Series 2012 C8X Class E, 144 A 4,828%, fällig 15.10.2045 *	732	0,06	MASTR Reperforming Loan Trust 2005-2X Series 2005 2X Class 1A1F, 144 A 0,434%, fällig 25.05.2035 *	530	0,05
314	314	0,03	6.800			384		
HarborView Mortgage Loan Trust 2005-3X Series 2005 3X Class 2A1 A, 0,567%, fällig 19.06.2035 *			JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Series 2018 WPT, Class GFL, 144 A 3,740%, fällig 05.07.2033 *	6.636	0,56	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5X Series 2007 5X Class AJ, 5,450%, fällig 12.08.2048 *	190	0,02
3.041	2.793	0,24	13.865			189		
HarborView Mortgage Loan Trust 2005-8X Series 2005 8X Class 2A2X 1,598%, fällig 19.09.2035 *			JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-FL7X Series 2015 FL7X Class D, 144 A 1,623%, fällig 15.05.2028 *	4.164	0,35	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5X Series 2007 5X Class AJFL, 144 A 5,450%, fällig 12.08.2048 *	94	0,01
601	581	0,05	6.800			5.000		
HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10X Series 2006 10X Class 2A1 A, 0,267%, fällig 19.11.2036 *			JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Series 2018 WPT, Class GFL, 144 A 3,740%, fällig 05.07.2033 *	6.636	0,56	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32X Series 2016 C32X Class D, 144 A 3,396%, fällig 15.12.2049 *	4.184	0,36
3.156	2.943	0,25	13.875			3		
HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10X Series 2006 10X Class 2A1 B, 0,327%, fällig 19.11.2036 *			JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Class G, 144 A 4,346%, fällig 15.12.2036 *	12.354	1,05	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-IQ13X Series 2007 IQ13X Class AJ, 5,438%, fällig 15.03.2044	3	-
1.257	1.232	0,10	13.875			2.276		
Impac CMB Trust Series 2005-1X Series 2005 1X Class M1X 0,774%, fällig 25.04.2035 *			JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Class H, 144 A 6,846%, fällig 15.12.2036 *	11.816	1,00	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-11AR, Series 2004 11AR, Class 1B1X 0,684%, fällig 25.01.2035 *	1.976	0,17
2.258	2.211	0,19	3.444			3.683		
Impac CMB Trust Series 2005-3X Series 2005 3X Class A2X 0,684%, fällig 25.08.2035 *			JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-NNN MZ, Series 2020 NNNZ, Class M, 144 A 8,542%, fällig 16.01.2037	2.844	0,24	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-8 AR, Series 2006 8AR, Class 1A3X 0,404%, fällig 25.06.2036 *	1.118	0,09
1.037	1.024	0,09				6.781		
Impac CMB Trust Series 2005-4X Series 2005 4X Class 1M1X 0,729%, fällig 25.05.2035 *						Motel 6 Trust 2017-MTL6X Series 2017 MTL6X Class F, 144 A 4,346%, fällig 15.08.2034 *	6.808	0,58
1.594	1.512	0,13						
Impac CMB Trust Series 2005-7X Series 2005 7X Class A1X 0,604%, fällig 25.11.2035 *								

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			13.153			4.000		
831 Multifamily Trust 2016-1X Series 2016 1X Class B, 144 A 12,843%, fällig 25.04.2046 *	956	0,08	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2X Series 2017 2X Class B, 144 A 0,000%, fällig 25.08.2056 †	4.784	0,41	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-NYCH, Series 2018 NYCH, Class F, 144 A 3,917%, fällig 15.02.2032 *	3.929	0,33
14.560 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class D, 144 A 4,544%, fällig 15.08.2036 *	13.452	1,14	22.182 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2X Series 2017 2X Class BIO, 144 A 0,835%, fällig 25.08.2056 **	2.508	0,21	5.706 UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust 2012-C2X Series 2012 C2X Class G, 144 A 5,000%, fällig 10.05.2063 *	243	0,02
4.870 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class E, 144 A 4,544%, fällig 15.08.2036 *	4.248	0,36	5.710 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2X Series 2017 2X Class M1X 144 A 4,000%, fällig 25.08.2056 *	5.809	0,49	990 UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust 2012-C2X Series 2012 C2X Class H, 144 A 5,000%, fällig 10.05.2063 *	14	-
4.102 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-4X Series 2016 4A, Class B5X 144 A 4,899%, fällig 25.11.2056 *	4.348	0,37	4.457 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2X Series 2017 2X Class M2X 144 A 4,000%, fällig 25.08.2056 *	4.620	0,39	3.569 WaMu Mortgage PassThrough Certificates Series 2005-AR11 Trust, Series 2005 AR11X Class B1X 0,999%, fällig 25.08.2045 *	3.086	0,26
4.252 Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Series 2015 4R, Class 4A7X 144 A 3,094%, fällig 26.03.2037 *	4.262	0,36	489.850 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2X Series 2017 2X Class XSIO, 144 A 0,075%, fällig 25.08.2056 **	2.149	0,18	746 WaMu Mortgage PassThrough Certificates Series 2005-AR15 Trust, Series 2005 AR15X Class A1C4X 0,884%, fällig 25.11.2045 *	491	0,04
308 Optimum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1X Series 2006 1X Class M1X 0,639%, fällig 25.04.2036 *	2.155	0,18	6.500 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3X Series 2017 3X Class M2X 144 A 4,750%, fällig 25.07.2056 *	6.797	0,58	6.451 WaMu Mortgage PassThrough Certificates Series 2005-AR2 Trust, Series 2005 AR2X Class B1X 0,879%, fällig 25.01.2045 *	5.470	0,46
6.163 PMT Credit Risk Transfer Trust 2019-3R, Series 2019 3R, Class A, 144 A 2,788%, fällig 27.10.2022 *	6.187	0,53	2.937 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1X Series 2018 1X Class M, 4,750%, fällig 25.05.2057 *	3.075	0,26	1.482 WaMu Mortgage PassThrough Certificates Series 2005-AR9 Trust, Series 2005 AR9X Class B1X 1,029%, fällig 25.07.2045 *	1.220	0,10
6.184 PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Series 2021 1R, Class A, 144 A 2,996%, fällig 27.02.2024 *	6.302	0,54	11.609 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-2X Series 2018 2X Class BX, 0,279%, fällig 25.11.2057 *	5.880	0,50	1.343 Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5X Series 2015 SBC5X Class B, 144 A 6,474%, fällig 14.09.2022 *	1.116	0,09
7.760 Radnor Re 2018-1 Ltd, Series 2018 1X Class M2X 144 A 2,784%, fällig 25.03.2028 *	7.838	0,67	16.257 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3X Series 2018 3X Class BX, 144 A 0,000%, fällig 25.08.2057 *	7.687	0,65	1.252 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22X Series 2014 C22X Class D, 144 A 4,049%, fällig 15.09.2057 *	1.182	0,10
824 RALI Series 2006-QA2 Trust, Series 2006 QA2X Class 1A1X 0,334%, fällig 25.02.2036 *	596	0,05	2.630 STACR Trust 2018-DNA3X Series 2018 DNA3X Class B1X 144 A 3,984%, fällig 25.09.2048 *	2.749	0,23	6.540 ZH Trust 2021-1X Series 2021 1X Class B, 144 A 3,262%, fällig 18.02.2027	6.560	0,56
8.257 RBSGC Mortgage Loan Trust 2007-A, Series 2007 A, Class 3A1X 0,434%, fällig 25.01.2037 *	1.256	0,11	6.000 STACR Trust 2018-DNA3X Series 2018 DNA3X Class B2X 144 A 7,834%, fällig 25.09.2048 *	6.561	0,56	Summe hypothekarisch gesicherte Wertpapiere (Kosten 909.306 USD)		
14.686 Redwood Funding Trust 2019-1X Series 2019 1X Class PT, 144 A 4,213%, fällig 27.09.2024	14.859	1,26	650 Stanwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class D, 144 A 3,596%, fällig 15.11.2027 **	-	-	854.924	72,60	
1.632 Reperforming Loan REMIC Trust 2006-R2X Series 2006 R2X Class AF1X 144 A 0,504%, fällig 25.07.2036 *	1.526	0,13	14.332 Stanwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class E, 144 A 4,496%, fällig 15.11.2027 **	-	-	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 3,83 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
4.098 Residential Asset Securitization Trust 2006-A7 CB, Series 2006 A7 CB, Class 1A3X 6,250%, fällig 25.07.2036	4.085	0,35	6.007 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Series 2005-19 XS, Series 2005 19XS, Class 1A2 B, 0,444%, fällig 25.10.2035 *	5.815	0,49	Vereinigte Staaten – 3,83 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
13.163 Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4X Series 2017 4X Class B, 144 A 0,000%, fällig 25.06.2057 †	4.095	0,35	383 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Series 2004 2X Class 1A1X 2,946%, fällig 25.03.2034 *	386	0,03	45.000 United States Treasury Note/ Bond, 0,750%, fällig 30.04.2026	45.042	3,83
20.068 Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4X Series 2017 4X Class BIO, 144 A 0,000%, fällig 25.06.2057 **	3.709	0,31	775 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Series 2005 8XS, Class M1X 0,729%, fällig 25.04.2035 *	762	0,06	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 44,849 USD)		
4.433 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1X Series 2016 1X Class B, 144 A 0,000%, fällig 25.09.2055 †	1.894	0,16	4.507 Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006 AR5X Series 2006 AR5X Class 4A1X 0,524%, fällig 25.05.2046 *	2.334	0,20	Schuldverschreibungen – 3,26 % (28. Februar 2021: 4,89 %)		
9.233 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1X Series 2016 1X Class BIO, 144 A 1,251%, fällig 25.09.2055 **	1.008	0,09	73 Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR6X Series 2006 AR6X Class 1A1X 0,444%, fällig 25.07.2046 *	66	0,01	30.000 American Dream, 10,750%, fällig 29.06.2024 *∞	11.064	0,94
9.640 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1X Series 2016 1X Class M2X 144 A 3,750%, fällig 25.09.2055 *	9.912	0,84	5.266 Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Class E, 144 A 3,426%, fällig 11.11.2034 *	5.253	0,45	1.613 Freehand Hotel, 4,750%, fällig 17.12.2024 *∞	1.595	0,13
61.695 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1X Series 2016 1X Class XSIO, 144 A 0,075%, fällig 25.09.2055 **	238	0,02				2.935 Freehand Hotel, 4,750%, fällig 17.12.2024 *∞	2.902	0,24
						5.452 Freehand Hotel, 4,750%, fällig 17.12.2024 *∞	5.391	0,46
						7.502 Palmetto Skilled Nursing, 6,250%, fällig 11.01.2022 *∞	7.502	0,64
						10.000 Sono Retail Loan, 4,015%, fällig 06.08.2022 *∞	9.988	0,85
						Summe Schuldverschreibungen (Kosten USD 57,434)		
						38.442	3,26	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
Organismen für gemeinsame Anlagen — 3,19 % (28. Februar 2021: 5,34 %)			Devisenterminkontrakte — (0,01 %) (28. Februar 2021: (0,08 %))		
37.574 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	37.574	3,19	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(122)	(0,01)
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 37.574 USD)	37.574	3,19	Futures – (0,01 %) (28. Februar 2021: (0,04 %))		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.245.741 USD)	1.175.048	99,78	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(121)	(0,01)
Credit Default Swaps – 0,01 % (28. Februar 2021: (0,01 %))			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(909)	(0,08)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	76	0,01	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.175.569	99,83
Devisenterminkontrakte – 0,11 % (28. Februar 2021: 0,09 %)			Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	2.095	0,17
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.244	0,11	Gesamtnettovermögen	1.177.664	100,00
Futures – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,00 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	110	0,01			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	1.176.478	99,91			
Credit Default Swaps – (0,05 %) (28. Februar 2021: (0,06 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(546)	(0,05)			
Zinsswaps – (0,01 %) (28. Februar 2021: (0,08 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(120)	(0,01)			

∞ Das Wertpapier wurde vom Manager oder dem jeweiligen Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.

ABKÜRZUNGEN:

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.

Analyse des Gesamtvermögens	% von Gesamtvermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,92
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	3,25
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,18
Finanzderivate	0,12
Sonstige Vermögenswerte	0,53
Gesamtvermögen	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 738.612.000 USD und machten 62,75 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

† Illiquid.

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kauf-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3,000%	Kauf	17.08.2061	1.550	\$ 76
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3,000%	Verkauf	17.10.2057	3.280	(434)
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3,000%	Verkauf	17.10.2057	850	(112)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 109 USD)					\$ 76
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (646) USD)					(546)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (537) USD)					\$ (470)

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520%, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2047	4.873	\$ (120)	
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): - USD)					\$ -
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (868) USD)					(120)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (868) USD)					\$ (120)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 2.105	Verkauf EUR 1.793	\$ (12)	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 52	Verkauf GBP 38	—	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf JPY 6.162.237	Verkauf USD 55.930	91	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf GBP 9.626	Verkauf USD 13.343	(109)	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 245.129	Verkauf USD 288.374	1.153	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf CHF 1.318	Verkauf USD 1.441	(1)	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 962 USD)					\$ 1.244
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (862) USD)					(122)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 100 USD)					\$ 1.122

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch 390	\$ 96.559	\$ 106	
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch (21)	(2.802)	4	
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch (58)	(7.176)	(17)	
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch 157	30.973	(104)	
Nicht realisierter Wertzuwachs von Terminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): - USD)				\$ 110
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 492 USD)				(121)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (492) USD)				\$ (11)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 1,19 % (28. Februar 2021: 0,16 %)			1 Fannie Mae Pool '253598', 8,500%, fällig 01.12.2030	1	–	6 Fannie Mae Pool '995072', 5,500%, fällig 01.08.2038	7	–
2.736	Hardee's Funding LLC, Series 2020 1A, Class A2X 144 A 3,981%, fällig 20.12.2050	0,29	114 Fannie Mae Pool '254793', 5,000%, fällig 01.07.2033	130	0,01	669 Fannie Mae Pool '995948', 5,000%, fällig 01.03.2039	766	0,07
2.730	Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Series 2021 2GS, Class B, 144 A 2,790%, fällig 20.03.2048	0,27	5.310 Fannie Mae Pool '387771', 3,790%, fällig 01.08.2028	5.911	0,57	80 Fannie Mae Pool 'AA8438', 4,500%, fällig 01.06.2039	90	0,01
1.500	MF1 2021-FL6 Ltd, Series 2021 FL6X Class A, 144 A 1,196%, fällig 16.07.2036 *	0,14	- Fannie Mae Pool '535270', 8,500%, fällig 01.04.2030	–	–	70 Fannie Mae Pool 'AB0129', 5,000%, fällig 01.04.2035	80	0,01
913	Navient Student Loan Trust 2016-3X Series 2016 3A, Class A3X 144 A 1,434%, fällig 25.06.2065 *	0,09	13 Fannie Mae Pool '535299', 7,500%, fällig 01.05.2030	15	–	698 Fannie Mae Pool 'AB0131', 5,000%, fällig 01.12.2038	794	0,08
1.076	SBA Small Business Investment Cos, Series 2018 1) B, Class 1X 3,548%, fällig 10.09.2028	0,11	1 Fannie Mae Pool '535332', 8,500%, fällig 01.04.2030	1	–	37 Fannie Mae Pool 'AB2725', 5,500%, fällig 01.04.2041	42	–
1.350	SMB Private Education Loan Trust 2015-C, Series 2015 C, Class C, 144 A 4,500%, fällig 17.09.2046	0,14	Fannie Mae Pool '535351', 8,000%, fällig 01.06.2030	–	–	21 Fannie Mae Pool 'AB2817', 5,000%, fällig 01.04.2041	24	–
1.499	Store Master Funding I-VII XIV XIX XX, Series 2021 1A, Class A3X 144 A 2,860%, fällig 20.06.2051	0,15	- Fannie Mae Pool '535435', 8,500%, fällig 01.08.2030	–	–	1.211 Fannie Mae Pool 'AB3882', 4,500%, fällig 01.11.2041	1.360	0,13
	Summe Forderungsbesicherte Wertpapiere (Kosten 12.033 USD)	12.294	1 Fannie Mae Pool '535608', 9,500%, fällig 01.04.2030	1	–	528 Fannie Mae Pool 'AB5692', 4,000%, fällig 01.06.2042	577	0,06
	Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 93,98 % (28. Februar 2021: 100,65 %)		5 Fannie Mae Pool '535996', 7,500%, fällig 01.06.2031	6	–	62 Fannie Mae Pool 'AB7668', 3,000%, fällig 01.01.2043	66	0,01
65.134	BANK 2017-BNK8X Series 2017 BNK8X Class XA, 0,865%, fällig 15.11.2050 *	0,25	- Fannie Mae Pool '537715', 8,500%, fällig 01.09.2030	–	–	220 Fannie Mae Pool 'AB8144', 5,000%, fällig 01.04.2037	250	0,02
2.400	BANK 2018-BNK10X Series 2018 BN10X Class A5X 3,688%, fällig 15.02.2061	0,26	26 Fannie Mae Pool '545189', 7,500%, fällig 01.08.2031	30	–	230 Fannie Mae Pool 'AB9107', 3,500%, fällig 01.04.2033	249	0,02
2.210	Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Series 2018 B1X Class A5X 3,666%, fällig 15.01.2051 *	0,24	24 Fannie Mae Pool '545190', 7,500%, fällig 01.08.2031	28	–	41 Fannie Mae Pool 'AC2389', 5,000%, fällig 01.02.2037	47	–
4.050	BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Class A, 144 A 1,346%, fällig 15.07.2035 *	0,40	2 Fannie Mae Pool '545612', 8,000%, fällig 01.04.2032	3	–	1.265 Fannie Mae Pool 'AD1645', 5,000%, fällig 01.03.2040	1.450	0,14
3.870	BXMT 2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2X Class A, 144 A 1,064%, fällig 15.02.2038 *	0,38	3 Fannie Mae Pool '545990', 7,500%, fällig 01.04.2031	3	–	78 Fannie Mae Pool 'AD2963', 5,000%, fällig 01.04.2040	88	0,01
37.127	CD 2017-CD6 Mortgage Trust, Series 2017 CD6X Class XA, 1,061%, fällig 13.11.2050 *	0,13	- Fannie Mae Pool '546591', 8,500%, fällig 01.06.2030	–	–	17 Fannie Mae Pool 'AD3336', 5,500%, fällig 01.04.2040	19	–
1.713	Fannie Mae Interest Strip 406X Class 2X 4,000%, fällig 25.02.2041	0,02	3 Fannie Mae Pool '548965', 8,500%, fällig 01.07.2030	3	–	16 Fannie Mae Pool 'AD3796', 5,000%, fällig 01.04.2040	19	–
414	Fannie Mae Interest Strip 407X Class 9X 5,000%, fällig 25.02.2041 *	0,01	12 Fannie Mae Pool '555676', 7,500%, fällig 01.12.2032	14	–	7 Fannie Mae Pool 'AD4567', 5,500%, fällig 01.04.2040	8	–
891	Fannie Mae Interest Strip 407X Class C10X 5,000%, fällig 25.01.2038	0,02	144 Fannie Mae Pool '555743', 5,000%, fällig 01.09.2033	164	0,02	5 Fannie Mae Pool 'AD4598', 5,500%, fällig 01.05.2040	6	–
579	Fannie Mae Interest Strip 409X Class C13X 3,500%, fällig 25.11.2041	0,01	38 Fannie Mae Pool '727181', 5,000%, fällig 01.08.2033	43	–	11 Fannie Mae Pool 'AD4614', 5,500%, fällig 01.06.2040	12	–
3.043	Fannie Mae Interest Strip 417X Class C5X 3,500%, fällig 25.02.2043	0,04	29 Fannie Mae Pool '735578', 5,000%, fällig 01.06.2035	33	–	64 Fannie Mae Pool 'AD4898', 5,000%, fällig 01.05.2040	70	0,01
6.984	Fannie Mae Interest Strip 418X Class C15X 3,500%, fällig 25.08.2043	0,10	22 Fannie Mae Pool '745248', 7,500%, fällig 01.08.2034	25	–	9 Fannie Mae Pool 'AD8281', 5,500%, fällig 01.07.2040	10	–
19.600	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 1,500% ±	1,94	639 Fannie Mae Pool '745580', 5,000%, fällig 01.06.2036	729	0,07	48 Fannie Mae Pool 'AD8326', 5,500%, fällig 01.07.2040	54	0,01
3.400	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 1,500% ±	0,33	157 Fannie Mae Pool '745802', 6,000%, fällig 01.07.2036	187	0,02	112 Fannie Mae Pool 'AD8642', 5,500%, fällig 01.08.2040	128	0,01
143.730	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000% ±	14,17	14 Fannie Mae Pool '745959', 5,500%, fällig 01.11.2036	16	–	67 Fannie Mae Pool 'AD9893', 5,500%, fällig 01.07.2040	76	0,01
20.500	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500% ±	2,07	195 Fannie Mae Pool '836390', 5,000%, fällig 01.10.2035	221	0,02	16 Fannie Mae Pool 'AE0758', 7,000%, fällig 01.02.2039	19	–
1	Fannie Mae Pool '252875', 8,000%, fällig 01.11.2029	–	637 Fannie Mae Pool '836398', 1,957%, fällig 01.10.2035 *	666	0,06	85 Fannie Mae Pool 'AH4029', 5,000%, fällig 01.04.2041	93	0,01
–	Fannie Mae Pool '253184', 8,000%, fällig 01.04.2030	–	12 Fannie Mae Pool '836852', 1,938%, fällig 01.10.2035 *	12	–	166 Fannie Mae Pool 'AH5036', 5,500%, fällig 01.02.2041	187	0,02
–	Fannie Mae Pool '253399', 8,500%, fällig 01.08.2030	–	13 Fannie Mae Pool '843823', 1,997%, fällig 01.11.2035 *	14	–	51 Fannie Mae Pool 'AH8309', 5,000%, fällig 01.04.2041	56	0,01
–	Fannie Mae Pool '253438', 8,500%, fällig 01.09.2030	–	163 Fannie Mae Pool '843997', 1,961%, fällig 01.11.2035 *	170	0,02	16 Fannie Mae Pool 'AH9785', 5,500%, fällig 01.04.2041	18	–
–		–	85 Fannie Mae Pool '865915', 2,234%, fällig 01.03.2036 *	86	0,01	66 Fannie Mae Pool 'AI0199', 5,000%, fällig 01.04.2041	72	0,01
–		–	181 Fannie Mae Pool '888218', 5,000%, fällig 01.03.2037	206	0,02	27 Fannie Mae Pool 'AI9532', 5,500%, fällig 01.09.2041	30	–
–		–	15 Fannie Mae Pool '889117', 5,000%, fällig 01.10.2035	17	–	16 Fannie Mae Pool 'AJ2033', 5,500%, fällig 01.10.2041	18	–
–		–	498 Fannie Mae Pool '890345', 5,000%, fällig 01.06.2041	566	0,06	40 Fannie Mae Pool 'AJ4713', 4,500%, fällig 01.11.2041	45	–
–		–	766 Fannie Mae Pool '890604', 4,500%, fällig 01.10.2044	856	0,08	59 Fannie Mae Pool 'AL0521', 5,000%, fällig 01.06.2041	68	0,01
–		–	18 Fannie Mae Pool '902663', 6,000%, fällig 01.11.2036	22	–	188 Fannie Mae Pool 'AL1051', 4,500%, fällig 01.09.2041	210	0,02
–		–	7 Fannie Mae Pool '909856', 6,000%, fällig 01.03.2037	7	–	703 Fannie Mae Pool 'AL1469', 7,000%, fällig 01.02.2039	831	0,08
–		–	193 Fannie Mae Pool '934231', 5,000%, fällig 01.01.2039	218	0,02	333 Fannie Mae Pool 'AL1470', 7,000%, fällig 01.04.2037	394	0,04
–		–	102 Fannie Mae Pool '961907', 5,000%, fällig 01.03.2038	116	0,01	5.257 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500%, fällig 01.01.2043	5.707	0,56
–		–	666 Fannie Mae Pool '962687', 5,000%, fällig 01.04.2038	763	0,07	44 Fannie Mae Pool 'AL3026', 3,500%, fällig 01.12.2042	48	–
–		–	16 Fannie Mae Pool '973013', 4,500%, fällig 01.03.2038	18	–	1.840 Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500%, fällig 01.05.2040	2.168	0,21
–		–	1 Fannie Mae Pool '974763', 4,500%, fällig 01.04.2038	1	–	196 Fannie Mae Pool 'AL4741', 4,500%, fällig 01.01.2044	220	0,02
–		–	16 Fannie Mae Pool '981766', 4,500%, fällig 01.04.2038	18	–			

^ 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 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)								
1.280			3			521		
Fannie Mae REMICS, Series 2020 89X Class DL, 2,500%, fällig 25.12.2050	171	0,02	Freddie Mac Gold Pool 'C55319', 8,000%, fällig 01.08.2031	3	–	Freddie Mac Gold Pool 'U90378', 4,000%, fällig 01.11.2042	570	0,06
11.117			–			331		
Fannie Mae REMICS, Series 2020 91X Class IO, 2,500%, fällig 25.12.2050	1.542	0,15	Freddie Mac Gold Pool 'C57324', 8,000%, fällig 01.09.2031	–	–	Freddie Mac Gold Pool 'U90436', 4,000%, fällig 01.11.2042	365	0,04
7.542			3			66		
Fannie Mae REMICS, Series 2020 93X Class LI, 2,500%, fällig 25.01.2051	1.054	0,10	Freddie Mac Gold Pool 'C91046', 6,500%, fällig 01.05.2027	4	–	Freddie Mac Gold Pool 'U90598', 3,500%, fällig 01.12.2042	71	0,01
29.068			1.760			117		
Fannie Mae REMICS, Series 2021 42X Class NI, 2,500%, fällig 25.11.2048	4.000	0,39	Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000%, fällig 01.02.2038	1.845	0,18	Freddie Mac Gold Pool 'U90608', 3,500%, fällig 01.12.2042	126	0,01
8.663			1			102		
Fannie Mae REMICS, Series 2021 46X Class BI, 2,500%, fällig 25.12.2048	1.150	0,11	Freddie Mac Gold Pool 'G00556', 8,000%, fällig 01.09.2026	1	–	Freddie Mac Gold Pool 'U90768', 3,500%, fällig 01.01.2043	109	0,01
1.397			1			120		
Fannie Mae REMICS, Series 2021 54X Class KI, 2,500%, fällig 25.05.2049	142	0,01	Freddie Mac Gold Pool 'G00726', 8,000%, fällig 01.06.2027	2	–	Freddie Mac Gold Pool 'U90778', 3,500%, fällig 01.01.2043	130	0,01
1.700			1			101		
Fannie Mae REMICS, Series 2021 61X Class KL, 2,500%, fällig 25.04.2049	219	0,02	Freddie Mac Gold Pool 'G00931', 8,000%, fällig 01.11.2026	1	–	Freddie Mac Gold Pool 'U90794', 3,500%, fällig 01.01.2043	109	0,01
572			7			152		
Fannie Mae-Aces, Series 2016 M11X Class AL, 2,944%, fällig 25.07.2039	605	0,06	Freddie Mac Gold Pool 'G02427', 5,500%, fällig 01.12.2036	8	–	Freddie Mac Gold Pool 'U90828', 3,500%, fällig 01.02.2043	164	0,02
21.659			38			171		
Fannie Mae-Aces, Series 2019 M11X Class X1X 1,168%, fällig 25.06.2029 *	1.422	0,14	Freddie Mac Gold Pool 'G04581', 6,500%, fällig 01.08.2038	44	–	Freddie Mac Gold Pool 'U90879', 3,500%, fällig 01.02.2043	186	0,02
22.762			1			178		
Fannie Mae-Aces, Series 2019 M13X Class X1X 0,946%, fällig 25.06.2034 *	1.252	0,12	Freddie Mac Gold Pool 'G04947', 6,500%, fällig 01.04.2038	1	–	Freddie Mac Gold Pool 'U90903', 3,500%, fällig 01.02.2043	193	0,02
39.646			6			135		
Fannie Mae-Aces, Series 2019 M14X Class X1X 0,703%, fällig 25.06.2029 *	1.584	0,15	Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500%, fällig 01.09.2039	7	–	Freddie Mac Gold Pool 'U91027', 3,500%, fällig 01.02.2043	146	0,01
5.551			262			5.818		
Fannie Mae-Aces, Series 2020 M11X Class IO, 1,874%, fällig 25.01.2029 *	615	0,06	Freddie Mac Gold Pool 'G07025', 5,000%, fällig 01.02.2042	300	0,03	Freddie Mac Gold Pool 'U91124', 3,500%, fällig 01.03.2045	6.295	0,61
34.577			162			3.069		
Fannie Mae-Aces, Series 2020 M16X Class X1X 0,552%, fällig 25.04.2032 *	1.185	0,12	Freddie Mac Gold Pool 'G07335', 7,000%, fällig 01.03.2039	190	0,02	Freddie Mac Gold Pool 'U91135', 4,000%, fällig 01.02.2044	3.355	0,33
6.102			38			58.930		
Fannie Mae-Aces, Series 2020 M24X Class X1X 1,888%, fällig 25.01.2037 *	924	0,09	Freddie Mac Gold Pool 'G07485', 5,000%, fällig 01.06.2041	43	–	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K065X Class X1X 0,810%, fällig 25.04.2027 *	2.023	0,20
19.094			325			87.753		
Fannie Mae-Aces, Series 2020 M31X Class X2X 1,451%, fällig 25.12.2032 *	1.918	0,19	Freddie Mac Gold Pool 'G07509', 6,500%, fällig 01.09.2039	378	0,04	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K069X Class X1X 0,490%, fällig 25.09.2027 *	1.845	0,18
61			1.566			54.532		
Freddie Mac Gold Pool 'A29586', 5,000%, fällig 01.01.2035	68	0,01	Freddie Mac Gold Pool 'G08700', 4,500%, fällig 01.03.2046	1.718	0,17	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K079X Class XAM, 0,222%, fällig 25.06.2028 *	462	0,04
16			271			57.720		
Freddie Mac Gold Pool 'A30703', 5,500%, fällig 01.12.2034	18	–	Freddie Mac Gold Pool 'G16672', 3,000%, fällig 01.03.2033	289	0,03	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K081X Class XAM, 0,210%, fällig 25.08.2028 *	443	0,04
132			1.743			187		
Freddie Mac Gold Pool 'A35950', 5,000%, fällig 01.07.2035	151	0,01	Freddie Mac Gold Pool 'G60329', 5,500%, fällig 01.06.2040	2.030	0,20	Freddie Mac Pool 'QA5768', 3,000%, fällig 01.01.2050	200	0,02
18			5.232			120		
Freddie Mac Gold Pool 'A36526', 5,000%, fällig 01.08.2035	20	–	Freddie Mac Gold Pool 'G60344', 4,000%, fällig 01.12.2045	5.806	0,56	Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000%, fällig 01.01.2050	126	0,01
53			7.231			463		
Freddie Mac Gold Pool 'A39036', 5,000%, fällig 01.05.2035	61	0,01	Freddie Mac Gold Pool 'G61814', 3,500%, fällig 01.09.2048	7.813	0,76	Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500%, fällig 01.02.2050	497	0,05
8			11.871			4.494		
Freddie Mac Gold Pool 'A39302', 5,500%, fällig 01.11.2035	9	–	Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000%, fällig 01.10.2046	12.733	1,24	Freddie Mac Pool 'QA7256', 3,000%, fällig 01.02.2050	4.707	0,46
139			1			262		
Freddie Mac Gold Pool 'A81215', 6,500%, fällig 01.08.2038	156	0,02	Freddie Mac Gold Pool 'H00790', 5,500%, fällig 01.05.2037	1	–	Freddie Mac Pool 'QA9686', 3,000%, fällig 01.05.2050	282	0,03
– Freddie Mac Gold Pool 'A84166', 6,500%, fällig 01.01.2039	–	–	255			563		
446			Freddie Mac Gold Pool 'H02425', 5,500%, fällig 01.02.2038	289	0,03	Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500%, fällig 01.11.2050	591	0,06
Freddie Mac Gold Pool 'A97953', 5,000%, fällig 01.04.2041	510	0,05	2			376		
1			Freddie Mac Gold Pool 'H09170', 5,500%, fällig 01.01.2038	2	–	Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500%, fällig 01.11.2050	396	0,04
Freddie Mac Gold Pool 'C00556', 8,000%, fällig 01.10.2027	2	–	464			97		
– Freddie Mac Gold Pool 'C01025', 8,000%, fällig 01.07.2030	–	–	Freddie Mac Gold Pool 'J39722', 3,000%, fällig 01.10.2033	493	0,05	Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000%, fällig 01.02.2051	99	0,01
– Freddie Mac Gold Pool 'C01051', 8,000%, fällig 01.09.2030	–	–	316			195		
2			Freddie Mac Gold Pool 'J39962', 3,000%, fällig 01.12.2033	335	0,03	Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000%, fällig 01.02.2051	199	0,02
Freddie Mac Gold Pool 'C46047', 8,000%, fällig 01.12.2030	2	–	213			96		
			Freddie Mac Gold Pool 'Q26702', 4,000%, fällig 01.06.2044	240	0,02	Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000%, fällig 01.02.2051	98	0,01
			2.356			97		
			Freddie Mac Gold Pool 'U69040', 4,000%, fällig 01.05.2045	2.599	0,25	Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000%, fällig 01.03.2051	98	0,01
			99			293		
			Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000%, fällig 01.10.2042	109	0,01	Freddie Mac Pool 'QB9485', 2,000%, fällig 01.03.2051	298	0,03
						197		
						Freddie Mac Pool 'QB9485', 2,000%, fällig 01.03.2051	201	0,02
						98		
						Freddie Mac Pool 'QB9961', 2,000%, fällig 01.03.2051	99	0,01
						98		
						Freddie Mac Pool 'QC0160', 2,000%, fällig 01.03.2051	100	0,01

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)								
96			3.027			3.059		
Freddie Mac Pool 'QC0161', 2,000%, fällig 01.03.2051								
97	97	0,01	186	3.286	0,32		649	0,06
Freddie Mac Pool 'QC0288', 2,000%, fällig 01.04.2051								
198	98	0,01	196	201	0,02	1.045	1.077	0,10
Freddie Mac Pool 'QC0297', 2,000%, fällig 01.04.2051								
99	202	0,02	146	211	0,02	2.260	477	0,05
Freddie Mac Pool 'QC0885', 2,000%, fällig 01.04.2051								
99	101	0,01	108	161	0,02	4.606	4.403	0,43
Freddie Mac Pool 'QC1164', 2,000%, fällig 01.04.2051								
98	101	0,01	15	17	–	13.318	1.783	0,17
Freddie Mac Pool 'QC1352', 2,000%, fällig 01.04.2051								
195	100	0,01	502	597	0,06	3.087	378	0,04
Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500%, fällig 01.05.2051								
497	208	0,02	9	10	–	13.375	1.577	0,15
Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500%, fällig 01.07.2051								
998	521	0,05	12	14	–	5.908	730	0,07
Freddie Mac Pool 'QC4446', 2,500%, fällig 01.07.2051								
499	1.047	0,10	189	221	0,02	4.595	692	0,07
Freddie Mac Pool 'QC4689', 2,500%, fällig 01.08.2051								
499	527	0,05	603	691	0,07	1.917	260	0,03
Freddie Mac Pool 'QC4690', 2,500%, fällig 01.08.2051								
400	525	0,05	451	512	0,05	186	23	–
Freddie Mac Pool 'QC4818', 2,500%, fällig 01.08.2051								
597	418	0,04	16.234	17.230	1,68	2.702	404	0,04
Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500%, fällig 01.08.2051								
98	625	0,06	243	257	0,03	780	111	0,01
Freddie Mac Pool 'QK0701', 2,500%, fällig 01.04.2041								
1.635	103	0,01	315	337	0,03	5.509	679	0,07
Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000%, fällig 01.09.2049								
3.597	1.747	0,17	63	69	0,01	23.557	3.779	0,37
Freddie Mac Pool 'RA2114', 3,500%, fällig 01.02.2050								
9.679	3.829	0,37	2.924	3.134	0,30	13.421	1.599	0,16
Freddie Mac Pool 'RA2194', 3,000%, fällig 01.02.2050								
2.579	10.242	1,00	1.140	1.238	0,12	1.805	342	0,03
Freddie Mac Pool 'RA2608', 4,500%, fällig 01.05.2050								
1.894	2.790	0,27	203	221	0,02	4.000	4.096	0,40
Freddie Mac Pool 'RA3474', 3,000%, fällig 01.09.2050								
472	1.995	0,19	185	200	0,02	–	–	–
Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000%, fällig 01.11.2050								
2.276	481	0,05	545	598	0,06	1	1	–
Freddie Mac Pool 'RA4175', 2,500%, fällig 01.12.2050								
564	2.388	0,23	66	73	0,01	–	–	–
Freddie Mac Pool 'RA4414', 2,500%, fällig 01.01.2051								
674	590	0,06	230	249	0,02	–	–	–
Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000%, fällig 01.02.2051								
1.764	686	0,07	4.600	5.519	0,54	–	–	–
Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000%, fällig 01.05.2051								
1.085	1.798	0,17	4.489	956	0,09	–	–	–
Freddie Mac Pool 'RA5155', 2,000%, fällig 01.05.2051								
6.713	1.107	0,11	3.058	445	0,04	–	–	–
Freddie Mac Pool 'RA5255', 3,500%, fällig 01.05.2051								
199	7.115	0,69	1.861	75	0,01	–	–	–
Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000%, fällig 01.06.2051								
1.789	202	0,02	704	30	–	–	–	–
Freddie Mac Pool 'RA5576', 2,500%, fällig 01.07.2051								
5.000	1.878	0,18	1.859	393	0,04	–	–	–
Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000%, fällig 01.09.2041								
217	5.125	0,50	815	61	0,01	–	–	–
Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000%, fällig 01.07.2047								
341	236	0,02	2.011	418	0,04	–	–	–
Freddie Mac Pool 'SD0422', 4,500%, fällig 01.07.2045								
198	369	0,04	289	300	0,03	–	–	–
Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000%, fällig 01.04.2051								
397	201	0,02	2.271	403	0,04	–	–	–
Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500%, fällig 01.07.2051								
1.773	417	0,04	1.360	249	0,02	–	–	–
Freddie Mac Pool 'ZA2343', 3,500%, fällig 01.05.2034								
2.382	1.910	0,19	2.845	451	0,04	–	–	–
Freddie Mac Pool 'ZA2415', 3,000%, fällig 01.06.2036								
388	2.513	0,24	5.402	1.106	0,11	–	–	–
Freddie Mac Pool 'ZA5297', 4,000%, fällig 01.03.2048								
358	425	0,04				–	–	–
Freddie Mac Pool 'Zi9993', 5,000%, fällig 01.05.2040								
2.949	404	0,04				–	–	–
Freddie Mac Pool 'ZM1466', 3,500%, fällig 01.07.2046								
4.831	3.146	0,31				–	–	–
Freddie Mac Pool 'ZM3060', 4,000%, fällig 01.04.2047								
54	5.214	0,51				–	–	–
Freddie Mac Pool 'ZM8774', 5,000%, fällig 01.10.2048								
536	59	0,01				–	–	–
Freddie Mac Pool 'ZN0480', 3,500%, fällig 01.10.2042								
1.169	582	0,06				–	–	–
Freddie Mac Pool 'ZN0538', 3,500%, fällig 01.11.2042								
	1.269	0,12				–	–	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)			3.111	Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000%, fällig 20.07.2047	0,32	338	Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000%, fällig 20.11.2047	0,04
2		–	78	Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000%, fällig 20.01.2050	0,01	306	Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000%, fällig 20.12.2047	0,03
9		–	386	Ginnie Mae II Pool '785218', 2,000%, fällig 20.12.2050	0,04	99	Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000%, fällig 20.02.2048	0,01
6		–	384	Ginnie Mae II Pool '785219', 2,000%, fällig 20.12.2050	0,04	158	Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000%, fällig 20.03.2048	0,02
4		–	291	Ginnie Mae II Pool '785220', 2,000%, fällig 20.12.2050	0,03	328	Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500%, fällig 20.04.2048	0,03
2		–	381	Ginnie Mae II Pool '785221', 2,000%, fällig 20.12.2050	0,04	245	Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500%, fällig 20.05.2048	0,03
3		–	1.067	Ginnie Mae II Pool '785359', 2,000%, fällig 20.03.2051	0,11	35	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500%, fällig 20.06.2048	–
55		0,01	594	Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000%, fällig 20.03.2051	0,06	266	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500%, fällig 20.07.2048	0,03
14		–	3.103	Ginnie Mae II Pool '892346', 2,792%, fällig 20.08.2059 *	0,32	3.458	Ginnie Mae II Pool 'MA5399', 4,500%, fällig 20.08.2048	0,36
374		0,04	268	Ginnie Mae II Pool '892614', 2,143%, fällig 20.08.2060 *	0,03	78	Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500%, fällig 20.09.2048	0,01
153		0,02	1.145	Ginnie Mae II Pool 'AV0243', 3,500%, fällig 20.08.2046	0,12	120	Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500%, fällig 20.12.2048	0,01
367		0,04	1.724	Ginnie Mae II Pool 'AV8311', 3,500%, fällig 20.08.2046	0,18	399	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500%, fällig 20.01.2049	0,04
–		–	1.957	Ginnie Mae II Pool 'AV8312', 3,500%, fällig 20.08.2046	0,21	261	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500%, fällig 20.03.2049	0,03
2		–	1.002	Ginnie Mae II Pool 'AZ3074', 4,000%, fällig 20.02.2047	0,10	23	Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500%, fällig 20.04.2049	–
–		–	837	Ginnie Mae II Pool 'BC5293', 3,500%, fällig 20.08.2047	0,09	248	Ginnie Mae II Pool 'MA6412', 4,500%, fällig 20.01.2050	0,03
1		–	5.273	Ginnie Mae II Pool 'BC5429', 3,500%, fällig 20.10.2047	0,55	237	Ginnie Mae II Pool 'MA6602', 4,500%, fällig 20.04.2050	0,02
67		0,01	783	Ginnie Mae II Pool 'BD3554', 3,500%, fällig 20.10.2047	0,08	35.800	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000% ±	3,55
448		0,05	1.502	Ginnie Mae II Pool 'BD3636', 3,500%, fällig 20.10.2047	0,16	47.600	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500% ±	4,80
3		–	67	Ginnie Mae II Pool 'BG7951', 4,500%, fällig 20.06.2048	0,01	922	Government National Mortgage Association, Series 2004 81X Class SK, 6,105%, fällig 16.10.2034 *	0,01
424		0,04	1.304	Ginnie Mae II Pool 'BH1521', 4,500%, fällig 20.07.2048	0,14	1.677	Government National Mortgage Association, Series 2008 40X Class SC, 6,255%, fällig 16.05.2038 *	0,03
173		0,02	2.408	Ginnie Mae II Pool 'BH1870', 4,500%, fällig 20.08.2048	0,26	2.109	Government National Mortgage Association, Series 2008 79X Class ID, 6,712%, fällig 20.06.2035 *	0,04
212		0,02	1.301	Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500%, fällig 20.02.2050	0,13	544	Government National Mortgage Association, Series 2010 H02X Class FA, 0,906%, fällig 20.02.2060 *	0,05
61		0,01	259	Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000%, fällig 20.10.2049	0,03	1.124	Government National Mortgage Association, Series 2010 H20X Class AF, 0,433%, fällig 20.10.2060 *	0,11
323		0,03	975	Ginnie Mae II Pool 'BS1728', 4,000%, fällig 20.01.2050	0,10	1.416	Government National Mortgage Association, Series 2010 H22X Class FE, 0,453%, fällig 20.05.2059 *	0,14
299		0,03	852	Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000%, fällig 20.02.2050	0,09	554	Government National Mortgage Association, Series 2010 H28X Class FE, 0,503%, fällig 20.12.2060 *	0,05
3.487		0,36	97	Ginnie Mae II Pool 'BS8546', 2,500%, fällig 20.12.2050	0,01	936	Government National Mortgage Association, Series 2011 146X Class KS, 6,005%, fällig 16.11.2041 *	0,02
9		–	582	Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500%, fällig 20.12.2050	0,06	1.188	Government National Mortgage Association, Series 2011 79X Class KS, 5,312%, fällig 20.05.2041 *	0,02
13		–	2.914	Ginnie Mae II Pool 'BT9472', 4,000%, fällig 20.05.2050	0,31	3.822	Government National Mortgage Association, Series 2012 H21X Class FA, 0,603%, fällig 20.07.2062 *	0,37
935		0,11	4.118	Ginnie Mae II Pool 'BU3196', 4,000%, fällig 20.05.2050	0,44	13.718	Government National Mortgage Association, Series 2013 93X Class SA, 6,105%, fällig 16.06.2043 *	0,28
137		0,02	1.511	Ginnie Mae II Pool 'BW7380', 4,500%, fällig 20.07.2050	0,16	3.737	Government National Mortgage Association, Series 2014 117X Class SJ, 5,512%, fällig 20.08.2044 *	0,06
157		0,02	1.354	Ginnie Mae II Pool 'BW7384', 4,000%, fällig 20.08.2050	0,15			
79		0,01	2.053	Ginnie Mae II Pool 'BX2423', 3,000%, fällig 20.10.2050	0,21			
49		0,01	3.049	Ginnie Mae II Pool 'MA2677', 3,000%, fällig 20.03.2045	0,31			
55		0,01	253	Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500%, fällig 20.04.2046	0,03			
5		–	141	Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500%, fällig 20.05.2046	0,01			
116		0,01	244	Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500%, fällig 20.06.2046	0,03			
47		0,01	147	Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500%, fällig 20.07.2046	0,02			
18		–	8.766	Ginnie Mae II Pool 'MA4003', 3,000%, fällig 20.10.2046	0,90			
14		–	1.178	Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000%, fällig 20.02.2047	0,12			
623		0,07	661	Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000%, fällig 20.06.2047	0,07			
1.404		0,15	142	Ginnie Mae II Pool 'MA4587', 4,000%, fällig 20.07.2047	0,01			
1.036		0,11	202	Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500%, fällig 20.08.2047	0,02			
105		0,01	286	Ginnie Mae II Pool 'MA4781', 5,000%, fällig 20.10.2047	0,03			

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)								
732			5.885			15.198		
Government National Mortgage Association, Series 2014 118X Class HS, 6,112%, fällig 20.08.2044 *	166	0,02	Government National Mortgage Association, Series 2020 160X Class QI, 2,500%, fällig 20.10.2050	1.070	0,10	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5X Series 2018 5X Class AX1X 144 A 0,284%, fällig 25.10.2048 * †	53	0,01
1.156			288			1.662		
Government National Mortgage Association, Series 2014 2X Class CI, 4,500%, fällig 20.01.2044	245	0,02	Government National Mortgage Association, Series 2020 160X Class VI, 2,500%, fällig 20.10.2050	38	–	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3X Series 2018 3A, Class A1X 144 A 4,500%, fällig 25.05.2058 *	1.801	0,18
3.400			865			Summe hypothekarisch gesicherte Wertpapiere (Kosten 956.599 USD)		
Government National Mortgage Association, Series 2014 60X Class SA, 6,005%, fällig 16.04.2044 *	678	0,07	Government National Mortgage Association, Series 2020 160X Class YI, 2,500%, fällig 20.10.2050	118	0,01	966.211	93,98	
11.228			1.534			Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 17,87 % (28. Februar 2021: 8,38 %)		
Government National Mortgage Association, Series 2015 136X Class IO, 0,504%, fällig 16.08.2055 *	308	0,03	Government National Mortgage Association, Series 2020 181X Class WI, 2,000%, fällig 20.12.2050	157	0,02	Vereinigte Staaten – 17,87 % (28. Februar 2021: 8,38 %)		
5.428			4.408			100.000		
Government National Mortgage Association, Series 2015 177X Class MI, 5,000%, fällig 20.10.2044	1.003	0,10	Government National Mortgage Association, Series 2020 191X Class IX, 2,500%, fällig 20.12.2050	807	0,08	United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 02.09.2021	100.000	9,73
31.833			6.111			70.000		
Government National Mortgage Association, Series 2017 111X Class IO, 0,598%, fällig 16.02.2059 *	1.402	0,14	Government National Mortgage Association, Series 2020 36X Class GS, 6,012%, fällig 20.03.2050 *	1.176	0,11	United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 05.10.2021	69.998	6,81
2.682			725			2.820		
Government National Mortgage Association, Series 2017 19X Class SE, 6,055%, fällig 16.02.2047 *	561	0,05	Government National Mortgage Association, Series 2020 47X Class MI, 3,500%, fällig 20.04.2050	106	0,01	United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 24.02.2022	2.819	0,27
5.524			271			2.600		
Government National Mortgage Association, Series 2017 26X Class IQ, 5,000%, fällig 20.02.2040	1.028	0,10	Government National Mortgage Association, Series 2020 47X Class NI, 3,500%, fällig 20.04.2050	42	–	United States Treasury Bill, Zero coupon, fällig 11.08.2022	2.598	0,25
12.052			1.812			60		
Government National Mortgage Association, Series 2017 8X Class IO, 0,521%, fällig 16.08.2058 *	491	0,05	Government National Mortgage Association, Series 2020 61X Class CI, 4,000%, fällig 20.03.2050	212	0,02	United States Treasury Note/ Bond, 1,125%, fällig 28.02.2025	61	0,01
2.957			1.315			8.220		
Government National Mortgage Association, Series 2018 125X Class HS, 6,162%, fällig 20.09.2048 *	433	0,04	Government National Mortgage Association, Series 2020 85X Class CI, 3,500%, fällig 20.04.2050	161	0,02	United States Treasury Note/Bond, 0,750%, fällig 30.04.2026	8.228	0,80
5.026			8.922			183.704		
Government National Mortgage Association, Series 2018 134X Class SM, 6,112%, fällig 20.10.2048 *	741	0,07	Government National Mortgage Association, Series 2020 H08X Class BI, 0,609%, fällig 01.04.2070 *	440	0,04	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 183.658 USD)		
1.036			1.895			183.704	17,87	
Government National Mortgage Association, Series 2018 37X Class QA, 2,750%, fällig 20.03.2048	1.103	0,11	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09X Class FL, 1,238%, fällig 20.05.2070 *	1.992	0,19	Organismen für gemeinsame Anlagen – 9,00 % (28. Februar 2021: 9,00 %)		
4.478			264			92.521		
Government National Mortgage Association, Series 2019 1X Class LS, 5,962%, fällig 20.01.2049 *	781	0,08	Government National Mortgage Association, Series 2020 H12X Class F, 0,588%, fällig 20.07.2070 *	266	0,03	Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 92.521 USD)		
50			1.562			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.244.811 USD)		
Government National Mortgage Association, Series 2019 123X Class A, 3,000%, fällig 20.10.2049	51	–	Government National Mortgage Association, Series 2020 H13X Class FA, 0,538%, fällig 20.07.2070 *	1.574	0,15	1.254.730	122,04	
500			29.717			Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
Government National Mortgage Association, Series 2019 128X Class AL, 2,500%, fällig 20.10.2049	521	0,05	Government National Mortgage Association, Series 2021 110X Class IO, 0,890%, fällig 16.11.2063 *	2.509	0,24	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 4 –		
762			11.778			Futures – 0,02 % (28. Februar 2021: 0,15 %)		
Government National Mortgage Association, Series 2019 28X Class AB, 3,150%, fällig 16.06.2060 *	782	0,08	Government National Mortgage Association, Series 2021 29X Class DI, 2,000%, fällig 20.02.2051	1.468	0,14	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 229 0,02		
20.018			51.524			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
Government National Mortgage Association, Series 2019 85X Class LS, 3,202%, fällig 20.07.2049 *	1.406	0,14	Government National Mortgage Association, Series 2021 37X Class IO, 0,805%, fällig 16.01.2061 *	3.852	0,37	1.254.963	122,06	
6.874			24.301			Zinsswaps – (0,06 %) (28. Februar 2021: (0,04 %))		
Government National Mortgage Association, Series 2020 116X Class GI, 2,500%, fällig 20.08.2050	878	0,09	Government National Mortgage Association, Series 2021 5X Class IO, 1,094%, fällig 16.01.2061 *	2.264	0,22	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (583) (0,06)		
2.255			31.780			Futures – (0,03 %) (28. Februar 2021: (0,15 %))		
Government National Mortgage Association, Series 2020 122X Class IM, 2,500%, fällig 20.08.2050	296	0,03	Government National Mortgage Association, Series 2021 60X Class IO, 0,836%, fällig 16.05.2063 *	2.499	0,24	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (315) (0,03)		
4.787			5.703			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
Government National Mortgage Association, Series 2020 123X Class EI, 2,500%, fällig 20.08.2050	632	0,06	Government National Mortgage Association, Series 2021 7X Class TI, 2,500%, fällig 16.01.2051	991	0,10	1.254.065	121,97	
575			3.740			Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
Government National Mortgage Association, Series 2020 129X Class IE, 2,500%, fällig 20.09.2050	79	0,01	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5X Class A, 144 A 1,646%, fällig 15.09.2031 *	3.403	0,33	(225.942)	(21,97)	
193			3.880			Gesamtnettovermögen		
Government National Mortgage Association, Series 2020 160X Class IH, 2,500%, fällig 20.10.2050	26	–	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5X Class B, 144 A 2,846%, fällig 15.09.2031 *	3.151	0,31	\$1.028.123	100,00	
			2.120			-		
			GS Mortgage Securities Trust 2017-GS8X Series 2017 GS8X Class A4X 3,469%, fällig 10.11.2050	2.353	0,23	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 31.560.000 USD und machten 3,09 % des Nettovermögens aus.		
						*		
						Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.		
						†		
						Illiquid.		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

∞	Das Wertpapier wurde vom Manager oder dem jeweiligen Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.		% von Gesamt Vermögen
±	Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.	Analyse des Gesamtvermögens	Vermögen
	ABKÜRZUNGEN:	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	75,27
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.	Organismen für gemeinsame Anlagen	5,99
TBA	– Wird noch bekanntgegeben	Finanzderivate	0,02
		Sonstige Vermögenswerte	18,72
		Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,250%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2028	39.022	\$ (475)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520%, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2047	4.368	(108)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (332) USD)				(583)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (332) USD)				\$ (583)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 757	Verkauf USD 891	\$ 4
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 9 USD)				\$ 4
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				–
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 9 USD)				\$ 4

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro\$ Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	2	\$499	\$ –
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	146	36.148	11
90 Day Euro\$ September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(205)	(51.188)	(6)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(66)	(8.808)	(11)
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	204	30.195	126
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(664)	(146.298)	(100)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	412	50.972	92
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	36	5.867	(22)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	260	51.293	(176)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Future-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.252 USD)				\$ 229
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.278) USD)				(315)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (26) USD)				\$ (86)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) £	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) £	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) £	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 90,57 % (28. Februar 2021: 90,39 %)			1.590 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 6,000%, fällig 07.12.2028	2.187	2,78	463 Aspire Defence Finance Plc, Series A, 4,674%, fällig 31.03.2040	614	0,78
Australien – 1,12 % (28. Februar 2021: 1,16 %)			300 Muenchener Rueckversicherungs Gesellschaft AG in Muenchen, 6,625%, fällig 26.05.2042 *	313	0,40	470 Assura Financing Plc, 3,000%, fällig 19.07.2028	523	0,66
	360 APT Pipelines Ltd, 3,125%, fällig 18.07.2031	0,50	400 Volkswagen Financial Services NV, 1,625%, fällig 30.11.2022	404	0,51	270 Assura Financing Plc, 1,625%, fällig 30.06.2033	272	0,34
	100 BHP Billiton Finance Ltd, 6,500%, fällig 22.10.2077 *	0,14	200 Volkswagen Financial Services NV, 2,125%, fällig 27.06.2024	207	0,26	237 Aviva Plc, 5,125%, fällig 04.06.2050 *	284	0,36
	370 Glencore Finance Europe Ltd, 6,000%, fällig 03.04.2022	0,48	400 Volkswagen International Finance NV, 3,375%, fällig 16.11.2026	444	0,56	190 Aviva Plc, 6,875%, fällig 20.05.2058 *	307	0,39
		884		5.213	6,62	70 Aviva Plc, 6,125%, Perpetual *	74	0,09
Belgien – 1,06 % (28. Februar 2021: 1,05 %)						140 Backward 2017 Ltd, 2,125%, fällig 25.03.2053	149	0,19
	166 Anheuser-Busch InBev SA/NV, 4,000%, fällig 24.09.2025	0,24	Italien – 1,90 % (28. Februar 2021: 1,91 %)			444 BAE Systems Plc, 4,125%, fällig 08.06.2022	456	0,58
	380 Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2,850%, fällig 25.05.2037	0,53	481 Enel Finance International NV, 5,750%, fällig 14.09.2040	743	0,94	610 Barclays Plc, 2,375%, fällig 06.10.2023 *	621	0,79
USD	21) Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,800%, fällig 23.01.2059	0,29	397 FCA Bank SpA/Ireland, 1,625%, fällig 29.09.2021	398	0,51	EUR 360 Barclays Plc, 3,375%, fällig 02.04.2025 *	336	0,43
		836	USD 400 UniCredit SpA, 7,296%, fällig 02.04.2034 *	352	0,45	260 Barclays Plc, 1,700%, fällig 03.11.2026 *	264	0,34
				1.493	1,90	493 Barclays Plc, 3,250%, fällig 12.02.2027	536	0,68
Kanada – 1,13 % (28. Februar 2021: 1,17 %)			Niederlande – 1,86 % (28. Februar 2021: 2,04 %)			310 BP Capital Markets Plc, 2,274%, fällig 03.07.2026	329	0,42
	340 Bank of Montreal, 1,375%, fällig 29.12.2021	0,43	300 Cooperatieve Rabobank UA, Series 2541X 4,000%, fällig 19.09.2022	311	0,40	800 British Land Co Plc/The, 2,375%, fällig 14.09.2029	830	1,05
	540 Royal Bank of Canada, 1,375%, fällig 09.12.2024	0,70	600 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625%, fällig 23.05.2029	718	0,91	193 BUPA Finance Plc, 5,000%, fällig 25.04.2023	206	0,26
		892	400 ING Groep NV, 3,000%, fällig 18.02.2026	433	0,55	130 Burberry Group Plc, 1,125%, fällig 21.09.2025	130	0,17
Dänemark – 1,18 % (28. Februar 2021: 1,20 %)				1.462	1,86	350 Cadent Finance Plc, 2,625%, fällig 22.09.2038	370	0,47
	350 Danske Bank A/S, 2,250%, fällig 14.01.2028 *	0,46	Südafrika – 0,38 % (28. Februar 2021: 0,38 %)			200 Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge/The, 2,350%, fällig 27.06.2078	291	0,37
	145 Orsted AS, 4,875%, fällig 12.01.2032	0,24	270 Anglo American Capital Plc, 3,375%, fällig 11.03.2029	298	0,38	300 Clarion Funding Plc, 1,250%, fällig 13.11.2032	292	0,37
	250 Orsted AS, 2,500%, fällig 16.05.2033	0,35	Spanien – 0,85 % (28. Februar 2021: 0,88 %)			300 Clarion Funding Plc, 1,875%, fällig 22.01.2035	307	0,39
	100 Orsted AS, Series GBP, 2,500%, fällig 18.02.3021 *	0,13	400 Banco Santander SA, 2,750%, fällig 12.09.2023	416	0,53	150 Clarion Funding Plc, 3,125%, fällig 19.04.2048	188	0,24
		930	200 Telefonica Emisiones SA, 5,445%, fällig 08.10.2029	256	0,32	189 Close Brothers Finance Plc, 2,750%, fällig 19.10.2026	205	0,26
Finnland – 0,28 % (28. Februar 2021: 0,29 %)				672	0,85	420 Close Brothers Group Plc, 2,750%, fällig 26.04.2023	433	0,55
	220 Nordea Bank Abp, 2,375%, fällig 02.06.2022	0,28	Supranational – 4,00 % (28. Februar 2021: 5,15 %)			320 Close Brothers Group Plc, 2,000%, fällig 11.09.2031 *	323	0,41
Frankreich – 5,30 % (28. Februar 2021: 5,28 %)						191 Clydesdale Bank Plc, 4,625%, fällig 08.06.2026	226	0,29
	150 AXA SA, 5,625%, fällig 16.01.2054 *	0,24	Schweden – 2,29 % (28. Februar 2021: 0,89 %)			257 Coventry Building Society, 5,875%, fällig 208.09.2022	271	0,34
	184 AXA SA, 6,686%, Perpetual *	0,29	380 Svenska Handelsbanken AB, 2,375%, fällig 18.01.2022	383	0,49	300 Coventry Building Society, 2,000%, fällig 20.12.2030	308	0,39
	290 BNP Paribas SA, 3,375%, fällig 23.01.2026	0,40	290 Swedbank AB, 1,250%, fällig 29.12.2021	291	0,37	606 CPMK Finance Ltd, 3,588%, fällig 28.08.2025	656	0,83
	500 BNP Paribas SA, 1,875%, fällig 14.12.2027	0,65	550 Swedbank AB, 1,375%, fällig 08.12.2027 *	553	0,70	195 Crh Finance UK Plc, 4,125%, fällig 02.12.2029	235	0,30
	300 BNP Paribas SA, 2,000%, fällig 24.05.2031 *	0,39	570 Vattenfall AB, 2,500%, fällig 29.06.2083 *	575	0,73	156 Dignity Finance Plc, Series A, 3,546%, fällig 31.12.2034	176	0,22
	300 BNP Paribas SA, 1,250%, fällig 13.07.2031	0,36		1.802	2,29	152 Eastern Power Networks Plc, 5,750%, fällig 08.03.2024	171	0,22
	200 BPCE SA, 5,250%, fällig 16.04.2029	0,32	Schweiz – 1,83 % (28. Februar 2021: 1,85 %)			92 Eastern Power Networks Plc, 6,250%, fällig 12.11.2036	147	0,19
	100 CNP Assurances, 7,375%, fällig 30.09.2041 *	0,13	110 Credit Suisse Group AG, 2,125%, fällig 12.09.2025 *	113	0,14	370 Experian Finance Plc, 0,739%, fällig 29.10.2025	368	0,47
	220 Credit Agricole SA, 7,500%, Perpetual *	0,33	350 Credit Suisse Group AG, 2,250%, fällig 09.06.2028 *	361	0,46	170 Experian Finance Plc, 3,250%, fällig 07.04.2032	196	0,25
	300 Electricite de France SA, 5,500%, fällig 27.03.2037	0,55	389 Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd, 3,000%, fällig 27.05.2022	396	0,50	319 FCE Bank Plc, 2,727%, fällig 03.06.2022	324	0,41
	100 Electricite de France SA, 5,500%, fällig 17.10.2041	0,19	USD 350 Glencore Finance Canada Ltd, 6,000%, fällig 15.11.2041	341	0,43	220 Folio Residential Finance NO 1 Plc, 1,246%, fällig 30.1.2027	222	0,28
	100 Electricite de France SA, 6,000%, fällig 23.01.2114	0,24	210 Holcim Sterling Finance Netherlands BV, 3,000%, fällig 12.05.2032	231	0,30	278 Gatwick Funding Ltd, 6,125%, fällig 02.03.2026	332	0,42
	219 Orange SA, 5,750%, Perpetual *	0,30		1.442	1,83	100 Gatwick Funding Ltd, 2,500%, fällig 15.04.2030	101	0,13
	400 TotalEnergies Capital International SA, 1,405%, fällig am 03.09.2031	0,51	Großbritannien – 42,95 % (28. Februar 2021: 42,16 %)			340 Gatwick Funding Ltd, 3,250%, fällig 26.02.2048	365	0,46
	200 Veolia Environnement SA, 6,125%, fällig 29.10.2037	0,40	160 Anglian Water Osprey Financing Plc, 2,000%, fällig 31.07.2028	162	0,21	190 GlaxoSmithKline Capital Plc, 6,375%, fällig 09.03.2039	321	0,41
		4.170	220 Anglian Water Services Financing Plc, 1,625%, fällig 10.08.2025	228	0,29			
Deutschland – 6,62 % (28. Februar 2021: 6,82 %)			603 Annington Funding Plc, 2,646%, fällig 12.07.2025	636	0,81			
	370 BMW International Investment BV, 1,000%, fällig 17.11.2021	0,47						
	190 Deutsche Telekom AG, 3,125%, fällig 06.02.2034	0,28						
	200 Deutsche Telekom International Finance BV, 6,500%, fällig 08.04.2022	0,26						
	550 E.ON International Finance BV, 6,125%, fällig 06.07.2039	1,10						

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) £	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) £	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) £	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			460 Natwest Group Plc, 2,105%, fällig 28.11.2031 *	466	0,59	200 Bank of America Corp, 7,000%, fällig 31.07.2028	275	0,35
Großbritannien – (Fortsetzung)			120 Notting Hill Genesis, 2,875%, fällig 31.01.2029	132	0,17	330 Bank of America Corp, 1,667%, fällig 02.06.2029 *	334	0,42
104 GlaxoSmithKline Capital Plc, 4,250%, fällig 18.12.2045	152	0,19	390 Paragon Treasury Plc, 2,000%, fällig 07.05.2036	403	0,51	180 Becton Dickinson and Co, 3,020%, fällig 24.05.2025	193	0,25
210 Grainger Plc, 3,375%, fällig 24.04.2028	229	0,29	190 RSA Insurance Group Ltd, 5,125%, fällig 10.10.2045 *	217	0,27	260 Berkshire Hathaway Finance Corp, 2,625%, fällig 19.06.2059	313	0,40
190 Grainger Plc, 3,000%, fällig 03.07.2030	203	0,26	120 Sanctuary Capital Plc, 5,000%, fällig 26.04.2047	197	0,25	519 Citigroup Inc, 7,375%, fällig 01.09.2039	958	1,22
168 Greene King Finance Plc, Series A2X 5,318%, fällig 15.09.2031	194	0,25	190 Sanctuary Capital Plc, 2,375%, fällig 14.04.2050	211	0,27	190 Comcast Corp, 1,875%, fällig 20.02.2036	191	0,24
230 Greene King Finance Plc, Series B1X 1,881%, fällig 15.12.2034 *	194	0,25	440 Santander UK Group Holdings Plc, 2,920%, fällig 08.05.2026 *	466	0,59	USD 60 CVS Health Corp, 4,125%, fällig 01.04.2040	51	0,06
310 Guinness Partnership Ltd/The, 2,000%, fällig 22.04.2055	329	0,42	170 Santander UK Plc, 5,750%, fällig 02.03.2026	209	0,26	200 Digital Stout Holding LLC, 3,750%, fällig 17.10.2030	231	0,29
400 HSBC Holdings Plc, 7,000%, fällig 07.04.2038	619	0,79	467 Santander UK Plc, 3,875%, fällig 15.10.2029	564	0,72	330 GE Capital UK Funding Unlimited Co, 5,875%, fällig 18.01.2033	460	0,58
387 HSBC Holdings Plc, 6,000%, fällig 29.03.2040	558	0,71	120 Scotland Gas Networks Plc, Series A3S, 4,875%, fällig 21.12.2034	160	0,20	210 GE Capital UK Funding Unlimited Co, 8,000%, fällig 14.01.2039	377	0,48
430 HSBC Holdings Plc, 5,875%, Perpetual *	482	0,61	198 Scottish Widows Ltd, 7,000%, fällig 16.06.2043	313	0,40	USD 33 General Electric Co, 6,875%, fällig 10.01.2039	36	0,05
100 Hutchison Whampoa Finance UK Plc, Series B, 5,625%, fällig 24.11.2026	123	0,16	350 Segro Plc, 2,875%, fällig 10.10.2037	406	0,52	560 General Motors Financial Co Inc, 2,350%, fällig 03.09.2025	583	0,74
210 Land Securities Capital Markets Plc, 2,399%, fällig 08.02.2029	224	0,28	180 Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,000%, fällig 02.06.2040	183	0,23	247 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,500%, fällig 12.10.2021	248	0,32
100 Land Securities Capital Markets Plc, 2,625%, fällig 22.09.2037	110	0,14	100 Severn Trent Utilities Finance Plc, 4,875%, fällig 24.01.2042	149	0,19	309 Goldman Sachs Group Inc/The, 7,125%, fällig 07.08.2025	380	0,48
190 Leeds Building Society, 3,750%, fällig 25.04.2029 *	206	0,26	252 South Eastern Power Networks Plc, 5,500%, fällig 05.06.2026	304	0,39	580 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,125%, fällig 25.07.2029	647	0,82
240 Legal & General Group Plc, 3,750%, fällig 26.11.2049 *	261	0,33	191 Southern Gas Networks Plc, 2,500%, fällig 03.02.2025	201	0,26	110 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,875%, fällig 18.01.2038	176	0,22
190 Legal & General Group Plc, 4,500%, fällig 01.11.2050 *	219	0,28	380 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500%, fällig 02.05.2025	401	0,51	300 JPMorgan Chase & Co, 1,895%, fällig 28.04.2033 *	306	0,39
330 Liberty Living Finance Plc, 3,375%, fällig 28.11.2029	368	0,47	190 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,750%, fällig 27.04.2030	205	0,26	191 Kraft Heinz Foods Co, 4,125%, fällig 01.07.2027	215	0,27
120 LiveWest Treasury Plc, 2,250%, fällig 10.10.2043	131	0,17	397 Tesco Property Finance 3 Plc, 5,744%, fällig 13.04.2040	537	0,68	200 McDonald's Corp, 2,950%, fällig 15.03.2034	228	0,29
430 Lloyds Bank Plc, 5,125%, fällig 07.03.2025	498	0,63	190 UNITE Group Plc/The, 3,500%, fällig 15.10.2028	213	0,27	92 MetLife Inc, 5,375%, fällig 09.12.2024	106	0,13
510 Lloyds Bank Plc, 7,625%, fällig 22.04.2025	629	0,80	350 UNITE USAF II Plc, 3,921%, fällig 30.06.2025	384	0,49	220 Mondelez International Inc, 4,500%, fällig 03.12.2035	285	0,36
453 Lloyds Bank Plc, 6,500%, fällig 17.09.2040	792	1,01	220 United Utilities Water Finance Plc, 1,875%, fällig 03.06.2042	221	0,28	440 Morgan Stanley, 2,625%, fällig 09.03.2027	473	0,60
340 Lloyds Banking Group Plc, 5,125%, Perpetual *	361	0,46	170 University of Oxford, 2,544%, fällig 08.12.2117	234	0,30	380 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692%, fällig 05.06.2028	407	0,52
350 Logisor 2019-1 UK Plc, 1,875%, fällig 17.11.2026	366	0,46	460 Vodafone Group Plc, 3,375%, fällig 08.08.2049	547	0,69	210 Prologis LP, 2,250%, fällig 30.06.2029	226	0,29
280 London Stock Exchange Group Plc, 1,625%, fällig 06.04.2030	283	0,36	410 Vodafone Group Plc, 3,000%, fällig 12.08.2056	457	0,58	365 Time Warner Cable LLC, 5,750%, fällig 02.06.2031	474	0,60
177 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,125%, fällig 02.04.2024	191	0,24	260 Wellcome Trust Ltd/The, 2,517%, fällig 07.02.2118	352	0,45	300 Toyota Motor Credit Corp, 0,750%, fällig 19.11.2026	297	0,38
340 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,750%, fällig 31.03.2034	428	0,54	362 Western Power Distribution East Midlands Plc, 5,250%, fällig 17.01.2023	385	0,49	590 Verizon Communications Inc, 1,875%, fällig 19.09.2030	602	0,77
160 Manchester Airport Group Funding Plc, 2,875%, fällig 30.09.2044	165	0,21	275 Western Power Distribution East Midlands Plc, 6,250%, fällig 10.12.2040	457	0,58	110 Verizon Communications Inc, 2,500%, fällig 08.04.2031	118	0,15
305 Marston's Issuer Plc, Series A3X 5,177%, fällig 15.07.2032 *	319	0,40	100 Whitbread Group Plc, 2,375%, fällig 31.05.2027	101	0,13	320 Verizon Communications Inc, 1,875%, fällig 03.11.2038	312	0,40
108 Marston's Issuer Plc, Series B1X 2,628%, fällig 16.07.2035 *	87	0,11	100 Whitbread Group Plc, 3,000%, fällig 31.05.2031	103	0,13	26 Walmart Inc, 5,250%, fällig 208.09.2035	39	0,05
34 Mitchells & Butlers Finance Plc, Series B1X 5,965%, fällig 15.12.2023	36	0,05	320 Wm Morrison Supermarkets Plc, 2,500%, fällig 01.10.2031	322	0,41	310 Wells Fargo & Co, 1,375%, fällig 30.06.2022	312	0,40
95 Mitchells & Butlers Finance Plc, Series B2X 6,013%, fällig 15.12.2028	105	0,13	180 Yorkshire Building Society, 3,500%, fällig 21.04.2026	201	0,26	850 Wells Fargo & Co, 4,875%, fällig 29.11.2035	1.125	1,43
300 National Express Group Plc, 2,375%, fällig 20.11.2028	311	0,40		33.801	42,95	200 Wells Fargo Bank NA, 5,250%, fällig 01.08.2023	216	0,27
250 National Grid Electricity Transmission Plc, 2,000%, fällig 17.04.2040	251	0,32	Vereinigte Staaten — 17,82 % (28. Februar 2021: 17,54 %)				14.022	17,82
310 National Grid Gas Plc, 1,375%, fällig 07.02.2031	299	0,38	USD 700 AbbVie Inc, 3,200%, fällig 21.11.2029	557	0,71	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 66,27 GBP)		
100 Nationwide Building Society, 3,000%, fällig 06.05.2026	110	0,14	141 Amgen Inc, 4,000%, fällig 13.09.2029	169	0,21	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 6,48 % (28. Februar 2021: 6,75 %)		
206 Nationwide Building Society, 3,250%, fällig 20.01.2028	235	0,30	USD 100 Apache Corp, 4,750%, fällig 15.04.2043	78	0,10	Deutschland – 0,42 % (28. Februar 2021: 0,43 %)		
230 Natwest Group Plc, 3,125%, fällig 28.03.2027 *	247	0,31	420 AT&T Inc, Series GBP, 2,900%, fällig 04.12.2026	454	0,58	EUR 370 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000%, fällig 15.02.2030	332	0,42
			383 AT&T Inc, 4,250%, fällig 01.06.2043	492	0,63			
			900 Bank of America Corp, 6,125%, fällig 15.09.2021	902	1,15			
			174 Bank of America Corp, 5,500%, fällig 22.11.2021	176	0,22			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) £	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) £	% des Netto- inventar- werts	% von Gesamt Vermögen
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Futures – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,05 %)			
Großbritannien – 5,12 % (28. Februar 2021: 5,39 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			6
250 United Kingdom Gilt, 1,000%, fällig 22.04.2024	255	0,33	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			97,06
2.560 United Kingdom Gilt, 2,750%, fällig 07.09.2024	2.756	3,50	Devisenterminkontrakte – (0,04 %)			
200 United Kingdom Gilt, 0,625%, fällig 07.06.2025	203	0,26	(28. Februar 2021: 0,00 %)			
140 United Kingdom Gilt, 2,000%, fällig 07.09.2025	150	0,19	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(32)
380 United Kingdom Gilt, 1,500%, fällig 22.07.2026	402	0,51	Futures – (0,04 %)			
250 United Kingdom Gilt, 1,250%, fällig 22.07.2027	262	0,33	(28. Februar 2021: (0,08 %))			
	4.028	5,12	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(28)
Vereinigte Staaten – 0,94 % (28. Februar 2021: 0,93 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			(60)
USD 510 United States Treasury Note/Bond, 1,500%, fällig 30.10.2024	383	0,49	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			76.329
USD 140 United States Treasury Note/Bond, 2,875%, fällig 15.05.2049	123	0,16	Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			2.376
USD 230 United States Treasury Note/Bond, 2,250%, fällig 15.08.2049	179	0,23	Gesamtnettvermögen			£78.705
USD 70 United States Treasury Note/Bond, 2,000%, fällig 15.02.2050	52	0,06				100,00
	737	0,94				
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 5,114 GBP)						
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 71,321 GBP)						

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

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

ABKÜRZUNGEN:

Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

EUR – Euro
USD – US-Dollar

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
18.11.2021	Citi	Kauf	GBP 930	Verkauf	USD 1.284	£ (7)
18.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	GBP 1.294	Verkauf	USD 1.793	(10)
18.11.2021	JP Morgan	Kauf	GBP 187	Verkauf	USD 260	(1)
18.11.2021	UBS	Kauf	GBP 904	Verkauf	EUR 1.067	(14)
18.11.2021	UBS	Kauf	GBP 423	Verkauf	USD 586	(3)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 49 GBP)					£ –	
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – GBP)					(32)	
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 49 GBP)					£ (32)	

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bund September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(2)	£ (301)
Long Gilt Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	13	1.667
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(15)	(1.456)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	37	3.329
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	9	1.067
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(861)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 38 GBP)			\$ 6
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (65) GBP)			(28)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (27) GBP)			\$ (22)

[^] 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 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,16 %)			128 MEG Energy Corp, 144 A 6,500%, fällig 15.01.2025	137	0,07	41) AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,150%, fällig 15.02.2024	429	0,23	
300 SMB Private Education Loan Trust 2020-A, Series 2020 A, Class A2A, 144 A 2,230%, fällig 15.09.2037	309	0,16	150 MEG Energy Corp, 144 A 7,125%, fällig 01.02.2027	158	0,08	28 Avolon Holdings Funding Ltd, 144 A 3,625%, fällig 01.05.2022	29	0,01	
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Kosten 310 USD)			90 MEG Energy Corp, 144 A 5,875%, fällig 01.02.2029	93	0,05	180 Avolon Holdings Funding Ltd, 144 A 5,125%, fällig 01.10.2023	194	0,10	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 90,35 % (28. Februar 2021: 87,35 %)			480 Royal Bank of Canada, 1,150%, fällig 14.07.2026	482	0,25	380 Avolon Holdings Funding Ltd, 144 A 4,250%, fällig 15.04.2026	412	0,22	
Argentinien – 0,29 % (28. Februar 2021: 0,29 %)			50 Teck Resources Ltd, 3,900%, fällig 15.07.2030	55	0,03	290 SMBC Aviation Capital Finance DAC, 144 A 4,125%, fällig 15.07.2023	307	0,16	
560 MercadoLibre Inc, 3,125%, fällig 14.01.2031	554	0,29	290 Teck Resources Ltd, 6,250%, fällig 15.07.2041	387	0,20				
Australien – 0,77 % (28. Februar 2021: 0,73 %)			10 Teck Resources Ltd, 5,400%, fällig 01.02.2043	12	0,01				
200 Commonwealth Bank of Australia, 144 A 2,688%, fällig 11.03.2031	202	0,11	60 TransAlta Corp, 6,500%, fällig 15.03.2040	71	0,04				
200 Commonwealth Bank of Australia, 144 A 3,743%, fällig 12.09.2039	222	0,12	80 Videotron Ltd, 144 A 3,625%, fällig 15.06.2029	82	0,04				
200 Commonwealth Bank of Australia, 144 A 3,305%, fällig 11.03.2041	208	0,11	350 Yamana Gold Inc, 4,625%, fällig 15.12.2027	392	0,21				
30 Glencore Funding LLC, 144 A 3,000%, fällig 27.10.2022	31	0,02	130 Yamana Gold Inc, 144 A 2,630%, fällig 15.08.2031	130	0,07				
460 Glencore Funding LLC, 144 A 4,625%, fällig 29.04.2024	504	0,27			4.657	2,46			
120 Glencore Funding LLC, 144 A 1,625%, fällig 01.09.2025	121	0,06	Kaimaninseln – 0,10 % (28. Februar 2021: 0,14 %)						
40 Glencore Funding LLC, 144 A 3,875%, fällig 27.10.2027	44	0,02	194 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144 A 6,500%, fällig 15.09.2024	193	0,10	Israel – 0,02 % (28. Februar 2021: 0,53 %)			
120 Westpac Banking Corp, 2,668%, fällig 15.11.2035 *	119	0,06				40 Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950%, fällig 18.12.2022	40	0,02	
		1.451				Italien – 2,06 % (28. Februar 2021: 1,88 %)			
Belgien – 0,55 % (28. Februar 2021: 0,52 %)			China – 0,73 % (28. Februar 2021: 0,52 %)						
280 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650%, fällig 01.02.2026	309	0,16	200 Alibaba Group Holding Ltd, 2,125%, fällig 09.02.2031	197	0,10	730 Intesa Sanpaolo SpA, 144 A 3,125%, fällig 14.07.2022	747	0,39	
590 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600%, fällig 15.04.2048	727	0,39	200 Alibaba Group Holding Ltd, 2,700%, fällig 09.02.2041	189	0,10	800 Intesa Sanpaolo SpA, 144 A 3,375%, fällig 12.01.2023	830	0,44	
		1.036	640 Alibaba Group Holding Ltd, 3,150%, fällig 09.02.2051	631	0,33	200 Intesa Sanpaolo SpA, 144 A 4,198%, fällig 01.06.2032	206	0,11	
Bermuda – 0,14 % (28. Februar 2021: 0,25 %)			80 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144 A 3,400%, fällig 01.05.2030	88	0,05	310 Intesa Sanpaolo SpA, 144 A 4,950%, fällig 01.06.2042	322	0,17	
250 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144 A 7,625%, fällig 15.10.2025	266	0,14	260 Tencent Holdings Ltd, 144 A 3,840%, fällig 22.04.2051	282	0,15	400 Intesa Sanpaolo SpA, Series XR, 144 A 4,700%, fällig 23.09.2049	487	0,26	
Brasilien – 0,72 % (28. Februar 2021: 0,22 %)					1.387	0,73	1.290 UniCredit SpA, 144 A 6,572%, fällig 14.01.2022	1.317	0,69
200 Klabin Austria GmbH, 144 A 3,200%, fällig 12.01.2031	197	0,10	Kolumbien – 0,09 % (28. Februar 2021: 0,09 %)					3.909	2,06
120 Petrobras Global Finance BV, 5,999%, fällig 27.01.2028	138	0,07	160 Ecopetrol SA, 5,875%, fällig 28.05.2045	172	0,09	Japan – 1,37 % (28. Februar 2021: 1,24 %)			
520 Petrobras Global Finance BV, 6,900%, fällig 19.03.2049	618	0,33	Dänemark – 1,11 % (28. Februar 2021: 1,11 %)						
130 Petrobras Global Finance BV, 5,500%, fällig 10.06.2051	130	0,07	1.210 Danske Bank A/S, 144 A 5,000%, fällig 12.01.2022	1.229	0,65	200 Nippon Life Insurance Co, 144 A 3,400%, fällig 23.01.2050 *	209	0,11	
290 Suzano Austria GmbH, 3,125%, fällig 15.01.2032	291	0,15	200 Danske Bank A/S, 144 A 3,001%, fällig 20.09.2022 *	200	0,11	540 Nippon Life Insurance Co, 144 A 2,750%, fällig 21.01.2051 *	539	0,28	
		1.374	220 Danske Bank A/S, 144 A 5,375%, fällig 12.01.2024	243	0,13	810 Nissan Motor Co Ltd, 144 A 3,043%, fällig 15.09.2023	844	0,45	
Kanada – 2,46 % (28. Februar 2021: 2,46 %)			400 Danske Bank A/S, 144 A 3,244%, fällig 20.12.2025 *	426	0,22	200 Nissan Motor Co Ltd, 144 A 3,522%, fällig 17.09.2025	214	0,11	
140 Barrick North America Finance LLC, 5,700%, fällig 30.05.2041	194	0,10			2.098	1,11	340 Nissan Motor Co Ltd, 144 A 4,810%, fällig 17.09.2030	386	0,20
60 Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950%, fällig 15.10.2039	84	0,04	Frankreich – 2,62 % (28. Februar 2021: 3,34 %)						
1.040 Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,500%, fällig 14.12.2023	1.039	0,55	560 BNP Paribas SA, 144 A 2,819%, fällig 19.11.2025 *	588	0,31	200 NTT Finance Corp, 144 A 1,162%, fällig 03.04.2026	200	0,11	
860 CI Financial Corp, 3,200%, fällig 17.12.2030	894	0,47	480 BNP Paribas SA, 144 A 2,219%, fällig 09.06.2026 *	494	0,26	200 NTT Finance Corp, 144 A 2,065%, fällig 03.04.2031	205	0,11	
170 CI Financial Corp, 4,100%, fällig 15.06.2051	184	0,10	320 BNP Paribas SA, 144 A 1,323%, fällig 13.01.2027 *	318	0,17			2.597	1,37
160 Element Fleet Management Corp, 144 A 1,600%, fällig 06.04.2024	162	0,09	770 BNP Paribas SA, 144 A 1,675%, fällig 30.06.2027 *	774	0,41	Kasachstan – 0,11 % (28. Februar 2021: 0,11 %)			
100 GFL Environmental Inc, 144 A 5,125%, fällig 15.12.2026	106	0,06	600 BNP Paribas SA, 144 A 2,824%, fällig 26.01.2041	582	0,30	200 KazMunayGas National Co JSC, 144 A 3,500%, fällig 14.04.2033	210	0,11	
			2.000 Societe Generale SA, 144 A 1,488%, fällig 14.12.2026 *	1.990	1,05	Kuwait – 0,21 % (28. Februar 2021: 0,21 %)			
			200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144 A 4,750%, fällig 17.09.2044	224	0,12	390 NBK SPC Ltd, 144 A 2,750%, fällig 30.05.2022	396	0,21	
					4.970	2,62			
			Deutschland – 0,04 % (28. Februar 2021: 0,04 %)			Luxemburg – 0,03 % (28. Februar 2021: 0,03 %)			
			50 Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750%, fällig 15.06.2030	75	0,04	40 ArcelorMittal SA, 7,000%, fällig 15.10.2039	58	0,03	
			Irland – 0,87 % (28. Februar 2021: 1,52 %)			Macau – 0,90 % (28. Februar 2021: 0,67 %)			
			270 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,500%, fällig 15.09.2023	288	0,15	200 Sands China Ltd, 4,600%, fällig 08.08.2023	211	0,11	
						200 Sands China Ltd, 4,600%, fällig 08.08.2023	211	0,11	
						580 Sands China Ltd, 5,125%, fällig 08.08.2025	646	0,34	
						200 Sands China Ltd, 3,800%, fällig 08.01.2026	213	0,11	
						200 Sands China Ltd, 4,375%, fällig 18.06.2030	219	0,12	
						200 Wynn Macau Ltd, 144 A 5,125%, fällig 15.12.2029	199	0,11	
								1.699	0,90

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Vereinigte Arabische Emirate — 0,30 % (28. Februar 2021: 0,15 %)			260 Alphabet Inc, 2,250%, fällig 15.08.2060		
Mexiko – 0,46 % (28. Februar 2021: 0,44 %)			250 Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 144 A 4,375%, fällig 23.04.2025			237 0,12		
200 Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman, 144 A 8,375%, Perpetual *	241	0,13	290 DAE Funding LLC, 144 A 1,550%, fällig 01.08.2024			335 0,18		
200 Comision Federal de Electricidad, 144 A 3,348%, fällig 09.02.2031	200	0,11				170 Altria Group Inc, 4,800%, fällig 14.02.2029		
200 Comision Federal de Electricidad, 144 A 4,677%, fällig 09.02.2051	197	0,10				420 Altria Group Inc, 2,450%, fällig 04.02.2032		
220 Fresnillo Plc, 144 A 4,250%, fällig 02.10.2050	235	0,12				81) Altria Group Inc, 3,400%, fällig 04.02.2041		
	873	0,46				270 Amazon.com Inc, 1,200%, fällig 03.06.2027		
Marokko — 0,21% (28. Februar 2021: 0,00%)			Großbritannien – 2,41 % (28. Februar 2021: 3,23 %)			340 Amazon.com Inc, 2,100%, fällig 12.05.2031		
200 OCP SA, 144 A 3,750%, fällig 23.06.2031	203	0,11	280 Barclays Plc, 5,088%, fällig 20.06.2030 *			120 Amazon.com Inc, 3,875%, fällig 22.08.2037		
200 OCP SA, 144 A 5,125%, fällig 23.06.2051	202	0,10	810 BAT Capital Corp, 2,259%, fällig 25.03.2028			200 Amazon.com Inc, 2,500%, fällig 03.06.2050		
	405	0,21	50 British Telecommunications Plc, 9,625%, fällig 15.12.2030			180 Amazon.com Inc, 3,100%, fällig 12.05.2051		
Niederlande – 1,18 % (28. Februar 2021: 1,20 %)			210 HSBC Holdings Plc, 1,589%, fällig 24.05.2027 *			21) American Airlines Inc/ AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144 A 5,500%, fällig 20.04.2026		
830 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625%, fällig 01.12.2023	904	0,48	400 HSBC Holdings Plc, 4,950%, fällig 31.03.2030			170 American Airlines Inc/ AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144 A 5,750%, fällig 20.04.2029		
540 NatWest Markets NV, Series B, 7,750%, fällig 15.05.2023	604	0,32	440 HSBC Holdings Plc, 3,973%, fällig 22.05.2030 *			100 American Express Co, 3,550%, Perpetual *		
290 Shell International Finance BV, 4,375%, fällig 11.05.2045	362	0,19	60 HSBC Holdings Plc, 7,625%, fällig 17.05.2032			260 American International Group Inc, 3,400%, fällig 30.06.2030		
340 Shell International Finance BV, 3,250%, fällig 06.04.2050	368	0,19	430 HSBC Holdings Plc, 2,804%, fällig 24.05.2032 *			90 American International Group Inc, 4,750%, fällig 01.04.2048		
	2.238	1,18	400 Lloyds Banking Group Plc, 4,375%, fällig 22.03.2028			90 Americo Life Inc, 144 A 3,450%, fällig 15.04.2031		
Peru – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,17 %)			200 Natwest Group Plc, 2,359%, fällig 22.05.2024 *			230 AmFam Holdings Inc, 144 A 2,805%, fällig 11.03.2031		
200 Petroleos del Peru SA, 144 A 5,625%, fällig 19.06.2047	209	0,11	340 Natwest Group Plc, 3,754%, fällig 01.11.2029 *			160 AmFam Holdings Inc, 144 A 3,833%, fällig 11.03.2051		
80 Southern Copper Corp, 5,250%, fällig 08.11.2042	103	0,05	165 Reynolds American Inc, 8,125%, fällig 01.05.2040			80 Amgen Inc, 4,400%, fällig 01.05.2045		
	312	0,16	200 Standard Chartered Plc, 144 A 1,214%, fällig 23.03.2025 *			70 Amgen Inc, 4,663%, fällig 15.06.2051		
Portugal — 0,16 % (28. Februar 2021: 0,16 %)			80 Vodafone Group Plc, 6,150%, fällig 27.02.2037			70 Anthem Inc, 4,375%, fällig 01.12.2047		
310 EDP Finance BV, 144 A 1,710%, fällig 24.01.2028	308	0,16	40 Vodafone Group Plc, 5,250%, fällig 30.05.2048			1) Apache Corp, 4,750%, fällig 15.04.2043		
Katar – 0,43 % (28. Februar 2021: 0,00 %)						150 Apache Corp, 5,350%, fällig 01.07.2049		
200 Qatar Petroleum, 144 A 1,375%, fällig 12.09.2026	200	0,11				41) Apple Inc, 2,650%, fällig 11.05.2050		
610 Qatar Petroleum, 144 A 2,250%, fällig 12.07.2031	616	0,32				220 AT&T Inc, 3,800%, fällig 15.02.2027		
	816	0,43				80 AT&T Inc, 4,250%, fällig 01.03.2027		
Singapur – 0,13 % (28. Februar 2021: 0,26 %)						60 AT&T Inc, 1,650%, fällig 01.02.2028		
240 BOC Aviation USA Corp, 144 A 1,625%, fällig 29.04.2024	243	0,13				41) AT&T Inc, 4,300%, fällig 15.02.2030		
Südafrika – 0,27 % (28. Februar 2021: 0,27 %)						280 AT&T Inc, 4,500%, fällig 15.05.2035		
200 Anglo American Capital Plc, 144 A 4,750%, fällig 10.04.2027	231	0,12				360 AT&T Inc, 3,100%, fällig 01.02.2043		
240 Anglo American Capital Plc, 144 A 4,500%, fällig 15.03.2028	274	0,15				2 AT&T Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.09.2053		
	505	0,27				163 AT&T Inc, 144 A 3,550%, fällig 15.09.2055		
Spanien – 0,12 % (28. Februar 2021: 0,11 %)						11) AT&T Inc, 144 A 3,800%, fällig 01.12.2057		
200 Banco Santander SA, 3,306%, fällig 27.06.2029	220	0,12				260 AT&T Inc, 3,500%, fällig 01.02.2061		
Supranational – 0,11 % (28. Februar 2021: 0,00 %)						120 Aviation Capital Group LLC, 144 A 5,500%, fällig 15.12.2024		
200 African Export-Import Bank/ The, 144 A 2,634%, fällig 17.05.2026	205	0,11				290 Bank of America Corp, 4,200%, fällig 26.08.2024		
Schweiz – 1,43 % (28. Februar 2021: 1,70 %)						120 Bank of America Corp, 1,319%, fällig 19.06.2026 *		
590 Credit Suisse Group AG, 144 A 3,091%, fällig 14.05.2032 *	616	0,33				132 Bank of America Corp, 3,419%, fällig 20.12.2028 *		
1.040 Credit Suisse Group AG, 144 A 5,250%, Perpetual *	1.092	0,58				250 Bank of America Corp, 4,271%, fällig 23.07.2029 *		
70 Credit Suisse USA Inc, 7,125%, fällig 15.07.2032	102	0,05						
660 Glencore Finance Canada Ltd, 144 A 4,250%, fällig 25.10.2022	688	0,36						
200 UBS Group AG, 144 A 3,126%, fällig 13.08.2030 *	216	0,11						
	2.714	1,43						

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			80 Centene Corp, 2,450%, fällig 15.07.2028	81	0,04	40 Comcast Corp, 7,050%, fällig 15.03.2033	59	0,03
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)			430 Centene Corp, 3,000%, fällig 15.10.2030	446	0,24	91 Comcast Corp, 6,500%, fällig 15.11.2035	133	0,07
70 Bank of America Corp, 3,974%, fällig 07.02.2030 *	80	0,04	240 CenterPoint Energy Houston Electric LLC, Series AA, 3,000%, fällig 01.02.2027	260	0,14	80 Comcast Corp, 3,750%, fällig 01.04.2040	92	0,05
420 Bank of America Corp, 2,884%, fällig 22.10.2030 *	445	0,23	920 Charles Schwab Corp/The, 0,900%, fällig 11.03.2026	918	0,48	50 Comcast Corp, 3,969%, fällig 01.11.2047	59	0,03
110 Bank of America Corp, 2,592%, fällig 29.04.2031 *	114	0,06	180 Charles Schwab Corp/The, 2,000%, fällig 20.03.2028	186	0,10	632 Comcast Corp, 144 A 2,887%, fällig 01.11.2051	630	0,33
70 Bank of America Corp, 1,898%, fällig 23.07.2031 *	69	0,04	600 Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000%, Perpetual *	625	0,33	190 Comcast Corp, 4,950%, fällig 15.10.2058	274	0,14
850 Bank of America Corp, 1,922%, fällig 24.10.2031 *	833	0,44	390 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,750%, fällig 15.02.2028	432	0,23	70 CommonSpirit Health, 2,782%, fällig 01.10.2030	73	0,04
550 Bank of America Corp, 2,687%, fällig 22.04.2032 *	572	0,30	50 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200%, fällig 15.03.2028	57	0,03	80 CommonSpirit Health, 3,910%, fällig 01.10.2050	90	0,05
420 Bank of America Corp, 2,299%, fällig 21.07.2032 *	423	0,22	520 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500%, fällig 01.06.2041	527	0,28	240 Commonwealth Edison Co, 6,450%, fällig 15.01.2038	357	0,19
140 Bank of America Corp, 2,676%, fällig 19.06.2041 *	138	0,07	50 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, fällig 01.05.2047	62	0,03	30 Commonwealth Edison Co, 4,000%, fällig 01.03.2048	36	0,02
330 Bank of America Corp, 3,311%, fällig 22.04.2042 *	356	0,19	240 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750%, fällig 01.04.2048	309	0,16	240 Comstock Resources Inc, 144 A 7,500%, fällig 15.05.2025	249	0,13
20 Bank of America Corp, 4,443%, fällig 20.01.2048 *	25	0,01	60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125%, fällig 01.07.2049	72	0,04	130 Comstock Resources Inc, 144 A 5,875%, fällig 15.01.2030	131	0,07
170 Bank of America Corp, 4,330%, fällig 15.03.2050 *	213	0,11	80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,850%, fällig 01.04.2061	80	0,04	120 ConocoPhillips, 144 A 3,750%, fällig 01.10.2027	135	0,07
140 Bank of America Corp, 4,083%, fällig 20.03.2051 *	169	0,09	230 Chevron USA Inc, 5,250%, fällig 15.11.2043	317	0,17	40 Constellation Brands Inc, 3,700%, fällig 06.12.2026	44	0,02
360 Bank of America Corp, 2,831%, fällig 24.10.2051 *	355	0,19	40 Chevron USA Inc, 2,343%, fällig 12.08.2050	37	0,02	30 Constellation Brands Inc, 3,500%, fällig 09.05.2027	33	0,02
90 Becton Dickinson and Co, 3,700%, fällig 06.06.2027	100	0,05	160 Cigna Corp, 4,375%, fällig 15.10.2028	187	0,10	100 Consumers Energy Co, 2,500%, fällig 01.05.2060	92	0,05
320 Bed Bath & Beyond Inc, 3,749%, fällig 01.08.2024	330	0,17	620 Cigna Corp, 2,400%, fällig 15.03.2030	639	0,34	22 Continental Airlines 2007-1 Class A Pass Through Trust, Series 071 A, 5,983%, fällig 19.04.2022	22	0,01
630 Berry Petroleum Co LLC, 144 A 7,000%, fällig 15.02.2026	626	0,33	130 Cigna Corp, 4,800%, fällig 15.08.2038	163	0,09	50 Continental Resources Inc/OK, 4,500%, fällig 15.04.2023	52	0,03
1.310 Blackstone Mortgage Trust Inc, 4,375%, fällig 05.05.2022	1.339	0,71	680 Cigna Corp, 3,200%, fällig 15.03.2040	717	0,38	110 Corning Inc, 3,900%, fällig 15.11.2049	127	0,07
60 Blackstone Mortgage Trust Inc, 4,750%, fällig 15.03.2023	63	0,03	290 Cimarex Energy Co, 4,375%, fällig 01.06.2024	314	0,17	80 Costco Wholesale Corp, 1,375%, fällig 20.06.2027	81	0,04
1.150 Boeing Co/The, 2,196%, fällig 04.02.2026	1.155	0,61	580 Cimarex Energy Co, 3,900%, fällig 15.05.2027	641	0,34	110 Costco Wholesale Corp, 1,600%, fällig 20.04.2030	109	0,06
1.140 Boeing Co/The, 3,100%, fällig 01.05.2026	1.210	0,64	70 Cintas Corp No 2X 3,700%, fällig 01.04.2027	79	0,04	30 Costco Wholesale Corp, 1,750%, fällig 20.04.2032	30	0,02
400 Boeing Co/The, 3,250%, fällig 01.02.2028	429	0,23	130 Citigroup Inc, 3,980%, fällig 20.03.2030 *	148	0,08	40 CVS Health Corp, 3,000%, fällig 15.08.2026	43	0,02
110 Boeing Co/The, 3,300%, fällig 01.03.2035	112	0,06	280 Citigroup Inc, 2,976%, fällig 05.11.2030 *	298	0,16	189 CVS Health Corp, 4,300%, fällig 25.03.2028	218	0,11
270 Boeing Co/The, 3,750%, fällig 01.02.2050	280	0,15	1.010 Citigroup Inc, 2,561%, fällig 01.05.2032 *	1.039	0,55	70 CVS Health Corp, 3,250%, fällig 15.08.2029	76	0,04
500 Boeing Co/The, 3,950%, fällig 01.08.2059	522	0,27	660 Citigroup Inc, 8,125%, fällig 15.07.2039	1.140	0,60	240 CVS Health Corp, 2,125%, fällig 15.09.2031	240	0,13
70 Bon Secours Mercy Health Inc, 3,464%, fällig 01.06.2030	78	0,04	270 Citigroup Inc, 4,650%, fällig 23.07.2048	359	0,19	10 CVS Health Corp, 4,780%, fällig 25.03.2038	12	0,01
440 BP Capital Markets America Inc, 3,410%, fällig 11.02.2026	481	0,25	200 Clorox Co/The, 1,800%, fällig 15.05.2030	198	0,10	880 CVS Health Corp, 2,700%, fällig 21.08.2040	865	0,46
160 BP Capital Markets America Inc, 3,119%, fällig 04.05.2026	174	0,09	100 Coca-Cola Co/The, 1,375%, fällig 15.03.2031	96	0,05	110 CVS Health Corp, 5,125%, fällig 20.07.2045	145	0,08
800 BP Capital Markets America Inc, 3,000%, fällig 24.02.2050	792	0,42	180 Coca-Cola Co/The, 2,500%, fällig 01.06.2040	181	0,10	340 CVS Health Corp, 5,050%, fällig 25.03.2048	451	0,24
320 Bristol-Myers Squibb Co, 2,350%, fällig 13.11.2040	311	0,16	50 Comcast Corp, 3,400%, fällig 01.04.2030	56	0,03	70 DCP Midstream LP, Series A, 7,375%, Perpetual *	68	0,04
190 Bristol-Myers Squibb Co, 4,250%, fällig 26.10.2049	242	0,13	260 Comcast Corp, 4,250%, fällig 15.10.2030	307	0,16	40 DCP Midstream Operating LP, 144 A 6,450%, fällig 03.11.2036	49	0,03
630 Broadcom Inc, 5,000%, fällig 15.04.2030	747	0,39				170 Dell International LLC / EMC Corp, 8,100%, fällig 15.07.2036	261	0,14
90 Broadcom Inc, 4,150%, fällig 15.11.2030	101	0,05				60 Dell International LLC / EMC Corp, 8,350%, fällig 15.07.2046	99	0,05
580 Broadcom Inc, 4,300%, fällig 15.11.2032	664	0,35				200 Delta Air Lines Inc, 144 A 7,000%, fällig 01.05.2025	234	0,12
130 Burlington Northern Santa Fe LLC, 4,400%, fällig 15.03.2042	163	0,09				200 Delta Air Lines Inc, 7,375%, fällig 15.01.2026	236	0,12
90 California Institute of Technology, 3,650%, fällig 01.09.2119	106	0,06				70 Delta Air Lines Inc, 3,750%, fällig 28.10.2029	71	0,04
70 Cameron LNG LLC, 144 A 3,701%, fällig 15.01.2039	79	0,04				400 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,500%, fällig 20.10.2025	429	0,23
70 Carlyle Finance LLC, 144 A 5,650%, fällig 15.09.2048	98	0,05				360 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,750%, fällig 20.10.2028	402	0,21
140 Carrier Global Corp, 2,493%, fällig 15.02.2027	147	0,08				630 Dermira Inc, 3,000%, fällig 15.05.2022	639	0,34

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			30 EOG Resources Inc, 4,950%, fällig 15.04.2050	40	0,02	1.840 Goldman Sachs Group Inc/The, Series VAR, 1,093%, fällig 09.12.2026 *	1.827	0,96
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)			420 EQT Corp, 3,000%, fällig 01.10.2022	429	0,23	240 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800%, fällig 15.03.2030	271	0,14
320 Devon Energy Corp, 5,850%, fällig 15.12.2025	373	0,20	40 EQT Corp, 144 A 3,125%, fällig 15.05.2026	41	0,02	450 Goldman Sachs Group Inc/The, Series DMTN, 2,383%, fällig 21.07.2032 *	455	0,24
182 Devon Energy Corp, 144 A 5,875%, fällig 15.06.2028	200	0,11	140 EQT Corp, 3,900%, fällig 01.10.2027	151	0,08	140 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150%, fällig 22.05.2045	188	0,10
274 Devon Energy Corp, 144 A 4,500%, fällig 15.01.2030	299	0,16	140 EQT Corp, 7,500%, fällig 01.02.2030	182	0,10	1.000 Guardian Life Global Funding, 144 A 0,875%, fällig 10.12.2025	994	0,52
30 Devon Energy Corp, 7,950%, fällig 15.04.2032	43	0,02	30 EQT Corp, 144 A 3,625%, fällig 15.05.2031	32	0,02	50 Halliburton Co, 2,920%, fällig 01.03.2030	52	0,03
400 Devon Energy Corp, 5,600%, fällig 15.07.2041	501	0,26	780 Equifax Inc, 2,350%, fällig 15.09.2031	786	0,41	10 Halliburton Co, 5,000%, fällig 15.11.2045	12	0,01
450 Devon Energy Corp, 5,000%, fällig 15.06.2045	533	0,28	60 Exxon Mobil Corp, 3,482%, fällig 19.03.2030	68	0,04	100 HCA Inc, 5,125%, fällig 15.06.2039	126	0,07
260 Devon OEI Operating LLC, 7,500%, fällig 15.09.2027	324	0,17	30 Exxon Mobil Corp, 2,995%, fällig 16.08.2039	31	0,02	150 Hershey Co/The, 1,700%, fällig 01.06.2030	150	0,08
240 Diamondback Energy Inc, 3,250%, fällig 01.12.2026	257	0,14	360 Exxon Mobil Corp, 4,227%, fällig 19.03.2040	436	0,23	40 Home Depot Inc/The, 3,300%, fällig 15.04.2040	44	0,02
430 Diamondback Energy Inc, 3,500%, fällig 01.12.2029	464	0,24	40 Exxon Mobil Corp, 4,114%, fällig 01.03.2046	48	0,03	100 Home Depot Inc/The, 3,350%, fällig 15.04.2050	112	0,06
220 Diamondback Energy Inc, 4,400%, fällig 24.03.2051	253	0,13	80 Exxon Mobil Corp, 3,452%, fällig 15.04.2051	89	0,05	130 Humana Inc, 3,850%, fällig 01.10.2024	141	0,07
110 Diversified Healthcare Trust, 4,750%, fällig 01.05.2024	114	0,06	150 Fidelity & Guaranty Life Holdings Inc, 144 A 5,500%, fällig 01.05.2025	172	0,09	80 Humana Inc, 3,950%, fällig 15.03.2027	90	0,05
380 DR Horton Inc, 2,500%, fällig 15.10.2024	398	0,21	290 FirstEnergy Corp, Series B, 4,400%, fällig 15.07.2027	326	0,17	100 Humana Inc, 4,950%, fällig 01.10.2044	131	0,07
220 Duke Energy Carolinas LLC, 5,300%, fällig 15.02.2040	302	0,16	280 FirstEnergy Corp, Series C, 7,375%, fällig 15.11.2031	392	0,21	810 ILFC E-Capital Trust I, 144 A 3,660%, fällig 21.12.2065 *	660	0,35
60 Duke Energy Corp, 3,150%, fällig 15.08.2027	65	0,03	30 FirstEnergy Corp, Series C, 5,350%, fällig 15.07.2047	38	0,02	140 Intel Corp, 2,800%, fällig 12.08.2041	142	0,07
240 Duke Energy Indiana LLC, Series YYY, 3,250%, fällig 01.10.2049	257	0,14	50 Florida Power & Light Co, 3,150%, fällig 01.10.2049	55	0,03	150 Intel Corp, 4,950%, fällig 25.03.2060	212	0,11
110 Duke Energy Ohio Inc, 2,125%, fällig 01.06.2030	112	0,06	760 Ford Motor Credit Co LLC, 3,350%, fällig 01.11.2022	778	0,41	70 Intel Corp, 3,200%, fällig 12.08.2061	73	0,04
180 Eaton Corp, 4,150%, fällig 02.11.2042	218	0,11	500 Ford Motor Credit Co LLC, 2,700%, fällig 10.08.2026	505	0,27	80 Jersey Central Power & Light Co, 144 A 4,300%, fällig 15.01.2026	89	0,05
90 eBay Inc, 2,600%, fällig 10.05.2031	93	0,05	200 Ford Motor Credit Co LLC, 4,125%, fällig 17.08.2027	214	0,11	370 Johnson & Johnson, 2,100%, fällig 01.09.2040	358	0,19
150 Edison International, 4,950%, fällig 15.04.2025	166	0,09	240 Fortinet Inc, 1,000%, fällig 15.03.2026	239	0,13	10 Johnson & Johnson, 2,250%, fällig 01.09.2050	10	–
270 Edison International, Series A, 5,375%, Perpetual *	276	0,15	360 Fortinet Inc, 2,200%, fällig 15.03.2031	363	0,19	200 Johnson & Johnson, 2,450%, fällig 01.09.2060	195	0,10
280 El Paso Natural Gas Co LLC, 7,500%, fällig 15.11.2026	355	0,19	230 Fox Corp, 5,476%, fällig 25.01.2039	299	0,16	340 JPMorgan Chase & Co, 0,563%, fällig 16.02.2025 *	339	0,18
200 Energy Transfer LP, Series 5Y, 4,200%, fällig 15.09.2023	213	0,11	100 GE Capital European Funding Unlimited Co, 6,025%, fällig 01.03.2038	200	0,11	70 JPMorgan Chase & Co, 4,203%, fällig 23.07.2029 *	80	0,04
90 Energy Transfer LP, 3,900%, fällig 15.07.2026	99	0,05	120 GE Capital UK Funding Unlimited Co, 8,000%, fällig 14.01.2039	296	0,16	840 JPMorgan Chase & Co, 2,739%, fällig 15.10.2030 *	885	0,47
250 Energy Transfer LP, 5,500%, fällig 01.06.2027	295	0,16	225 General Electric Co, 6,875%, fällig 10.01.2039	341	0,18	20 JPMorgan Chase & Co, 2,522%, fällig 22.04.2031 *	21	0,01
250 Energy Transfer LP, 4,950%, fällig 15.06.2028	290	0,15	130 General Motors Co, 4,875%, fällig 02.10.2023	141	0,07	450 JPMorgan Chase & Co, 2,956%, fällig 13.05.2031 *	477	0,25
10 Energy Transfer LP, Series 20 Y, 5,800%, fällig 15.06.2038	12	0,01	80 General Motors Co, 6,125%, fällig 01.10.2025	94	0,05	900 JPMorgan Chase & Co, 1,953%, fällig 04.02.2032 *	884	0,47
400 Energy Transfer LP, 6,125%, fällig 15.12.2045	515	0,27	140 General Motors Co, 6,600%, fällig 01.04.2036	192	0,10	260 JPMorgan Chase & Co, 2,580%, fällig 22.04.2032 *	268	0,14
460 Energy Transfer LP, Series H, 6,500%, Perpetual *	473	0,25	20 General Motors Co, 6,750%, fällig 01.04.2046	29	0,02	90 JPMorgan Chase & Co, 4,950%, fällig 01.06.2045	120	0,06
130 Energy Transfer LP, Series B, 6,625%, Perpetual *	126	0,07	130 General Motors Co, 5,950%, fällig 01.04.2049	177	0,09	140 JPMorgan Chase & Co, 4,260%, fällig 22.02.2048 *	173	0,09
210 Energy Transfer LP, Series F, 6,750%, Perpetual *	213	0,11	120 General Motors Financial Co Inc, 3,700%, fällig 09.05.2023	125	0,07	160 JPMorgan Chase & Co, 3,964%, fällig 15.11.2048 *	190	0,10
700 Energy Transfer LP, Series G, 7,125%, Perpetual *	722	0,38	630 Genting New York LLC / GENNY Capital Inc, 144 A 3,300%, fällig 15.02.2026	631	0,33	510 JPMorgan Chase & Co, 3,328%, fällig 22.04.2052 *	556	0,29
430 Enterprise Products Operating LLC, 4,150%, fällig 16.10.2028	494	0,26	100 Gilead Sciences Inc, 4,000%, fällig 01.09.2036	117	0,06	280 JPMorgan Chase & Co, Series KK, 3,650%, Perpetual *	285	0,15
110 Enterprise Products Operating LLC, Series D, 6,875%, fällig 01.03.2033	155	0,08	100 Gilead Sciences Inc, 4,750%, fällig 01.03.2046	129	0,07	100 Kaiser Foundation Hospitals, Series 2021X 2,810%, fällig 01.06.2041	103	0,05
630 Enterprise Products Operating LLC, 4,250%, fällig 15.02.2048	733	0,39	250 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250%, fällig 201.10.2025	279	0,15	70 Kaiser Foundation Hospitals, Series 2019X 3,266%, fällig 01.11.2049	77	0,04
80 Enterprise Products Operating LLC, 3,950%, fällig 31.01.2060	89	0,05	430 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855%, fällig 12.02.2026 *	428	0,23	100 Kaiser Foundation Hospitals, Series 2021X 3,002%, fällig 01.06.2051	105	0,06
450 Enterprise Products Operating LLC, 5,375%, fällig 15.02.2078 *	465	0,24	810 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500%, fällig 16.11.2026	882	0,47	60 Kinder Morgan Energy Partners LP, 7,300%, fällig 15.08.2033	86	0,05
190 EOG Resources Inc, 4,150%, fällig 15.01.2026	213	0,11						
290 EOG Resources Inc, 4,375%, fällig 15.04.2030	343	0,18						

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			80 Molson Coors Beverage Co, 4,200%, fällig 15.07.2046	91	0,05	100 Occidental Petroleum Corp, 4,100%, fällig 15.02.2047	98	0,05
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)			40 Mondelez International Inc, 2,625%, fällig 04.09.2050	38	0,02	190 Ohio Edison Co, 6,875%, fällig 15.07.2036	277	0,15
100 Kinder Morgan Inc, 5,300%, fällig 01.12.2034	124	0,07	270 Morgan Stanley, 2,188%, fällig 28.04.2026 *	281	0,15	20 Oncor Electric Delivery Co LLC, 3,100%, fällig 15.09.2049	21	0,01
90 Kinder Morgan Inc, 5,200%, fällig 01.03.2048	114	0,06	1.830 Morgan Stanley, 0,985%, fällig 10.12.2026 *	1.809	0,95	250 Oracle Corp, 3,950%, fällig 25.03.2051	277	0,15
210 KKR Group Finance Co III LLC, 144 A 5,125%, fällig 01.06.2044	278	0,15	50 Morgan Stanley, 1,593%, fällig 04.05.2027 *	50	0,03	460 Oracle Corp, 4,100%, fällig 25.03.2061	523	0,28
40 KKR Group Finance Co VII LLC, 144 A 3,625%, fällig 25.02.2050	44	0,02	90 Morgan Stanley, 2,699%, fällig 22.01.2031 *	94	0,05	80 Otis Worldwide Corp, 2,565%, fällig 15.02.2030	84	0,04
130 Lam Research Corp, 1,900%, fällig 15.06.2030	131	0,07	70 Morgan Stanley, 1,794%, fällig 13.02.2032 *	68	0,04	70 Pacific Gas and Electric Co, 1,750%, fällig 16.06.2022	70	0,04
50 Lam Research Corp, 2,875%, fällig 15.06.2050	52	0,03	210 Morgan Stanley, 2,239%, fällig 21.07.2032 *	211	0,11	130 Pacific Gas and Electric Co, 4,250%, fällig 01.08.2023	136	0,07
1.070 Las Vegas Sands Corp, 2,900%, fällig 25.06.2025	1.106	0,58	50 Morgan Stanley, 3,217%, fällig 22.04.2042 *	54	0,03	100 Pacific Gas and Electric Co, 2,100%, fällig 01.08.2027	97	0,05
100 Lennox International Inc, 1,700%, fällig 01.08.2027	101	0,05	130 Morgan Stanley, 5,597%, fällig 24.03.2051 *	196	0,10	190 Pacific Gas and Electric Co, 2,500%, fällig 01.02.2031	179	0,09
140 Lithia Motors Inc, 144 A 4,625%, fällig 15.12.2027	149	0,08	210 Morgan Stanley, 2,802%, fällig 25.01.2052 *	210	0,11	10 Pacific Gas and Electric Co, 3,300%, fällig 01.08.2040	9	–
240 Lithia Motors Inc, 144 A 3,875%, fällig 01.06.2029	252	0,13	20 MPLX LP, 4,800%, fällig 15.02.2029	23	0,01	60 Pacific Gas and Electric Co, 4,950%, fällig 01.07.2050	64	0,03
320 Lowe's Cos Inc, 1,700%, fällig 15.10.2030	311	0,16	430 MPLX LP, 4,500%, fällig 15.04.2038	493	0,26	10 Pacific Gas and Electric Co, 3,500%, fällig 01.08.2050	9	–
150 Lowe's Cos Inc, 3,000%, fällig 15.10.2050	151	0,08	GBP 330 MPT Operating Partnership LP/ MPT Finance Corp, 3,692%, fällig 05.06.2028	486	0,26	100 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144 A 5,625%, fällig 15.10.2027	108	0,06
100 LPL Holdings Inc, 144 A 4,375%, fällig 15.05.2031	104	0,05	130 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 4,625%, fällig 01.08.2029	139	0,07	170 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144 A 4,125%, fällig 15.02.2028	179	0,09
100 M&T Bank Corp, 3,500%, Perpetual *	102	0,05	730 Nasdaq Inc, 2,500%, fällig 21.12.2040	685	0,36	90 PayPal Holdings Inc, 2,300%, fällig 01.06.2030	94	0,05
140 Marriott International Inc/MD, 3,600%, fällig 15.04.2024	149	0,08	60 Netflix Inc, 144 A 5,375%, fällig 15.11.2029	74	0,04	150 PayPal Holdings Inc, 3,250%, fällig 01.06.2050	166	0,09
190 Mars Inc, 144 A 2,375%, fällig 16.07.2040	185	0,10	140 Netflix Inc, 144 A 4,875%, fällig 15.06.2030	168	0,09	540 PDC Energy Inc, 1,125%, fällig 15.09.2021	543	0,29
60 Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144 A 3,375%, fällig 15.04.2050	65	0,03	280 New York Life Insurance Co, 144 A 3,750%, fällig 15.05.2050	324	0,17	150 PepsiCo Inc, 2,625%, fällig 29.07.2029	161	0,08
140 Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144 A 4,900%, fällig 01.04.2077	188	0,10	80 New York Life Insurance Co, 144 A 4,450%, fällig 15.05.2069	103	0,05	47 Pfizer Inc, 3,000%, fällig 15.12.2026	52	0,03
200 Mastercard Inc, 3,300%, fällig 26.03.2027	222	0,12	70 Nissan Motor Acceptance Corp, 144 A 1,050%, fällig 08.03.2024	70	0,04	60 Pfizer Inc, 2,550%, fällig 28.05.2040	61	0,03
300 Mastercard Inc, 3,350%, fällig 26.03.2030	339	0,18	90 Nissan Motor Acceptance Corp, 144 A 2,000%, fällig 09.03.2026	91	0,05	50 Pfizer Inc, 2,700%, fällig 28.05.2050	51	0,03
200 Mastercard Inc, 1,900%, fällig 15.03.2031	204	0,11	110 Nissan Motor Acceptance Corp, 144 A 2,750%, fällig 09.03.2028	114	0,06	480 Philip Morris International Inc, 1,750%, fällig 01.11.2030	469	0,25
80 Mastercard Inc, 3,850%, fällig 26.03.2050	98	0,05	390 Nordstrom Inc, 2,300%, fällig 08.04.2024	393	0,21	380 Pioneer Natural Resources Co, 2,150%, fällig 15.01.2031	373	0,20
120 McDonald's Corp, 2,125%, fällig 01.03.2030	122	0,06	120 Norfolk Southern Railway Co, 7,875%, fällig 15.05.2043	196	0,10	70 Plains All American Pipeline LP, Series B, 6,125%, Perpetual *	63	0,03
90 McDonald's Corp, 4,450%, fällig 01.03.2047	112	0,06	80 Northwest Pipeline LLC, 7,125%, fällig 01.12.2025	97	0,05	40 Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700%, fällig 15.05.2036	50	0,03
230 McDonald's Corp, 4,450%, fällig 01.09.2048	289	0,15	480 Northwest Pipeline LLC, 4,000%, fällig 01.04.2027	537	0,28	10 Procter & Gamble Co/The, 3,000%, fällig 25.03.2030	11	0,01
190 MDC Holdings Inc, 2,500%, fällig 15.01.2031	186	0,10	390 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144 A 3,850%, fällig 30.09.2047	452	0,24	360 Procter & Gamble Co/The, 1,200%, fällig 29.10.2030	347	0,18
70 MDC Holdings Inc, 6,000%, fällig 15.01.2043	90	0,05	170 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144 A 3,450%, fällig 30.03.2051	188	0,10	200 Prologis LP, 1,250%, fällig 15.10.2030	190	0,10
80 Merck & Co Inc, 1,450%, fällig 24.06.2030	79	0,04	90 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144 A 3,625%, fällig 30.09.2059	101	0,05	130 Prudential Financial Inc, 1,500%, fällig 10.03.2026	133	0,07
190 Merck & Co Inc, 2,350%, fällig 24.06.2040	186	0,10	340 NRG Energy Inc, 144 A 2,450%, fällig 02.12.2027	346	0,18	16 Range Resources Corp, 5,875%, fällig 01.07.2022	16	0,01
20 Merck & Co Inc, 2,450%, fällig 24.06.2050	19	0,01	130 Nuveen LLC, 144 A 4,000%, fällig 01.11.2028	149	0,08	70 Range Resources Corp, 5,000%, fällig 15.08.2022	72	0,04
530 Microchip Technology Inc, 144 A 0,972%, fällig 15.02.2024	531	0,28	50 NVIDIA Corp, 3,500%, fällig 01.04.2040	57	0,03	100 Range Resources Corp, 4,875%, fällig 15.05.2025	104	0,05
200 Microchip Technology Inc, 144 A 0,983%, fällig 01.09.2024	200	0,11	40 NVIDIA Corp, 3,700%, fällig 01.04.2060	48	0,02	470 Range Resources Corp, 9,250%, fällig 01.02.2026	515	0,27
224 Microsoft Corp, 3,450%, fällig 08.08.2036	262	0,14	130 Occidental Petroleum Corp, 3,200%, fällig 15.08.2026	134	0,07	190 Range Resources Corp, 144 A 8,250%, fällig 15.01.2029	211	0,11
67 Microsoft Corp, 2,525%, fällig 01.06.2050	67	0,04	50 Occidental Petroleum Corp, 7,875%, fällig 15.09.2031	66	0,03	70 Raymond James Financial Inc, 4,950%, fällig 15.07.2046	92	0,05
359 Microsoft Corp, 2,921%, fällig 17.03.2052	387	0,20	230 Occidental Petroleum Corp, 6,450%, fällig 15.09.2036	288	0,15	110 Raymond James Financial Inc, 3,750%, fällig 01.04.2051	125	0,07
50 MidAmerican Energy Co, 3,650%, fällig 15.04.2029	57	0,03	50 Occidental Petroleum Corp, 7,950%, fällig 15.06.2039	66	0,03	280 Reliance Standard Life Global Funding II, 144 A 2,500%, fällig 30.10.2024	292	0,15
180 MidAmerican Energy Co, 3,150%, fällig 15.04.2050	192	0,10	40 Occidental Petroleum Corp, 4,400%, fällig 15.04.2046	41	0,02	180 Republic Services Inc, 3,375%, fällig 15.11.2027	198	0,10
240 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144 A 6,500%, fällig 20.06.2027	261	0,14				130 S&P Global Inc, 1,250%, fällig 15.08.2030	124	0,07
40 Molson Coors Beverage Co, 3,000%, fällig 15.07.2026	43	0,02				40 S&P Global Inc, 3,250%, fällig 01.12.2049	44	0,02

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			60 T-Mobile USA Inc, 2,625%, fällig 15.02.2029			70 Visa Inc, 2,700%, fällig 15.04.2040		
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)			260 T-Mobile USA Inc, 2,550%, fällig 15.02.2031			70 Visa Inc, 3,650%, fällig 15.09.2047		
40 S&P Global Inc, 2,300%, fällig 15.08.2060	35	0,02	70 T-Mobile USA Inc, 2,875%, fällig 15.02.2031	72	0,04	220 Vontier Corp, 144 A 1,800%, fällig 01.04.2026	221	0,12
480 salesforce.com Inc, 1,500%, fällig 15.07.2028	482	0,25	120 T-Mobile USA Inc, 2,250%, fällig 15.11.2031	120	0,06	480 Vontier Corp, 144 A 2,400%, fällig 01.04.2028	481	0,25
60 salesforce.com Inc, 1,950%, fällig 15.07.2031	61	0,03	20 T-Mobile USA Inc, 4,375%, fällig 15.04.2040	23	0,01	60 Walmart Inc, 3,700%, fällig 26.06.2028	69	0,04
500 salesforce.com Inc, 2,900%, fällig 15.07.2051	515	0,27	180 T-Mobile USA Inc, 3,000%, fällig 15.02.2041	179	0,09	200 Walmart Inc, 4,050%, fällig 29.06.2048	254	0,13
190 salesforce.com Inc, 3,050%, fällig 15.07.2061	198	0,10	150 T-Mobile USA Inc, 3,300%, fällig 15.02.2051	151	0,08	20 Walt Disney Co/The, 6,200%, fällig 15.12.2034	28	0,01
200 San Diego Gas & Electric Co, Series VVV, 1,700%, fällig 01.10.2030	195	0,10	335 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850%, fällig 01.02.2026	422	0,22	23 Walt Disney Co/The, 6,400%, fällig 15.12.2035	34	0,02
230 San Diego Gas & Electric Co, Series RRR, 3,750%, fällig 01.06.2047	262	0,14	460 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,250%, fällig 01.12.2026	584	0,31	80 Walt Disney Co/The, 6,650%, fällig 15.11.2037	122	0,06
180 Service Properties Trust, 4,500%, fällig 15.06.2023	184	0,10	50 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 4,450%, fällig 01.08.2042	61	0,03	50 Walt Disney Co/The, 5,400%, fällig 01.10.2043	71	0,04
290 Service Properties Trust, 4,350%, fällig 01.10.2024	294	0,15	410 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950%, fällig 15.05.2050	463	0,24	10 Walt Disney Co/The, 4,950%, fällig 15.10.2045	14	0,01
80 Service Properties Trust, 4,750%, fällig 01.10.2026	80	0,04	380 Truist Financial Corp, 1,267%, fällig 02.03.2027 *	381	0,20	170 Waste Management Inc, 3,150%, fällig 15.11.2027	187	0,10
220 Simon Property Group LP, 3,500%, fällig 01.09.2025	240	0,13	320 Union Pacific Corp, 2,973%, fällig 16.09.2062	316	0,17	280 Wells Fargo & Co, 0,805%, fällig 19.05.2025 *	281	0,15
150 Skyworks Solutions Inc, 1,800%, fällig 01.06.2026	152	0,08	90 Union Pacific Corp, 3,750%, fällig 05.02.2070	103	0,05	110 Wells Fargo & Co, 2,406%, fällig 30.10.2025 *	115	0,06
520 Southern California Edison Co, 2,250%, fällig 01.06.2030	521	0,27	169 United Airlines 2014-1 Class B Pass Through Trust, Series B, 4,750%, fällig 11.04.2022	171	0,09	10 Wells Fargo & Co, 3,000%, fällig 23.10.2026	11	0,01
150 Southern California Edison Co, Series G, 2,500%, fällig 01.06.2031	152	0,08	243 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875%, fällig 15.01.2026	256	0,13	300 Wells Fargo & Co, 3,196%, fällig 17.06.2027 *	325	0,17
10 Southern California Edison Co, 4,000%, fällig 01.04.2047	11	0,01	100 United Airlines Holdings Inc, 4,250%, fällig 01.10.2022	102	0,05	110 Wells Fargo & Co, 3,584%, fällig 22.05.2028 *	122	0,06
160 Southern California Edison Co, Series C, 4,125%, fällig 01.03.2048	173	0,09	360 UnitedHealth Group Inc, 3,850%, fällig 15.06.2028	413	0,22	350 Wells Fargo & Co, 4,478%, fällig 04.04.2031 *	415	0,22
100 Southern California Edison Co, 3,650%, fällig 01.02.2050	102	0,05	110 UnitedHealth Group Inc, 2,000%, fällig 15.05.2030	112	0,06	80 Wells Fargo & Co, 3,068%, fällig 30.04.2041 *	84	0,04
560 Southwest Airlines Co, 4,750%, fällig 04.05.2023	598	0,32	120 UnitedHealth Group Inc, 3,500%, fällig 15.08.2039	136	0,07	270 Wells Fargo & Co, 5,375%, fällig 02.11.2043	364	0,19
260 Southwest Airlines Co, 5,250%, fällig 04.05.2025	295	0,16	130 UnitedHealth Group Inc, 2,750%, fällig 15.05.2040	134	0,07	200 Wells Fargo & Co, 4,750%, fällig 07.12.2046	255	0,13
640 SYNnex Corp, 144 A 1,250%, fällig 09.08.2024	641	0,34	120 UnitedHealth Group Inc, 4,750%, fällig 15.07.2045	160	0,08	270 Wells Fargo & Co, 5,013%, fällig 04.04.2051 *	377	0,20
170 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 144 A 4,000%, fällig 15.01.2032	178	0,09	30 UnitedHealth Group Inc, 4,450%, fällig 15.12.2048	39	0,02	170 Western Midstream Operating LP, 2,229%, fällig 13.01.2023 *	170	0,09
50 Target Corp, 3,375%, fällig 15.04.2029	56	0,03	390 USAA Capital Corp, 144 A 0,500%, fällig 01.05.2024	389	0,21	230 Western Midstream Operating LP, 3,950%, fällig 01.06.2025	241	0,13
110 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144 A 4,900%, fällig 15.09.2044	145	0,08	230 Verizon Communications Inc, 1,500%, fällig 108.09.2030	222	0,12	250 Western Midstream Operating LP, 4,750%, fällig 15.08.2028	275	0,14
160 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144 A 4,270%, fällig 15.05.2047	198	0,10	180 Verizon Communications Inc, 2,550%, fällig 21.03.2031	186	0,10	80 Western Midstream Operating LP, 5,500%, fällig 15.08.2048	92	0,05
160 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144 A 3,300%, fällig 15.05.2050	172	0,09	760 Verizon Communications Inc, 4,272%, fällig 15.01.2036	910	0,48	130 Western Midstream Operating LP, 6,500%, fällig 01.02.2050	153	0,08
270 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000%, fällig 15.03.2027	344	0,18	10 Verizon Communications Inc, 5,250%, fällig 16.03.2037	13	0,01		128.555	67,79
340 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000%, fällig 15.10.2028	445	0,23	100 Verizon Communications Inc, 2,650%, fällig 20.11.2040	97	0,05	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 163.000 USD)		
320 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144 A 2,900%, fällig 01.03.2030	333	0,18	220 Verizon Communications Inc, 3,400%, fällig 22.03.2041	236	0,12	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 4,53 % (28. Februar 2021: 4,05 %)		
60 Texas Instruments Inc, 2,900%, fällig 03.11.2027	66	0,03	40 Verizon Communications Inc, 6,550%, fällig 15.09.2043	64	0,03	Bermuda — 0,18% (28. Februar 2021: 0,17%)		
120 Texas Instruments Inc, 2,250%, fällig 04.09.2029	125	0,07	60 Verizon Communications Inc, 4,125%, fällig 15.08.2046	71	0,04	330 Bermuda Government International Bond, 144 A 2,375%, fällig 20.08.2030		
650 Texas Instruments Inc, 3,875%, fällig 15.03.2039	788	0,42	190 Verizon Communications Inc, 4,522%, fällig 15.09.2048	239	0,13	Chile – 0,21 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
480 Time Warner Cable LLC, 7,300%, fällig 01.07.2038	700	0,37	70 Verizon Communications Inc, 4,000%, fällig 22.03.2050	81	0,04	200 Chile Government International Bond, 2,550%, fällig 27.07.2033		
90 Time Warner Cable LLC, 6,750%, fällig 15.06.2039	126	0,07	110 Verizon Communications Inc, 2,875%, fällig 20.11.2050	106	0,06	200 Chile Government International Bond, 3,100%, fällig 07.05.2041		
254 Time Warner Entertainment Co LP, 8,375%, fällig 15.07.2033	379	0,20	810 Verizon Communications Inc, 3,550%, fällig 22.03.2051	882	0,46	Ghana – 0,13 % (28. Februar 2021: 0,13 %)		
			30 Verizon Communications Inc, 2,987%, fällig 30.10.2056	29	0,02	250 Ghana Government International Bond, 144 A 8,627%, fällig 16.06.2049		
			170 Verizon Communications Inc, 3,000%, fällig 20.11.2060	164	0,09	Israel – 0,44 % (28. Februar 2021: 0,43 %)		
			1.750 Verizon Communications Inc, 3,700%, fällig 22.03.2061	1.928	1,02	360 Israel Government International Bond, 3,250%, fällig 17.01.2028		
			90 Visa Inc, 2,050%, fällig 15.04.2030	93	0,05			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			350 Asurion LLC, 3,217%, fällig 03.11.2023 *	346	0,18	Futures – 0,02 % (28. Februar 2021: 0,02 %)		
400 Israel Government International Bond, 2,750%, fällig 03.07.2030	432	0,23	289 Bass Pro Group LLC, 5,000%, fällig 26.02.2028 *	290	0,15	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	830	0,44	170 Carnival Corp, 3,750%, fällig 30.06.2025 *	170	0,09	42 0,02		
Mexiko – 0,92 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			227 CoreCivic Inc, 5,500%, fällig 18.12.2024 *	225	0,12	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
MXN 17.350 Mexican Bonos, Series M 30X 8,500%, fällig 18.11.2038	947	0,50	1 Endo Luxembourg Finance I Company S.a.r.l., 5,750%, fällig 11.03.2028 *	–	–	190.499 100,45		
750 Mexico Government International Bond, 4,280%, fällig 14.08.2041	804	0,42	369 Four Seasons Hotels Ltd, 2,092%, fällig 30.11.2023 *	367	0,19	Devisenterminkontrakte – (0,73 %)		
	1.751	0,92	280 Horizon Therapeutics USA Inc, 2,500%, fällig 26.02.2028 *	279	0,15	(28. Februar 2021: (0,02 %))		
Panama – 0,24 % (28. Februar 2021: 0,24 %)			400 ICON Luxembourg S.a.r.l., 3,000%, fällig 01.07.2028 *	400	0,21	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
470 Panama Government International Bond, 2,252%, fällig 29.09.2032	460	0,24	100 Indigo Merger Sub, Inc., 3,000%, fällig 01.07.2028 *	100	0,05	(63) (0,03)		
Paraguay – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,16 %)			80 Schweitzer-Mauduit International, Inc., 4,500%, fällig 23.02.2028 *	80	0,04	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
260 Paraguay Government International Bond, 144 A 5,400%, fällig 30.03.2050	312	0,16	150 SkyMiles IP Ltd, 4,750%, fällig 16.09.2027 *	159	0,08	(1.459) (0,76)		
Peru – 0,05 % (28. Februar 2021: 0,05 %)			180 United Airlines Inc, 4,500%, fällig 14.04.2028 *	181	0,10	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
100 Peruvian Government International Bond, 2,783%, fällig 23.01.2031	102	0,05	260 VICI Properties 1 LLC, 1,838%, fällig 22.12.2024 *	259	0,14	189.040 99,69		
Katar – 0,42 % (28. Februar 2021: 0,39 %)			280 XPO Logistics Inc, 1,881%, fällig 24.02.2025 *	278	0,15	Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
230 Qatar Government International Bond, 144 A 4,817%, fällig 14.03.2049	301	0,16	360 Zebra Buyer LLC, 0,000%, fällig 22.04.2028 *	361	0,19	597 0,31		
400 Qatar Government International Bond, 144 A 4,400%, fällig 16.04.2050	497	0,26	Summe Schuldverschreibungen (Kosten 4.234 USD)			Gesamtvermögen		
	798	0,42	4.271 2,25			\$ 189.637 100,00		
Russland – 0,14 % (28. Februar 2021: 0,13 %)			Kommunale Anleihen – 0,70 % (28. Februar 2021: 0,66 %)			-		
RUB 18.730 Russian Federal Bond - OFZ, Series 6224X 6,900%, fällig 23.05.2029	257	0,14	120 Alabama Economic Settlement Authority, 3,163%, fällig 15.09.2025	127	0,07	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 %.		
United Arab Emirates – 0,49 % (28. Februar 2021: 0,46 %)			150 American Municipal Power Inc, 7,834%, fällig 15.02.2041	252	0,13	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 43.906.000 USD und machten 23,18 % des Nettovermögens aus.		
200 Abu Dhabi Government International Bond, 144 A 3,125%, fällig 16.04.2030	221	0,12	210 Port Authority of New York & New Jersey, 4,458%, fällig 01.10.2062	289	0,15	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.		
230 Abu Dhabi Government International Bond, 144 A 3,125%, fällig 30.09.2049	237	0,12	220 Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 3,006%, fällig 15.05.2050	225	0,12	ABKÜRZUNGEN:		
400 Abu Dhabi Government International Bond, 144 A 3,875%, fällig 16.04.2050	468	0,25	210 State of California, 7,300%, fällig 01.10.2039	340	0,18	Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.		
	926	0,49	70 State of Illinois, 5,100%, fällig 01.06.2033	83	0,05	EUR – Euro		
Vereinigte Staaten – 1,15 % (28. Februar 2021: 1,89 %)			Summe kommunale Anleihen (Kosten 1.099 USD)			GBP – Britisches Pfund Sterling		
130 United States Treasury Note/ Bond, 1,250%, fällig 30.04.2028	132	0,07	1.316 0,70			MXN – Mexikanischer Peso		
20 United States Treasury Note/ Bond, 1,250%, fällig 30.06.2028	20	0,01	Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,01 % (28. Februar 2021: 5,08 %)			RUB – Russischer Rubel		
50 United States Treasury Note/ Bond, 1,000%, fällig 31.07.2028	50	0,03	3.815 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	3.815	2,01	Analyse des Gesamtvermögens		
240 United States Treasury Note/ Bond, 2,250%, fällig 15.05.2041	257	0,14	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 3,815 USD)			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
50 United States Treasury Note/ Bond, 1,625%, fällig 15.11.2050	47	0,02	Vorzugsaktien – 0,26 % (28. Februar 2021: 0,26 %)			94,69		
920 United States Treasury Note/ Bond, 1,875%, fällig 15.02.2051	908	0,48	Vereinigte Staaten – 0,26 % (28. Februar 2021: 0,26 %)			Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden		
690 United States Treasury Note/ Bond, 2,375%, fällig 15.05.2051	762	0,40	– Targa Resources Corp, Series A 496 0,26			2,22		
	2.176	1,15	Summe Vorzugsaktien (Kosten 483 USD)			1,98		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 8.318 USD)			8.592 4,53			Organismen für gemeinsame Anlagen		
Schuldverschreibungen – 2,25 % (28. Februar 2021: 0,98 %)			Immobilieninvestmentgesellschaften – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Finanzderivate		
180 AECOM, 1,842%, fällig 09.04.2028 *	180	0,09	Vereinigte Staaten – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Sonstige Vermögenswerte		
427 Air Canada, 1,839%, fällig 06.10.2023 *	427	0,23	12 TPG RE Finance Trust Inc, Series C 297 0,16			1,08		
170 Asplundh Tree Expert LLC, 1,842%, fällig 04.09.2027 *	169	0,09	Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 300 USD)			Gesamtvermögen		
			297 0,16			100,00		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 181.559 USD)			190.435 100,42					
Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2021: 1,84 %)			22 0,01					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)								

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	122.334	Verkauf	USD	169.586	\$ (1.387)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	933	Verkauf	USD	1.098	5
19.10.2021	BNP Paribas	Kauf	EUR	1.402	Verkauf	USD	1.666	(9)
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	729	Verkauf	GBP	527	5
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	RUB	20.762	Verkauf	USD	275	6
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	MXN	12.140	Verkauf	USD	599	1
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	BRL	1.461	Verkauf	USD	275	5
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 3.528 USD)								\$ 22
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (48) USD)								(1.396)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 3.480 USD)								\$ (1.374)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bund September 2021	Bank of America Merrill Lynch	(1)	\$ (207)	\$ (5)
Long Gilt Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(5)	(882)	6
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	74	9.875	(6)
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(55)	(12.118)	(8)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	225	27.837	36
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(77)	(12.549)	(39)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Bank of America Merrill Lynch	(5)	(986)	(5)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 48 USD)				\$ 42
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 197 USD)				(63)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (149) USD)				\$ (21)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 3,85 % (28. Februar 2021: 3,47 %)			Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 29,00 % (28. Februar 2021: 31,01 %)			Vereinigte Staaten – 20,97 % (28. Februar 2021: 21,63 %)		
260 Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Ctf's Ser 2004-R10X Series 2004 R10X Class M6X 2,139%, fällig 25.11.2034 *	260	1,12	20 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000%, fällig 30.09.2043	28	0,12	1) Abbott Laboratories, 3,750%, fällig 30.11.2026	11	0,05
193 Ameriquest Mortgage Securities Trust 2006-R1X Series 2006 R1X Class M1X 0,669%, fällig 25.03.2036 *	192	0,83	40 Glencore Funding LLC, 144 A 4,000%, fällig 27.03.2027	44	0,19	1) Abbott Laboratories, 4,750%, fällig 30.11.2036	13	0,06
80 RAMP Series 2006-RZ3 Trust, Series 2006 RZ3X Class M1X 0,434%, fällig 25.08.2036 *	79	0,34	72	0,31	20 Abbott Laboratories, 4,900%, fällig 30.11.2046	28	0,12	
100 Saxon Asset Securities Trust 2006-3X Series 2006 3X Class A4X 0,324%, fällig 25.10.2046 *	91	0,40	Belgien – 0,51 % (28. Februar 2021: 0,81 %)			100 AbbVie Inc, 3,600%, fällig 14.05.2025	109	0,47
250 Towd Point Mortgage Trust 2017-4X Series 2017 4X Class B2X 144 A 3,459%, fällig 25.06.2057 *	268	1,16	40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500%, fällig 01.06.2030	45	0,19	80 AbbVie Inc, 3,200%, fällig 21.11.2029	87	0,38
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Kosten 880 USD)	890	3,85	20 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350%, fällig 01.06.2040	24	0,10	20 AbbVie Inc, 4,250%, fällig 21.11.2049	24	0,10
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 20,90 % (28. Februar 2021: 24,54 %)			40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500%, fällig 01.06.2050	50	0,22	20 Alphabet Inc, 1,100%, fällig 15.08.2030	19	0,08
100 BANK 2017-BNK7X Series 2017 BNK7X Class C, 4,181%, fällig 15.09.2060 *	107	0,46	119	0,51	20 Alphabet Inc, 2,050%, fällig 15.08.2050	18	0,08	
7.910 Benchmark 2018-B7 Mortgage Trust, Series 2018 B7X Class XA, 0,595%, fällig 15.05.2053 *	198	0,86	Brasilien – 1,86 % (28. Februar 2021: 1,62 %)			32 Altria Group Inc, 4,400%, fällig 14.02.2026	36	0,16
230 BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA, Series 2018 BIOA, Class A, 144 A 0,767%, fällig 15.03.2037 *	230	1,00	200 Petrobras Global Finance BV, 5,750%, fällig 01.02.2029	229	0,99	8 Altria Group Inc, 4,800%, fällig 14.02.2029	9	0,04
120 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C01X Class 1M2X 2,334%, fällig 25.07.2030 *	122	0,53	60 Suzano Austria GmbH, 3,125%, fällig 15.01.2032	60	0,26	20 Altria Group Inc, 5,800%, fällig 14.02.2039	25	0,11
224 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05X Class 1M2X 2,434%, fällig 25.01.2031 *	226	0,98	100 Vale Overseas Ltd, 6,875%, fällig 21.11.2036	140	0,61	30 Altria Group Inc, 5,950%, fällig 14.02.2049	39	0,17
100 Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 1,500% ±	102	0,44	429	1,86	Kanada – 0,95 % (28. Februar 2021: 0,99 %)	40 Amazon.com Inc, 1,500%, fällig 03.06.2030	39	0,17
100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 1,500% ± 98	0,43		30 Bank of Montreal, 1,850%, fällig 01.05.2025	31	0,13	50 Amazon.com Inc, 2,500%, fällig 03.06.2050	48	0,21
500 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000% ±	507	2,19	20 Bank of Nova Scotia/The, 1,300%, fällig 11.06.2025	20	0,09	30 Anthem Inc, 3,650%, fällig 01.12.2027	34	0,15
458 Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000%, fällig 01.09.2048	493	2,13	20 Barrick North America Finance LLC, 5,700%, fällig 30.05.2041	28	0,12	50 AT&T Inc, 1,650%, fällig 01.02.2028	50	0,22
199 Fannie Mae Pool 'FM7740', 2,500%, fällig 01.06.2051	210	0,91	20 Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,950%, fällig 23.06.2023	20	0,09	20 AT&T Inc, 3,100%, fällig 01.02.2043	20	0,09
322 Fannie Mae Pool 'MA3057', 3,500%, fällig 01.07.2047	343	1,48	10 MEG Energy Corp, 144 A 5,875%, fällig 01.02.2029	10	0,04	20 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250%, fällig 15.01.2049	25	0,11
529 Freddie Mac Pool 'SD0176', 3,500%, fällig 01.12.2049	559	2,42	40 Royal Bank of Canada, 1,150%, fällig 10.06.2025	40	0,17	40 Boeing Co/The, 4,875%, fällig 01.05.2025	45	0,19
221 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2X Series 2020 DNA2X Class M2X 144 A 1,934%, fällig 25.02.2050 *	223	0,97	70 Toronto-Dominion Bank/The, 1,150%, fällig 12.06.2025	71	0,31	50 Boeing Co/The, 5,150%, fällig 01.05.2030	59	0,26
214 Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500%, fällig 20.09.2048	227	0,98	Kolumbien – 0,46 % (28. Februar 2021: 0,49 %)			50 Boeing Co/The, 5,705%, fällig 01.05.2040	52	0,22
262 Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000%, fällig 20.05.2050	277	1,20	100 Ecopetrol SA, 5,875%, fällig 28.05.2045	107	0,46	50 Boeing Co/The, 5,805%, fällig 01.05.2050	68	0,29
299 Ginnie Mae II Pool 'MA7473', 3,000%, fällig 20.07.2051	313	1,35	Frankreich – 1,00 % (28. Februar 2021: 1,05 %)			40 BP Capital Markets America Inc, 3,119%, fällig 04.05.2026	43	0,19
100 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000% ±	102	0,44	200 BNP Paribas SA, 144 A 4,400%, fällig 14.08.2028	231	1,00	20 BP Capital Markets America Inc, 3,633%, fällig 06.04.2030	23	0,10
400 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500% ±	415	1,79	Israel – 1,01 % (28. Februar 2021: 1,04 %)			20 BP Capital Markets America Inc, 3,000%, fällig 24.02.2050	20	0,09
77 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2 R, Series 2021 NQ2 R, Class A3X 144 A 1,353%, fällig 25.09.2058 *	78	0,34	120 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800%, fällig 21.07.2023	118	0,51	40 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400%, fällig 26.07.2029	45	0,19
Summe hypothekarisch gesicherte Wertpapiere (Kosten 4,839 USD)	4.830	20,90	120 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150%, fällig 01.10.2026	115	0,50	16 Bristol-Myers Squibb Co, 5,000%, fällig 15.08.2045	22	0,10
			233	1,01	Macau – 0,88 % (28. Februar 2021: 0,94 %)	260 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500%, fällig 01.05.2032	272	1,18
			Peru – 0,56 % (28. Februar 2021: 0,57 %)			40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908%, fällig 23.07.2025	45	0,20
			100 Southern Copper Corp, 5,250%, fällig 08.11.2042	129	0,56	80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200%, fällig 15.03.2028	91	0,39
			Schweiz – 0,12 % (28. Februar 2021: 0,11 %)			40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, fällig 01.04.2038	50	0,21
			20 Glencore Finance Canada Ltd, 144 A 6,000%, fällig 15.11.2041	27	0,12	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800%, fällig 01.03.2050	47	0,20
			Großbritannien – 0,37 % (28. Februar 2021: 1,43 %)			40 Cigna Corp, 4,375%, fällig 15.10.2028	47	0,20
			40 BAT Capital Corp, 3,557%, fällig 15.08.2027	43	0,19			
			40 BAT Capital Corp, 4,540%, fällig 15.08.2047	43	0,18			
				86	0,37			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			30 PepsiCo Inc, 3,625%, fällig 19.03.2050	36	0,15	Peru – 0,30 % (28. Februar 2021: 0,31 %)		
Vereinigte Staaten — (Fortsetzung)			20 Philip Morris International Inc, 2,100%, fällig 01.05.2030	20	0,09	50 Peruvian Government International Bond, 6,550%, fällig 14.03.2037	69	0,30
20 Cigna Corp, 4,800%, fällig 15.08.2038	25	0,11	20 Philip Morris International Inc, 4,500%, fällig 20.03.2042	24	0,10	Polen – 0,24 % (28. Februar 2021: 0,25 %)		
20 Cigna Corp, 4,900%, fällig 15.12.2048	26	0,11	40 Raytheon Technologies Corp, 2,250%, fällig 01.07.2030	41	0,18	50 Republic of Poland Government International Bond, 4,000%, fällig 22.01.2024	54	0,24
60 Cimarex Energy Co, 4,375%, fällig 15.03.2029	68	0,30	10 Raytheon Technologies Corp, 4,500%, fällig 01.06.2042	13	0,05	Russland – 2,33 % (28. Februar 2021: 2,34 %)		
150 Citigroup Inc, 5,500%, fällig 13.09.2025	174	0,75	60 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144 A 8,000%, fällig 20.09.2025	68	0,29	RUB 39.311 Russian Federal Bond OFZ, Series 6224X 6,900%, fällig 23.05.2029	539	2,33
10 Citigroup Inc, 8,125%, fällig 15.07.2039	17	0,07	10 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875%, fällig 01.02.2031	11	0,05	Vereinigte Staaten — 18,81 % (28. Februar 2021: 27,34 %)		
50 Citigroup Inc, 4,650%, fällig 23.07.2048	66	0,29	10 T-Mobile USA Inc, 2,250%, fällig 15.02.2026	10	0,04	230 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2,125%, fällig 15.02.2040	440	1,90
50 Coca-Cola Co/The, 2,500%, fällig 15.03.2051	49	0,21	10 T-Mobile USA Inc, 2,625%, fällig 15.02.2029	10	0,04	330 United States Treasury Note/Bond, 0,375%, fällig 31.12.2025	326	1,41
40 ConocoPhillips, 144 A 4,300%, fällig 15.08.2028	46	0,20	70 T-Mobile USA Inc, 2,550%, fällig 15.02.2031	71	0,31	470 United States Treasury Note/Bond, 0,625%, fällig 31.12.2027	460	1,99
10 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20 A, 3,350%, fällig 01.04.2030	11	0,05	10 T-Mobile USA Inc, 2,875%, fällig 15.02.2031	10	0,04	320 United States Treasury Note/Bond, 0,750%, fällig 31.01.2028	315	1,36
30 Deere & Co, 3,750%, fällig 15.04.2050	37	0,16	20 T-Mobile USA Inc, 144 A 3,500%, fällig 15.04.2031	21	0,09	210 United States Treasury Note/Bond, 1,125%, fällig 29.02.2028	212	0,91
150 Delta Air Lines Inc, 7,375%, fällig 15.01.2026	177	0,76	20 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850%, fällig 01.02.2026	25	0,11	20 United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 31.03.2028	20	0,09
160 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144 A 4,750%, fällig 20.10.2028	179	0,77	50 Union Pacific Corp, 144 A 2,891%, fällig 06.04.2036	53	0,23	10 United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 30.04.2028	10	0,04
40 Devon Energy Corp, 5,850%, fällig 15.12.2025	47	0,20	40 Union Pacific Corp, 3,839%, fällig 20.03.2060	47	0,20	340 United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 31.05.2028	344	1,49
40 Devon Energy Corp, 5,000%, fällig 15.06.2045	47	0,20	20 United Airlines Inc, 144 A 4,625%, fällig 15.04.2029	21	0,09	200 United States Treasury Note/Bond, 1,125%, fällig 31.08.2028	201	0,87
20 Diamondback Energy Inc, 3,500%, fällig 01.12.2029	22	0,09	40 UnitedHealth Group Inc, 2,000%, fällig 15.05.2030	41	0,18	10 United States Treasury Note/Bond, 0,625%, fällig 15.08.2030	9	0,04
20 Energy Transfer LP, 5,250%, fällig 15.04.2029	24	0,10	20 UnitedHealth Group Inc, 2,750%, fällig 15.05.2040	21	0,09	170 United States Treasury Note/Bond, 1,625%, fällig 15.05.2031	175	0,76
20 Energy Transfer LP, 6,250%, fällig 15.04.2049	27	0,11	20 UnitedHealth Group Inc, 3,700%, fällig 15.08.2049	23	0,10	130 United States Treasury Note/Bond, 2,250%, fällig 15.05.2041	139	0,60
20 EOG Resources Inc, 4,375%, fällig 15.04.2030	24	0,10	40 US Bancorp, 1,450%, fällig 12.05.2025	41	0,18	50 United States Treasury Note/Bond, 2,875%, fällig 15.05.2049	60	0,26
20 EOG Resources Inc, 4,950%, fällig 15.04.2050	27	0,12	20 Visa Inc, 2,050%, fällig 15.04.2030	21	0,09	50 United States Treasury Note/Bond, 2,250%, fällig 15.08.2049	54	0,23
150 EQT Corp, 5,000%, fällig 15.01.2029	171	0,74	30 Visa Inc, 4,300%, fällig 14.12.2045	39	0,17	10 United States Treasury Note/Bond, 1,250%, fällig 15.05.2050	8	0,04
10 Exelon Corp, 5,625%, fällig 15.06.2035	13	0,06	140 Western Midstream Operating LP, 6,500%, fällig 01.02.2050	165	0,71	380 United States Treasury Note/Bond, 1,375%, fällig 15.08.2050	333	1,44
220 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000%, fällig 13.11.2030	232	1,01	20 Williams Cos Inc/The, 4,850%, fällig 01.03.2048	25	0,11	260 United States Treasury Note/Bond, 1,625%, fällig 15.11.2050	242	1,05
20 General Motors Co, 5,950%, fällig 01.04.2049	27	0,12		4.848	20,97	540 United States Treasury Note/Bond, 1,875%, fällig 15.02.2051	533	2,31
40 Home Depot Inc/The, 3,300%, fällig 15.04.2040	44	0,19				330 United States Treasury Note/Bond, 2,375%, fällig 15.05.2051	365	1,58
20 Kinder Morgan Inc, 5,200%, fällig 01.03.2048	25	0,11				100 United States Treasury Note/Bond, 2,000%, fällig 15.08.2051	102	0,44
40 Las Vegas Sands Corp, 3,200%, fällig 08.08.2024	42	0,18					4.348	18,81
10 MDC Holdings Inc, 6,000%, fällig 15.01.2043	13	0,06				Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 7.447 USD)		
30 Merck & Co Inc, 1,450%, fällig 24.06.2030	29	0,13					7.371	31,89
110 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144 A 6,500%, fällig 20.06.2027	120	0,52				Brasilien – 1,36 % (28. Februar 2021: 1,41 %)		
40 Mondelez International Inc, 1,500%, fällig 04.05.2025	41	0,18				BRL 600 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000%, fällig 01.01.2027	116	0,50
110 Morgan Stanley, 2,188%, fällig 28.04.2026 *	114	0,49				200 Brazilian Government International Bond, 5,000%, fällig 27.01.2045	198	0,86
70 Morgan Stanley, 3,622%, fällig 01.04.2031 *	78	0,34					314	1,36
10 Morgan Stanley, 5,597%, fällig 24.03.2051 *	15	0,07				Indonesien – 2,24 % (28. Februar 2021: 1,38 %)		
20 MPLX LP, 4,800%, fällig 15.02.2029	23	0,10				200 Indonesia Government International Bond, 4,625%, fällig 15.04.2043	238	1,03
20 MPLX LP, 5,500%, fällig 15.02.2049	26	0,11				IDR 1.145.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR59X 7,000%, fällig 15.05.2027	87	0,37
20 NIKE Inc, 3,375%, fällig 27.03.2050	23	0,10				IDR 2.677.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR87X 6,500%, fällig 15.02.2031	193	0,84
40 Northrop Grumman Corp, 3,250%, fällig 15.01.2028	44	0,19					518	2,24
20 Northrop Grumman Corp, 5,250%, fällig 01.05.2050	28	0,12				Mexiko – 6,61 % (28. Februar 2021: 4,27 %)		
20 PepsiCo Inc, 1,625%, fällig 01.05.2030	20	0,09				MXN 25.890 Mexican Bonos, Series M, 7,750%, fällig 13.11.2042	1.315	5,69
						200 Mexico Government International Bond, 4,350%, fällig 15.01.2047	214	0,92
							1.529	6,61

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Schuldscheindarlehen – 9,56 % (28. Februar 2021: 10,40 %)			20 RealPage Inc, 3,750%, fällig 18.02.2028 *	20	0,09	Devisenterminkontrakte – 0,14 % (28. Februar 2021: 0,09 %)		
70 1011778 BC ULC, 1,842%, fällig 14.11.2026 *	68	0,30	57 Reynolds Consumer Products LLC, 1,842%, fällig 04.02.2027 *	57	0,24	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
1) AECOM, 1,842%, fällig 09.04.2028 *	10	0,04	50 Reynolds Group Holdings Inc, 2,842%, fällig 05.02.2023 *	50	0,22	Futures – 0,31 % (28. Februar 2021: 0,31 %)		
60 Allied Universal Holdco LLC, 4,250%, fällig 14.05.2028 *	60	0,26	60 Scientific Games International Inc, 2,842%, fällig 14.08.2024 *	59	0,26	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
1) AmWINS Group, Inc., 3,000%, fällig 17.02.2028 *	10	0,04	60 Sotera Health, 3,250%, fällig 13.12.2026 *	60	0,26	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten		
50 Athenaehealth Inc, 4,410%, fällig 11.02.2026 *	50	0,22	30 Station Casinos LLC, 2,500%, fällig 08.02.2027 *	30	0,13	23.915	103,47	
60 Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 2,750%, fällig 01.12.2027 *	60	0,26	19 Trans Union LLC, 1,842%, fällig 13.11.2026 *	19	0,08	Verträge (in Tsd.)		
70 Bausch Health Americas Inc, 2,842%, fällig 27.11.2025 *	70	0,30	18 UFC Holdings LLC, 3,500%, fällig 29.04.2026 *	18	0,08	Verkaufte Optionen – (0,04 %) (28. Februar 2021: (0,05 %))		
18 Berry Global Inc, 1,856%, fällig 01.07.2026 *	18	0,08	30 United Airlines Inc, 4,500%, fällig 14.04.2028 *	30	0,13	– Euro \$2 Year Midcurve Dezember 2021 Call 99,1250X fällig 10.12.2021 – Morgan Stanley (1) -		
10 Brookfield WEC Holdings Inc., 3,250%, fällig 01.08.2025 *	10	0,04	10 Unicom Communications Inc, 4,000%, fällig 24.03.2026 *	10	0,04	– Euro \$2 Year Midcurve Dezember 2021 Call 99,25X fällig 10.12.2021 – Morgan Stanley - -		
70 Caesars Resort Collection LLC, 2,842%, fällig 22.12.2024 *	69	0,30	70 Versend Holding Corp., 4,092%, fällig 27.08.2025 *	70	0,30	– Euro \$2 Year Midcurve Dezember 2021 Put 98,75X fällig 10.12.2021 – Morgan Stanley - -		
49 Change Healthcare Holdings LLC, 3,500%, fällig 01.03.2024 *	49	0,21	68 VFH Parent LLC, 3,088%, fällig 01.03.2026 *	68	0,29	– U.S. 10 Year November 2021 Call 134,00X fällig 22.10.2021 – Morgan Stanley - -		
70 Charter Communications Operating LLC, 1,850%, fällig 30.04.2025 *	69	0,30	40 VICI Properties 1 LLC, 1,838%, fällig 22.12.2024 *	40	0,17	– U.S. 10 Year Oktober 2021 Call 134,00X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley (1) (0,01)		
50 Citadel Securities, 2,592%, fällig 27.02.2028 *	49	0,21	60 Virgin Media Bristol LLC, 2,595%, fällig 04.01.2028 *	59	0,26	– U.S. 10 Year Oktober 2021 Call 134,50X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley - -		
99 CityCenter Holdings LLC, 3,000%, fällig 18.04.2024 *	99	0,43	39 Western Digital Corp, 1,842%, fällig 29.04.2023 *	39	0,17	– U.S. 10 Year Oktober 2021 Put 133,00X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley (1) (0,01)		
10 CSC Holdings LLC, 2,345%, fällig 15.01.2026 *	10	0,04	70 Whatabrands LLC, 3,750%, fällig 21.07.2028 *	70	0,30	– U.S. 10 Year Oktober 2021 Put 133,50X fällig 03.09.2021 – Morgan Stanley (1) -		
10 DCert Buyer, Inc., 4,092%, fällig 16.10.2026 *	10	0,04	20 Zebra Buyer LLC, 0,000%, fällig 22.04.2028 *	20	0,09	– U.S. Bond Oktober 2021 Call 165,00X fällig 24.09.2021 – Morgan Stanley (1) -		
26 Endo Luxembourg Finance I Company S.a.r.l., 5,750%, fällig 11.03.2028 *	26	0,11	Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 2.223 USD)			2.210	9,56	
50 Energizer Holdings, Inc., 2,750%, fällig 16.12.2027 *	49	0,21	Kollektive Kapitalanlagen – 5,52 % (28. Februar 2021: 6,64 %)					
10 FleetCor Technologies Operating Co, LLC, 1,863%, fällig 22.04.2028 *	10	0,04	66 Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	958	4,14			
10 Four Seasons Hotels Ltd, 2,092%, fällig 30.11.2023 *	10	0,04	319 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	319	1,38			
20 Gainwell Acquisition Corp, 4,750%, fällig 01.10.2027 *	20	0,09	Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 1.249 USD)			1.277	5,52	
70 Genesee & Wyoming Inc, 2,147%, fällig 30.12.2026 *	69	0,30	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 23.330 USD)			23.282	100,72	
60 GoDaddy Operating Co, 1,842%, fällig 15.02.2024 *	59	0,26	Verträge (in Tsd.)					
70 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 2,088%, fällig 15.11.2027 *	69	0,30	Gekaufte Optionen – 0,05 % (28. Februar 2021: 0,01 %)					
10 GVC Holdings Gibraltar Ltd, 0,000%, fällig 16.03.2027 *	10	0,04	110 USD Put/AUD Call 0,7270X fällig 23.11.2021 – Goldman Sachs	2	0,01			
60 Harbor Freight Tools USA Inc, 0,000%, fällig 19.10.2027 *	59	0,26	210 USD Put/ CAD Call 1,2685X fällig 23.11.2021 – BNP Paribas	3	0,02			
32 ICON Luxembourg S.a.r.l., 3,000%, fällig 01.07.2028 *	32	0,14	464 USD Put/ JPY Call 107,80X fällig 11.11.2021 – Morgan Stanley	2	0,01			
10 iHeartCommunications Inc, 3,115%, fällig 01.05.2026 *	10	0,04	110 USD Put/NZD Call 0,6955X fällig 23.11.2021 – Goldman Sachs	3	0,01			
8 Indigo Merger Sub, Inc., 3,000%, fällig 01.07.2028 *	8	0,03	Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 6 USD)			10	0,05	
50 Ineos U.S. Petrochemical, 3,250%, fällig 21.01.2026 *	50	0,22	Credit Default Swaps – 1,31 % (28. Februar 2021: 1,17 %)					
40 Jazz Financing Lux S.a.r.l., 4,000%, fällig 22.04.2028 *	40	0,17	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			302	1,31	
20 Level 3 Parent LLC, 1,842%, fällig 01.03.2027 *	20	0,09	Zinsswaps – 0,94 % (28. Februar 2021: 1,49 %)					
20 Michaels Cos Inc./The, 5,000%, fällig 08.04.2028 *	20	0,09	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			217	0,94	
60 Nexstar Broadcasting Inc, 2,596%, fällig 19.09.2026 *	60	0,26	Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten 12 USD)			(8)	(0,04)	
70 Option Care Health Inc, 3,842%, fällig 06.08.2026 *	69	0,30	Zinsswaps – (0,14 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)					
60 PPD, Inc., 2,750%, fällig 06.01.2028 *	60	0,26	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(32)	(0,14)	
20 Quikrete Holdings, Inc., 0,000%, fällig 11.06.2028 *	20	0,09	Devisenterminkontrakte – (0,15 %) (28. Februar 2021: (0,33 %))					
10 Rackspace Technology Global, Inc, 3,500%, fällig 09.02.2028 *	10	0,04	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(35)	(0,15)	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
Termingeschäfte – (0,39 %) (28. Februar 2021: (0,76 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(91)	(0,39)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(166)	(0,72)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	23.749	102,75
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	(634)	(2,75)
Gesamtvermögen	\$23.115	100,00

± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.
 β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

ABKÜRZUNGEN:

- REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.
- TBA – Wird noch bekanntgegeben.
- BRL – Brasilianischer Real
- IDR – Indonesische Rupiah
- MXN – Mexikanischer Peso
- RUB – Russischer Rubel

- 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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.822.000 USD und machten 7,89 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

Analyse des Gesamtvermögens		% von Gesamtvermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		79,25
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden		8,85
Organismen für gemeinsame Anlagen		5,11
Finanzderivate		2,53
Sonstige Vermögenswerte		4,26
Gesamtvermögen		100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kauf/- Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5,000%	Verkauf	20.06.2026	3.370	\$ 119
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000%	Verkauf	20.06.2026	1.655	183
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 260 USD)					\$ 302
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)					–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 260 USD)					\$ 302

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,820%	04.06.2024	4.094	\$ (2)
Morgan Stanley	Pay Fixed 0,780%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.11.2027	3.370	51
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,250%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2028	1.123	(14)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,350%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2028	542	(10)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,225%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	1.655	162
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,520%, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2047	52	(1)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,630%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2047	275	3
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,000%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	03.06.2051	64	(5)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,671%, Receive Floating USD 3M Libor BBA	09.07.2051	175	1
Unrealised Appreciation of Interest Rate Swaps (28. Februar 2021 (000's): \$330)				\$ 217
Unrealised Depreciation of Interest Rate Swaps (28. Februar 2021 (000's): \$-)				(32)
Net Appreciation of Interest Rate Swaps (28. Februar 2021 (000's): \$330)				\$ 185

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
19.10.2021	BNP Paribas	Kauf	USD 194	Verkauf	EUR 163	\$ 1
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD 567	Verkauf	CNH 3.701	(4)
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	GBP 244	Verkauf	USD 338	(2)
19.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	CAD 600	Verkauf	USD 483	(8)
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	JPY 91.330	Verkauf	USD 832	(2)
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	IDR 3.089.753	Verkauf	USD 209	7
19.10.2021	JP Morgan	Kauf	AUD 841	Verkauf	USD 631	(15)
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD 619	Verkauf	EUR 520	4
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD 296	Verkauf	MXN 5.991	–
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	RUB 46.864	Verkauf	USD 618	18
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	CAD 1.035	Verkauf	USD 824	(4)
19.10.2021	Morgan Stanley	Kauf	BRL 1.372	Verkauf	USD 261	2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 21 USD)						\$ 32
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (73) USD)						(35)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (52) USD)						\$ (3)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro\$ Dezember 2021	Morgan Stanley	(44)	\$(10.981)	\$ (6)
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Morgan Stanley	56	13.865	14
90 Day Euro\$ Juni 2023	Morgan Stanley	9	2.235	3
90 Day Euro\$ September 2023	Morgan Stanley	2	496	–
Australia 10 Year Bond September 2021	Morgan Stanley	5	533	18
Euro FX Currency September 2021	Morgan Stanley	1	148	(5)
Euro-Bund Dezember 2021	Morgan Stanley	(6)	(1.222)	4
Euro-Bund September 2021	Morgan Stanley	(8)	(1.657)	(41)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2021	Morgan Stanley	(1)	(251)	(17)
Euro-OAT September 2021	Morgan Stanley	2	381	9
Mexican Peso Currency September 2021	Morgan Stanley	4	99	(1)
RUB/USD September 2021	Morgan Stanley	4	136	3
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2021	Morgan Stanley	22	2.936	6
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2021	Morgan Stanley	(5)	(740)	2
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2021	Morgan Stanley	(2)	(441)	–
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2021	Morgan Stanley	80	9.897	13
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2021	Morgan Stanley	(25)	(4.074)	(10)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Morgan Stanley	16	3.157	(11)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 69 USD)				\$ 72
Nicht realisierte Wertminderung von Termingeschäftskontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (168) USD)				(91)
Nettowertminderung von Termingeschäftskontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (99) USD)				\$ (19)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 4,71 % (28. Februar 2021: 4,07 %)					
Mexiko – 1,73 % (28. Februar 2021: 1,72 %)					
	760	0,25			
	4.200	1,48			
	4.686	1,73			
Supranational – 2,98 % (28. Februar 2021: 2,19 %)					
RUB	368.000	1,76			
MXN	71.300	1,22			
	8.110	2,98			
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 13.670 USD)					
	12.796	4,71			
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 92,67 % (28. Februar 2021: 92,34 %)					
Australien – 4,71 % (28. Februar 2021: 4,66 %)					
AUD	7.411	2,11			
AUD	1.930	0,55			
AUD	3.420	0,99			
AUD	3.530	1,07			
	12.788	4,71			
Brasilien – 2,77 % (28. Februar 2021: 2,24 %)					
BRL	38.410	2,77			
Chile – 0,64 % (28. Februar 2021: 0,47 %)					
	1.690	0,64			
Kolumbien – 3,90 % (28. Februar 2021: 4,26 %)					
COP	41.300.000	3,90			
Indonesien – 2,69 % (28. Februar 2021: 3,82 %)					
IDR	88.200.000	2,69			
Malaysia – 4,06 % (28. Februar 2021: 1,46 %)					
MYR	7.750	0,69			
MYR	20.370	1,85			
MYR	5.550	0,52			
MYR	10.760	1,00			
	11.036	4,06			
Mexiko – 9,32 % (28. Februar 2021: 9,96 %)					
MXN	104.000	2,09			
MXN	140.900	2,83			
MXN	176.800	3,30			
MXN	57.700	1,10			
	25.337	9,32			
Polen – 6,22 % (28. Februar 2021: 0,75 %)					
PLN	60.130	6,22			
Südafrika – 3,98 % (28. Februar 2021: 3,53 %)					
ZAR	102.800	1,77			
ZAR	101.500	2,21			
	10.820	3,98			
Südkorea – 5,67 % (28. Februar 2021: 0,00 %)					
KRW	15.600.000	5,67			
Großbritannien – 5,30 % (28. Februar 2021: 14,73 %)					
GBP	10.310	5,30			
Vereinigte Staaten – 43,41 % (28. Februar 2021: 46,46 %)					
	32.375	11,92			
	15.500	5,71			
	70.010	25,78			
	117.959	43,41			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 258.436 USD)					
	251.839	92,67			
Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,35 % (28. Februar 2021: 4,16 %)					
	6.381	2,35			
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 6.381 USD)					
	6.381	2,35			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 278.487 USD)					
	271.016	99,73			
Devisenterminkontrakte – 0,31 % (28. Februar 2021: 1,12 %)					
	853	0,31			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
	271.869	100,04			
Devisenterminkontrakte – (0,97 %) (28. Februar 2021: (0,74 %))					
	(2.651)	(0,97)			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
	(2.651)	(0,97)			
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
	269.218	99,07			
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen					
	2.540	0,93			
Gesamtnettvermögen					
	\$271.758	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 2.694.000 USD und machten 0,99 % des Nettovermögens aus.					
* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.					

ABKÜRZUNGEN:

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

Analyse des Gesamtvermögens

	% von Gesamtvermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,25
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,30
Finanzderivate	0,31
Sonstige Vermögenswerte	2,14
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
		Kauf		Verkauf	Kauf		Verkauf	
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	AUD	–	\$
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.037	Verkauf	AUD	1.661	8
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	256	Verkauf	AUD	483	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	254	Verkauf	AUD	344	2
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	AUD	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	CAD	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	CAD	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.095	Verkauf	CAD	1.627	5
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	272	Verkauf	CAD	472	(2)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	269	Verkauf	CAD	337	2
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	69	Verkauf	DKK	605	(1)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	281	Verkauf	DKK	2.084	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	69	Verkauf	DKK	432	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	DKK	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	DKK	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	1.266	Verkauf	EUR	1.074	(5)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	5.491	Verkauf	EUR	4.638	15
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	MXN	396	Verkauf	EUR	16	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	ILS	4	Verkauf	EUR	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NOK	1	Verkauf	EUR	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	ILS	39	Verkauf	EUR	10	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	JPY	1.529	Verkauf	EUR	12	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	JPY	63.797	Verkauf	EUR	496	(3)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SGD	17	Verkauf	EUR	9	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NOK	60	Verkauf	EUR	5	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	EUR	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SEK	1	Verkauf	EUR	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SEK	74	Verkauf	EUR	6	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	EUR	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	5.617	Verkauf	EUR	6.593	(59)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	MXN	45	Verkauf	EUR	1	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	PLN	66	Verkauf	EUR	13	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	69	Verkauf	EUR	43	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CAD	10	Verkauf	EUR	7	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CAD	63	Verkauf	EUR	42	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	DKK	2	Verkauf	EUR	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	DKK	91	Verkauf	EUR	11	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	7	Verkauf	EUR	4	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	55	Verkauf	GBP	39	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.562	Verkauf	GBP	3.035	33
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	MXN	7	Verkauf	GBP	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	MXN	28	Verkauf	GBP	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NOK	4	Verkauf	GBP	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SEK	6	Verkauf	GBP	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	JPY	1.118	Verkauf	GBP	8	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	6	Verkauf	GBP	2	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SGD	1	Verkauf	GBP	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	JPY	3.829	Verkauf	GBP	26	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	GBP	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	PLN	4	Verkauf	GBP	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	ILS	3	Verkauf	GBP	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CAD	1	Verkauf	GBP	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	ILS	–	Verkauf	GBP	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CAD	4	Verkauf	GBP	2	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	DKK	7	Verkauf	GBP	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	900	Verkauf	GBP	650	9
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	ILS	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	62	Verkauf	ILS	281	(1)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	254	Verkauf	ILS	969	(2)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	62	Verkauf	ILS	200	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	ILS	–	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	10.927	Verkauf	JPY	1.418.676	7
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	2.678	Verkauf	JPY	293.707	8
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	2.696	Verkauf	JPY	410.995	(28)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	9	Verkauf	JPY	1.279	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	MXN	5	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	399	Verkauf	MXN	9.449	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	99	Verkauf	MXN	2.740	(1)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	98	Verkauf	MXN	1.956	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	MXN	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	32	Verkauf	NOK	397	\$	(1)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	NOK	–		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	129	Verkauf	NOK	1.365		(3)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	32	Verkauf	NOK	282		(1)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	NOK	–		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	78	Verkauf	PLN	421		(1)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	319	Verkauf	PLN	1.454		(2)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	78	Verkauf	PLN	301		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	PLN	–		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	PLN	–		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	40	Verkauf	SEK	483		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	SEK	–		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	164	Verkauf	SEK	1.661		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SEK	–		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	40	Verkauf	SEK	344		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	SGD	–		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	240	Verkauf	SGD	387		(2)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	59	Verkauf	SGD	111		(1)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	59	Verkauf	SGD	80		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SGD	–		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	6.063	Verkauf	USD	8.416		(85)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	6	Verkauf	USD	7		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	35	Verkauf	USD	41		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	24.451	Verkauf	USD	28.960		(80)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	65	Verkauf	AUD	90		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	AUD	2		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	14	Verkauf	EUR	11		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	515	Verkauf	GBP	372		3
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	560	Verkauf	GBP	410		(2)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	30.353	Verkauf	USD	42.060		(331)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	873	Verkauf	USD	641		(3)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	20	Verkauf	USD	26		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.617	Verkauf	USD	1.901		8
20.09.2021	HSBC	Kauf	CLP	1.070.000	Verkauf	USD	1.461		(79)
07.10.2021	HSBC	Kauf	THB	26.800	Verkauf	USD	822		9
08.10.2021	HSBC	Kauf	CLP	8.200.000	Verkauf	USD	11.330		(750)
13.10.2021	Citi	Kauf	PLN	21.590	Verkauf	USD	5.623		15
13.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	388	Verkauf	PLN	1.490		(1)
26.10.2021	Bardclays	Kauf	EUR	25.950	Verkauf	USD	30.674		–
26.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	606	Verkauf	EUR	510		3
27.10.2021	Citi	Kauf	PLN	8.050	Verkauf	USD	2.072		30
28.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	9.954	Verkauf	IDR	146.300.000		(280)
28.10.2021	JP Morgan	Kauf	IDR	26.690.000	Verkauf	USD	1.840		27
29.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	10.374	Verkauf	COP	40.420.000		(316)
29.10.2021	JP Morgan	Kauf	COP	2.820.000	Verkauf	USD	725		21
01.11.2021	Citi	Kauf	USD	17.386	Verkauf	KRW	20.060.000		88
01.11.2021	Citi	Kauf	KRW	10.670.000	Verkauf	USD	9.151		51
02.11.2021	Citi	Kauf	NOK	112.900	Verkauf	USD	12.758		226
05.11.2021	HSBC	Kauf	PEN	23.380	Verkauf	USD	5.945		(235)
08.11.2021	HSBC	Kauf	THB	35.700	Verkauf	USD	1.079		28
10.11.2021	HSBC	Kauf	CLP	970.000	Verkauf	USD	1.264		(15)
15.11.2021	Citi	Kauf	RUB	140.000	Verkauf	USD	1.853		38
17.11.2021	HSBC	Kauf	USD	9.791	Verkauf	ZAR	145.500		(123)
19.11.2021	HSBC	Kauf	HUF	2.730.000	Verkauf	USD	9.096		118
22.11.2021	Citi	Kauf	USD	7.124	Verkauf	MXN	144.900		(11)
23.11.2021	Citi	Kauf	USD	12.941	Verkauf	GBP	9.430		(26)
07.12.2021	Citi	Kauf	JPY	1.875.000	Verkauf	USD	17.123		(65)
08.12.2021	JP Morgan	Kauf	USD	12.328	Verkauf	AUD	17.030		(136)
09.12.2021	HSBC	Kauf	THB	24.600	Verkauf	USD	734		29
15.12.2021	Citi	Kauf	RUB	281.000	Verkauf	USD	3.708		70
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 4.100 USD)								\$	853
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (2.715) USD)									(2.651)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.385 USD)								\$	(1.798)

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts						
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 1,82 % (28. Februar 2021: 2,16 %)			9.020	Caterpillar Financial Services Corp, 0,200%, fällig 17.11.2022 *	9,026	1,26	6.810	United States Treasury Floating Rate Note –When Issued, 0,079%, fällig 30.04.2023 *	6,812	0,95				
2.570	Towd Point Mortgage Trust 2018-3X Series 2018 3X Class A2X 144A, 3,875%, fällig 25.05.2058 *	2,794	0,39	5.065	Exxon Mobil Corp, 3,452%, fällig 15.04.2051	5,614	0,79	7.490	United States Treasury Floating Rate Note –When Issued, 0,084%, fällig 31.07.2023 *	7,492	1,05			
9.904	Towd Point Mortgage Trust 2018-5X Series 2018 5X Class A1X 144A, 3,250%, fällig 25.07.2058 *	10,245	1,43	2.465	General Motors Co, 6,800%, fällig 01.10.2027	3,108	0,43							
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Kosten 12.699 USD)									208.172	29,13				
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere – 6,89 % (28. Februar 2021: 8,13 %)			10.330	General Motors Financial Co Inc, 1,250%, fällig 17.11.2023 *	10,498	1,47	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 484.260 USD)			479,394	67,08			
3.135	Angel Oak Mortgage Trust 2019-6X Series 2019 6X Class A1X 144A, 2,620%, fällig 25.11.2059 *	3,149	0,44	17.150	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,881%, fällig 23.02.2023 *	17,292	2,42	Kollektive Kapitalanlagen – 2,56 % (28. Februar 2021: 5,77 %)						
11.861	Angel Oak Mortgage Trust 2020-1X Series 2020 1X Class A1X 144A, 2,466%, fällig 25.12.2059 *	11,939	1,67	1.845	Hess Corp, 5,800%, fällig 01.04.2047	2,405	0,34	18.269			Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	18,269	2,56	
1.428	Angel Oak Mortgage Trust I LLC 2019-2X Series 2019 2X Class A1.144A, 3,628%, fällig 25.03.2049 *	1,445	0,20	3.065	Jabil Inc, 3,000%, fällig 15.01.2031	3,160	0,44	Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 18.269 USD)			18,269	2,56		
11.380	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust, Series 2017 COR2X Class A3X 3,510%, fällig 10.09.2050	12,644	1,77	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 132.583 USD)			140,184	19,62	Summe ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten USD 695.680)			700,111	97,97	
4.950	COMM 2017-PANW Mortgage Trust, Series 2017 PANW, Class D, 144A, 4,343%, fällig 10.10.2029 *	5,120	0,72	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen 67,08 % (28. Februar 2021: 54,36 %)					Devisenterminkontrakte – 1,30 % (28. Februar 2021: 2,71 %)					
8.350	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C34X Series 2017 C34X Class A3X 3,276%, fällig 15.11.2052	9,078	1,27	Brasilien – 4,54 % (28. Februar 2021: 2,99 %)					Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			9,325	1,30	
EUR 2.028	Newgate Funding Plc, Series 2007 1X, Class BB, 0,000%, fällig 01.12.2050 *	2,249	0,32	BRL 26.845	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN, 10,000%, fällig 01.01.2029	5,158	0,72	Summe zum beizulegenden Zeitwert ergebniswirksam bewertete finanzielle Vermögenswerte			709,436	99,27		
EUR 3.225	Newgate Funding Plc, Series 2007 2X, Class BB, 0,000%, fällig 15.12.2050 *	3,601	0,50	BRL 144.330	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN, 10,000%, fällig 01.01.2031	27,265	3,82	Devisenterminkontrakte: (1,52 %) (28. Februar 2021: (0,68 %))						
Summe hypothekarisch gesicherte Wertpapiere (Kosten 47.869 USD)			49,225	6,89		32,423	4,54	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(10,890)	(1,52)		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen: 19,62 % (28. Februar 2021: 28,98 %)					China – 3,06 % (28. Februar 2021: 0,00 %)					Futures: (0,11 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)				
Kanada – 6,18 % (28. Februar 2021: 6,07 %)					CNY 133.330	China Government Bond, Series INBK, 3,810%, fällig 14.09.2050	21,896	3,06	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten(siehe unten)			(804)	(0,11)	
15.090	Bank of Montreal, 0,726%, fällig 10.03.2023 *	15,220	2,13	Kolumbien – 3,77 % (28. Februar 2021: 4,10 %)					Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten			(11,694)	(1,63)	
14.705	Bank of Nova Scotia/The, 0,597%, fällig 15.09.2023 *	14,808	2,07	COP104.990.000	Colombian TES, Series B, 6,000%, fällig 28.04.2028	26,972	3,77	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			697,742	97,64		
14.020	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,850%, fällig 17.03.2023 *	14,160	1,98	Indonesien – 6,30 % (28. Februar 2021: 3,73 %)					Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			16,907	2,36	
		44,188	6,18	IDR 216.500.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR71X 9,000%, fällig 15.03.2029	17,935	2,51	Gesamtnettvermögen			\$714,649	100,00		
				IDR 179.700.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR68X 8,375%, fällig 15.03.2034	14,445	2,02	-						
				IDR 112.300.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR80X 7,500%, fällig 15.06.2035	8,480	1,19	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 %.						
				IDR 50.300.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR67X 8,750%, fällig 15.02.2044	4,163	0,58	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 34.692.000 USD und machten 4,85 % des Nettovermögens aus.						
						45,023	6,30	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.						
				Mexiko – 6,50 % (28. Februar 2021: 4,50 %)					ABKÜRZUNGEN:					
				MXN 366.800	Mexican Bonos, Series M 30X 8,500%, fällig 18.11.2038	20,009	2,80	BRL	-	Brasilianischer Real				
				MXN 509.700	Mexican Bonos, Series M, 8,000%, fällig 07.11.2047	26,472	3,70	CNY	-	Chinesischer Renminbi				
						46,481	6,50	COP	-	Kolumbianischer Peso				
				Südafrika – 5,14 % (28. Februar 2021: 4,75 %)					EUR	-	Euro			
				ZAR 621.200	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048X 8,750%, fällig 28.02.2048	36,719	5,14	IDR	-	Indonesische Rupiah				
				Südkorea – 8,64 % (28. Februar 2021: 0,00 %)					MXN	-	Mexikanischer Peso			
				KRW73.700.000	Korea Treasury Bond, Series 3012X 1,500%, fällig 10.12.2030	61,708	8,64	ZAR	-	Südafrikanischer Rand				
				Vereinigte Staaten – 29,13 % (28. Februar 2021: 34,29 %)					Analyse des Gesamtvermögens					
6.770	American Express Co, 0,721%, fällig 05.11.2021 *	6,773	0,95	33.295			United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,155%, fällig 31.07.2022 *	33,314	4,66	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden			93,66	
946	Apache Corp, 5,350%, fällig 01.07.2049	1,056	0,15	30.755			United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,145%, fällig 30.1.10.2022 *	30,776	4,31	Organismen für gemeinsame Anlagen			2,51	
1.690	Boeing Co/The, 5,705%, fällig 01.05.2040	2,192	0,31	129.695			United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,064%, fällig 31.01.2023 *	129,778	18,16	Finanzderivate			1,28	
3.515	Boeing Co/The, 5,805%, fällig 01.05.2050	4,782	0,67							Sonstige Vermögenswerte			2,55	
2.310	Boeing Co/The, 5,930%, fällig 01.05.2060	3,217	0,45							Gesamtvermögen			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 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf			Währungsverkauf			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
		(in Tsd.)			(in Tsd.)			
08.09.2021	JP Morgan	Kauf	USD	14.409	Verkauf	TRY	126.200	\$ (705)
08.09.2021	JP Morgan	Kauf	TRY	132.500	Verkauf	USD	14.792	1.076
08.09.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	714	Verkauf	TRY	6.300	(40)
14.09.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	80.902	Verkauf	CHF	72.360	1.856
14.09.2021	HSBC	Kauf	USD	36.512	Verkauf	CHF	33.050	407
14.09.2021	Morgan Stanley	Kauf	USD	19.739	Verkauf	CHF	18.040	32
14.09.2021	Morgan Stanley	Kauf	CHF	38.770	Verkauf	USD	42.122	231
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	23	Verkauf	GBP	17	—
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	—	Verkauf	SEK	2	—
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	10.989	Verkauf	USD	15.227	(120)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	—	Verkauf	USD	—	—
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	479.182	Verkauf	USD	352.219	(1.639)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SEK	2	Verkauf	USD	—	—
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	97.889	Verkauf	USD	115.131	487
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SGD	178.656	Verkauf	USD	131.743	1.138
01.10.2021	HSBC	Kauf	USD	1.636	Verkauf	CLP	1.240.000	36
01.10.2021	HSBC	Kauf	CLP	44.180.000	Verkauf	USD	60.471	(3.451)
07.10.2021	HSBC	Kauf	THB	63.500	Verkauf	USD	1.948	22
13.10.2021	Citi	Kauf	PLN	143.350	Verkauf	USD	37.332	97
20.10.2021	HSBC	Kauf	USD	37.013	Verkauf	BRL	196.340	(683)
20.10.2021	HSBC	Kauf	BRL	12.800	Verkauf	USD	2.443	14
26.10.2021	Citi	Kauf	USD	55.811	Verkauf	EUR	47.210	5
26.10.2021	HSBC	Kauf	EUR	1.000	Verkauf	USD	1.182	—
27.10.2021	Citi	Kauf	PLN	219.450	Verkauf	USD	56.545	755
28.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	49.743	Verkauf	IDR	731.100.000	(1.399)
28.10.2021	JP Morgan	Kauf	IDR	81.160.000	Verkauf	USD	5.600	78
29.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	26.224	Verkauf	COP	102.030.000	(761)
01.11.2021	Citi	Kauf	USD	60.675	Verkauf	KRW	69.790.000	493
02.11.2021	Citi	Kauf	NOK	307.000	Verkauf	USD	34.691	614
02.11.2021	HSBC	Kauf	USD	28.097	Verkauf	NOK	250.300	(688)
02.11.2021	HSBC	Kauf	NOK	250.300	Verkauf	USD	28.670	114
05.11.2021	HSBC	Kauf	PEN	139.000	Verkauf	USD	34.193	(241)
08.11.2021	HSBC	Kauf	THB	84.700	Verkauf	USD	2.560	67
15.11.2021	Citi	Kauf	USD	28.108	Verkauf	RUB	2.117.000	(479)
15.11.2021	Citi	Kauf	RUB	2.117.000	Verkauf	USD	28.020	567
16.11.2021	HSBC	Kauf	CAD	44.410	Verkauf	USD	35.194	2
17.11.2021	HSBC	Kauf	ZAR	330.800	Verkauf	USD	21.660	880
17.11.2021	HSBC	Kauf	USD	36.096	Verkauf	ZAR	536.400	(452)
18.11.2021	HSBC	Kauf	USD	20.297	Verkauf	CNH	132.450	(95)
22.11.2021	Citi	Kauf	USD	45.854	Verkauf	MXN	932.700	(67)
23.11.2021	Citi	Kauf	USD	34.897	Verkauf	GBP	25.430	(70)
30.11.2021	Morgan Stanley	Kauf	AUD	48.410	Verkauf	USD	35.369	61
06.12.2021	HSBC	Kauf	SEK	303.900	Verkauf	USD	35.042	200
09.12.2021	HSBC	Kauf	THB	79.700	Verkauf	USD	2.378	93
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 19.726 USD)								\$ 9.325
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (4.911) USD)								(10.890)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 14.815 USD)								\$ (1.565)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Termingeschäftskontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 545 USD)				\$ —
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): - USD)				(804)
Nettowertminderung von Termingeschäftskontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 545 USD)				\$ (804)

[^] 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 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 93,21 % (28. Februar 2021: 93,43 %)			Vereinigte Staaten: 57,05 % (28. Februar 2021 — 51,51 %)			15 International Game Technology Plc, 144A, 4,125 %, fällig 15.04.2026		
Brasilien – 4,96 % (28. Februar 2021: 11,68 %)			200 Alcoa Nederland Holding BV, 4,125 %, fällig 31.03.2029			16		
200 Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, fällig 28.01.2028			120 Antero Resources Corp, 5,000 %, fällig 01.03.2025			123		
200 Gol Finance SA, 144A, 8,000 %, fällig 30.06.2026			38 Antero Resources Corp, 144A, 8,375 %, fällig 15.07.2026			43		
200 XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026			45 Arconic Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2028			48		
605			200 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027			207		
209			25 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.10.2030			29		
1,72			212 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.04.2025			217		
1,64			95 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029			94		
1,60			45 Bausch Health Cos Inc, 7,250 %, fällig 30.05.2029			46		
4,96			95 Big River Steel LLC / BRS Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 31.01.2029			103		
Kanada – 2,47 % (28. Februar 2021: 3,98 %)			35 Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig 01.07.2030			37		
75 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.01.2026			50 Carrols Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029			48		
35 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 5,125 %, fällig 15.01.2026			50 Carvana Co, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2027			52		
180 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026			110 Central Garden & Pet Co, 4,125 %, fällig 15.10.2030			113		
301			145 Central Garden & Pet Co, 4,125 %, fällig 30.04.2031			147		
0,65			120 CITGO Petroleum Corp, 144A, 6,375 %, fällig 15.06.2026			122		
0,30			130 Clearway Energy Operating LLC, 5,000 %, fällig 15.09.2026			134		
1,52			165 Cleveland-Cliffs Inc, 5,875 %, fällig 01.06.2027			173		
2,47			115 CNX Resources Corp, 144A, 6,000 %, fällig 15.01.2029			120		
Chile – 3,34 % (28. Februar 2021: 1,73 %)			45 CommScope Inc, 6,000 %, fällig 01.03.2026			47		
200 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27.04.2026			35 CommScope Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.07.2028			37		
204			80 Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2028			82		
1,68			35 Consolidated Communications Inc, 6,500 %, fällig 01.10.2028			38		
203			50 Deluxe Corp, 144A, 8,000 %, fällig 01.06.2029			54		
1,66			255 DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026			267		
3,34			35 Edgewell Personal Care Co, 5,500 %, fällig 01.06.2028			37		
China – 1,72 % (28. Februar 2021: 1,78 %)			25 Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig 15.07.2029			25		
205 Sunac China Holdings Ltd, 8,350 %, fällig 19.04.2023			100 Embarg Corp, 7,995 %, fällig 01.06.2036			105		
210			200 Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc, 5,875 %, fällig 15.10.2024			196		
1,72			30 Entegris Inc, 3,625 %, fällig 01.05.2029			31		
Kolumbien – 3,28 % (28. Februar 2021: 1,70 %)			95 Gap Inc/The, 144A, 8,875 %, fällig 15.05.2027			109		
200 Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 17.01.2027			60 Genworth Holdings Inc, 4,900 %, fällig 15.08.2023			60		
200			110 GPS Hospitality Holding Co LLC / GPS Finco Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.08.2028			109		
1,64			150 Haemonetics Corp, 144A, zero coupon, fällig 01.03.2026			129		
1,64			100 Harsco Corp, 144A, 5,750 %, fällig 31.07.2027			104		
3,28			175 Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 6,250 %, fällig 15.05.2026			185		
Frankreich – 0,94 % (28. Februar 2021: 0,98 %)			EUR Altice France SA/France, 100 3,375 %, fällig 15.01.2028			115		
115			95 Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 6,250 %, fällig 15.05.2026			95		
0,94			75 Scientific Games International Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.10.2025			77		
Israel – 2,51 % (28. Februar 2021: 1,28 %)			145 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 30.03.2031			149		
149			60 Select Medical Corp, 144A, 6,250 %, fällig 15.08.2026			64		
1,22			35 Sensata Technologies Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.02.2030			38		
1,29			90 Simmons Foods Inc/ Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/ Simmons Feed, 144A, 4,625 %, fällig 01.03.2029			92		
2,51			115 Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026			118		
Luxemburg – 1,63 % (28. Februar 2021: 1,63 %)			200 Altice France Holding SA, 6,000 %, fällig 15.02.2028			199		
199			55 Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2030			54		
1,63			25 Switch Ltd, 144A, 4,125 %, fällig 15.06.2029			26		
Mexiko – 5,18 % (28. Februar 2021: 8,52 %)			200 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig 15.11.2029			212		
212			25 Synaptics Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.06.2029			26		
1,74			115 Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15.01.2026			119		
2,25			35 TEGNA Inc, 4,625 %, fällig 15.03.2028			36		
1,19			75 Tenet Healthcare Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.06.2029			77		
5,18			664			5,44		
Panama – 1,70 % (28. Februar 2021: 1,76 %)			200 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030			208		
208			200 Natwest Group Plc, 4,600 %, Perpetual *			204		
1,70			200 Vmed O2UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031			206		
Großbritannien – 5,44 % (28. Februar 2021: 2,11 %)			245 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 6,750 %, fällig 01.10.2026			254		
254			664			5,44		

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 1,74 % (28. Februar 2021: 3,35 %)			Devisenterminkontrakte: (0,55 %) (28. Februar 2021: 0,25 %)		
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			Ukraine: 1,74 % (28. Februar 2021: 1,69 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (67) (0,55)		
115 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	123	1,00	200 Ukraine Government International Bond, 7,253 %, fällig 15.03.2033	212	1,74	Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten (111) (0,91)		
100 Travel + Leisure Co, 144A, 6,625 %, fällig 31.07.2026	114	0,93	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 200 USD) 212 1,74			Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 12.203 100,01		
100 Travel + Leisure Co, 6,000 %, fällig 01.04.2027	111	0,91	Organismen für gemeinsame Anlagen: 4,15 % (28. Februar 2021: 1,79 %)			Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten (2) (0,01)		
75 Ironox Inc, 6,500 %, fällig 01.05.2025	79	0,65	506 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	506	4,15	Gesamtnettvermögen \$ 12.201 100,00		
20 Tronox Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.05.2025	21	0,17	Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 506 USD) 506 4,15			- 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 %.		
20 Tronox Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.03.2029	20	0,17	Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 11.637 USD) 12.092 99,10			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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 5.793.000 USD und machten 47,47 % des Nettovermögens aus.		
45 Uber Technologies Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2028	48	0,40	Credit Default Swaps: 1,81 % (28. Februar 2021: 2,19 %)			* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.		
105 Vector Group Ltd, 5,750 %, fällig 01.02.2029	107	0,88	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 221 1,81			ABKÜRZUNGEN:		
115 Vishay Intertechnology Inc, 2,250 %, fällig 15.06.2025	121	1,00	Devisenterminkontrakte: 0,01 % (28. Februar 2021: 0,43 %)			Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.		
60 Vista Outdoor Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2029	61	0,50	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 1 0,01			EUR – Euro		
75 XHR LP, 144A, 4,875 %, fällig 01.06.2029	77	0,63	Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 12.314 100,92			Analyse des Gesamtvermögens		
	6.962	57,05	Credit Default Swaps: (0,36 %) (28. Februar 2021: 0,07 %)			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 92,70		
Uruguay: 0,99 % (28. Februar 2021: 1,01 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (44) (0,36)			Organismen für gemeinsame Anlagen 4,05		
110 Navios South American Logistics Inc / Navios Logistics Finance US Inc, 144A, 10,750 %, fällig 01.07.2025	120	0,99				Finanzderivate 1,78		
Sambia: 2,00 % (28. Februar 2021: 2,03 %)						Sonstige Vermögenswerte 1,47		
225 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	244	2,00				Gesamtvermögen 100,00		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 10.931 USD)								
	11.374	93,21						

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit	Kaufs-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	T-Mobile USA Inc, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	335	\$ 12
Morgan Stanley	CenturyLink Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2023	105	(1)
Morgan Stanley	CenturyLink Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2025	115	(5)
Citi	iTraxx Europe, 5,000 %	Verkauf	20.12.2025	1.140	168
Goldman Sachs	Talen Energy Supply LLC, 1,000 %	Verkauf	20.06.2022	110	(38)
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	345	13
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 %	Verkauf	20.12.2025	175	17
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000 %	Verkauf	20.12.2025	180	8
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2022	280	2
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2022	185	1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (31. August 2021 (in Tsd.): 264 USD)					\$ 221
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (31. August 2021 (in Tsd.): (8) USD)					(44)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (31. August 2021 (in Tsd.): 256 USD)					\$ 177

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	CHF	–	\$	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CAD	6	Verkauf	CHF	4		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	15	Verkauf	EUR	17		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CAD	2.691	Verkauf	EUR	1.812		(7)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CAD	295	Verkauf	GBP	170		1
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SEK	–		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CAD	1	Verkauf	SEK	10		–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	63	Verkauf	USD	88		(1)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CAD	11.753	Verkauf	USD	9.373		(58)
26.10.2021	Citi	Kauf	EUR	490	Verkauf	USD	580		–
23.11.2021	Citi	Kauf	GBP	170	Verkauf	USD	235		(1)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 52 USD)								\$	1
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (30) USD)									(67)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 22 USD)								\$	(66)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts				
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,12 %)			6.160	Goldman Sachs Group Inc/ The, 0,881 %, fällig 23.02.2023 *	6,211	2,25	Mexiko – 9,13 % (28. Februar 2021: 9,24 %)					
425	Towd Point Mortgage Trust 2017-6, Series 2017 6, Class AZ, 144A, 3,000 %, fällig 25.10.2057 *	446	0,16	890	Hess Corp, 5,800 %, fällig 01.04.2047	1,160	0,42	MXN 123.900	MexicanBonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	6,758	2,46	
				540	Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, fällig 15.03.2040	645	0,23	MXN 131.500	MexicanBonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	7,174	2,61	
				555	Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig 15.03.2046	703	0,25	MXN 165.500	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	8,408	3,05	
				1.550	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.04.2046	1.586	0,58	MXN 53.800	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	2,794	1,01	
				1.680	Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig 15.03.2048	1.648	0,60			25,134	9,13	
				795	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.08.2049	802	0,29	Norwegen – 5,21 % (28. Februar 2021: 0,00 %)				
						35,604	12,93	NOK 121.760	Norway Government Bond, Series 475, 144A, 2,000 %, fällig 24.05.2023	14,337	5,21	
				Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 51.225 USD)			54,121	19,66	Polen – 9,55 % (28. Februar 2021: 1,00 %)			
				Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 74,82 % (28. Februar 2021: 70,77 %)					PLN 93.450	Republic of Poland Government Bond, Series 1023, 4,000 %, fällig 25.10.2023	26,280	9,55
				Australien – 4,56 % (28. Februar 2021: 2,22 %)					Russland – 0,52 % (28. Februar 2021: 0,49 %)			
				AUD 7.350	Australia Government Bond, Series 128, 5,750 %, fällig 15.07.2022	5,645	2,05	RUB 100.000	Russian Federal Bond - OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10.04.2030	1,437	0,52	
				AUD 1.840	New South Wales Treasury Corp, 4,000 %, fällig 20.04.2023	1,432	0,52	Südafrika – 5,13 % (28. Februar 2021: 4,75 %)				
				AUD 3.235	Queensland Treasury Corp, Series 23, 144A, 4,250 %, fällig 21.07.2023	2,548	0,93	ZAR 121.000	Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	5,674	2,06	
				AUD 3.550	Western Australian Treasury Corp, Series 23, 6,000 %, fällig 16.10.2023	2,917	1,06	ZAR 143.140	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	8,461	3,07	
						12,542	4,56			14,135	5,13	
				Brasilien – 2,94 % (28. Februar 2021: 3,19 %)					Südkorea – 7,64 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			
				BRL 32.620	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	6,317	2,29	KRW 17.400.000	Korea Treasury Bond, Series 3106, 2,000 %, fällig 10.06.2031	15,113	5,49	
				BRL 9.240	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2029	1,775	0,65	KRW 7.000.000	Korea Treasury Bond, Series 5103, 1,875 %, fällig 10.03.2051	5,915	2,15	
						8,092	2,94			21,028	7,64	
				China – 2,96 % (28. Februar 2021: 0,00 %)					Vereinigte Staaten – 16,61 % (28. Februar 2021: 23,73 %)			
				CNY 49.540	China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050	8,136	2,96	37.130	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,064 %, fällig 31.01.2023 *	37,154	13,50	
				Kolumbien – 3,66 % (28. Februar 2021: 4,48 %)					4.225	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,079 %, fällig 30.04.2023 *	4,226	1,53
				COP 14.900.000	Colombian TES, Series B, 6,250 %, fällig 26.11.2025	4,043	1,47	4.350	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,084 %, fällig 31.07.2023 *	4,351	1,58	
				COP 23.500.000	Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	6,037	2,19			45,731	16,61	
						10,080	3,66	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 212.854 USD)				
				Indonesien – 2,60 % (28. Februar 2021: 3,52 %)					205,949	74,82		
				IDR 70.500.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029	5,840	2,12	Kollektive Kapitalanlagen – 2,50 % (28. Februar 2021: 5,53 %)				
				IDR 15.900.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR67, 8,750 %, fällig 15.02.2044	1,316	0,48	6.890	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	6,890	2,50	
						7,156	2,60	Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 6.890 USD)				
				Malaysia – 4,31 % (28. Februar 2021: 3,66 %)					Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 273.876 USD)			
				MYR 19.195	Malaysia Government Bond, Series 0117, 3,882 %, fällig 10.03.2022	4,668	1,70	269,942	98,06			
				MYR 13.430	Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480 %, fällig 15.03.2023	3,309	1,20	Devisenterminkontrakte – 0,41 % (28. Februar 2021: 0,49 %)				
				MYR 5.595	Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	1,416	0,51	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				
				MYR 9.735	Malaysia Government Bond, Series 0417, 3,899 %, fällig 16.11.2027	2,468	0,90	1,125	0,41			
						11,861	4,31	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				
								271,067	98,47			

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Terminkontrakte in Fremdwahrung — (1,16 %) (28. Februar 2021: (0,68 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(3.181)	(1,16)
Futures – (0,03 %) (28. Februar 2021: (0,12 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(73)	(0,03)
Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(3.254)	(1,19)
Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	267.813	97,28
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	7.467	2,72
Gesamtnettvermögen	\$275.280	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 23.625.000 USD und machten 8,58 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

ABKÜRZUNGEN:

AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
CNY	– Chinesischer Renminbi
COP	– Kolumbianischer Peso
EUR	– Euro
IDR	– Indonesische Rupiah
KRW	– Südkoreanischer Won
MXN	– Mexikanischer Peso
MYR	– Malaysischer Ringgit
NOK	– Norwegische Krone
PLN	– Polnischer Zloty
RUB	– Russischer Rubel
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens

	% von Gesamt Vermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,19
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,47
Finanzderivate	0,40
Sonstige Vermögenswerte	2,94
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Wahrungskauf (in Tsd.)	Wahrungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
03.09.2021	HSBC	Kauf	USD 9.763	Verkauf	CLP 7.640.000	\$ (110)
03.09.2021	HSBC	Kauf	CLP 7.640.000	Verkauf	USD 10.921	(1.050)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 45	Verkauf	AUD 86	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD 446	Verkauf	AUD 426	3
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 48	Verkauf	CAD 84	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD 471	Verkauf	CAD 417	2
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 13	Verkauf	DKK 107	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD 121	Verkauf	DKK 535	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 974	Verkauf	EUR 1.142	(10)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD 9.522	Verkauf	EUR 5.667	16
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD 1.498	Verkauf	GBP 760	12
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD –	Verkauf	ILS –	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD 109	Verkauf	ILS 248	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 11	Verkauf	ILS 50	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 481	Verkauf	JPY 73.279	(5)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD 4.703	Verkauf	JPY 363.550	9
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD 171	Verkauf	MXN 2.418	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 18	Verkauf	MXN 488	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD 56	Verkauf	NOK 349	(1)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 6	Verkauf	NOK 71	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	PLN 19	Verkauf	NZD 7	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SEK 22	Verkauf	NZD 4	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SGD 5	Verkauf	NZD 5	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 40	Verkauf	NZD 79	(1)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	DKK 28	Verkauf	NZD 6	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CAD 22	Verkauf	NZD 25	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD 381	Verkauf	NZD 557	(11)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NOK 18	Verkauf	NZD 3	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	JPY 18.672	Verkauf	NZD 249	(6)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	MXN 126	Verkauf	NZD 9	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	ILS 13	Verkauf	NZD 6	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD 23	Verkauf	NZD 24	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR 294	Verkauf	NZD 503	(8)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 14	Verkauf	PLN 75	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD –	Verkauf	PLN –	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD 137	Verkauf	PLN 372	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 7	Verkauf	SEK 86	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD 71	Verkauf	SEK 426	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD 104	Verkauf	SGD 98	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD –	Verkauf	SGD –	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 10	Verkauf	SGD 20	–
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 1.078	Verkauf	USD 1.498	(15)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	NZD 10.541	Verkauf	USD 7.424	3
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD –	Verkauf	GBP –	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD –	Verkauf	GBP –	–

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	105	Verkauf	USD	146	\$ (1)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	USD	1	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–	–
07.10.2021	HSBC	Kauf	THB	15.500	Verkauf	USD	476	5
08.10.2021	HSBC	Kauf	CLP	9.290.000	Verkauf	USD	12.836	(850)
13.10.2021	Citi	Kauf	USD	2.604	Verkauf	PLN	10.000	(7)
13.10.2021	Goldman Sachs	Kauf	PLN	10.000	Verkauf	USD	2.606	5
20.10.2021	HSBC	Kauf	USD	578	Verkauf	BRL	3.040	(5)
20.10.2021	HSBC	Kauf	BRL	24.850	Verkauf	USD	4.684	87
26.10.2021	Barclays	Kauf	EUR	21.370	Verkauf	USD	25.260	–
26.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	979	Verkauf	EUR	830	(2)
26.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	1.426	Verkauf	EUR	1.200	7
28.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	10.349	Verkauf	IDR	152.100.000	(291)
28.10.2021	JP Morgan	Kauf	IDR	46.940.000	Verkauf	USD	3.238	46
29.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	10.627	Verkauf	COP	41.400.000	(323)
29.10.2021	JP Morgan	Kauf	COP	4.600.000	Verkauf	USD	1.182	34
01.11.2021	Citi	Kauf	USD	22.285	Verkauf	KRW	25.740.000	89
01.11.2021	Citi	Kauf	KRW	9.810.000	Verkauf	USD	8.410	49
01.11.2021	Citi	Kauf	KRW	600.000	Verkauf	USD	523	(6)
08.11.2021	HSBC	Kauf	THB	43.200	Verkauf	USD	1.306	34
10.11.2021	HSBC	Kauf	CLP	4.740.000	Verkauf	USD	6.178	(71)
10.11.2021	HSBC	Kauf	HUF	1.550.000	Verkauf	USD	5.052	181
10.11.2021	UBS	Kauf	USD	502	Verkauf	HUF	150.000	(5)
15.11.2021	Citi	Kauf	RUB	425.000	Verkauf	USD	5.625	114
17.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	ZAR	10.600	Verkauf	USD	707	15
17.11.2021	HSBC	Kauf	ZAR	69.600	Verkauf	USD	4.608	135
17.11.2021	HSBC	Kauf	USD	13.741	Verkauf	ZAR	204.200	(172)
18.11.2021	HSBC	Kauf	USD	8.566	Verkauf	CNH	55.900	(40)
18.11.2021	HSBC	Kauf	CNH	7.200	Verkauf	USD	1.102	6
19.11.2021	HSBC	Kauf	HUF	1.610.000	Verkauf	USD	5.364	70
22.11.2021	Citi	Kauf	USD	1.701	Verkauf	MXN	34.600	(3)
22.11.2021	Citi	Kauf	MXN	5.500	Verkauf	USD	273	(2)
07.12.2021	Citi	Kauf	JPY	1.493.000	Verkauf	USD	13.634	(52)
07.12.2021	HSBC	Kauf	CLP	5.460.000	Verkauf	USD	6.943	81
08.12.2021	JP Morgan	Kauf	USD	12.082	Verkauf	AUD	16.690	(134)
09.12.2021	HSBC	Kauf	THB	31.600	Verkauf	USD	943	37
15.12.2021	Citi	Kauf	RUB	340.000	Verkauf	USD	4.486	85
12.05.2021	HSBC	Kauf	CLP	8.370.000	Verkauf	USD	11.930	(356)
12.05.2021	HSBC	Kauf	USD	27.976	Verkauf	ZAR	418.000	608
13.05.2021	Citi	Kauf	MXN	173.200	Verkauf	USD	8.435	(222)
14.05.2021	Goldman Sachs	Kauf	CAD	22.630	Verkauf	USD	17.618	166
20.05.2021	JP Morgan	Kauf	CZK	299.400	Verkauf	USD	14.083	(277)
21.05.2021	Citi	Kauf	RUB	981.000	Verkauf	USD	13.122	(109)
25.05.2021	Barclays	Kauf	USD	13.502	Verkauf	AUD	17.010	411
25.05.2021	JP Morgan	Kauf	AUD	21.870	Verkauf	USD	17.216	(385)
28.05.2021	HSBC	Kauf	CLP	3.760.000	Verkauf	USD	5.269	(70)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 2.835 USD)							\$	1.125
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (3.975) USD)								(3.181)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (1.140) USD)							\$	(2.056)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Morgan Stanley	(70)	\$(13.810)	\$ (73)
Nicht realisierter Wertzuwachs von Futures-Kontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (723) USD)				(73)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (723) USD)				\$ (73)

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts				
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 4,26 % (28. Februar 2021: 1,55 %)			6.000 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1B1, 3,834 %, fällig 25.10.2030 *			6.251	0,48	3.705 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Series 2014 LC14, Class D, 144A, 4,586 %, fällig 15.03.2047 *	3.797	0,29		
528 CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-I, Series 2004 I, Class A, 0,386 %, fällig 15.02.2034 *	526	0,04	1.778 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1M2, 2,234 %, fällig 25.10.2030 *	1.802	0,14	Summe hypothekarisch gesicherte Wertpapiere (Kosten 205.594 USD)			206.511	15,99		
359 Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006-HE1, Series 2006 HE1, Class M1, 0,669 %, fällig 25.12.2036 *	358	0,03	11.000 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1M3C, 2,234 %, fällig 25.10.2030 *	11.084	0,86	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 61,04 % (28. Februar 2021: 69,16 %)						
15.360 Towd Point Mortgage Trust 2016-2, Series 2016 2, Class B2, 144A, 3,429 %, fällig 25.08.2055 *	16.539	1,28	2.024 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05, Class 1M2, 2,434 %, fällig 25.01.2031 *	2.050	0,16	Australien – 0,60 % (28. Februar 2021: 0,00 %)						
1.046 Towd Point Mortgage Trust 2017-4, Series 2017 4, Class A1, 144A, 2,750 %, fällig 25.06.2057 *	1.072	0,08	8.779 Freddie Mac STACR 2019-HQA3, Series 2019 HQA3, Class B1, 144A, 3,084 %, fällig 25.09.2049 *	8.862	0,69	2.065 Glencore Funding LLC, 2,850 %, fällig 27.04.2031			2.115	0,16		
5.893 Towd Point Mortgage Trust 2017-6, Series 2017 6, Class B2, 144A, 3,268 %, fällig 25.10.2057 *	6.176	0,48	2.245 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Series 2020 DNA3, Class B1, 144A, 5,184 %, fällig 25.06.2050 *	2.351	0,18	5.430 NBN Co Ltd, 2,625 %, fällig 05.05.2031			5.603	0,44		
17.590 Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Class B1, 144A, 3,311 %, fällig 25.03.2058 *	18.808	1,46	34.093 Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-HQA2, Series 2020 HQA2, Class M2, 144A, 3,184 %, fällig 25.03.2050 *	34.590	2,68	7.718			0,60			
189 Towd Point Mortgage Trust 2018-3, Series 2018 3, Class A1, 144A, 3,750 %, fällig 25.05.2058 *	197	0,01	492 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA3, Series 2020 HQA3, Class M2, 144A, 3,684 %, fällig 25.07.2050 *	497	0,04	Brasilien – 1,51 % (28. Februar 2021: 2,84 %)						
6.755 Towd Point Mortgage Trust 2018-3, Series 2018 3, Class B1, 144A, 3,652 %, fällig 25.05.2058 *	7.203	0,56	2.760 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA4, Series 2020 HQA4, Class B1, 144A, 5,334 %, fällig 25.09.2050 *	2.911	0,23	1.880 Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, fällig 28.01.2028			1.967	0,15		
4.155 Tryon Park CLO Ltd, Series 2013 1A, Class DR, 144A, 6,076 %, fällig 15.04.2029 *	4.168	0,32	8.660 Freddie Mac Stacr Trust 2018-HQA2, Series 2018 HQA2, Class M2, 144A, 2,384 %, fällig 25.10.2048 *	8.746	0,68	1.205 BRF SA, 144A, 3,950 %, fällig 22.05.2023			1.245	0,10		
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Kosten 54.237 USD)						1.015 Cemig Geracao e Transmissao SA, 9,250 %, fällig 05.12.2024			1.165	0,09		
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 15,99 % (28. Februar 2021: 10,60 %)			6.315 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA2, Series 2019 DNA2, Class M2, 144A, 2,534 %, fällig 25.03.2049 *			6.404	0,50	1.335 Embraer Netherlands Finance BV, 144A, 6,950 %, fällig 17.01.2028			1.524	0,12
2.455 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R01, Series 2019 R01, Class 2B1, 144A, 4,434 %, fällig 25.07.2031 *	2.532	0,20	3.253 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Series 2019 DNA3, Class M2, 144A, 2,134 %, fällig 25.07.2049 *	3.288	0,26	4.775 Minerva Luxembourg SA, 144A, 4,375 %, fällig 18.03.2031			4.697	0,36		
3.916 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R02, Series 2019 R02, Class 1B1, 144A, 4,234 %, fällig 25.08.2031 *	4.040	0,31	5.935 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Series 2019 DNA4, Class B1, 144A, 2,784 %, fällig 25.10.2049 *	5.986	0,46	9.090 XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026			8.893	0,69		
5.000 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R03, Series 2019 R03, Class 1B1, 144A, 4,184 %, fällig 25.09.2031 *	5.141	0,40	2.171 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Series 2019 DNA4, Class M2, 144A, 2,034 %, fällig 25.10.2049 *	2.182	0,17	19.491			1,51			
766 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R04, Series 2019 R04, Class 2M2, 144A, 2,184 %, fällig 25.06.2039 *	769	0,06	3.285 Freddie Mac STACR Trust 2019-HQA2, Series 2019 HQA2, Class B1, 144A, 4,184 %, fällig 25.04.2049 *	3.400	0,26	Kanada – 1,87 % (28. Februar 2021: 3,14 %)						
6.115 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 4,184 %, fällig 25.07.2039 *	6.233	0,48	678 Freddie Mac STACR Trust 2019-HQA2, Series 2019 HQA2, Class M2, 144A, 2,134 %, fällig 25.04.2049 *	682	0,05	CAD 4.550 Air Canada, 4,750 %, fällig 06.10.2023			3.662	0,28		
9.520 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 3,484 %, fällig 25.10.2039 *	9.639	0,75	5.855 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2020 HQA5, Class B1, 144A, 4,050 %, fällig 25.11.2050 *	6.177	0,48	500 Air Canada, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2026			503	0,04		
8.000 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Class 1B1, 144A, 3,334 %, fällig 25.01.2040 *	8.008	0,62	18.515 Oaktown Re V Ltd, Series 2020A, Class M1B, 144A, 3,684 %, fällig 25.10.2030 *	18.866	1,46	7.788 Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust, 144A, 5,250 %, fällig 01.04.2029			8.479	0,66		
7.618 Eagle RE 2019-1 Ltd, Series 2019 1, Class M2, 144A, 3,384 %, fällig 25.04.2029 *	7.708	0,59	7.239 Radnor RE 2019-1 Ltd, Series 2019 1, Class M2, 144A, 3,284 %, fällig 25.02.2029 *	7.326	0,57	5.590 Antares Holdings LP, 144A, 2,750 %, fällig 15.01.2027			5.619	0,43		
7.602 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C02, Class 2M2C, 3,734 %, fällig 25.09.2029 *	7.936	0,61	10.016 STACR Trust 2018-DNA3, Series 2018 DNA3, Class M2B, 144A, 2,184 %, fällig 25.09.2048 *	10.178	0,79	1.110 Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,850 %, fällig 17.03.2023 *			1.121	0,09		
3.471 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C06, Class 2M2, 2,884 %, fällig 25.02.2030 *	3.546	0,27	3.430 STACR Trust 2018-HRP1, Series 2018 HRP1, Class B1, 144A, 3,834 %, fällig 25.04.2043 *	3.529	0,27	4.385 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026			4.516	0,35		
						200 Teck Resources Ltd, 3,900 %, fällig 15.07.2030			218	0,02		
						24.118			1,87			
						Chile – 0,73 % (28. Februar 2021: 0,80 %)						
						6.680 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27.04.2026			6.830	0,53		
						2.435 Kenbourne Invest SA, 6,875 %, fällig 26.11.2024			2.581	0,20		
						9.411			0,73			
						China – 0,80 % (28. Februar 2021: 2,15 %)						
						2.830 Alibaba Group Holding Ltd, 3,400 %, fällig 06.12.2027			3.084	0,24		
						1.060 JD.com Inc, 3,375 %, fällig 14.01.2030			1.132	0,09		
						390 NXP BV / NXP Funding LLC NXP USA Inc, 144A, 3,400 %, fällig 01.05.2030			428	0,03		
						340 Tencent Music Entertainment Group, 2,000 %, fällig 03.09.2030			327	0,02		
						1.585 Weibo Corp, 3,375 %, fällig 08.07.2030			1.625	0,13		
						3.505 Xiaomi Best Time International Ltd, 144A, 3,375 %, fällig 29.04.2030			3.687	0,29		
						10.283			0,80			

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			2.900 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	2.981	0,23	4.505 Boeing Co/The, 5,040 %, fällig 01.05.2027	5.197	0,40
Kolumbien – 0,50 % (28. Februar 2021: 0,00 %)				14.761	1,14	335 Broadcom Inc, 4,700 %, fällig 15.04.2025	375	0,03
4.420 Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 17.01.2027	4.422	0,34	Vereinigte Staaten – 47,42 % (28. Februar 2021: 50,60 %)			2.430 Broadcom Inc, 3,459 %, fällig 15.09.2026	2.640	0,20
2.060 SierraCol Energy Andina LLC, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2028	2.058	0,16	170 AES Corp/The, 144A, 3,300 %, fällig 15.08.2025	182	0,01	4.105 Broadcom Inc, 144A, 1,950 %, fällig 15.02.2028	4.106	0,32
	6.480	0,50	1.365 AES Corp/The, 2,450 %, fällig 15.01.2031	1.379	0,11	455 Broadcom Inc, 4,110 %, fällig 15.09.2028	510	0,04
Deutschland – 0,37 % (28. Februar 2021: 0,07 %)			5.100 Air Lease Corp, 0,800 %, fällig 18.08.2024	5.084	0,39	5.945 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 144A, 2,742 %, fällig 31.12.2039	5.954	0,46
4.485 Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A, 0,650 %, fällig 11.03.2024	4.512	0,35	7.302 Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, fällig 15.08.2027	8.145	0,63	7.540 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.03.2026	8.081	0,63
320 Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A, 2,700 %, fällig 26.09.2022	328	0,02	2.595 American Tower Corp, 1,600 %, fällig 15.04.2026	2.623	0,20	890 CIT Group Inc, 5,000 %, fällig 15.08.2022	926	0,07
	4.840	0,37	975 AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5,625 %, fällig 20.05.2024	1.068	0,08	475 CIT Group Inc, 3,929 %, fällig 15.09.2024 *	499	0,04
Israel – 1,71 % (28. Februar 2021: 0,62 %)			5.210 AmerisourceBergen Corp, 0,737 %, fällig 15.03.2023	5.219	0,40	10.340 Citrix Systems Inc, 1,250 %, fällig 01.03.2026	10.229	0,79
1.370 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 30.03.2024	1.397	0,11	915 Amgen Inc, 2,300 %, fällig 25.02.2031	935	0,07	535 CNH Industrial Capital LLC, 1,875 %, fällig 15.01.2026	547	0,04
4.035 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 30.03.2026	4.138	0,32	8.600 Antero Resources Corp, 5,000 %, fällig 01.03.2025	8.791	0,68	5.980 CNX Resources Corp, 144A, 6,000 %, fällig 15.01.2029	6.237	0,48
2.590 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig 31.01.2025	2.832	0,22	847 Antero Resources Corp, 144A, 8,375 %, fällig 15.07.2026	960	0,07	3.045 CNX Resources Corp, 6,000 %, fällig 15.01.2029	3.176	0,25
5.970 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	5.710	0,44	4.145 Antero Resources Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.02.2029	4.565	0,35	464 CommScope Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.03.2026	487	0,04
CHF 7.405 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands IV BV, 0,500 %, fällig 28.07.2022	7.993	0,62	5.515 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2026	5.741	0,44	11.635 CommScope Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.07.2028	12.217	0,95
	22.070	1,71	435 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	451	0,04	6.860 Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2028	7.054	0,55
Japan – 0,82 % (28. Februar 2021: 0,97 %)			515 Ares Capital Corp, 4,200 %, fällig 10.06.2024	554	0,04	160 Crown Castle International Corp, 3,700 %, fällig 15.06.2026	176	0,01
9.450 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345 %, fällig 17.09.2027	10.521	0,82	555 Ares Capital Corp, 4,250 %, fällig 01.03.2025	599	0,05	3.910 Crown Castle International Corp, 1,050 %, fällig 15.07.2026	3.855	0,30
Luxemburg – 1,03 % (28. Februar 2021: 0,82 %)			9.220 Ares Capital Corp, 3,250 %, fällig 15.07.2025	9.746	0,76	1.560 Dell International LLC / EMC Corp, 6,020 %, fällig 15.06.2026	1.864	0,14
2.535 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	2.606	0,20	3.065 Ares Capital Corp, 3,875 %, fällig 15.01.2026	3.299	0,26	4.825 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20.10.2025	5.177	0,40
10.770 Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, fällig 15.02.2028	10.691	0,83	4.663 Ares Capital Corp, 2,150 %, fällig 15.07.2026	4.699	0,36	1.020 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20.10.2028	1.138	0,09
	13.297	1,03	2.450 Ares Capital Corp, 2,875 %, fällig 15.06.2028	2.500	0,19	20.372 DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	21.301	1,65
Mexiko – 0,89 % (28. Februar 2021: 3,02 %)			3.890 AT&T Inc, 1,700 %, fällig 25.03.2026	3.943	0,31	680 DPL Inc, 4,125 %, fällig 01.07.2025	729	0,06
8.035 Petroleos Mexicanos, 5,350 %, fällig 12.02.2028	8.006	0,62	11.500 AT&T Inc, 2,750 %, fällig 01.06.2031	12.060	0,93	185 Embarq Corp, 7,995 %, fällig 01.06.2036	195	0,02
3.980 Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	3.518	0,27	11.760 Athene Global Funding, 144A, 0,914 %, fällig 19.08.2024	11.783	0,91	1.415 Entegris Inc, 3,625 %, fällig 01.05.2029	1.465	0,11
	11.524	0,89	105 AutoNation Inc, 4,750 %, fällig 01.06.2030	124	0,01	3.505 Equinix Inc, 2,500 %, fällig 15.05.2031	3.597	0,28
Panama – 0,28 % (28. Februar 2021: 0,82 %)			9.740 Bain Capital Specialty Finance Inc, 2,950 %, fällig 10.03.2026	10.027	0,78	2.530 FedEx Corp, 0,450 %, fällig 04.05.2029	3.015	0,23
3.495 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030	3.637	0,28	7.700 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,000 %, fällig 30.01.2028	7.357	0,57	2.305 Flex Ltd, 4,875 %, fällig 12.05.2030	2.685	0,21
Supranational – 0,67 % (28. Februar 2021: 1,90 %)			4.090 Bausch Health Cos Inc, 144A, 4,875 %, fällig 01.06.2028	4.208	0,33	460 FMC Corp, 3,450 %, fällig 01.10.2029	502	0,04
RUB 222.000 International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig 22.01.2026	2.889	0,22	2.710 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2029	2.534	0,20	1.310 Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21.04.2023	1.450	0,11
MXN 61.000 International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig 22.01.2026	2.841	0,22	1.450 Blackstone Secured Lending Fund, 3,650 %, fällig 14.07.2023	1.515	0,12	2.650 Ford Motor Credit Co LLC, 4,271 %, fällig 09.01.2027	2.839	0,22
BRL 17.100 International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, fällig 22.01.2026	2.915	0,23	3.080 Blackstone Secured Lending Fund, 3,625 %, fällig 15.01.2026	3.274	0,25	8.355 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig 16.02.2028	8.335	0,65
	8.645	0,67	9.170 Blackstone Secured Lending Fund, 144A, 2,125 %, fällig 15.02.2027	9.068	0,70	4.148 FS KKR Capital Corp, 4,625 %, fällig 15.07.2024	4.464	0,35
Schweiz – 0,15 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			4.315 Block Financial LLC, 3,875 %, fällig 15.08.2030	4.717	0,37	515 FS KKR Capital Corp, 4,125 %, fällig 01.02.2025	548	0,04
1.930 UBS AG/London, 144A, 0,700 %, fällig 09.08.2024	1.932	0,15	8.360 Blue Owl Finance LLC, 144A, 3,125 %, fällig 10.06.2031	8.408	0,65	1.770 FS KKR Capital Corp, 3,400 %, fällig 15.01.2026	1.848	0,14
Großbritannien – 1,14 % (28. Februar 2021: 0,46 %)			345 Boeing Co/The, 2,700 %, fällig 01.05.2022	350	0,03	2.010 Gap Inc/The, 144A, 8,625 %, fällig 15.05.2025	2.196	0,17
5.410 HSBC Holdings Plc, 4,292 %, fällig 12.09.2026 *	6.012	0,46	5.385 Boeing Co/The, 4,875 %, fällig 01.05.2025	6.022	0,47	2.465 General Electric Co, 3,625 %, fällig 01.05.2030	2.774	0,22
GBP 1.075 Nationwide Building Society, 5,750 %, Perpetual *	1.660	0,13				1.335 General Motors Co, 6,800 %, fällig 01.10.2027	1.683	0,13
400 Natwest Group Plc, 2,359 %, fällig 22.05.2024 *	411	0,03						
3.625 Natwest Group Plc, 4,600 %, Perpetual *	3.697	0,29						

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			10.600	MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2028	0,85	7.835	T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	0,65
Vereinigte Staaten – (Fortsetzung)			9.696	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	0,82	2.340	Universal Health Services Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.10.2030	0,19
515	General Motors Co, 6,250 %, fällig 02.10.2043	0,05	8.820	Mohegan Gaming & Entertainment, 144A, 8,000 %, fällig 01.02.2026	0,72	5.340	Univision Communications Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.02.2025	0,42
3.600	General Motors Financial Co Inc, 2,700 %, fällig 20.08.2027	0,29	1.705	Nissan Motor Acceptance Corp, 144A, 2,750 %, fällig 09.03.2028	0,14	4.080	Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.06.2027	0,34
2.160	Global Payments Inc, 1,200 %, fällig 01.03.2026	0,17	3.255	Nordstrom Inc, 2,300 %, fällig 08.04.2024	0,25	6.945	Verizon Communications Inc, 1,450 %, fällig 20.03.2026	0,55
2.010	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,375 %, fällig 01.11.2023	0,17	2.855	Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, fällig 15.02.2027	0,22	3.215	Vishay Intertechnology Inc, 2,250 %, fällig 15.06.2025	0,26
1.895	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 3,350 %, fällig 01.09.2024	0,16	1.050	Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, fällig 01.09.2030	0,10	1.070	Vista Outdoor Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2029	0,08
5.215	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,375 %, fällig 15.04.2026	0,46	1.750	Owens Corning, 3,875 %, fällig 01.06.2030	0,15	5.870	Vontier Corp, 144A, 1,800 %, fällig 01.04.2026	0,46
6.820	Goldman Sachs Group Inc The, 0,673 %, fällig 08.03.2024 *	0,53	1.085	Owl Rock Capital Corp, 4,000 %, fällig 30.03.2025	0,09	5.240	Vontier Corp, 144A, 2,400 %, fällig 01.04.2028	0,41
3.545	Goldman Sachs Group Inc The, 0,855 %, fällig 12.02.2026 *	0,27	975	Owl Rock Capital Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2026	0,08	5.920	Vontier Corp, 144A, 2,950 %, fällig 01.04.2031	0,46
9.320	Golub Capital BDC Inc, 2,500 %, fällig 24.08.2026	0,73	4.330	Owl Rock Capital Corp, 2,625 %, fällig 15.01.2027	0,34	2.695	Walgreens Boots Alliance Inc, 4,800 %, fällig 18.11.2044	0,26
6.560	Golub Capital BDC Inc, 2,050 %, fällig 15.02.2027	0,50	480	Owl Rock Technology Finance Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.12.2025	0,04	1.100	William Carter Co/The, 144A, 5,625 %, fällig 15.03.2027	0,09
10.000	Graham Holdings Co, 144A, 5,750 %, fällig 01.06.2026	0,81	9.345	Owl Rock Technology Finance Corp, 144A, 3,750 %, fällig 17.06.2026	0,77			47,42
12.940	Graphic Packaging International LLC, 144A, 1,512 %, fällig 15.04.2026	1,00	2.000	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2028	0,16	Sambia – 0,55 % (28. Februar 2021: 0,86 %)		
5.700	Haemonetics Corp, 144A, zero coupon, fällig 01.03.2026	0,38	250	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144A, 7,750 %, fällig 15.02.2029	0,02	6.565	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	0,55
2.695	Harsco Corp, 144A, 5,750 %, fällig 31.07.2027	0,22	6.135	Pfizer Inc, 1,750 %, fällig 18.08.2031	0,47	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 777.919 USD)		
4.090	HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	0,35	5.345	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC Reynolds Group Issuer Lu, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2027	0,41	788.129		61,04
2.000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 144A, 5,000 %, fällig 01.06.2029	0,16	5.820	Schweitzer-Mauduit International Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.10.2026	0,47	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 9,08 % (28. Februar 2021: 5,18 %)		
320	Hyundai Capital America, 144A, 2,850 %, fällig 01.11.2022	0,03	5.305	Scientific Games International Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.10.2025	0,42	Ägypten – 0,80 % (28. Februar 2021: 2,15 %)		
1.010	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 5,250 %, fällig 15.05.2027	0,08	890	Seagate HDD Cayman, 144A, 4,125 %, fällig 15.01.2031	0,07	EGP	162.400 Egypt Treasury Bills, zero coupon, fällig 14.09.2021	0,80
665	International Game Technology Plc, 144A, 4,125 %, fällig 15.04.2026	0,05	2.620	Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	0,21	Frankreich – 1,95 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
2.455	International Game Technology Plc, 144A, 5,250 %, fällig 15.01.2029	0,20	2.710	Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.02.2027	0,20	EUR	21.340 French Republic Government Bond OAT, 144A, 0,750 %, fällig 25.05.2052	1,95
5.180	Iron Mountain Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.03.2028	0,42	3.685	Sixth Street Specialty Lending Inc, 2,500 %, fällig 01.08.2026	0,29	Italien – 1,01 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
3.025	Jabil Inc, 1,700 %, fällig 15.04.2026	0,24	310	Smithfield Foods Inc, 144A, 3,000 %, fällig 15.10.2030	0,02	EUR	9.410 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CAC, 144A, 2,450 %, fällig 01.09.2050	1,01
2.255	Jabil Inc, 3,600 %, fällig 15.01.2030	0,19	7.155	Sprint Spectrum Co LLC Sprint Spectrum Co II LLC Sprint Spectrum Co III LLC, 144A, 4,738 %, fällig 20.03.2025	0,59	Mexiko – 4,12 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
6.820	Keurig Dr Pepper Inc, 0,750 %, fällig 15.03.2024	0,53	4.735	Sprint Spectrum Co LLC Sprint Spectrum Co II LLC Sprint Spectrum Co III LLC, 144A, 5,152 %, fällig 20.03.2028	0,42	MXN	1.024.400 Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	4,12
5.144	Level 3 Financing Inc, 144A, 3,750 %, fällig 15.07.2029	0,39	1.220	Stellantis NV, 5,250 %, fällig 15.04.2023	0,10	Spanien – 1,06 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
865	Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01.02.2030	0,08	8.710	Tenet Healthcare Corp, 144A, 6,250 %, fällig 01.02.2027	0,70	EUR	8.530 Spain Government Bond, Series 30Y, 144A, 2,700 %, fällig 31.10.2048	1,06
1.215	Macy's Retail Holdings LLC, 2,875 %, fällig 15.02.2023	0,10	4.745	Tenet Healthcare Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.06.2029	0,38	Großbritannien – 0,14 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
2.320	Main Street Capital Corp, 5,200 %, fällig 01.05.2024	0,20	1.130	T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	0,10	1.835	Bank of England Euro Note, 144A, 0,250 %, fällig 08.03.2024	0,14
3.000	Main Street Capital Corp, 3,000 %, fällig 14.07.2026	0,24	11.520	T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	0,91	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 120.001 USD)		
4.165	Mastercard Inc, 1,900 %, fällig 15.03.2031	0,33				117.161		9,08
3.900	McCormick & Co Inc/MD, 0,900 %, fällig 15.02.2026	0,30				Kollektive Kapitalanlagen – 8,14 % (28. Februar 2021: 7,73 %)		
6.185	Michaels Cos Inc/The, 5,250 %, fällig 01.05.2028	0,49				105.165	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	8,14
						Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 105.165 USD)		
						105.165		8,14
						Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.262.916 USD)		
						1.272.013		98,51
						Credit Default Swaps – 1,12 % (28. Februar 2021: 2,30 %)		
						Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
						14.518		1,12

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nettewert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts		% von Gesamt Vermögen
Devisenterminkontrakte – 0,20 % (28. Februar 2021: 0,44 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	2.651	0,20		
Futures – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,05 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	177	0,01		
Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	1.289.359	99,84		
Devisentermingeschäfte - (0,07 %) (28. Februar 2021: 0,39 %)				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(922)	(0,07)		
Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(922)	(0,07)		
Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.288.437	99,77		
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	2.834	0,23		
Gesamtnettovermögen	\$ 1.291.271	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 664.690.000 USD und machten 51,48 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

ABKÜRZUNGEN:

Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.

BRL – Brasilianischer Real

CAD – Kanadischer Dollar

CHF – Schweizer Franken

EGP – Ägyptisches Pfund

GBP – Britisches Pfund Sterling

MXN – Mexikanischer Peso

RUB – Russischer Rubel

Analyse des Gesamtvermögens

	% von Gesamt Vermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	87,67
Organismen für gemeinsame Anlagen	7,90
Finanzderivate	1,30
Sonstige Vermögenswerte	3,13
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzinheit	Kaufs-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitsstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	1.725	\$ 63
Citi	CDX.NA.IG, 1,000 %	Verkauf	20.06.2025	55.620	1.116
Citi	iTraxx Europe, 1,000 %	Verkauf	20.12.2024	3.160	83
Citi	iTraxx Europe, 5,000 %	Verkauf	20.12.2025	50.547	7.460
Citi	iTraxx Europe, 5,000 %	Verkauf	20.06.2026	20.080	2.896
Citi	iTraxx Europe, 1,000 %	Verkauf	20.06.2025	23.060	660
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 %	Verkauf	20.12.2025	3.390	334
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 %	Verkauf	20.12.2025	1.605	158
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 %	Verkauf	20.06.2026	15.700	1.432
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000 %	Verkauf	20.12.2025	1.605	72
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000 %	Verkauf	20.12.2025	3.495	157
JP Morgan	Liberty Media LLC, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	1.700	59
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2022	1.115	7
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.12.2022	1.925	17
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2022	715	4
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (31. August 2021 (in Tsd.): 10.441 USD)					\$ 14.518
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (31. August 2021 (in Tsd.): – USD)					–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (31. August 2021 (in Tsd.): 10.441 USD)					\$ 14.518

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD 6	Verkauf CNH 39 \$ –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD –	Verkauf EUR – –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD 5.458	Verkauf EUR 4.651 (33)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD –	Verkauf GBP – –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD 59	Verkauf GBP 42 –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD 217	Verkauf SEK 1.895 (3)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD 2	Verkauf SEK 16 –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD 107	Verkauf SGD 146 (1)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CHF 2.655	Verkauf USD 2.904 (2)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CHF 29	Verkauf USD 31 –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR 374.476	Verkauf USD 440.396 1.906
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SGD 53.512	Verkauf USD 39.455 347
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CNH 6.860	Verkauf USD 1.056 6
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD 2.928	Verkauf USD 2.152 (10)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 50	Verkauf USD 69 –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 37.061	Verkauf USD 51.359 (405)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SEK 86.257	Verkauf USD 9.941 56
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD 503	Verkauf USD 364 4
20.10.2021	HSBC	Kauf	USD 2.428	Verkauf BRL 12.880 (45)
26.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD 55.893	Verkauf EUR 47.370 (102)
01.11.2021	Citi	Kauf	USD 28.220	Verkauf KRW 32.500.000 194
01.11.2021	Citi	Kauf	KRW 32.500.000	Verkauf USD 27.909 117

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
16.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	3.207	Verkauf	CAD	4.020	\$ 21
22.11.2021	Citi	Kauf	USD	38.111	Verkauf	MXN	775.200	(56)
22.11.2021	Goldman Sachs	Kauf	USD	16.042	Verkauf	MXN	330.200	(216)
15.12.2021	Citi	Kauf	USD	2.586	Verkauf	RUB	196.000	(49)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 2.025 USD)								\$ 2.651
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (1.778) USD)								(922)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 247 USD)								\$ 1.729

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Citi	180	\$ 35.511	\$ 177
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 234 USD)				\$ 177
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (379) USD)				-
Nettowertsteigerung von Future-Kontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (145) USD)				\$ 177

Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 21,15 % (28. Februar 2021: 7,86 %)			570 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Class 1B1, 144A, 3,334 %, fällig 25.01.2040 *	571	0,98	Summe hypothekarisch gesicherte Wertpapiere (Kosten 30.050 USD)		
2.425 American Credit Acceptance Receivables Trust 2019-3, Series 2019 3, Class F, 144A, 5,420 %, fällig 12.05.2026	2.531	4,37	2.250 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Series 2020 SBT1, Class 1M2, 144A, 3,734 %, fällig 25.02.2040 *	2.330	4,02	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 17,40 % (28. Februar 2021: 19,39 %)		
710 American Credit Acceptance Receivables Trust 2020-3, Series 2020 3, Class F, 144A, 5,940 %, fällig 14.06.2027	749	1,29	1.415 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1B1, 3,834 %, fällig 25.10.2030 *	1.474	2,54	China – 0,81 % (28. Februar 2021: 0,90 %)		
700 American Credit Acceptance Receivables Trust 2020-4, Series 2020 4, Class F, 144A, 5,220 %, fällig 13.08.2027	727	1,25	2.000 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05, Class 1B1, 4,334 %, fällig 25.01.2031 *	2.097	3,62	Israel – 0,98 % (28. Februar 2021: 0,65 %)		
590 ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R Ltd, Series 2018 1RA, Class E, 144A, 5,629 %, fällig 13.04.2031 *	568	0,98	800 Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Series 2021 MN2, Class M2, 144A, 3,400 %, fällig 25.07.2041 *	796	1,37	505 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,750 %, fällig 01.03.2028		
365 Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd, Series 2013 1A, Class DR, 144A, 6,929 %, fällig 13.10.2030 *	364	0,63	360 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, Series 2020 DNA6, Class B2, 144A, 5,700 %, fällig 25.12.2050 *	392	0,68	Japan – 0,89 % (28. Februar 2021: 0,99 %)		
1.365 Atrium XIV LLC 14A, Class E, 144A, 5,776 %, fällig 23.08.2030 *	1.343	2,31	1.725 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA1, Series 2021 DNA1, Class B1, 144A, 2,700 %, fällig 25.01.2051 *	1.731	2,99	230 Nissan Motor Co Ltd, 4,345 %, fällig 17.09.2027		
1.150 Barings CLO Ltd 2018-II, Series 2018 2X, Class D, 5,676 %, fällig 15.04.2030 *	1.142	1,97	500 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Series 2021 DNA5, Class B1, 144A, 3,100 %, fällig 25.01.2034 *	510	0,88	235 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345 %, fällig 17.09.2027		
845 CONSUMER LOAN UNDERLYING BOND CLUB CERTIFICATE ISSUER TRUST I SERIES 2019-HP1, Series 2019 HP1, Class C, 144A, 4,700 %, fällig 15.12.2026	868	1,50	1.190 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2020 HQA5, Class B2, 144A, 7,450 %, fällig 25.11.2050 *	1.403	2,42	518		
1.125 Octagon Investment Partners 37 Ltd, Series 2018 2A, Class D, 144A, 5,525 %, fällig 25.07.2030 *	1.100	1,90	31.291 GS Mortgage Securities Trust 2017-G55, Series 2017 G55, Class XA, 0,992 %, fällig 10.03.2050 *	1.288	2,22	Mexiko – 0,97 % (28. Februar 2021: 1,94 %)		
750 Progress Residential 2021-SFR1, Series 2021 SFR1, Class H, 144A, 5,004 %, fällig 17.04.2038	776	1,34	950 Home RE 2021-2 Ltd, Series 2021 2, Class M2, 144A, 3,300 %, fällig 25.01.2034 *	955	1,65	555 Petroleos Mexicanos, 4,500 %, fällig 23.01.2026		
720 Regatta XI Funding Ltd, Series 2018 1A, Class E, 144A, 5,634 %, fällig 17.07.2031 *	707	1,22	EUR 600 IM Pastor 3 FTB 3, Class B, 0,000 %, fällig 22.03.2043 *	444	0,77	Panama – 0,36 % (28. Februar 2021: 0,41 %)		
360 TICP CLO XI Ltd, Series 2018 11A, Class E, 144A, 6,134 %, fällig 20.10.2031 *	354	0,61	EUR 500 IM Pastor 4 FTA 4, Class B, 0,000 %, fällig 22.03.2044 *	359	0,62	200 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030		
1.000 Westlake Automobile Receivables Trust 2018-3, Series 2018 3A, Class F, 144A, 6,020 %, fällig 18.02.2025	1.030	1,78	EUR 1.135 Landmark Mortgage Securities No 2 Plc 2, Class BC, 0,058 %, fällig 17.06.2039 *	1.259	2,17	Vereinigte Republik Tansania — 0,80 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Kosten 12.255 USD)	12.259	21,15	605 LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5, Series 2017 5, Class D, 144A, 4,870 %, fällig 10.03.2050 *	568	0,98	435 HTA Group Ltd/Mauritius, 7,000 %, fällig 18.12.2025		
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 53,18 % (28. Februar 2021: 60,22 %)			245 SFAVE Commercial Mortgage Securities Trust 2015-5AVE, Series 2015 5AVE, Class D, 144A, 4,534 %, fällig 05.01.2043 *	205	0,35	Vereinigte Staaten – 10,01 % (28. Februar 2021: 10,80 %)		
1.000 Bellemeade Re 2020-2 Ltd, Series 2020 2A, Class M2, 144A, 6,084 %, fällig 26.08.2030 *	1.062	1,83	1.665 STACR Trust 2018-HRP2, Series 2018 HRP2, Class B1, 144A, 4,284 %, fällig 25.02.2047 *	1.765	3,05	715 Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030		
2.180 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC15, Series 2013 GC15, Class C, 5,352 %, fällig 10.09.2046 *	2.279	3,93	645 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Series 2015 C28, Class D, 4,230 %, fällig 15.05.2048 *	632	1,09	315 CommScope Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.03.2027		
1.297 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC17, Series 2013 GC17, Class C, 5,260 %, fällig 10.11.2046 *	1.357	2,34	54.390 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC22, Series 2015 LC22, Class XA, 0,930 %, fällig 15.09.2058 *	1.424	2,46	805 CommScope Inc, 8,250 %, fällig 01.03.2027		
460 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Series 2014 GC23, Class D, 144A, 4,633 %, fällig 10.07.2047 *	465	0,80	855 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NX55, Series 2016 NX55, Class D, 5,151 %, fällig 15.01.2059 *	930	1,61	1.330 DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026		
1.680 Connecticut Avenue Securities Trust 2018-R07, Series 2018 R07, Class 1B1, 144A, 4,434 %, fällig 25.04.2031 *	1.745	3,01	985 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Series 2014 LC14, Class D, 144A, 4,586 %, fällig 15.03.2047 *	1.010	1,74	200 Flex Ltd, 4,875 %, fällig 12.05.2030		
570 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 4,184 %, fällig 25.07.2039 *	581	1,00				215 Marriott International Inc/ MD, Series FF, 4,625 %, fällig 15.06.2030		
1.180 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 3,484 %, fällig 25.10.2039 *	1.195	2,06				190 Scientific Games International Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.03.2026		
						830 Scientific Games International Inc, 8,250 %, fällig 15.03.2026		
						795 Sinclair Television Group Inc, 5,875 %, fällig 15.03.2026		
						5.801		
						10,01		
						Sambia – 2,58 % (28. Februar 2021: 2,46 %)		
						555 First Quantum Minerals Ltd, 7,250 %, fällig 01.04.2023		
						200 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 01.04.2023		
						670 First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 15.10.2027		
						1.497		
						2,58		
						Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 9.759 USD)		
						10.088		
						17,40		
						Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 2,76 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
						China – 2,76 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
						CNY 9.740 China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050		
						1.599		
						2,76		
						Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 1.583 USD)		
						1.599		
						2,76		
						Organismen für gemeinsame Anlagen – 6,29 % (28. Februar 2021: 4,88 %)		
						3.644 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class		
						3.644		
						6,29		
						Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 3.644 USD)		
						3.644		
						6,29		

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Stammaktien - 0,28 % (28. Februar 2021: 4,96 %)			Credit Default Swaps – (1,45 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)		
Vereinigte Staaten - 0,28 % (28. Februar 2021: 2,80 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus		
8 Danimer Scientific Inc	164	0,28	Kontrakten (siehe unten)	(843)	(1,45)
Summe Stammaktien (Kosten 534 USD)	164	0,28	Devisenterminkontrakte — (0,10 %) (28. Februar 2021: (0,67 %))		
Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 57.825 USD)			Nicht realisierte Wertminderung aus		
	58.581	101,06	Kontrakten (siehe unten)	(60)	(0,10)
Credit Default Swaps — 0,11 % (28. Februar 2021: 0,20 %)			Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus			(903)		
Kontrakten (siehe unten)			(1,55)		
	65	0,11	Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Devisenterminkontrakte – 0,10 % (28. Februar 2021: 0,48 %)			57.813		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus			99,73		
Kontrakten (siehe unten)			0,27		
	62	0,10	Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigende Vermögen		
Futures – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,08 %)			155		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus			0,27		
Kontrakten (siehe unten)			100,00		
	8	0,01	Gesamtnettvermögen		
Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			\$57.968		
	58.716	101,28	100,00		

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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 29.401.000 USD und machten 50,71 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

ABKÜRZUNGEN:

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.
CNY – Chinesischer Renminbi
EUR – Euro

Analyse des Gesamtvermögens	% von Gesamt Vermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	90,09
Organismen für gemeinsame Anlagen	5,98
Finanzderivate	0,22
Sonstige Vermögenswerte	3,71
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzinheit	Kauf-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	731	\$ 27
Barclays	T-Mobile USA Inc, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	725	27
Citi	CMBX.NA.BBB, 3,000 %	Verkauf	17.11.2059	3.105	(276)
Citi	CMBX.NA.BBB, 3,000 %	Verkauf	17.11.2059	3.185	(283)
Citi	CMBX.NA.BBB, 3,000 %	Verkauf	17.11.2059	3.205	(284)
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.12.2022	925	8
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2022	520	3
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (31. August 2021 (in Tsd.): 105 USD)					\$ 65
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (31. August 2021 (in Tsd.): – USD)					(843)
Nettoabschreibung von Credit Default Swaps (31. August 2021 (in Tsd.): 105 USD)					\$ (778)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 2.632	Verkauf BRL 13.775	\$ (33)
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf BRL 13.775	Verkauf USD 2.642	22
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 1	Verkauf EUR 1	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 1	Verkauf USD 1	–
01.10.2021	BNY Mellon	Kauf BRL 13.443	Verkauf USD 2.558	30
26.10.2021	Citi	Kauf USD 839	Verkauf EUR 710	–
26.10.2021	JP Morgan	Kauf USD 1.079	Verkauf EUR 920	(9)
01.11.2021	Citi	Kauf USD 1.143	Verkauf KRW 1.320.000	5
01.11.2021	Citi	Kauf KRW 1.320.000	Verkauf USD 1.134	5
18.11.2021	HSBC	Kauf USD 1.523	Verkauf CNH 9.940	(7)
07.12.2021	Citi	Kauf JPY 311.000	Verkauf USD 2.840	(11)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 250 USD)				\$ 62
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (346) USD)				(60)
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (96) USD)				\$ 2

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2021	Citi 8	\$ 1.578	\$ 8
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 41 USD)			\$ 8
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (79) USD)			-
Nettowertsteigerung von Future-Kontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (38) USD)			\$ 8

[^] 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 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 92,59 % (28. Februar 2021: 91,89 %)			Vereinigte Staaten – 53,31 % (28. Februar 2021: 51,44 %)			45 Marriott Ownership Resorts Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.06.2029		
Brasilien – 5,40 % (28. Februar 2021: 11,97 %)			200 Alcoa Nederland Holding BV, 4,125 %, fällig 31.03.2029			46		
200 Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, fällig 28.01.2028			100 AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5,625 %, fällig 20.05.2024			110 Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig 01.05.2028		
200 Gol Finance SA, 144A, 8,000 %, fällig 30.06.2026			35 Antero Resources Corp, 144A, 8,375 %, fällig 15.07.2026			113		
200 XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026			45 Arconic Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2028			115 MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2028		
			200 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 4,125 %, fällig 15.08.2026			30 ModivCare Escrow Issuer Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2029		
			25 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.10.2030			31		
			94 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.04.2025			40 Nexstar Media Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.11.2028		
			65 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029			72 NRG Energy Inc, 6,625 %, fällig 15.01.2027		
			45 Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,250 %, fällig 30.05.2029			125 Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, fällig 15.02.2027		
			35 Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig 01.07.2030			105 Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, fällig 01.09.2030		
			135 Central Garden & Pet Co, 4,125 %, fällig 30.04.2031			80 Owl Rock Capital Corp, 4,000 %, fällig 30.03.2025		
			120 CITGO Petroleum Corp, 144A, 6,375 %, fällig 15.06.2026			100 Par Pharmaceutical Inc, 7,500 %, fällig 01.04.2027		
			120 Clearway Energy Operating LLC, 5,000 %, fällig 15.09.2026			45 Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2028		
			17 Cleveland-Cliffs Inc, 9,875 %, fällig 17.10.2025			50 Scientific Games International Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.10.2025		
			115 CNX Resources Corp, 144A, 6,000 %, fällig 15.01.2029			45 Select Medical Corp, 144A, 6,250 %, fällig 15.08.2026		
			45 CommScope Inc, 6,000 %, fällig 01.03.2026			30 Sensata Technologies Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.02.2030		
			80 Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2028			90 Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 144A, 4,625 %, fällig 01.03.2029		
			35 Consolidated Communications Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.10.2028			275 Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026		
			40 Dell International LLC / EMC Corp, 7,125 %, fällig 15.06.2024			55 Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2030		
			95 Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.06.2024			115 Sirius XM Radio Inc, 5,375 %, fällig 15.07.2026		
			45 Deluxe Corp, 144A, 8,000 %, fällig 01.06.2029			25 Switch Ltd, 144A, 4,125 %, fällig 15.06.2029		
			35 Edgewell Personal Care Co, 5,500 %, fällig 01.06.2028			25 Synaptics Inc, 4,000 %, fällig 15.06.2029		
			25 Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig 15.07.2029			110 Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15.01.2026		
			90 Embarg Corp, 7,995 %, fällig 01.06.2036			70 Tenet Healthcare Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.06.2029		
			110 Encompass Health Corp, 4,500 %, fällig 01.02.2028			115 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031		
			50 Entegris Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2028			100 Travel + Leisure Co, 6,000 %, fällig 01.04.2027		
			25 Entegris Inc, 3,625 %, fällig 01.05.2029			90 Tronox Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.05.2025		
			95 Gap Inc/The, 144A, 8,875 %, fällig 15.05.2027			20 Tronox Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.03.2029		
			100 GPS Hospitality Holding Co LLC / GPS Finco Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.08.2028			90 Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.06.2027		
			100 Harsco Corp, 144A, 5,750 %, fällig 31.07.2027			100 Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 01.02.2029		
			170 Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 6,250 %, fällig 15.05.2026			95 Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2027		
			15 International Game Technology Plc, 144A, 4,125 %, fällig 15.04.2026			110 Vishay Intertechnology Inc, 2,250 %, fällig 15.06.2025		
			45 KB Home, 4,000 %, fällig 15.06.2031			60 Vista Outdoor Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2029		
			95 Level 3 Financing Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.09.2027			90 WR Grace & Co-Conn, 144A, 4,875 %, fällig 15.06.2027		
			100 Levi Strauss & Co, 144A, 3,500 %, fällig 01.03.2031			65 XHR LP, 144A, 4,875 %, fällig 01.06.2029		
			200 Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01.02.2030			67		
			66 Macy's Retail Holdings LLC, 2,875 %, fällig 15.02.2023			53,31		
						5,974		
						53,31		
Kanada – 2,09 % (28. Februar 2021: 4,59 %)								
105 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.01.2026			110			0,99		
120 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026			124			1,10		
			234			2,09		
Chile – 3,64 % (28. Februar 2021: 1,77 %)								
200 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27.04.2026			204			1,83		
200 Kenbourne Invest SA, 4,700 %, fällig 22.01.2028			203			1,81		
			407			3,64		
China – 1,87 % (28. Februar 2021: 1,82 %)								
205 Sunac China Holdings Ltd, 8,350 %, fällig 19.04.2023			210			1,87		
Kolumbien – 3,57 % (28. Februar 2021: 1,74 %)								
200 Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 17.01.2027			200			1,79		
200 SierraCol Energy Andina LLC, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2028			200			1,78		
			400			3,57		
Frankreich – 1,13 % (28. Februar 2021: 1,11 %)								
EUR Altice France SA/France, 110 3,375 %, fällig 15.01.2028			126			1,13		
Israel – 4,39 % (28. Februar 2021: 2,92 %)								
140 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 30.03.2031			144			1,29		
200 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig 31.01.2025			219			1,95		
135 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026			129			1,15		
			492			4,39		
Macau – 1,76 % (28. Februar 2021: 1,72 %)								
200 Studio City Finance Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2029			198			1,76		
Mexiko – 5,43 % (28. Februar 2021: 8,57 %)								
200 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig 15.11.2029			212			1,89		
265 Petroleos Mexicanos, 5,350 %, fällig 12.02.2028			264			2,36		
150 Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060			133			1,18		
			609			5,43		
Panama – 1,86 % (28. Februar 2021: 1,80 %)								
200 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030			208			1,86		
Großbritannien – 5,14 % (28. Februar 2021: 1,41 %)								
160 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 6,750 %, fällig 01.10.2026			166			1,48		
200 Natwest Group Plc, 4,600 %, Perpetual *			204			1,82		
200 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031			206			1,84		
			576			5,14		

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Credit Default Swaps – 1,74 % (28. Februar 2021: 1,90 %)		
Uruguay – 1,07 % (28. Februar 2021: 1,03 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
40 Navios South American Logistics Inc / Navios Logistics Finance US Inc, 144A, 10,750 %, fällig 01.07.2025	44	0,39		196	1,74
70 Navios South American Logistics Inc / Navios Logistics Finance US Inc, 10,750 %, fällig 01.07.2025	76	0,68		2	0,02
	120	1,07			
Sambia - 1,93 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Devisenterminkontrakte – 0,02 % (28. Februar 2021: 0,23 %)		
200 First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 15.10.2027	217	1,93	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
				(41)	(0,36)
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 10.011 USD)			Summe zum beizulegenden Zeitwert ergebniswirksam bewertete finanzielle Vermögenswerte		
	10.376	92,59		11.175	99,71
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 1,89 % (28. Februar 2021: 3,43 %)			Credit Default Swaps – (0,36 %) (28. Februar 2021: (0,07 %))		
Ukraine - 1,89 % (28. Februar 2021: 1,73 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
200 Ukraine Government International Bond, 7,253 %, fällig 15.03.2033	213	1,89		(25)	(0,22)
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 200 USD)			Devisenterminkontrakte – (0,22 %) (28. Februar 2021: (0,25 %))		
	213	1,89	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,47 % (28. Februar 2021: 3,65 %)			Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
388 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	388	3,47		(66)	(0,58)
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 388 USD)			Summe erfolgswirksam num Fair Value bewerteter finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	388	3,47		11.109	99,13
Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten USD 10.599)			Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
	10.977	97,95		98	0,87
			Gesamtvermögen		
			\$ 11.207 100,00		

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.

ABKÜRZUNGEN:

Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.

EUR – Euro

	% von Gesamt Vermögen
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,36
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,42
Finanzderivate	1,75
Sonstige Vermögenswerte	1,47
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzinheit	Kaufs-/ Verkaufssicherung	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	T-Mobile USA Inc, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	130	\$ 5
Morgan Stanley	CenturyLink Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2023	105	(1)
Morgan Stanley	CenturyLink Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2025	115	(5)
Citi	iTraxx Europe, 5,000 %	Verkauf	20.12.2025	1.115	164
Goldman Sachs	Talen Energy Supply LLC, 1,000 %	Verkauf	20.06.2022	100	(35)
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 %	Verkauf	20.06.2022	185	7
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 %	Verkauf	20.12.2025	170	17
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.06.2022	165	1
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 %	Verkauf	20.12.2022	205	2
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (31. August 2021 (in Tsd.): 223 USD)					\$ 196
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (31. August 2021 (in Tsd.): (8) USD)					(41)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (31. August 2021 (in Tsd.): 215 USD)					\$ 155

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR 39	Verkauf	CAD 57	\$ –
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR 229	Verkauf	GBP 196	2
13.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR 7.234	Verkauf	USD 8.567	(24)
26.10.2021	Citi	Kauf	EUR 430	Verkauf	USD 509	–
23.11.2021	Citi	Kauf	GBP 160	Verkauf	USD 221	(1)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 27 USD)						\$ 2
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (29) USD)						(25)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (2) USD)						\$ (23)

[^] 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 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 14,17 % (28. Februar 2021: 17,02 %)						Futures – (3,24 %) (28. Februar 2021: (0,30 %))		
Kanada – 3,64 % (28. Februar 2021: 3,43 %)						Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (3.854) (3,24)		
2.310 Bank of Nova Scotia/The, 0,597 %, fällig 15.09.2023 *	2.329	1,95	MYR 1.730 Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	437	0,37	Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten (9.871) (8,29)		
1.990 Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,850 %, fällig 17.03.2023 *	2.011	1,69	MYR 4.240 Malaysia Government Bond, Series 0417, 3,899 %, fällig 16.11.2027	1.079	0,90	Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 137.140 115,16		
	4.340	3,64		4.452	3,74	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten (18.061) (15,16)		
Mexiko – 1,79 % (28. Februar 2021: 1,73 %)			Mexiko – 17,84 % (28. Februar 2021: 17,67 %)			Gesamtnetovermögen \$119.079 100,00		
370 Petroleos Mexicanos, 6,750 %, fällig 21.09.2047	327	0,27	MXN 55.400 Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	3.019	2,54	- 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 %.		
1.890 Petroleos Mexicanos, 7,690 %, fällig 23.01.2050	1.805	1,52	MXN 55.300 Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	3.032	2,55	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 3.453.000 USD und machten 2,89 % des Nettovermögens aus.		
	2.132	1,79	MXN 239.200 Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	12.162	10,21	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2021.		
Vereinigte Staaten – 8,74 % (28. Februar 2021: 10,48 %)			Russland – 2,80 % (28. Februar 2021: 2,65 %)					
160 Apache Corp, 5,350 %, fällig 01.07.2049	179	0,15	RUB 232.000 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10.04.2030	3.337	2,80	ABKÜRZUNGEN:		
1.970 Athene Global Funding, 144A, 0,750 %, fällig 24.05.2024 *	1.983	1,66	Südafrika – 9,84 % (28. Februar 2021: 8,74 %)			BRL – Brasilianischer Real		
320 Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01.05.2040	417	0,35	ZAR 47.700 Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	2.235	1,88	CNY – Chinesischer Renminbi		
480 Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01.05.2050	652	0,55	ZAR 160.300 Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	9.478	7,96	COP – Kolumbianischer Peso		
410 Boeing Co/The, 5,930 %, fällig 01.05.2060	574	0,48		11.713	9,84	IDR – Indonesische Rupiah		
1.530 Caterpillar Financial Services Corp, 0,200 %, fällig 17.11.2022 *	1.532	1,29	Südkorea – 22,33 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			KRW – Südkoreanischer Won		
350 General Motors Co, 6,800 %, fällig 01.10.2027	442	0,37	KRW22.020.000 Korea Treasury Bond, Series 3106, 2,000 %, fällig 10.06.2031	19.126	16,06	MXN – Mexikanischer Peso		
450 General Motors Co, 6,250 %, fällig 02.10.2043	620	0,52	KRW8.840.000 Korea Treasury Bond, Series 5103, 1,875 %, fällig 10.03.2051	7.470	6,27	MYR – Malaysischer Ringgit		
270 Hess Corp, 5,800 %, fällig 01.04.2047	353	0,30		26.596	22,33	RUB – Russischer Rubel		
1.460 Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 0,620 %, fällig 13.01.2023 *	1.470	1,23	Türkei – 10,96 % (28. Februar 2021: 0,00%)			TRY – Türkische Lira		
160 Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, fällig 15.03.2040	192	0,16	TRY 137.900 Turkey Government Bond, 11,700 %, fällig 13.11.2030	13.045	10,96	ZAR – Südafrikanischer Rand		
250 Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig 15.03.2046	317	0,27	Vereinigte Staaten – 6,33 % (28. Februar 2021: 21,12 %)					
680 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.04.2046	698	0,59	7.535 United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,064 %, fällig 31.01.2023 *	7.540	6,33	Analyse des Gesamtvermögens		
640 Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig 15.03.2048	629	0,53	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 119,072 USD) 118.277 99,33			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 36,61		
340 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.08.2049	344	0,29	Organismen für gemeinsame Anlagen – 5,51 % (28. Februar 2021: 4,23 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen 1,78		
	10.402	8,74	Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 6.208 USD) 6.568 5,51			Finanzderivate 1,43		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 15.829 USD) 16.874 14,17						Sonstige Vermögenswerte 60,18		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 99,33 % (28. Februar 2021: 72,51 %)						Gesamtvermögen 100,00		
Brasilien – 6,10 % (28. Februar 2021: 5,93 %)								
BRL 37.880 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2029	7.263	6,10	Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 141.109 USD) 141.719 119,01					
China – 9,33 % (28. Februar 2021: 0,00 %)						Devisenterminkontrakte – 4,44 % (28. Februar 2021: 1,35 %)		
CNY 67.660 China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050	11.111	9,33	Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 147.011 123,45			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 5.292 4,44		
Kolumbien – 3,67 % (28. Februar 2021: 3,97 %)						Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte (6.017) (5,05)		
COP 16.900.000 Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	4.375	3,67						
Indonesien – 6,39 % (28. Februar 2021: 8,59 %)								
IDR 91.900.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029	7.607	6,39						
Malaysia – 3,74 % (28. Februar 2021: 3,84 %)								
MYR 8.560 Malaysia Government Bond, Series 0117, 3,882 %, fällig 10.03.2022	2.081	1,75						
MYR 3.470 Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480 %, fällig 15.03.2023	855	0,72						

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
03.09.2021	HSBC	Kauf	USD	344	Verkauf	CLP	260.000	\$ 7
03.09.2021	HSBC	Kauf	USD	6.818	Verkauf	CLP	5.340.000	(81)
03.09.2021	HSBC	Kauf	CLP	5.600.000	Verkauf	USD	8.005	(769)
08.09.2021	Barclays	Kauf	USD	25.186	Verkauf	TRY	220.900	(1.268)
08.09.2021	HSBC	Kauf	USD	2.020	Verkauf	TRY	18.000	(135)
08.09.2021	JP Morgan	Kauf	USD	11.947	Verkauf	TRY	104.300	(544)
08.09.2021	JP Morgan	Kauf	TRY	343.200	Verkauf	USD	38.314	2.786
13.09.2021	HSBC	Kauf	USD	4.581	Verkauf	KRW	5.200.000	96
13.09.2021	HSBC	Kauf	KRW	5.200.000	Verkauf	USD	4.667	(182)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SGD	118	Verkauf	USD	87	1
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	475.224	Verkauf	USD	349.310	(1.626)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	6	Verkauf	USD	8	–
10.07.2021	HSBC	Kauf	THB	35.800	Verkauf	USD	1.098	12
10.13.2021	Citi	Kauf	PLN	140.070	Verkauf	USD	36.478	95
10.13.2021	HSBC	Kauf	USD	1.482	Verkauf	PLN	5.750	(19)
10.15.2021	Barclays	Kauf	USD	1.573	Verkauf	MYR	6.650	(26)
10.15.2021	Barclays	Kauf	MYR	120.760	Verkauf	USD	28.715	314
20.10.2021	HSBC	Kauf	BRL	46.290	Verkauf	USD	8.725	162
26.10.2021	Citi	Kauf	USD	7.282	Verkauf	EUR	6.160	1
29.10.2021	JP Morgan	Kauf	USD	30.090	Verkauf	COP	117.235.000	(916)
29.10.2021	JP Morgan	Kauf	COP	71.335.000	Verkauf	USD	18.335	532
01.11.2021	Citi	Kauf	USD	25.896	Verkauf	KRW	29.910.000	103
01.11.2021	Citi	Kauf	KRW	10.740.000	Verkauf	USD	9.208	54
08.11.2021	HSBC	Kauf	THB	43.600	Verkauf	USD	1.318	35
15.11.2021	Citi	Kauf	RUB	2.963.000	Verkauf	USD	39.217	793
17.11.2021	HSBC	Kauf	USD	3.513	Verkauf	ZAR	52.200	(44)
18.11.2021	HSBC	Kauf	CNH	154.300	Verkauf	USD	23.646	111
22.11.2021	Citi	Kauf	USD	3.835	Verkauf	MXN	78.000	(6)
23.11.2021	Citi	Kauf	GBP	34.650	Verkauf	USD	47.927	(281)
23.11.2021	JP Morgan	Kauf	CZK	304.300	Verkauf	USD	14.047	64
07.12.2021	Citi	Kauf	JPY	3.432.000	Verkauf	USD	31.342	(120)
07.12.2021	HSBC	Kauf	CLP	5.340.000	Verkauf	USD	6.791	79
09.12.2021	HSBC	Kauf	THB	40.300	Verkauf	USD	1.202	47
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 5.291 USD)								\$ 5.292
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (1.896) USD)								(6.017)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (3.395) USD)								\$ (725)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2021	Morgan Stanley	(226)	\$(56.711)	\$ (3.367)
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2021	Morgan Stanley	(469)	(92.525)	(487)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 998 USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (1.176) USD)				(3.854)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (178) USD)				\$ (3.854)

[^] 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 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Organismen für gemeinsame Anlagen - 3,48 % (28. Februar 2021: 2,93 %)			Elektrik - 3,73 % (28. Februar 2021: 2,31 %)			– Merck & Co Inc 6 0,29		
67 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	67	3,07	– American Electric Power Co Inc	5	0,24	– Pfizer Inc	17	0,81
– iShares Russell 1000 Value ETF - ETF	9	0,41	– Dominion Energy Inc	31	1,42		124	5,69
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 76 USD)	76	3,48	– Duke Energy Corp	6	0,27	Pipelines — 0,78 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
Stammaktien - 97,02 % (28. Februar 2021: 98,33 %)			– Exelon Corp	7	0,31	1 Kinder Morgan Inc	12	0,55
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung — 1,02 % (28. Februar 2021: 1,06 %)			– NextEra Energy Inc	15	0,66	– Targa Resources Corp	5	0,23
1 Howmet Aerospace Inc	22	1,02	– Southern Co/The	18	0,83		17	0,78
Landwirtschaft - 0,84 % (28. Februar 2021: 0,83 %)				82	3,73	Einzelhandel — 2,86 % (28. Februar 2021: 1,80 %)		
– Darling Ingredients Inc	18	0,84	Elektrische Komponenten und Zubehör — 0,06 % (28. Februar 2021: 0,05 %)			– Advance Auto Parts Inc	20	0,93
Automobilhersteller - 3,66 % (28. Februar 2021: 5,01 %)			– Acuity Brands Inc	1	0,06	– AutoNation Inc	17	0,77
2 General Motors Co	80	3,66	Elektronik — 1,24 % (28. Februar 2021: 0,71 %)			– Kohl's Corp	11	0,48
Banken: 22,51 % (28. Februar 2021: 19,00 %)			– Arrow Electronics Inc	16	0,74	– Walmart Inc	15	0,68
2 Bank of America Corp	93	4,25	– SYNEX Corp	11	0,50		63	2,86
– Bank OZK	3	0,13	Energie - Alternative Quellen — 0,50 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Halbleiter - 4,39 % (28. Februar 2021: 5,06 %)		
– BOK Financial Corp	3	0,13	– First Solar Inc	11	0,50	2 Intel Corp	96	4,39
1 Citigroup Inc	75	3,43	Engineering & Konstruktion - 0,28 % (28. Februar 2021: 0,56 %)			Software - 1,86 % (28. Februar 2021: 1,88 %)		
– Citizens Financial Group Inc	16	0,75	– AECOM	6	0,28	– J2 Global Inc	6	0,27
– East West Bancorp Inc	11	0,51	Lebensmittel - 1,59 % (28. Februar 2021: 0,83 %)			– Oracle Corp	35	1,59
– Fifth Third Bancorp	9	0,43	– J M Smucker Co/The	18	0,84		41	1,86
– First Citizens BancShares Inc/NC	4	0,21	– Kroger Co/The	4	0,16	Telekommunikation - 1,25 % (28. Februar 2021: 1,76 %)		
– Goldman Sachs Group Inc/The	109	4,97	– Sysco Corp	13	0,59	– AT&T Inc	9	0,43
– JPMorgan Chase & Co	58	2,67		35	1,59	– Verizon Communications Inc	18	0,82
– KeyCorp	7	0,31	Medizinische Dienstleistungen — 5,35 % (28. Februar 2021: 2,96 %)				27	1,25
– Popular Inc	4	0,18	– Anthem Inc	52	2,39	Textilien - 1,30 % (28. Februar 2021: 0,82 %)		
– Regions Financial Corp	7	0,30	– DaVita Inc	34	1,57	– Mohawk Industries Inc	29	1,30
– State Street Corp	32	1,45	– Molina Healthcare Inc	21	0,96	Transport - 0,43 % (28. Februar 2021: 0,08 %)		
– Synovus Financial Corp	2	0,10	– Quest Diagnostics Inc	10	0,43	– Knight-Swift Transportation Holdings Inc	9	0,43
1 US Bancorp	48	2,19		117	5,35	Summe Stammaktien (Kosten 1.674 USD)		
– Valley National Bancorp	2	0,10	Wohnungsbauunternehmen - 4,04 % (28. Februar 2021: 4,54 %)				2.121	97,02
– Zions Bancorp NA	9	0,40	– DR Horton Inc	46	2,12	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.750 USD)		
	492	22,51	– PulteGroup Inc	25	1,14		2.197	100,50
Biotechnologie — 8,24 % (28. Februar 2021: 6,09 %)			– Toll Brothers Inc	17	0,78	Devisenterminkontrakte - 0,29 % (28. Februar 2021: 0,17 %)		
– Amgen Inc	13	0,62		88	4,04	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
– Biogen Inc	38	1,75	Versicherungen - 5,69 % (28. Februar 2021: 3,54 %)				6	0,29
1 Corteva Inc	25	1,13	– Aflac Inc	21	0,95	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
– Regeneron Pharmaceuticals Inc	104	4,74	– Allstate Corp/The	41	1,89		2.203	100,79
	180	8,24	– American Financial Group Inc/OH	5	0,21	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Baumaterialien - 0,09 % (28. Februar 2021: 2,11 %)			– Arch Capital Group Ltd	6	0,25		2.203	100,79
– Louisiana-Pacific Corp	2	0,09	– Berkshire Hathaway Inc 'B'	30	1,39	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
Chemikalien - 1,23 % (28. Februar 2021: 5,90 %)			– Lincoln National Corp	4	0,20		(17)	(0,79)
– CF Industries Holdings Inc	14	0,63	– MetLife Inc	8	0,37	Gesamtvermögen		
– Mosaic Co/The	13	0,60	– Progressive Corp/The	9	0,43		\$2.186	100,00
	27	1,23		124	5,69			
Commercial Services - 1,32 % (28. Februar 2021: 3,06 %)			Eisen/Stahl — 3,38 % (28. Februar 2021: 0,17 %)			– 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 %.		
– ManpowerGroup Inc	12	0,56	– Nucor Corp	55	2,53	ABKÜRZUNGEN:		
– Service Corp International/US	17	0,76	– Steel Dynamics Inc	19	0,85	ETF – Börsengehandelter Fonds (Exchange Traded Fund).		
	29	1,32		74	3,38			
Computer — 0,96 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Maschinen - Bau und Bergbau - 1,23 % (28. Februar 2021: 1,48 %)					
– Amdocs Ltd	11	0,52	– Caterpillar Inc	27	1,23			
– CACI International Inc 'A'	10	0,44	Medien - 2,68 % (28. Februar 2021: 2,04 %)					
	21	0,96	– Comcast Corp	12	0,56			
Kosmetik & Körperpflege - 1,07 % (28. Februar 2021: 1,11 %)			1 Fox Corp	21	0,93			
– Procter & Gamble Co/The	24	1,07	– Nexstar Media Group Inc 'A'	12	0,57			
			– Walt Disney Co/The	14	0,62			
				59	2,68			
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 6,45 % (28. Februar 2021: 11,42 %)			Bergbau - 0,20 % (28. Februar 2021: 1,96 %)					
– Affiliated Managers Group Inc	4	0,19	– Alcoa Corp	4	0,20			
– Ally Financial Inc	21	0,97	Diverse Fertigung - 0,65 % (28. Februar 2021: 0,22 %)					
– Capital One Financial Corp	33	1,51	– Carlisle Cos Inc	6	0,27			
– Credit Acceptance Corp	8	0,34	– Textron Inc	8	0,38			
– Invesco Ltd	12	0,53		14	0,65			
– Jefferies Financial Group Inc	9	0,42	Öl und Gas - 0,45 % (28. Februar 2021: 0,57 %)					
– OneMain Holdings Inc	7	0,34	1 Marathon Oil Corp	10	0,45			
– Santander Consumer USA Holdings Inc	14	0,65	Pharmazieunternehmen - 5,69 % (28. Februar 2021: 3,11 %)					
– SLM Corp	5	0,20	– Cigna Corp	75	3,42			
1 Synchrony Financial	28	1,30	– Johnson & Johnson	26	1,17			
	141	6,45						

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

<u>Fälligkeitstermin</u>	<u>Gegenpartei</u>	<u>Währungskauf (in Tsd.)</u>			<u>Währungsverkauf (in Tsd.)</u>			<u>Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)</u>	
15.09.2021	BNY Mellon	Buy	EUR	1.281	Verkauf	USD	1.506	\$	6
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 3 USD)								\$	6
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): – USD)									–
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 3 USD)								\$	6

[^] 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 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts			
Stammaktien - 95,48 % (28. Februar 2021: 94,72 %)			Versicherungen - 7,08 % (28. Februar 2021: 6,75 %)			Vorzugsaktien - 1,41 % (28. Februar 2021: 1,60 %)					
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung - 0,83 % (28. Februar 2021: 1,97 %)			446 American International Group Inc	24.338	3,30	Automobilhersteller - 1,41 % (28. Februar 2021: 1,60 %)					
17 Northrop Grumman Corp	6.144	0,83	598 Equitable Holdings Inc	18.533	2,51	EUR	44 Volkswagen AG	10.425	1,41		
Fluggesellschaften - 1,39 % (28. Februar 2021: 1,47 %)			353 Unum Group	9.399	1,27	Summe Vorzugsaktien (Kosten 8.829 USD)			10.425	1,41	
206 Southwest Airlines Co	10.243	1,39				Immobilieninvestmentgesellschaften - 0,96 % (28. Februar 2021: 0,60 %)					
Bekleidung - 0,78 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Internet - 4,85 % (28. Februar 2021: 3,96 %)			REITs - 0,96 % (28. Februar 2021: 0,60 %)					
102 Capri Holdings Ltd	5.748	0,78	6 Alphabet Inc	16.761	2,27	53 Simon Property Group Inc			7.101	0,96	
Automobilhersteller - 1,02 % (28. Februar 2021: 1,25 %)			34 Facebook Inc 'A'	13.081	1,77	Summe Immobilienfonds (Kosten 6.299 USD)			7.101	0,96	
153 General Motors Co	7.508	1,02	154 Uber Technologies Inc	6.009	0,81						
Autoteile und Ausrüstung - 0,49 % (28. Februar 2021: 0,00 %)						Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 584.291 USD)			722.688	97,85	
230 Goodyear Tire & Rubber Co/The	3.643	0,49	Freizeit - 1,16 % (28. Februar 2021: 1,68 %)			Devisenterminkontrakte - 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)					
Banken - 12,17 % (28. Februar 2021: 9,77 %)			355 Carnival Corp	8.573	1,16	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			25	-	
562 Bank of America Corp	23.434	3,17	Unterkunft - 2,38 % (28. Februar 2021: 3,21 %)			Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			722.713	97,85	
163 Bank of New York Mellon Corp/The	8.984	1,22	360 Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	4.954	0,67	Devisenterminkontrakte - 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)					
41 Goldman Sachs Group Inc/The	17.132	2,32	297 MGM Resorts International	12.660	1,71	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(14)	-	
56 Signature Bank/New York NY	14.400	1,95				Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			(14)	-	
567 Wells Fargo & Co	25.905	3,51	Maschinen - Bau und Bergbau - 1,14 % (28. Februar 2021: 1,14 %)			Summe erfolgswirksam num Fair Value bewerteter finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			722.699	97,85	
	89.855	12,17	74 Oshkosh Corp	8.425	1,14	Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			722.699	97,85	
Getränke - 1,98 % (28. Februar 2021: 1,24 %)			Maschinen - diversifiziert - 1,17 % (28. Februar 2021: 2,19 %)			Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			15.894	2,15	
104 Anheuser-Busch InBev SA/NV ADR	6.381	0,86	EUR	81	8,621	1,17	Gesamtvermögen			\$738.593	100,00
39 Constellation Brands Inc 'A'	8.228	1,12	Medien - 2,05 % (28. Februar 2021: 4,07 %)								
	14.609	1,98	215 Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	10.638	1,44						
Biotechnologie - 5,94 % (28. Februar 2021: 2,71 %)			108 ViacomCBS Inc 'B'	4.493	0,61						
38 Biogen Inc	12.799	1,73									
113 BioMarin Pharmaceutical Inc	9.520	1,29	Bergbau - 2,21 % (28. Februar 2021: 3,39 %)								
150 Gilead Sciences Inc	10.905	1,48	449 Freeport-McMoRan Inc	16.339	2,21						
53 Vertex Pharmaceuticals Inc	10.633	1,44	Diverse Fertigung - 3,25 % (28. Februar 2021: 0,64 %)								
	43.857	5,94	34 Eaton Corp Plc	5.715	0,77						
Chemikalien - 0,86 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			174 General Electric Co	18.303	2,48						
EUR	36	0,86									
Kommerzielle Dienstleistungen - 1,42 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Öl und Gas - 6,76 % (28. Februar 2021: 7,67 %)								
44 GXO Logistics Inc	3.565	0,48	280 Devon Energy Corp	8.272	1,12						
68 Quanta Services Inc	6.932	0,94	738 EQT Corp	13.529	1,83						
	10.497	1,42	124 Pioneer Natural Resources Co	18.504	2,51						
Computer - 2,17 % (28. Februar 2021: 1,98 %)			216 TotalEnergies SE ADR	9.587	1,30						
437 DXC Technology Co	16.050	2,17									
Kosmetik und Körperpflege - 0,96 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Öl- und Gasdienstleistungen - 1,15 % (28. Februar 2021: 0,00 %)								
728 Coty Inc	7.117	0,96	303 Schlumberger NV	8.507	1,15						
Distribution und Großhandel - 0,76 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Pharmazieunternehmen - 3,27 % (28. Februar 2021: 5,74 %)								
JPY	709	0,76	130 AbbVie Inc	15.662	2,12						
Diversifizierte Finanzdienstleistungen - 6,39 % (28. Februar 2021: 6,02 %)			33 Eli Lilly & Co	8.467	1,15						
170 Charles Schwab Corp/The	12.348	1,67									
273 OneMain Holdings Inc	15.757	2,13	Pipelines - 0,35 % (28. Februar 2021: 0,46 %)								
384 Synchrony Financial	19.094	2,59	158 Kinder Morgan Inc	2.570	0,35						
	47.199	6,39	Immobilien - 0,81 % (28. Februar 2021: 0,93 %)								
Elektrik - 2,69 % (28. Februar 2021: 3,02 %)			66 Howard Hughes Corp/The	5.990	0,81						
494 AES Corp/The	11.796	1,60	Einzelhandel - 1,07 % (28. Februar 2021: 3,99 %)								
423 Vistra Corp	8.076	1,09	53 Darden Restaurants Inc	7.927	1,07						
	19.872	2,69	Halbleiter - 1,68 % (28. Februar 2021: 4,69 %)								
Medizinische Produkte - 1,52 % (28. Februar 2021: 1,44 %)			280 ON Semiconductor Corp	12.408	1,68						
84 Medtronic Plc	11.214	1,52	Software - 4,82 % (28. Februar 2021: 2,85 %)								
Medizinische Dienstleistungen - 1,85 % (28. Februar 2021: 1,51 %)			88 Fidelity National Information Services Inc	11.279	1,53						
33 UnitedHealth Group Inc	13.658	1,85	190 Oracle Corp	16.935	2,29						
Holdinggesellschaften - Diversifiziert - 0,39 % (28. Februar 2021: 0,60 %)			48 Splunk Inc	7.387	1,00						
283 East Resources Acquisition Co	2.853	0,39									
Bauunternehmen - 0,60 % (28. Februar 2021: 1,05 %)			Telekommunikation - 3,44 % (28. Februar 2021: 2,30 %)								
69 Toll Brothers Inc	4.427	0,60	249 Cisco Systems Inc/Delaware	14.688	1,99						
Einrichtungsgegenstände - 1,39 % (28. Februar 2021: 1,61 %)			78 T-Mobile US Inc	10.724	1,45						
99 Sony Group Corp ADR	10.246	1,39									
			Transport - 1,24 % (28. Februar 2021: 1,23 %)								
			34 FedEx Corp	9.135	1,24						
			Summe Stammaktien (Kosten 569.163 USD)			705.162	95,48				

- Beträge, die mit „-“ bezeichnet sind, beaufen 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.
- EUR - Euro
- JPY - Japanischer Yen

Analyse des Gesamtvermögens

	% von Gesamtvermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,33
Finanzderivate	-
Sonstige Vermögenswerte	2,67
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason ClearBridge Value Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	1.437	Verkauf	EUR	1.226	\$	(10)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	363	Verkauf	SGD	492		(4)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SGD	2.915	Verkauf	USD	2.151		18
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.622	Verkauf	USD	1.908		7
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): – USD)								\$	25
Nicht realisierte Wertminderung von Devisentermingeschäften (31. August 2021 (in Tsd.): (1) USD)									(14)
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (1) USD)								\$	11

Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Stammaktien - 92,06 % (28. Februar 2021: 97,69 %)			Gesundheitsprodukte - 3,78 % (28. Februar 2021: 3,89 %)			Halbleiter - 2,07 % (28. Februar 2021: 2,04 %)		
Automobilhersteller - 0,50 % (28. Februar 2021: 0,57 %)			Medizinische Dienstleistungen - 2,34 % (28. Februar 2021: 2,20 %)			Software - 12,81 % (28. Februar 2021: 12,01 %)		
23 General Motors Co	1.123	0,50	27 Medtronic Plc	3.636	1,63	4 ASML Holding NV	3.200	1,43
Banken - 5,82 % (28. Februar 2021: 6,02 %)			9 Thermo Fisher Scientific Inc	4.819	2,15	7 Texas Instruments Inc	1.431	0,64
90 Bank of America Corp	3.768	1,68	Bauunternehmen - 0,69 % (28. Februar 2021: 0,59 %)			Telekommunikation - 3,09 % (28. Februar 2021: 2,79 %)		
49 JPMorgan Chase & Co	7.873	3,52	24 Toll Brothers Inc	1.549	0,69	4 Arista Networks Inc	1.532	0,68
24 US Bancorp	1.383	0,62	Versicherungen - 5,20 % (28. Februar 2021: 5,58 %)			16 Cisco Systems Inc/Delaware	932	0,42
Getränke - 1,99 % (28. Februar 2021: 1,89 %)			13 UnitedHealth Group Inc	5.239	2,34	18 T-Mobile US Inc	2.472	1,11
35 Coca-Cola Co/The	1.986	0,89	Internet - 11,02 % (28. Februar 2021: 11,37 %)			36 Verizon Communications Inc	1.965	0,88
16 PepsiCo Inc	2.465	1,10	2 Alphabet Inc	5.541	2,48	Transport - 2,20 % (28. Februar 2021: 2,68 %)		
Baumaterialien - 0,60 % (28. Februar 2021: 0,64 %)			2 Alphabet Inc 'A'	5.063	2,26	16 Canadian Pacific Railway Ltd	1.069	0,48
7 Vulcan Materials Co	1.340	0,60	2 Amazon.com Inc	7.749	3,46	3 Union Pacific Corp	667	0,30
Chemikalien - 5,23 % (28. Februar 2021: 5,74 %)			15 Facebook Inc 'A'	5.632	2,52	16 United Parcel Service Inc 'B'	3.186	1,42
13 Air Products & Chemicals Inc	3.437	1,54	12 Pinterest Inc	660	0,30	Summe Stammaktien (Kosten 115.777 USD)		
10 Ecolab Inc	2.245	1,00	Eisen/Stahl - 0,90 % (28. Februar 2021: 0,86 %)			205.927		
24 PPG Industries Inc	3.865	1,73	60 ArcelorMittal SA	2.008	0,90	92,06		
7 Sherwin-Williams Co/The	2.157	0,96	Medien - 3,85 % (28. Februar 2021: 4,98 %)			Immobilieninvestmentgesellschaft - 1,51 % (28. Februar 2021: 1,31 %)		
Kommerzielle Dienstleistungen - 1,61 % (28. Februar 2021: 1,58 %)			89 Comcast Corp	5.405	2,42	REITS - 1,51 % (28. Februar 2021: 1,31 %)		
17 Automatic Data Processing Inc	3.612	1,61	18 Walt Disney Co/The	3.206	1,43	12 American Tower Corp		
Computer - 5,57 % (28. Februar 2021: 6,85 %)			Diverse Fertigung - 0,39 % (28. Februar 2021: 0,55 %)			3.374		
82 Apple Inc	12.466	5,57	5 3M Co	878	0,39	Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 1.633 USD)		
Kosmetik & Körperpflege - 1,21 % (28. Februar 2021: 1,41 %)			Öl und Gas - 0,64 % (28. Februar 2021: 1,84 %)			3.374		
19 Procter & Gamble Co/The	2.702	1,21	10 Pioneer Natural Resources Co	1.430	0,64	1,51		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen - 3,64 % (28. Februar 2021: 4,21 %)			Verpackung und Behälter - 0,63 % (28. Februar 2021: 0,65 %)			Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
6 CME Group Inc	1.152	0,52	15 Ball Corp	1.398	0,63	209.301		
12 Intercontinental Exchange Inc	1.410	0,63	Pharmazieunternehmen - 6,28 % (28. Februar 2021: 6,60 %)			Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
24 Visa Inc 'A'	5.570	2,49	3 Becton Dickinson and Co	760	0,34	209.301		
Elektrik - 0,64 % (28. Februar 2021: 0,65 %)			9 Eli Lilly & Co	2.230	1,00	93,57		
8 NextEra Energy Inc	674	0,30	28 Johnson & Johnson	4.878	2,18	Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
6 Sempra Energy	748	0,34	47 Merck & Co Inc	3.560	1,59	14.389		
Elektronik - 2,44 % (28. Februar 2021: 2,51 %)			57 Pfizer Inc	2.613	1,17	6,43		
24 Honeywell International Inc	5.460	2,44	Pipelines - 0,43 % (28. Februar 2021: 0,46 %)			Gesamtvermögen		
Energie - Alternative Quellen - 0,14 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			59 Kinder Morgan Inc	967	0,43	\$223.690		
2 Enphase Energy Inc	308	0,14	Einzelhandel - 4,16 % (28. Februar 2021: 4,21 %)			100,00		
Umweltkontrolle - 1,37 % (28. Februar 2021: 1,04 %)			17 Home Depot Inc/The	5.684	2,54	% von Gesamtvermögen		
20 Waste Management Inc	3.071	1,37	50 TJX Cos Inc/The	3.625	1,62	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
Lebensmittel - 0,82 % (28. Februar 2021: 0,83 %)			Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			93,40		
30 Mondelez International Inc	1.841	0,82	Sonstige Vermögenswerte			6,60		

- 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 %.

	% von Gesamt Vermögen
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,40
Sonstige Vermögenswerte	6,60
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	
Stammaktien – 96,94 % (28. Februar 2021: 98,47 %)			113 Palo Alto Networks Inc			52.256			2,47
Autoteile und Ausrüstung – 1,56 % (28. Februar 2021: 1,83 %)			86 Sea Ltd ADR			29.086			1,37
217 Aptiv Plc			33.027			1,56			
Getränke – 2,29 % (28. Februar 2021: 2,37 %)			782 Uber Technologies Inc			30.614			1,45
258 Anheuser-Busch InBev SA/ NV ADR			15.784			0,75			
334 Monster Beverage Corp			48.379			2,29			
Biotechnologie – 0,86 % (28. Februar 2021: 3,50 %)			401 CVS Health Corp			34.638			1,64
9 Amgen Inc			2.050			0,10			
191 BioMarin Pharmaceutical Inc			16.054			0,76			
			18.104			0,86			
Chemikalien – 1,26 % (28. Februar 2021: 1,40 %)			39 ASML Holding NV			32.869			1,55
118 Ecolab Inc			26.695			1,26			
Gewerbliche Dienstleistungen – 2,16 % (28. Februar 2021: 1,78 %)			363 NVIDIA Corp			81.339			3,84
380 IHS Markit Ltd			45.765			2,16			
Computer – 4,87 % (28. Februar 2021: 4,74 %)			137 Advance Auto Parts Inc			27.712			1,31
679 Apple Inc			103.097			4,87			
Distribution und Großhandel – 1,65 % (28. Februar 2021: 1,72 %)			134 Home Depot Inc/The			43.706			2,06
80 WW Grainger Inc			34.916			1,65			
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 4,28 % (28. Februar 2021: 4,74 %)			136 Tractor Supply Co			26.386			1,25
396 Visa Inc 'A'			90.660			4,28			
Elektronik – 2,08 % (28. Februar 2021: 2,12 %)			95 Ulta Beauty Inc			36.754			1,74
190 Honeywell International Inc			44.012			2,08			
Medizinische Produkte – 5,20 % (28. Februar 2021: 3,95 %)			344 QUALCOMM Inc			50.545			2,39
375 Alcon Inc			30.889			1,46			
21 Intuitive Surgical Inc			21.843			1,03			
103 Thermo Fisher Scientific Inc			57.362			2,71			
			110.094			5,20			
Medizinische Dienstleistungen – 3,04 % (28. Februar 2021: 3,29 %)			39 VMware Inc			7.962			0,37
154 UnitedHealth Group Inc			64.281			3,04			
Internet – 23,90 % (28. Februar 2021: 22,03 %)			99 Workday Inc 'A'			27.166			1,28
54 Amazon.com Inc			187.144			8,84			
11 Booking Holdings Inc			25.962			1,23			
391 Facebook Inc 'A'			148.184			7,00			
57 Netflix Inc			32.674			1,54			
			448.484			21,19			
Transport – 2,30 % (28. Februar 2021: 2,23 %)			39 ASML Holding NV			32.869			1,55
249 United Parcel Service Inc 'B'			48.739			2,30			
Summe Stammaktien (Kosten 1.200.699 USD)			2.051.809			96,94			
			194.200			9,17			
Software – 21,19 % (28. Februar 2021: 19,68 %)			120 Adobe Inc			79.538			3,76
120 Atlassian Corp Plc			43.958			2,08			
228 Fidelity National Information Services Inc			29.179			1,38			
385 Microsoft Corp			116.148			5,49			
229 Nutanix Inc			8.446			0,40			
270 salesforce.com Inc			71.643			3,38			
203 Splunk Inc			31.068			1,47			
197 UiPath Inc			12.478			0,59			
53 VMware Inc			7.962			0,37			
99 Workday Inc 'A'			27.166			1,28			
			448.484			21,19			
Immobilieninvestmentgesellschaften – 1,55 % (28. Februar 2021: 1,52 %)			120 Adobe Inc			79.538			3,76
REITS – 1,55 % (28. Februar 2021: 1,52 %)			39 Equinix Inc			32.806			1,55
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 17.598 USD)			32.806			1,55			
Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.218.297 USD)			2.084.615			98,49			
Devisenterminkontrakte – 0,08 % (28. Februar 2021: 0,06 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			1.680			0,08
Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			2.086.295			98,57			
Devisenterminkontrakte – (0,04 %) (28. Februar 2021: 0,13 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(932)			(0,04)
Summe - Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten			(932)			(0,04)			
Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			2.085.363			98,53			
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			31.225			1,47			
Gesamtvermögen			\$2.116.588			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.			
						ABKÜRZUNGEN:			
						% von Gesamtvermögen			
Analyse des Gesamtvermögens			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden			97,86			
			Finanzderivate			0,08			
			Sonstige Vermögenswerte			2,06			
Gesamtvermögen			100,00						

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	72.601	Verkauf	BRL 380.086	\$ (905)
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf	BRL	380.086	Verkauf	USD 72.887	620
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	2.135	Verkauf	EUR 1.817	(11)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	43.009	Verkauf	USD 50.605	193
01.10.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	1.909	Verkauf	BRL 10.000	(16)
01.10.2021	BNY Mellon	Kauf	BRL	384.707	Verkauf	USD 73.210	867
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 1.202 USD)						\$	1.680
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (2.409) USD)							(932)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (1.207) USD)						\$	748

Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Stammaktien - 99,86 % (28. Februar 2021: 99,88 %)			Internet - 10,64 % (28. Februar 2021: 7,85 %)			139 Nuance Communications Inc 7.649 1,01		
Biotechnologie - 16,54 % (28. Februar 2021: 16,26 %)			30 Facebook Inc 'A' 11.354 1,51			95.339 12,65		
58 Amgen Inc	13.180	1,75	509 FireEye Inc	9.249	1,23	Summe Stammaktien		
129 Biogen Inc	43.843	5,82	135 Lyft Inc	6.417	0,85	(Kosten 476.054 USD)		
94 Guardant Health Inc	12.021	1,59	79 Match Group Inc	10.886	1,44	752.465 99,86		
234 ImmunoGen Inc	1.416	0,19	655 Twitter Inc	42.244	5,61	Summe der ergebniswirksam num		
272 Ionis Pharmaceuticals Inc	10.823	1,44		80.150	10,64	beizulegenden Zeitwert bewerteten		
71 Ultragenyx Pharmaceutical Inc	6.878	0,91	Medien - 21,49 % (28. Februar 2021: 26,56 %)			Anlagen (Kosten 476.054 USD)		
182 Vertex Pharmaceuticals Inc	36.479	4,84	316 AMC Networks Inc	15.007	1,99	752.465 99,86		
	124.640	16,54	999 Comcast Corp	60.652	8,05	Devisentermingeschäfte - 0,01 % (28. Februar 2021: 0,02 %)		
Baumaterialien - 2,39 % (28. Februar 2021: 1,70 %)			335 Discovery Inc	9.658	1,28	Nicht realisierte Wertsteigerung aus		
240 Johnson Controls International			405 Discovery Inc	11.174	1,48	Kontrakten (siehe unten) 69 0,01		
plc	17.983	2,39	88 Liberty Broadband Corp	16.289	2,16	Summe der erfolgswirksam num		
Computer - 5,98 % (28. Februar 2021: 5,92 %)			64 Liberty Broadband Corp	12.272	1,63	beizulegenden Zeitwert bewerteten		
356 Seagate Technology Holdings			128 Liberty Media Corp-Liberty			finanziellen Vermögenswerte		
Plc	31.170	4,14	Formula One 'C'	6.451	0,86	752.534 99,87		
220 Western Digital Corp	13.903	1,84	380 Liberty Media Corp-Liberty	18.771	2,49	Devisenterminkontrakte - (0,01 %)		
	45.073	5,98	SiriusXM	11.639	1,55	(28. Februar 2021: (0,01 %))		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen - 0,42 %			235 Liberty Media Corp-Liberty	161.913	21,49	Nicht realisierte Wertminderung aus		
36 Cohen & Steers Inc	3.150	0,42				Kontrakten (siehe unten) (64) (0,01)		
Elektronik - 5,47 % (28. Februar 2021: 4,51 %)			Öl- und Gasdienstleistungen - 1,00 %			Summe - Erfolgswirksam num		
274 TE Connectivity Ltd	41.241	5,47	(28. Februar 2021: 1,93 %)			beizulegenden Zeitwert bewertete		
Unterhaltung - 4,04 % (28. Februar 2021: 3,87 %)			275 Core Laboratories NV	7.566	1,00	finanzielle Vermögenswerte und		
190 Madison Square Garden			Pharmazieunternehmen - 3,00 % (28. Februar 2021: 3,19 %)			Verbindlichkeiten		
Entertainment Corp	15.269	2,02	41 AbbVie Inc	4.901	0,65	752.470 99,86		
84 Madison Square Garden			181 Agios Pharmaceuticals Inc	8.085	1,07	Sonstige die Verbindlichkeiten		
Sports Corp	15.197	2,02	330 Bausch Health Cos Inc	9.628	1,28	übersteigendes Vermögen		
	30.466	4,04		22.614	3,00	1.027 0,14		
Umweltkontrolle - 0,46 % (28. Februar 2021: 0,32 %)			Halbleiter - 8,57 % (28. Februar 2021: 9,67 %)			Gesamtvermögen		
45 Pentair Plc	3.451	0,46	73 Broadcom Inc	36.378	4,83	\$753.497 100,00		
Medizinische Produkte - 0,74 % (28. Februar 2021: 0,62 %)			332 Cree Inc	28.214	3,74			
42 Medtronic Plc	5.598	0,74		64.592	8,57			
Medizinische Dienstleistungen - 5,04 %			Software - 12,65 % (28. Februar 2021: 11,42 %)					
(28. Februar 2021: 3,83 %)			91 Autodesk Inc	28.097	3,73			
91 UnitedHealth Group Inc	37.942	5,04	107 Cerence Inc	11.644	1,55			
Wohnungseinrichtung - 1,43 % (28. Februar 2021: 1,34 %)			131 Citrix Systems Inc	13.526	1,79			
108 Dolby Laboratories Inc 'A'	10.747	1,43	77 DocuSign Inc 'A'	22.795	3,03			
			17 HubSpot Inc	11.628	1,54			

- 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 %.

	% von Gesamt Vermögen
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	99,62
Finanzderivate	0,01
Sonstige Vermögenswerte	0,37
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 713	Verkauf AUD 986	\$ (8)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 38	Verkauf AUD 51	-
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 2	Verkauf CHF 2	-
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 151	Verkauf CNH 985	-
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 125	Verkauf EUR 107	(1)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 39	Verkauf GBP 29	-
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 48	Verkauf PLN 186	(1)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 1	Verkauf SEK 9	-
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 104	Verkauf SGD 141	(1)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf SGD 4.336	Verkauf USD 3.200	25
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf AUD 11.241	Verkauf USD 8.265	(42)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf SEK 287	Verkauf USD 33	-
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf PLN 6.543	Verkauf USD 1.683	26
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf GBP 964	Verkauf USD 1.336	(11)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 1.612	Verkauf USD 1.898	8
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf CNH 13.672	Verkauf USD 2.104	10
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf CHF 68	Verkauf USD 74	-
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf AUD 333	Verkauf USD 244	-
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf SEK 9	Verkauf USD 1	-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 141 USD)				\$ 69
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (32) USD)				(64)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 109 USD)				\$ 5

Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Stammaktien – 73,42 % (28. Februar 2021: 68,97 %)			Pharmazieunternehmen – 5,30 % (28. Februar 2021: 5,49 %)			Gesundheitsprodukte – 2,35 % (28. Februar 2021: 1,96 %)		
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung – 1,47 % (28. Februar 2021: 1,44 %)			2 AbbVie Inc 227 0,52			1 Boston Scientific Corp, Series A 153 0,35		
8 Raytheon Technologies Corp 640 1,47			3 Johnson & Johnson 564 1,30			– Danaher Corp, Series A 869 2,00		
Banken – 3,61 % (28. Februar 2021: 3,62 %)			10 Merck & Co Inc 793 1,83			1.022 2,35		
19 Bank of America Corp 810 1,86			16 Pfizer Inc 718 1,65			Medien – 1,36 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
5 JPMorgan Chase & Co 760 1,75			2.302 5,30			9 ViacomCBS Inc, Series A 589 1,36		
1.570 3,61			Pipelines – 8,74 % (28. Februar 2021: 6,00 %)			Private Equity – 2,68 % (28. Februar 2021: 2,50 %)		
Getränke – 1,24 % (28. Februar 2021: 1,01 %)			18 Enbridge Inc 727 1,67			14 KKR & Co Inc, Series C 1.164 2,68		
10 Coca-Cola Co/The 538 1,24			36 Equitrans Midstream Corp 317 0,73			Halbleiter – 3,75 % (28. Februar 2021: 6,22 %)		
Biotechnologie – 1,14 % (28. Februar 2021: 1,28 %)			38 Kinder Morgan Inc 617 1,42			1 Broadcom Inc, Series A 1.631 3,75		
2 Amgen Inc 496 1,14			6 ONEOK Inc 308 0,71			Summe Vorzugsaktien (Kosten 4.628 USD) 6.549 15,08		
Chemikalien – 1,82 % (28. Februar 2021: 2,07 %)			64 Plains GP Holdings LP 'A' 622 1,43			Immobilieninvestmentgesellschaften – 8,38 % (28. Februar 2021: 8,34 %)		
2 Air Products & Chemicals Inc 439 1,01			30 Rattler Midstream LP, MLP # 325 0,75			REITs – 8,38 % (28. Februar 2021: 8,34 %)		
13 Huntsman Corp 350 0,81			6 TC Energy Corp 307 0,71			6 AGNC Investment Corp 99 0,23		
789 1,82			23 Williams Cos Inc/The 572 1,32			4 Alexandria Real Estate Equities Inc 751 1,73		
Computer – 6,70 % (28. Februar 2021: 6,00 %)			3.795 8,74			2 American Tower Corp 669 1,54		
19 Apple Inc 2.909 6,70			Private Equity – 1,79 % (28. Februar 2021: 1,70 %)			6 Apartment Income REIT Corp 318 0,73		
Kosmetik & Körperpflege – 1,46 % (28. Februar 2021: 1,43 %)			6 Blackstone Inc 776 1,79			2 Crown Castle International Corp 364 0,84		
4 Procter & Gamble Co/The 636 1,46			Halbleiter – 7,18 % (28. Februar 2021: 9,21 %)			1 Duke Realty Corp 74 0,17		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 2,36 % (28. Februar 2021: 2,12 %)			– ASML Holding NV 367 0,84			1 Equinix Inc 494 1,14		
3 Apollo Global Management Inc 'A' 197 0,45			3 NXP Semiconductors NV 746 1,72			3 Equity Lifestyle Properties Inc 241 0,55		
2 CME Group Inc 306 0,71			10 QUALCOMM Inc 1.419 3,27			2 Prologis Inc 267 0,61		
4 Intercontinental Exchange Inc 522 1,20			2 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR 276 0,64			1 SBA Communications Corp 'A' 258 0,60		
1.025 2,36			2 Texas Instruments Inc 309 0,71			3 Weyerhaeuser Co 105 0,24		
Elektrik – 3,55 % (28. Februar 2021: 3,92 %)			3.117 7,18			Summe Immobilienfonds (Kosten 2.281 USD) 3.640 8,38		
4 Brookfield Renewable Corporation 183 0,42			Software – 8,78 % (28. Februar 2021: 7,47 %)			Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 28.638 USD) 43.016 99,03		
19 Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP # 790 1,82			9 Microsoft Corp 2.718 6,26			Devisenterminkontrakte – 0,02 % (28. Februar 2021: 0,04 %)		
4 NextEra Energy Inc 356 0,82			9 Oracle Corp 813 1,87			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 9 0,02		
2 Sempra Energy 214 0,49			2 Paychex Inc 281 0,65			Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 43.025 99,05		
1.543 3,55			3.812 8,78			Devisenterminkontrakte – (0,02 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)		
Elektrische Komponenten und Zubehör – 1,08 % (28. Februar 2021: 0,99 %)			Telekommunikation – 2,14 % (28. Februar 2021: 0,25 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (7) (0,02)		
4 Emerson Electric Co 470 1,08			12 Cisco Systems Inc/Delaware 735 1,69			Summe – Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten (7) (0,02)		
Elektronik – 1,65 % (28. Februar 2021: 1,66 %)			4 Verizon Communications Inc 194 0,45			Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 43.018 99,03		
5 TE Connectivity Ltd 718 1,65			929 2,14			Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen 421 0,97		
Energie – Alternative Quellen – 0,90 % (28. Februar 2021: 0,92 %)			Transport – 2,27 % (28. Februar 2021: 2,29 %)			Gesamtvermögen 43.439 100,00		
5 NextEra Energy Partners LP 391 0,90			41 KNOT Offshore Partners LP, MLP # 734 1,69					
Hand- und Maschinenwerkzeuge – 2,18 % (28. Februar 2021: 2,25 %)			1 United Parcel Service Inc 'B' 254 0,58					
5 Stanley Black & Decker Inc 949 2,18			988 2,27					
Haushaltswaren und -artikel – 0,97 % (28. Februar 2021: 1,06 %)			Summe Stammaktien (Kosten 21.039 USD) 31.893 73,42					
3 Kimberly-Clark Corp 422 0,97			Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 2,15 % (28. Februar 2021: 2,57 %)					
Versicherungen – 0,70 % (28. Februar 2021: 0,80 %)			Fluggesellschaften – 1,62 % (28. Februar 2021: 1,90 %)					
2 Chubb Ltd 304 0,70			469 American Airlines Group Inc, 6,500 %, fällig 01.07.2025 704 1,62					
Internet – 0,86 % (28. Februar 2021: 0,71 %)			Freizeit – 0,53 % (28. Februar 2021: 0,67 %)					
14 NortonLifeLock Inc 372 0,86			170 Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,250 %, fällig 15.06.2023 230 0,53					
Investmentgesellschaften – 3,65 % (28. Februar 2021: 3,79 %)			Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 690 USD) 934 2,15					
9 Ares Capital Corp 176 0,40			Vorzugsaktien – 15,08 % (28. Februar 2021: 15,84 %)					
29 Barings BDC Inc 316 0,73			Autoteile und Ausrüstung – 1,42 % (28. Februar 2021: 1,58 %)					
28 Trinity Capital Inc 452 1,04			4 Aptiv Plc, Series A 616 1,42					
42 TriplePoint Venture Growth BDC Corp 643 1,48			Elektrik – 2,67 % (28. Februar 2021: 2,68 %)					
1.587 3,65			11 DTE Energy Co 547 1,26					
Maschinen – diversifiziert – 1,88 % (28. Februar 2021: 1,49 %)			11 NextEra Energy Inc 613 1,41					
9 Otis Worldwide Corp 815 1,88			1.160 2,67					
			Öl und Gas – 0,85 % (28. Februar 2021: 0,41 %)					
			4 South Jersey Industries Inc 215 0,50					
			3 Spire Inc, Series A 152 0,35					
			367 0,85					

Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
		Kauf	USD		Verkauf			\$	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf		AUD	6	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf		CNH	4	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf		EUR	2	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf		SGD	1	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	1.905	Verkauf		USD	1.400	(7)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SGD	283	Verkauf		USD	208	2
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.466	Verkauf		USD	1.726	6
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CNH	785	Verkauf		USD	121	1
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	5	Verkauf		USD	4	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 16 USD)								\$	9
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (2) USD)									(7)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 14 USD)								\$	2

Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
Stammaktien – 95,25 % (28. Februar 2021: 97,17 %)			Lebensmittel – 3,02 % (28. Februar 2021: 1,67 %)			54 Workday Inc 'A'	14.617	1,14
Bekleidung – 1,73 % (28. Februar 2021: 1,75 %)			423 Hain Celestial Group Inc/The	15.822	1,23		158.284	12,31
135 NIKE Inc	22.238	1,73	211 McCormick & Co Inc/MD	18.213	1,42	Telekommunikation – 2,92 % (28. Februar 2021: 1,36 %)		
Autoteile und Ausstattung – 1,75 % (28. Februar 2021: 2,12 %)			513 SunOpta Inc	4.835	0,37	359 Cisco Systems Inc/Delaware	21.190	1,65
148 Aptiv Plc	22.529	1,75		38.870	3,02	119 T-Mobile US Inc	16.298	1,27
Banken – 6,75 % (28. Februar 2021: 6,68 %)			Hand- und Maschinenwerkzeuge – 1,85 % (28. Februar 2021: 2,05 %)				37.488	2,92
835 Bank of America Corp	34.841	2,71	159 Regal Beloit Corp	23.754	1,85	Spielzeug, Spiele und Hobbys – 1,73 % (28. Februar 2021: 1,71 %)		
118 First Republic Bank/CA	23.467	1,83	Gesundheitsprodukte – 4,31 % (28. Februar 2021: 2,05 %)			226 Hasbro Inc	22.217	1,73
272 Morgan Stanley	28.401	2,21	98 Danaher Corp	31.774	2,47	Summe Stammaktien (Kosten 15.154 USD)	1.224.472	95,25
	86.709	6,75	43 Thermo Fisher Scientific Inc	23.588	1,84	Immobilieninvestmentgesellschaft – 1,41 % (28. Februar 2021: 1,33 %)		
Biotechnologie – 4,98 % (28. Februar 2021: 5,16 %)				55.362	4,31	REITS – 1,41 % (28. Februar 2021: 1,33 %)		
98 Amgen Inc	22.103	1,72	Medizinische Dienstleistungen – 2,36 % (28. Februar 2021: 2,31 %)			22 Equinix Inc	18.138	1,41
202 BioMarin Pharmaceutical Inc	17.005	1,32	73 UnitedHealth Group Inc	30.383	2,36	Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 15.154 USD)	18.138	1,41
343 Gilead Sciences Inc	24.962	1,94	Einrichtungsgegenstände – 1,20 % (28. Februar 2021: 1,76 %)			Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.054.970 USD)	1.242.610	96,66
	64.070	4,98	366 Herman Miller Inc	15.376	1,20	Devisenterminkontrakte – 0,02 % (28. Februar 2021: 0,27 %)		
Baustoffe – 1,83 % (28. Februar 2021: 1,87 %)			Versicherungen – 3,30 % (28. Februar 2021: 3,66 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	208	0,02
214 Trex Co Inc	23.477	1,83	316 Hartford Financial Services Group Inc/The	21.246	1,65	Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	1.242.818	96,68
Chemikalien – 1,37 % (28. Februar 2021: 1,54 %)			220 Progressive Corp/The	21.196	1,65	Devisenterminkontrakte – (0,08 %) (28. Februar 2021: (0,01 %))		
78 Ecolab Inc	17.578	1,37		42.442	3,30	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.019)	(0,08)
Kommerzielle Dienste – 1,21 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Internet – 3,25 % (28. Februar 2021: 1,80 %)			Summe – Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	(1.019)	(0,08)
278 Progyny Inc	15.535	1,21	7 Amazon.com Inc	22.913	1,78	Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.241.799	96,60
Computer – 4,49 % (28. Februar 2021: 5,49 %)			8 Booking Holdings Inc	18.861	1,47	Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	43.726	3,40
380 Apple Inc	57.701	4,49		41.774	3,25	Gesamtnettovermögen	\$ 1.285.525	100,00
Vertrieb und Großhandel – 1,60 % (28. Februar 2021: 1,21 %)			Unterkunft – 1,59 % (28. Februar 2021: 2,14 %)					
640 Resideo Technologies Inc	20.624	1,60	151 Marriott International Inc/MD	20.409	1,59			
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 5,00 % (28. Februar 2021: 5,28 %)			Medien – 3,70 % (28. Februar 2021: 4,59 %)					
24 BlackRock Inc	22.931	1,78	405 Comcast Corp	24.577	1,91			
304 Charles Schwab Corp/The	22.145	1,72	127 Walt Disney Co/The	23.021	1,79			
84 Visa Inc 'A'	19.244	1,50		47.598	3,70			
	64.320	5,00	Diverse Fertigung – 1,98 % (28. Februar 2021: 2,19 %)					
Elektrik – 3,04 % (28. Februar 2021: 3,33 %)			128 Trane Technologies Plc	25.412	1,98			
509 Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP #	20.632	1,60	Verpackung und Behälter – 1,96 % (28. Februar 2021: 2,15 %)					
220 NextEra Energy Inc	18.477	1,44	262 Ball Corp	25.153	1,96			
	39.109	3,04	Pharmazieunternehmen – 2,24 % (28. Februar 2021: 3,63 %)					
Elektronik – 3,79 % (28. Februar 2021: 4,24 %)			334 CVS Health Corp	28.849	2,24			
125 Keysight Technologies Inc	22.421	1,74	Einzelhandel – 4,22 % (28. Februar 2021: 4,14 %)					
175 TE Connectivity Ltd	26.295	2,05	59 Costco Wholesale Corp	26.878	2,09			
	48.716	3,79	84 Home Depot Inc/The	27.394	2,13			
Alternative Energiequellen: 4,22 % (28. Februar 2021: 4,94 %)				54.272	4,22			
83 Enphase Energy Inc	14.418	1,12	Halbleiter – 1,55 % (28. Februar 2021: 2,07 %)					
342 Shoals Technologies Group Inc 'A'	11.134	0,86	33 Lam Research Corp	19.963	1,55			
50 SolarEdge Technologies Inc	14.484	1,13	Software – 12,31 % (28. Februar 2021: 11,99 %)					
1.056 Vestas Wind Systems A/S ADR	14.224	1,11	52 Autodesk Inc	16.128	1,26			
	54.260	4,22	279 Microsoft Corp	84.248	6,55			
			68 salesforce.com Inc	18.036	1,40			
			76 Synopsys Inc	25.255	1,96			

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 370	Verkauf EUR 316	\$ (2)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 653	Verkauf GBP 472	2
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 265	Verkauf GBP 193	(2)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 42.140	Verkauf USD 49.574	200
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf GBP 90.328	Verkauf USD 125.210	(1.015)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf GBP 1.225	Verkauf USD 1.678	6
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 1.741 USD)				\$ 208
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (45) USD)				(1.019)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 1.696 USD)				(811)

[^] 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 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Stammaktien – 99,28 % (28. Februar 2021: 97,85 %)			Schweden – 2,68 % (28. Februar 2021: 1,39 %)			2 Trex Co Inc 199 1,46		
Argentinien – 0,95 % (28. Februar 2021: 0,94 %)			SEK 3 Atlas Copco AB 203 1,48			- Ulta Beauty Inc 150 1,10		
- MercadoLibre Inc 129 0,95			- Atlas Copco AB ADR 17 0,13			1 Union Pacific Corp 260 1,90		
Australien – 0,59 % (28. Februar 2021: 0,77 %)			SEK 6 Sandvik AB 146 1,07			1 United Parcel Service Inc 'B' 218 1,60		
AUD 3 Ansell Ltd 81 0,59			366 2,68			- United Rentals Inc 162 1,19		
Brasilien: 1,31 % (28. Februar 2021: 1,67 %)			Schweiz – 4,01 % (28. Februar 2021: 3,69 %)			- UnitedHealth Group Inc 102 0,74		
2 StoneCo Ltd 'A' 70 0,52			CHF 3 Alcon Inc 272 1,99			1 Waste Management Inc 141 1,03		
2 XP Inc 'A' 109 0,79			CHF 2 Nestle SA 275 2,02			1 Workday Inc 'A' 143 1,05		
179 1,31			547 4,01			Summe Stammaktien (Kosten 10.360 USD) 13.552 99,28		
Kanada – 2,82 % (28. Februar 2021: 2,27 %)			Taiwan – 2,94 % (28. Februar 2021: 1,81 %)			Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 13.552 99,28		
2 Canadian Pacific Railway Ltd 117 0,86			1 Sea Ltd ADR 186 1,37			Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 13.552 99,28		
Constellation Software Inc/ - Canada 115 0,84			2 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR 215 1,57			Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen 98 0,72		
CAD 1 Thomson Reuters Corp 153 1,12			401 2,94			Gesamtnettovermögen \$13.650 100,00		
385 2,82			Großbritannien – 5,46 % (28. Februar 2021: 5,61 %)			-		
China – 0,75 % (28. Februar 2021: 2,70 %)			1 Diageo Plc ADR 131 0,96			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 %.		
1 Zai Lab Ltd ADR 102 0,75			GBP 12 Dr. Martens Plc 69 0,51			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 2021 belaufen sich diese Wertpapiere auf 273.000 USD und machten 2,00 % des Nettovermögens aus.		
Frankreich – 2,90 % (28. Februar 2021: 2,21 %)			EUR 1 Just Eat Takeaway.com NV, 144A 74 0,54			ABKÜRZUNGEN:		
EUR - L'Oréal SA 214 1,57			GBP 2 London Stock Exchange Group Plc 219 1,60			ADR – American Depositary Receipt.		
396 2,90			GBP 5 Ocado Group Plc 139 1,02			AUD – Australischer Dollar		
Deutschland – 1,09 % (28. Februar 2021: 3,72 %)			GBP 14 Rentokil Initial Plc 745 5,46			CAD – Kanadischer Dollar		
EUR - adidas AG 149 1,09			Vereinigte Staaten – 55,98 % (28. Februar 2021: 52,44 %)			CHF – Schweizer Franken		
Hongkong – 1,49 % (28. Februar 2021: 1,79 %)			- Alphabet Inc 'A' 368 2,69			EUR – Euro		
HKD 17 AIA Group Ltd 203 1,49			- Amazon.com Inc 365 2,67			GBP – Britisches Pfund Sterling		
Irland – 1,09 % (28. Februar 2021: 0,76 %)			3 Apple Inc 514 3,76			HKD – Hongkong-Dollar		
3 CRH Plc ADR 149 1,09			- Arista Networks Inc 99 0,72			JPY – Japanischer Yen		
Italien – 0,87 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			1 Atlassian Corp Plc 247 1,81			KRW – Südkoreanischer Won		
EUR 42 Intesa Sanpaolo SpA 119 0,87			6 Avantor Inc 249 1,83			SEK – Schwedische Kronen		
Japan – 6,63 % (28. Februar 2021: 6,55 %)			12 Coty Inc 119 0,87					
JPY 1 FAN UC Corp 117 0,85			- Dexcom Inc 164 1,20					
JPY 1 Hoya Corp 241 1,77			- DocuSign Inc 'A' 97 0,71					
JPY - Keyence Corp 208 1,52			1 Ecolab Inc 238 1,75					
JPY - Nintendo Co Ltd 27 0,20			1 Elastic NV 175 1,28					
JPY 4 Recruit Holdings Co Ltd 225 1,65			1 Fidelity National Information Services Inc 112 0,82					
JPY 1 Shiseido Co Ltd 87 0,64			1 Guardant Health Inc 98 0,72					
905 6,63			1 Intercontinental Exchange Inc 129 0,95					
Niederlande – 2,61 % (28. Februar 2021: 2,67 %)			- Kodiak Sciences Inc 38 0,28					
- Argenx SE ADR 122 0,89			4 Kroger Co/The 170 1,25					
EUR - ASML Holding NV 235 1,72			1 Marriott International Inc/MD 186 1,37					
357 2,61			1 Marvell Technology Inc 46 0,34					
Polen – 0,54 % (28. Februar 2021: 0,66 %)			1 McCormick & Co Inc/MD 86 0,63					
EUR 4 InPost SA 74 0,54			2 Microsoft Corp 524 3,84					
Portugal – 1,04 % (28. Februar 2021: 1,28 %)			1 NVIDIA Corp 175 1,28					
EUR 26 EDP- Energias de Portugal SA 142 1,04			1 Old Dominion Freight Line Inc 205 1,50					
Südkorea – 0,73 % (28. Februar 2021: 1,54 %)			2 Pinterest Inc 99 0,73					
KRW 2 Samsung Electronics Co Ltd 100 0,73			2 Procter & Gamble Co/The 228 1,67					
Spanien – 2,80 % (28. Februar 2021: 2,43 %)			1 S&P Global Inc 242 1,77					
EUR 3 Amadeus IT Group SA 183 1,34			1 salesforce.com Inca 207 1,51					
EUR 3 Cellnex Telecom SA, 144A 199 1,46			2 Sensient Technologies Corp 143 1,05					
382 2,80			1 TE Connectivity Ltd 174 1,28					
			- Tesla Inc 185 1,35					
			- Thermo Fisher Scientific Inc 170 1,25					
			3 TIX Cos Inc/The 223 1,63					
			1 T-Mobile US Inc 191 1,40					

[^] 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 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Nettoinventarwerts				
Stammaktien – 88,24 % (28. Februar 2021: 94,46 %)			USD 3	CMS Energy Corp	161	0,02	Devisentermingeschäfte - (0,10 %) (28. Februar 2021: (0,09 %))					
Australien – 4,53 % (28. Februar 2021: 7,31 %)			USD 418	CMS Energy Corp	22.716	3,33	Nicht realisierte Wertminderung aus					
AUD 3.565	Sydney Airport	17.515	2,57	USD 4	CSX Corp	103	0,02	Kontrakten (siehe unten)	(677)	(0,10)		
AUD 1.520	Transurban Group	13.316	1,96	USD 576	CSX Corp	15.857	2,33	Summe - Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten				
		30.831	4,53	USD 153	Dominion Energy Inc	10.104	1,48	(677)			(0,10)	
Kanada – 10,08 % (28. Februar 2021: 3,14 %)			USD 106	Entergy Corp	9.895	1,45	Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			662.512	97,25	
CAD 144	Canadian National Railway Co	14.337	2,11	USD 5	Exelon Corp	201	0,03	Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			18.710	2,75
CAD 978	Enbridge Inc	32.574	4,78	USD 749	Exelon Corp	31.105	4,57	Gesamtnettvermögen			€ 681.222	100,00
CAD 842	Pembina Pipeline Corp	21.735	3,19	USD 287	NextEra Energy Inc	20.417	3,00	–				
		68.646	10,08	USD 2	NextEra Energy Inc	132	0,02	144A				
Frankreich – 12,48 % (28. Februar 2021: 13,21 %)			USD 3	Public Service Enterprise Group Inc	167	0,02	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 29.215.000 EUR und machten 4,29 % des Nettovermögens aus.					
154	Aéroports de Paris	15.315	2,25	USD 477	Public Service Enterprise Group Inc	25.850	3,79	ABKÜRZUNGEN:				
144	Eiffage SA	12.657	1,86	USD 61	Southern Co/The	3.395	0,50	AUD			–	Australischer Dollar
1.998	Getlink SE	27.274	4,00	USD 301	Southern Co/The	16.760	2,46	CAD			–	Kanadischer Dollar
328	Vinci SA	29.774	4,37	USD 168	Union Pacific Corp	30.826	4,53	GBP			–	Britisches Pfund Sterling
		85.020	12,48	USD 1	Union Pacific Corp	200	0,03	JPY			–	Japanischer Yen
Italien – 1,99 % (28. Februar 2021: 7,02 %)					267.683	39,29	USD			–	US-Dollar	
2.029	Terna - Rete Elettrica Nazionale	13.563	1,99	Summe Stammaktien (Kosten 538.791 USD)			601.102	88,24				
Japan – 2,55 % (28. Februar 2021: 2,10 %)			Immobilieninvestmentgesellschaften – 8,96 % (28. Februar 2021: 5,96 %)			Vereinigte Staaten – 8,96 % (28. Februar 2021: 5,96 %)						
JPY 305	East Japan Railway Co	17.393	2,55	USD 1	American Tower Corp	177	0,02					
Portugal: 2,41 % (28. Februar 2021: 2,15 %)			USD 98	American Tower Corp	24.174	3,55						
3.529	EDP – Energias de Portugal SA	16.396	2,41	USD 1	Crown Castle International Corp	90	0,01					
Spanien – 9,61 % (28. Februar 2021: 9,62 %)			USD 85	Crown Castle International Corp	13.942	2,05						
94	Aena SME SA, 144A	12.686	1,86	USD –	SBA Communications Corp 'A'	146	0,02					
285	Cellnex Telecom SA, 144A	16.529	2,43	USD 74	SBA Communications Corp 'A'	22.543	3,31					
776	Ferrovial SA	19.054	2,80	Summe Immobilienfonds (Kosten 51.567 USD)			61.072	8,96				
1.636	Iberdrola SA	17.163	2,52	Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 590.358 USD)			662.174	97,20				
		65.432	9,61	Devisenterminkontrakte – 0,15 % (28. Februar 2021: 0,04 %)								
Großbritannien – 5,30 % (28. Februar 2021: 5,22 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			1.015	0,15					
GBP 422	Severn Trent Plc	13.590	1,99	Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			663.189	97,35				
GBP 1.185	SSE Plc	22.548	3,31									
		36.138	5,30									
Vereinigte Staaten – 39,29 % (28. Februar 2021: 41,63 %)												
USD 2	Alliant Energy Corp	91	0,01									
USD 272	Alliant Energy Corp	14.020	2,06									
USD 399	Brookfield Renewable Corporation	14.809	2,17									
USD 4	CenterPoint Energy Inc	85	0,01									
USD 614	CenterPoint Energy Inc	13.050	1,92									
USD 2	Cheniere Energy Inc	171	0,03									
USD 322	Cheniere Energy Inc	23.876	3,50									
USD 515	Clearway Energy Inc 'C'	13.692	2,01									

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 4.555	Verkauf BRL 28.030	€ (36)
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf BRL 28.030	Verkauf EUR 4.544	47
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 35	Verkauf GBP 30	–
02.09.2021	BNY Mellon	Kauf GBP 10	Verkauf EUR 12	–
02.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR –	Verkauf GBP –	–
03.09.2021	BNY Mellon	Kauf GBP 1	Verkauf EUR 1	–
03.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR –	Verkauf GBP –	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 157	Verkauf AUD 251	1
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 881	Verkauf AUD 1.443	(12)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf CAD 4.018	Verkauf AUD 4.379	(16)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf GBP 1.837	Verkauf AUD 3.508	(35)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf GBP 3.185	Verkauf CAD 5.580	(37)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 1.354	Verkauf CAD 2.034	(11)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf AUD 863	Verkauf CAD 789	5
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 216	Verkauf CNH 1.636	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 23	Verkauf CNH 173	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf GBP 9.857	Verkauf EUR 11.499	(24)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 127.162	Verkauf EUR 108.145	(486)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf SGD 4.398	Verkauf EUR 2.760	10
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf CNH 301	Verkauf EUR 40	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf CAD 21.575	Verkauf EUR 14.354	124
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf SGD –	Verkauf EUR –	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf AUD 664	Verkauf EUR 409	–

[^] 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 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
								€	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	3.740	Verkauf	EUR	2.338	€	(20)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CNH	51.873	Verkauf	EUR	6.789		6
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	722	Verkauf	GBP	381		5
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CAD	3.899	Verkauf	GBP	2.226		26
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.092	Verkauf	GBP	938		1
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CAD	1.846	Verkauf	JPY	157.443		27
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	848	Verkauf	JPY	126.582		12
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	359	Verkauf	JPY	46.140		5
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	8	Verkauf	SGD	12		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CAD	34.612	Verkauf	USD	26.915		439
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	15.811	Verkauf	USD	21.547		161
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	13.403	Verkauf	USD	15.699		113
01.10.2021	BNY Mellon	Kauf	BRL	28.812	Verkauf	EUR	4.663		33
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 230 EUR)								€	1.015
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (558) EUR)									(677)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (328) EUR)								€	338

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Stammaktien – 96,76 % (28. Februar 2021: 96,36 %)					
Brasilien – 14,73 % (28. Februar 2021: 13,56 %)					
BRL 42	CCR SA	100	3,43		
BRL 14	CPFL Energia SA	80	2,75		
BRL 30	EcoRodovias Infraestrutur e Logistica SA	58	1,99		
BRL 19	Equatorial Energia SA	93	3,17		
BRL 31	Neoenergia SA	99	3,39		
		430	14,73		
China – 28,16 % (28. Februar 2021: 24,76 %)					
HKD 39	China Gas Holdings Ltd	114	3,89		
HKD 26	China Longyuan Power Group Corp Ltd	53	1,82		
HKD 14	China Resources Gas Group Ltd	85	2,90		
HKD 18	China Resources Power Holdings Co Ltd	44	1,52		
HKD 396	China Tower Corp Ltd, 144A	52	1,77		
HKD 6	ENN Energy Holdings Ltd	115	3,93		
HKD 50	Guangdong Investment Ltd	69	2,38		
HKD 52	Jiangsu Expressway Co Ltd	54	1,85		
CNH 77	Shanghai International Port 'A'	66	2,28		
HKD 66	Shenzhen Expressway Co Ltd	63	2,17		
HKD 174	Xinyi Energy Holdings Ltd	106	3,65		
		821	28,16		
Indien – 24,97 % (28. Februar 2021: 26,53 %)					
INR 17	Container Corp Of India Ltd	155	5,31		
INR 11	Gujarat Gas Ltd	106	3,63		
INR 17	Gujarat State Petronet Ltd	83	2,84		
INR 16	Indraprastha Gas Ltd	123	4,22		
INR 10	Indus Towers Ltd	30	1,04		
INR 4	Mahanagar Gas Ltd	65	2,22		
INR 69	Power Grid Corp of India Ltd	166	5,71		
		728	24,97		
Indonesien – 4,65 % (28. Februar 2021: 4,20 %)					
IDR 490	Jasa Marga Persero Tbk PT	136	4,65		
Malaysia – 5,88 % (28. Februar 2021: 5,36 %)					
MYR 77	Malaysia Airports Holdings Bhd	123	4,23		
MYR 19	Tenaga Nasional Bhd	48	1,65		
		171	5,88		
Mexiko – 10,48 % (28. Februar 2021: 11,78 %)					
MXN 28	ALEATICA SAB de CV	29	0,99		
MXN 41	GMexico Transportes SAB de CV, 144A	63	2,17		
Philippinen – 7,89 % (28. Februar 2021: 5,91 %)					
PHP 46	International Container Terminal Services Inc	169	5,81		
PHP 784	Metro Pacific Investments Corp	61	2,08		
		230	7,89		
Summe Stammaktien (Kosten 2.597 USD)					
			2.822		96,76
Immobilieninvestmentgesellschaften – 3,62 % (28. Februar 2021: 3,70 %)					
Mexiko – 3,62 % (28. Februar 2021: 3,70 %)					
MXN 74	CFE Capital S de RL de CV	105	3,62		
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 68 USD)					
			105		3,62
Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 2.665 USD)					
			2.927		100,38
Devisentermingeschäfte – 0,23 % (28. Februar 2021: 0,15 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)					
			7		0,23
Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
			2.934		100,61
Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
			2.934		100,61
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten					
			(18)		(0,61)
Gesamtvermögen					
			\$2.916		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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 115.000 USD und machten 3,94 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

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

	% von Gesamt Vermögen
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,73
Finanzderivate	0,23
Sonstige Vermögenswerte	2,04
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	Verkauf	
		EUR	USD	
		1.435	1.688	\$ 7
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 4 USD)				
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): – USD)				
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 4 USD)				

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Stammaktien – 83,36 %			EUR 66 Ferrovial SA 1.902 1,85			Devisenterminkontrakte – 0,00 %		
Australien – 15,25 %			EUR 188 Iberdrola SA 2.330 2,27			Nicht realisierte Wertminderung aus		
AUD 118 APA Group	787	0,76	EUR 98 Red Electrica Corp SA 1.955 1,90			Kontrakten (siehe unten) (6) –		
AUD 837 Atlas Arteria Ltd	4.176	4,06	11.085 10,78			Summe - Erfolgswirksam num		
AUD 2,288 AusNet Services Ltd	3.236	3,15	Großbritannien – 6,58 %			beizulegenden Zeitwert bewertete		
AUD 564 Spark Infrastructure Group	1.159	1,13	GBP 241 National Grid Plc 3.119 3,03			finanzielle Verbindlichkeiten (6) –		
AUD 665 Sydney Airport	3.858	3,75	GBP 162 SSE Plc 3.646 3,55			Summe der erfolgswirksam num		
AUD 238 Transurban Group	2.465	2,40	6.765 6,58			beizulegenden Zeitwert bewerteten		
	15.681	15,25	Vereinigte Staaten – 20,89 %			finanzielle Vermögenswerte und		
Brasilien – 3,10 %			53 Brookfield Renewable 2.330 2,27			Verbindlichkeiten 91.006 88,48		
BRL 358 CCR SA	849	0,83	137 Clearway Energy Inc 'C' 4.297 4,18			Sonstige die Verbindlichkeiten		
BRL 279 CPFL Energia SA	1.566	1,52	12 Entergy Corp 1.322 1,28			übersteigendes Vermögen 11.848 11,52		
BRL 105 Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA	768	0,75	24 Exelon Corp 4.679 4,55			Gesamtnettovermögen \$102.854 100,00		
	3.183	3,10	54 NextEra Energy Partners LP 1.905 1,85			-		
Kanada – 11,49 %			54 Public Service Enterprise Group Inc 3.471 3,37			Beträge, die mit „-“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder		
CAD 101 Enbridge Inc	3.954	3,84	53 Southern Co/The 3.486 3,39			auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile		
CAD 133 Gibson Energy Inc	2.404	2,34	21.490 20,89			oder weniger als 0,01 %.		
CAD 109 Pembina Pipeline Corp	3.313	3,22	Summe Stammaktien			144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-		
CAD 45 TC Energy Corp	2.151	2,09	(Kosten 83.777 USD) 85.737 83,36			Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten		
	11.822	11,49	Immobilienfonds (REIT) - 4,93 %			Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen		
Frankreich – 7,74 %			Mexiko – 1,20 %			nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an		
EUR 21 Eiffage SA	2.186	2,12	MXN 873 CFE Capital S de RL de CV 1.238 1,20			qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden.		
EUR 24 Eutelsat Communications SA	273	0,27	Vereinigte Staaten – 3,73 %			Am 31. August 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf		
EUR 169 Getlink SE	2.720	2,64	20 Crown Castle International Corp 3.840 3,73			2.554.000 USD und machten 2,48 % des Nettovermögens		
EUR 26 Vinci SA	2.785	2,71	Summe Immobilienfonds (REIT)			aus.		
	7.964	7,74	(Kosten 5.117 USD) 5.078 4,93			ABKÜRZUNGEN:		
Italien – 3,09 %			Summe der ergebniswirksam num			AUD – Australischer Dollar		
EUR 539 Snam SpA	3.175	3,09	beizulegenden Zeitwert bewerteten			BRL – Brasilianischer Real		
Mexiko – 2,15 %			Anlagen (Kosten 88.894 USD) 90.815 88,29			CAD – Kanadischer Dollar		
MXN 190 Grupo Aeroportuario del Pacífico SAB de CV	2.216	2,15	Devisentermingeschäfte – 0,19 %			EUR – Euro		
Portugal – 2,29 %			Nicht realisierte Wertsteigerung aus			GBP – Britisches Pfund Sterling		
EUR 430 EDP – Energias de Portugal SA	2.356	2,29	Kontrakten (siehe unten) 197 0,19			MXN – Mexikanischer Peso		
Spanien – 10,78 %			Summe der erfolgswirksam num			Analyse des Gesamtvermögens		
EUR 16 Aena SME SA, 144A	2.554	2,48	beizulegenden Zeitwert bewerteten			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen		
EUR 103 Enagas SA	2.344	2,28	finanziellen Vermögenswerte 91.012 88,48			Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt		
						gehandelt werden 86,93		
						Finanzderivate 0,19		
						Sonstige Vermögenswerte 2,88		
						Gesamtvermögen 100,00		

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD –	Verkauf EUR –	\$ –
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 94	Verkauf SGD 128	(1)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf SGD 29.740	Verkauf USD 21.942	180
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 3.678	Verkauf USD 4.326	16
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf AUD 210	Verkauf USD 153	1
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf AUD 2.199	Verkauf USD 1.614	(5)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten				\$ 197
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten				(6)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten				\$ 191

[^] 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 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Organismen für gemeinsame Anlagen – 4,91 % (28. Februar 2021: 7,12 %)			Gewerbliche Dienstleistungen — 3,22 % (28. Februar 2021: 3,13 %)			Umweltkontrolle – 0,51 % (28. Februar 2021: 0,54 %)		
52.853 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	52.853	4,91	211 American Public Education Inc	5.566	0,52	165 Heritage-Crystal Clean Inc	4.898	0,46
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 52.853 USD)	52.853	4,91	346 Cross Country Healthcare Inc	7.532	0,70	89 Quest Resource Holding Corp	590	0,05
Stammaktien – 89,34 % (28. Februar 2021: 86,40 %)			26 Evercel Inc	57	0,01		5.488	0,51
Werbung – 0,05 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			89 Heidrick & Struggles International Inc	3.827	0,36	Lebensmittel – 0,22 % (28. Februar 2021: 0,90 %)		
86 Marin Software Inc	570	0,05	57 Herc Holdings Inc	7.479	0,69	56 Chefs' Warehouse Inc/The	1.678	0,15
Luft- & Raumfahrt und Verteidigung – 2,99 % (28. Februar 2021: 1,97 %)			71 Korn Ferry	4.995	0,46	61 Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	740	0,07
161 AAR Corp	5.450	0,51	188 TrueBlue Inc	5.152	0,48		2.418	0,22
341 Astronics Corp	4.554	0,42		34.608	3,22	Waldprodukte und Papier – 0,39 % (28. Februar 2021: 0,21 %)		
104 Ducommun Inc	5.471	0,51	Computer – 0,71 % (28. Februar 2021: 0,62 %)			268 Glatfelter Corp	4.227	0,39
100 Hexcel Corp	5.674	0,53	269 Conduent Inc	1.963	0,18	Hand- und Maschinenwerkzeuge – 0,42 % (28. Februar 2021: 0,11 %)		
121 Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	4.749	0,44	276 SecureWorks Corp	5.646	0,53	10 Hurco Cos Inc	334	0,03
340 Triumph Group Inc	6.277	0,58		7.609	0,71	193 Luxfer Holdings Plc	4.131	0,39
	32.175	2,99	Vertrieb und Großhandel — 2,88 % (28. Februar 2021: 1,14 %)				4.465	0,42
Fluggesellschaften – 1,06 % (28. Februar 2021: 2,33 %)			277 KAR Auction Services Inc	4.681	0,44	Gesundheitsprodukte – 2,55 % (28. Februar 2021: 3,35 %)		
37 Alaska Air Group Inc	2.104	0,19	319 Manitex International Inc	2.550	0,24	571 Accuray Inc	2.327	0,22
312 JetBlue Airways Corp	4.716	0,44	182 Resideo Technologies Inc	5.852	0,54	127 Alphatec Holdings Inc	1.831	0,17
580 Mesa Air Group Inc	4.624	0,43	209 Univar Solutions Inc	4.940	0,46	62 Cutera Inc	3.085	0,29
	11.444	1,06	111 VSE Corp	5.518	0,51	225 Invacare Corp	1.904	0,18
Bekleidung – 1,36 % (28. Februar 2021: 0,94 %)			64 WESCO International Inc	7.454	0,69	101 Misonix Inc	2.568	0,24
297 Fossil Group Inc	3.985	0,37		30.995	2,88	97 Orthofix Medical Inc	4.125	0,38
106 Skechers USA Inc	5.351	0,50	Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 1,94 % (28. Februar 2021: 3,23 %)			482 Sientra Inc	2.934	0,27
230 Unifi Inc	5.349	0,49	169 Air Lease Corp 'A'	6.712	0,62	40 SmileDirectClub Inc	219	0,02
	14.685	1,36	81 B Riley Financial Inc	5.282	0,49	452 Surgalyn Holdings Inc	685	0,06
Automobilhersteller – 0,55 % (28. Februar 2021: 0,55 %)			36 Houlihan Lokey Inc 'A'	3.205	0,30	129 Varex Imaging Corp	3.760	0,35
381 Wabash National Corp	5.918	0,55	92 Moelis & Co 'A'	5.686	0,53	660 ViewRay Inc	3.982	0,37
Kfz-Teile und Zubehör – 2,79 % (28. Februar 2021: 2,93 %)				20.885	1,94		27.420	2,55
355 Commercial Vehicle Group Inc 3.727	0,34		Elektrik – 0,68 % (28. Februar 2021: 0,90 %)			Medizinische Dienstleistungen – 1,90 % (28. Februar 2021: 2,81 %)		
285 Dana Inc	6.637	0,62	9 Ameresco Inc 'A'	654	0,06	31 Acadia Healthcare Co Inc	2.058	0,19
73 Garrett Motion Inc	509	0,05	64 Black Hills Corp	4.473	0,41	502 Community Health Systems Inc	6.177	0,58
186 Meritor Inc	4.400	0,41	51 Hawaiian Electric Industries Inc 2.241	0,21	108 Neuronetics Inc	732	0,07	
438 Modine Manufacturing Co	5.451	0,50		7.368	0,68	232 Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	4.745	0,44
137 Shyft Group Inc/The	6.028	0,56	Elektrische Komponenten und Zubehör – 0,31 % (28. Februar 2021: 0,39 %)			79 RadNet Inc	2.480	0,23
835 Westport Fuel Systems Inc	3.306	0,31	15 Encore Wire Corp	1.238	0,12	122 Select Medical Holdings Corp	4.232	0,39
	30.058	2,79	56 Insteel Industries Inc	2.077	0,19		20.424	1,90
Banken – 2,92 % (28. Februar 2021: 2,45 %)				3.315	0,31	Bauunternehmen – 2,61 % (28. Februar 2021: 3,20 %)		
142 First Foundation Inc	3.425	0,32	Elektronik – 4,25 % (28. Februar 2021: 4,06 %)			139 Beazer Homes USA Inc	2.609	0,24
209 Hilltop Holdings Inc	6.981	0,65	41 Advanced Energy Industries Inc	3.732	0,35	8 Cavco Industries Inc	2.006	0,18
174 Seacoast Banking Corp of Florida	5.576	0,52	257 Applied Optoelectronics Inc	1.883	0,18	49 Century Communities Inc	3.419	0,32
79 Texas Capital Bancshares Inc	5.355	0,49	171 Avnet Inc	6.917	0,64	687 Horizon Global Corp	5.350	0,50
255 TriState Capital Holdings Inc	5.149	0,48	262 Comtech Telecommunications Corp	6.696	0,62	19 LGI Homes Inc	3.071	0,28
45 Walker & Dunlop Inc	4.937	0,46	154 GoPro Inc 'A'	1.528	0,14	55 Skyline Champion Corp	3.425	0,32
	31.423	2,92	149 Identiv Inc	2.647	0,25	68 Taylor Morrison Home Corp 'A'	1.907	0,18
Getränke – 0,03 % (28. Februar 2021: 0,42 %)			251 IntriCon Corp	5.686	0,53	57 Toll Brothers Inc	3.645	0,34
439 Reed's Inc	294	0,03	285 Knowles Corp	5.705	0,53	112 Tri Pointe Homes Inc	2.672	0,25
Biotechnologie – 0,44 % (28. Februar 2021: 0,42 %)			154 Stoneridge Inc	3.574	0,33		28.104	2,61
75 Emergent BioSolutions Inc	4.760	0,44	335 Vishay Intertechnology Inc	7.358	0,68	Einrichtungsgegenstände – 0,97 % (28. Februar 2021: 0,40 %)		
Baustoffe — 1,96 % (28. Februar 2021: 3,78 %)				45.726	4,25	118 Ethan Allen Interiors Inc	2.822	0,26
133 Apogee Enterprises Inc	5.699	0,53	Technik und Bau – 2,93 % (28. Februar 2021: 2,60 %)			119 Herman Miller Inc	4.991	0,46
31 Gibraltar Industries Inc	2.290	0,21	112 Arcosa Inc	5.716	0,53	294 VIA Optronics AG ADR	2.661	0,25
201 Griffon Corp	4.859	0,45	71 Comfort Systems USA Inc	5.420	0,50		10.474	0,97
136 JELD-WEN Holding Inc	3.730	0,35	302 Concrete Pumping Holdings Inc	2.513	0,23	Haushaltswaren und -artikel – 0,24 % (28. Februar 2021: 0,27 %)		
284 LSI Industries Inc	2.361	0,22	94 Construction Partners Inc 'A'	3.156	0,29	61 Central Garden & Pet Co 'A'	2.540	0,24
100 PGT Innovations Inc	2.113	0,20	58 Frontdoor Inc	2.518	0,24	Versicherungen — 3,88 % (28. Februar 2021: 3,41 %)		
	21.052	1,96	355 Iteer Inc	2.028	0,19	142 Brighthouse Financial Inc	6.927	0,64
Chemikalien – 2,90 % (28. Februar 2021: 4,15 %)			203 Limbach Holdings Inc	1.606	0,15	56 HCI Group Inc	6.219	0,58
168 AdvanSix Inc	6.111	0,57	230 Mistras Group Inc	2.440	0,23	92 Heritage Insurance Holdings Inc	645	0,06
235 American Vanguard Corp	3.602	0,33	351 Orion Group Holdings Inc	1.913	0,18	242 MGIC Investment Corp	3.700	0,35
271 Huntsman Corp	7.178	0,67	163 Primoris Services Corp	4.196	0,39	194 NMI Holdings Inc 'A'	4.392	0,41
82 Intrepid Potash Inc	2.550	0,24		31.506	2,93	290 Old Republic International Corp	7.545	0,70
183 Kraton Corp	7.711	0,71	Unterhaltung – 0,14 % (28. Februar 2021: 0,55 %)			161 Radian Group Inc	3.806	0,35
192 Tronox Holdings Plc	4.062	0,38	36 Six Flags Entertainment Corp	1.529	0,14	93 Stewart Information Services Corp	5.824	0,54
	31.214	2,90				105 United Fire Group Inc	2.720	0,25
							41.778	3,88

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Stammaktien — (Fortsetzung)			Öl und Gas — 1,67 % (28. Februar 2021: 1,13 %)			Telekommunikation – 4,34 % (28. Februar 2021: 3,94 %)		
Internet – 1,40 % (28. Februar 2021: 0,98 %)			627 Baytex Energy Corp 1.079 0,10			533 A10 Networks Inc 7.405 0,69		
145 Cars.com Inc	1.849	0,17	79 Chesapeake Energy Corp	4.411	0,41	274 ADTRAN Inc	5.659	0,53
820 comScore Inc	3.187	0,30	479 Earthstone Energy Inc 'A'	3.960	0,37	109 Aviat Networks Inc	3.874	0,36
196 DHI Group Inc	879	0,08	199 Mammoth Energy Services Inc	688	0,06	553 CalAmp Corp	6.274	0,58
33 Eventbrite Inc	575	0,05	128 Matador Resources Co	3.681	0,34	533 Ceragon Networks Ltd	2.154	0,20
54 Overstock.com Inc	3.893	0,36	308 Southwestern Energy Co	1.401	0,13	338 DZS Inc	4.671	0,43
263 QuinStreet Inc	4.720	0,44	332 Trecora Resources	2.786	0,26	167 Frequency Electronics Inc	1.822	0,17
	15.103	1,40		18.006	1,67	660 Infinera Corp	5.599	0,52
Eisen/Stahl – 2,30 % (28. Februar 2021: 1,71 %)			Öl- und Gasdienstleistungen — 0,62 % (28. Februar 2021: 0,40 %)			50 InterDigital Inc 3.637 0,34		
366 Allegheny Technologies Inc	6.533	0,61	308 Archrock Inc 2.366 0,22			141 Ooma Inc 2.685 0,25		
160 Carpenter Technology Corp	5.333	0,49	168 Matrix Service Co 1.892 0,18			432 PCTEL Inc 2.868 0,27		
259 Cleveland-Cliffs Inc	6.071	0,56	94 Ranger Energy Services Inc 700 0,06					
210 Commercial Metals Co	6.845	0,64	197 US Silica Holdings Inc 1.733 0,16			46.648 4,34		
	24.782	2,30						
Unterkunft – 0,47 % (28. Februar 2021: 0,08 %)			Verpackung und Behälter – 0,43 % (28. Februar 2021: 0,26 %)			Textilien – 0,10 % (28. Februar 2021: 0,08 %)		
136 Century Casinos Inc	1.816	0,17	143 TriMas Corp 4.604 0,43			266 Dixie Group Inc/The 1.079 0,10		
207 Marcus Corp/The	3.239	0,30						
	5.055	0,47	Pharmazieunternehmen – 1,67 % (28. Februar 2021: 1,78 %)			Transport – 3,32 % (28. Februar 2021: 2,37 %)		
Maschinen – Bau und Bergbau – 0,68 % (28. Februar 2021: 0,55 %)			256 Option Care Health Inc 6.842 0,64			557 Ardmore Shipping Corp 1.936 0,18		
473 Babcock & Wilcox Enterprises Inc	3.452	0,32	169 Organon & Co 5.725 0,53			95 Atlas Air Worldwide Holdings Inc 6.975 0,65		
66 Hyster-Yale Materials Handling Inc	3.889	0,36	145 Owens & Minor Inc 5.419 0,50			281 Daseke Inc 2.652 0,25		
	7.341	0,68	17.986 1,67			551 Diana Shipping Inc 2.743 0,26		
Maschinen – diversifiziert – 1,70 % (28. Februar 2021: 0,92 %)			Immobilien — 0,37 % (28. Februar 2021: 0,28 %)			320 Dorian LPG Ltd 4.230 0,39		
198 CIRCOR International Inc	7.085	0,66	224 Realogy Holdings Corp 3.925 0,37			92 Hub Group Inc 'A' 6.459 0,60		
104 Ichor Holdings Ltd	4.623	0,43				331 Navigator Holdings Ltd 2.908 0,27		
351 Intevac Inc	1.803	0,17	Einzelhandel – 5,89 % (28. Februar 2021: 4,65 %)			319 Radiant Logistics Inc 2.188 0,20		
420 NN Inc	2.292	0,21	287 Barnes & Noble Education Inc 2.343 0,22			153 Scorpio Tankers Inc 2.478 0,23		
194 Power Solutions	969	0,09	87 BlueLinx Holdings Inc 5.009 0,47			355 US Xpress Enterprises Inc 3.104 0,29		
120 Twin Disc International Inc	1.501	0,14	100 Caleres Inc 2.438 0,23			35.673 3,32		
	18.273	1,70	225 Carrols Restaurant Group Inc 929 0,09			Summe Stammaktien (Kosten 841.769 USD) 961.343 89,34		
Medien – 0,86 % (28. Februar 2021: 0,12 %)			654 Chico's FAS Inc 3.377 0,31			Immobilieninvestmentgesellschaften — 3,67 % (28. Februar 2021: 3,37 %)		
364 Extravision Communications Corp	2.533	0,23	78 Chuy's Holdings Inc 2.522 0,24			REITS – 3,67 % (28. Februar 2021: 3,37 %)		
309 Houghton Mifflin Harcourt Co	4.162	0,39	234 Conn's Inc 5.741 0,53			181 ACRES Commercial Realty Corp 3.053 0,29		
83 Thryv Holdings Inc	2.568	0,24	285 Designer Brands Inc 4.134 0,38			270 Alexander & Baldwin Inc 5.633 0,52		
	9.263	0,86	17 Dillard's Inc 3.147 0,29			340 Armada Hoffer Properties Inc 4.572 0,43		
Metallerzeugung und Metallelemente – 1,30 % (28. Februar 2021: 0,69 %)			325 Express Inc 1.930 0,18			262 Braemar Hotels & Resorts Inc 1.317 0,12		
127 Northwest Pipe Co	3.296	0,31	137 Guess? Inc 3.310 0,31			68 CatchMark Timber Trust Inc 'A' 786 0,07		
92 Olympic Steel Inc	2.497	0,23	179 J Jill Inc 3.588 0,33			152 Chatham Lodging Trust 1.822 0,17		
127 Park-Ohio Holdings Corp	3.280	0,31	232 Kirkland's Inc 4.429 0,41			659 Diversified Healthcare Trust 2.474 0,23		
357 TimkenSteel Corp	4.875	0,45	222 Lumber Liquidators Holdings Inc 4.635 0,43			272 Kimco Realty Corp 5.920 0,55		
	13.948	1,30	279 Noodles & Co 'A' 3.516 0,33			385 Macerich Co/The 6.580 0,61		
Bergbau – 2,08 % (28. Februar 2021: 1,81 %)			129 Nordstrom Inc 3.687 0,34			30 Ryman Hospitality Properties Inc 2.500 0,23		
273 Century Aluminum Co	3.507	0,33	345 Regis Corp 1.868 0,17			288 Tanger Factory Outlet Centers Inc 4.814 0,45		
473 Coeur Mining Inc	3.336	0,31	154 Ruth's Hospitality Group Inc 3.147 0,29			39.471 3,67		
648 Ferroglobe Plc	5.382	0,50	35 Sonic Automotive Inc 'A' 1.792 0,17			Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 34.778 USD) 39.471 3,67		
314 Livent Corp	7.813	0,73	28 Victoria's Secret & Co 1.832 0,17			Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 929.400 USD) 1.053.667 97,92		
CAD 367 Major Drilling Group International Inc	2.320	0,21	63.374 5,89			Devisenterminkontrakte – 0,09 % (28. Februar 2021: 0,04 %)		
	22.358	2,08	Sparkassen — 0,34 % (28. Februar 2021: 0,17 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 965 0,09		
Diverse Fertigung – 2,81 % (28. Februar 2021: 2,29 %)			75 Axos Financial Inc 3.657 0,34			Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 1.054.632 98,01		
78 EnPro Industries Inc	6.671	0,62	Halbleiter – 5,25 % (28. Februar 2021: 5,31 %)			Devisenterminkontrakte — (0,04 %) (28. Februar 2021: 0,05 %)		
62 Fabrinet	6.360	0,59	211 Alpha & Omega Semiconductor Ltd 6.112 0,57			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (409) (0,04)		
189 Haynes International Inc	7.422	0,69	295 Amkor Technology Inc 8.097 0,75			Summe - Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten (409) (0,04)		
233 LiqTech International Inc	1.244	0,12	203 Amtech Systems Inc 2.098 0,19			Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 1.054.223 97,97		
329 LSB Industries Inc	2.717	0,25	162 CoHu Inc 5.772 0,54			Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen 21.812 2,03		
202 Trinity Industries Inc	5.855	0,54	143 CTS Corp 5.025 0,47			Gesamtnettvermögen \$1.076.035 100,00		
	30.269	2,81	135 FormFactor Inc 5.249 0,49					
Büro- und Büroausrüstung – 0,48 % (28. Februar 2021: 0,52 %)			Software — 2,70 % (28. Februar 2021: 3,77 %)					
693 Pitney Bowes Inc	5.176	0,48	284 Avaya Holdings Corp 5.738 0,53					
Büromöbel – 0,76 % (28. Februar 2021: 0,48 %)			187 Avid Technology Inc 4.831 0,45					
270 Interface Inc 'A'	3.885	0,36	183 Castlight Health Inc 332 0,03					
302 Steelcase Inc	4.248	0,40	341 Digi International Inc 7.487 0,70					
	8.133	0,76	117 Evolent Health Inc 'A' 2.877 0,27					
			215 Immersion Corp 1.614 0,15					
			363 Kaleya Inc 4.454 0,41					
			662 Zovio Inc 'A' 1.699 0,16					
			29.032 2,70					

- 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 %.

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

ABKÜRZUNGEN:

ADR	– Amerikanischer Hinterlegungsschein.
CAD	– Kanadischer Dollar

	% von Gesamt Vermögen
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,27
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,87
Finanzderivate	0,09
Sonstige Vermögenswerte	2,77
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	17.975	Verkauf	BRL 94.278	\$ (257)
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf	BRL	93.278	Verkauf	USD 17.887	153
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf	BRL	1.000	Verkauf	USD 196	(3)
03.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	218	Verkauf	USD 159	1
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	944	Verkauf	AUD 1.306	(11)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	626	Verkauf	AUD 852	2
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	522	Verkauf	CNH 3.388	(3)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	4.368	Verkauf	EUR 3.717	(25)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	7	Verkauf	GBP 5	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	23	Verkauf	GBP 16	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	219	Verkauf	PLN 855	(4)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	7	Verkauf	SEK 61	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	294	Verkauf	SEK 2.572	(2)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	2.626	Verkauf	SGD 3.565	(26)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SEK	4.813	Verkauf	USD 555	3
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SEK	83	Verkauf	USD 10	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SGD	41.807	Verkauf	USD 30.851	242
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CNH	49.905	Verkauf	USD 7.682	39
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	1.119	Verkauf	USD 813	5
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	PLN	28.585	Verkauf	USD 7.351	113
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	44.776	Verkauf	USD 52.687	203
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	19.564	Verkauf	USD 14.386	(72)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP	553	Verkauf	USD 768	(6)
01.10.2021	BNY Mellon	Kauf	BRL	90.605	Verkauf	USD 17.242	204
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 503 USD)							\$ 965
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (611) USD)							(409)
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (108) USD)							\$ 556

Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,96 % (28. Februar 2021: 3,34 %)			Technik und Bau – 3,13 % (28. Februar 2021: 2,61 %)			Halbleiter – 12,26 % (28. Februar 2021: 10,27 %)		
12 iShares Russell 2000 Value ETF - ETF	1.936	1,95	36 Arcosa Inc	1.813	1,82	19 CMC Materials Inc	2.574	2,59
1,004 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	1.004	1,01	86 Great Lakes Dredge & Dock Corp	1.299	1,31	77 Cohu Inc	2.731	2,75
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 2.686 USD)	2.940	2,96		3.112	3,13	32 Kulicke & Soffa Industries Inc	2.251	2,26
Stammaktien – 97,19 % (28. Februar 2021: 95,57 %)			Gesundheitsprodukte – 4,38 % (28. Februar 2021: 3,73 %)			16 MKS Instruments Inc	2.392	2,41
Bekleidung – 1,42 % (28. Februar 2021: 2,22 %)			3 Bio-Techne Corp	1.338	1,35	14 Nova Ltd	1.391	1,40
39 Wolverine World Wide Inc	1.406	1,42	117 Meridian Bioscience Inc	2.360	2,38	11 Onto Innovation Inc	847	0,85
Autoteile und Ausrüstung – 5,78 % (28. Februar 2021: 5,32 %)			25 Natus Medical Inc	649	0,65		12.186	12,26
48 Gentex Corp	1.469	1,48	Wohnungsbauunternehmen – 1,84 % (28. Februar 2021: 2,30 %)			Software – 3,69 % (28. Februar 2021: 3,68 %)		
97 Meritor Inc	2.300	2,31	7 LCI Industries	986	0,99	13 J2 Global Inc	1.780	1,79
53 Miller Industries Inc/TN	1.974	1,99	13 Skyline Champion Corp	840	0,85	43 Simulations Plus Inc	1.888	1,90
	5.743	5,78		1.826	1,84		3.668	3,69
Baumaterialien – 4,25 % (28. Februar 2021: 4,64 %)			Versicherungen – 1,55 % (28. Februar 2021: 2,44 %)			Textilien – 0,55 % (28. Februar 2021: 0,56 %)		
32 Gibraltar Industries Inc	2.414	2,43	14 RLI Corp	1.541	1,55	2 UniFirst Corp/MA	547	0,55
16 Patrick Industries Inc	1.286	1,29	Internet – 0,98 % (28. Februar 2021: 1,00 %)			Transport – 2,04 % (28. Februar 2021: 2,72 %)		
CAD 15 Stella-Jones Inc	527	0,53	38 ChannelAdvisor Corp	974	0,98	12 Landstar System Inc	2.029	2,04
	4.227	4,25	Freizeit – 2,09 % (28. Februar 2021: 2,74 %)			Summe Stammaktien (Kosten 80.502 USD)		
Chemikalien – 2,46 % (28. Februar 2021: 1,89 %)			83 MasterCraft Boat Holdings Inc	2.078	2,09		96.582	97,19
9 Innospec Inc	851	0,85	Unterkunft – 2,37 % (28. Februar 2021: 1,39 %)			Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 83.188 USD)		
6 Quaker Chemical Corp	1.596	1,61	176 Century Casinos Inc	2.353	2,37		99.522	100,15
	2.447	2,46	Maschinen – diversifiziert – 3,94 % (28. Februar 2021: 4,18 %)			Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
Gewerbliche Dienstleistungen – 10,92 % (28. Februar 2021: 9,16 %)			39 Colfax Corp	1.889	1,90	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
18 Cass Information Systems Inc	799	0,80	10 Kadant Inc	2.026	2,04		1	–
136 Computer Task Group Inc	1.177	1,18		3.915	3,94	Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
42 Forrester Research Inc	2.007	2,02	Metallherstellung und -elemente – 0,86 % (28. Februar 2021: 1,06 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
64 Heidrick & Struggles International Inc	2.749	2,77	33 Northwest Pipe Co	852	0,86		–	–
32 Korn Ferry	2.266	2,28	Diverse Fertigung – 5,12 % (28. Februar 2021: 5,33 %)			Summe - Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		
37 Vectrus Inc	1.854	1,87	26 ESCO Technologies Inc	2.318	2,33		–	–
	10.852	10,92	8 Fabrinet	774	0,78	Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Computer – 1,59 % (28. Februar 2021: 3,34 %)			14 John Bean Technologies Corp	1.998	2,01		99.523	100,15
15 Insight Enterprises Inc	1.576	1,59		5.090	5,12	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
Kosmetika und Körperpflege – 2,04 % (28. Februar 2021: 2,25 %)			Öl- und Gasdienstleistungen – 2,01 % (28. Februar 2021: 2,88 %)			(153)		
28 Inter Parfums Inc	2.032	2,04	CAD 307 Pason Systems Inc	1.993	2,01	Gesamtnettvermögen		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 7,05 % (28. Februar 2021: 6,81 %)			Verpackung und Behälter – 0,83 % (28. Februar 2021: 0,55 %)			\$99.370		
48 Air Lease Corp 'A'	1.903	1,92	12 UFP Technologies Inc	824	0,83	100,00		
20 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	1.037	1,04	Pharmazieunternehmen – 1,89 % (28. Februar 2021: 0,48 %)					
66 GCM Grosvenor Inc	735	0,74	147 Catalyst Pharmaceuticals Inc	809	0,81			
18 Houlihan Lokey Inc 'A'	1.662	1,67	32 Harmony Biosciences Holdings Inc	1.072	1,08			
35 Lazard Ltd 'A'	1.671	1,68		1.881	1,89			
	7.008	7,05	Immobilien – 3,66 % (28. Februar 2021: 3,23 %)					
Elektrische Komponenten und Zubehör – 1,17 % (28. Februar 2021: 0,83 %)			127 Kennedy-Wilson Holdings Inc	2.792	2,81			
42 nLight Inc	1.166	1,17	22 Marcus & Millichap Inc	849	0,85			
Elektronik – 6,04 % (28. Februar 2021: 6,45 %)				3.641	3,66			
21 FARO Technologies Inc	1.469	1,48	Einzelhandel – 1,28 % (28. Februar 2021: 0,78 %)					
74 Kimball Electronics Inc	1.778	1,79	20 Movado Group Inc	722	0,73			
74 Vishay Intertechnology Inc	1.625	1,64	101 Regis Corp	545	0,55			
30 Vishay Precision Group Inc	1.129	1,13		1.267	1,28			
	6.001	6,04						

- 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:

ETF – Börsengehandelter Fonds (Exchange Traded Fund).
CAD – Kanadischer Dollar

	% von Gesamt Vermögen
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,61
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,94
Finanzderivate	–
Sonstige Vermögenswerte	0,45
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
		Kauf	USD		Verkauf	EUR		\$	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	8	Verkauf	EUR	7	\$	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SEK	3		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SEK	4	Verkauf	USD	–		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SEK	75	Verkauf	USD	9		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	235	Verkauf	USD	277		1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 3 USD)								\$	1
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (3) USD)									–
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): – USD)								\$	1

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts		
Stammaktien - 97,27 % (28. Februar 2021: 98,10 %)			8 NN Group NV			339			1,12	
Australien - 2,96 % (28. Februar 2021: 2,84 %)			4 Wolters Kluwer NV			433			1,42	
GBP	14 BHP Group Plc	356				1.283			4,23	
GBP	9 Rio Tinto Plc	540								
		896							2,96	
Belgien - 2,98 % (28. Februar 2021: 1,82 %)			Norwegen - 1,22 % (28. Februar 2021: 1,33 %)			370			1,22	
	7 Ageas SA/NV	296				24 Galp Energia SGPS SA			207	0,68
	6 Etablissements Franz Colruyt NV	298				Portugal - 0,68 % (28. Februar 2021: 1,08 %)				
	10 Telenet Group Holding NV	310				24 Red Electrica Corp SA			403	1,33
		904				65 Telefonica SA			274	0,90
									1.362	4,49
Brasilien - 1,07 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Russland - 1,23 % (28. Februar 2021: 1,89 %)			373			1,23	
NOK	8 Yara International ASA	323				Spanien - 4,49 % (28. Februar 2021: 4,84 %)				
Dänemark - 5,19 % (28. Februar 2021: 6,08 %)			Schweden - 6,73 % (28. Februar 2021: 4,31 %)			280			0,92	
DKK	3 Coloplast A/S	419				SEK 10 ICA Gruppen AB			404	1,33
DKK	10 Novo Nordisk A/S	833				SEK 25 Securitas AB			356	1,18
DKK	3 SimCorp A/S	322				SEK 37 Skandinaviska Enskilda Banken AB			424	1,40
		1.574				SEK 27 Swedish Match AB			208	0,69
						SEK 37 Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'			367	1,21
Finnland - 5,80 % (28. Februar 2021: 4,52 %)			Schweiz - 15,06 % (28. Februar 2021: 20,27 %)			250			0,82	
	11 Kesko Oyj	385				CHF 3 Banque Cantonale Vaudoise			370	1,22
	5 Kone Oyj 'B'	384				CHF 6 Galenica AG, 144A				
SEK	48 Nordea Bank Abp	473				CHF 1 Kuehne + Nagel International AG			402	1,33
	7 Orion Oyj	241				CHF 4 Logitech International SA			356	1,17
	8 Valmet Oyj	276				CHF 8 Nestle SA			839	2,77
		1.759				CHF 11 Novartis AG			854	2,82
						CHF 3 Roche Holding AG			1.075	3,55
						CHF - SGS SA			418	1,38
									4.564	15,06
Frankreich - 10,71 % (28. Februar 2021: 9,51 %)			Großbritannien - 21,53 % (28. Februar 2021: 20,05 %)			429			1,42	
	23 Carrefour SA	386				GBP 10 Admiral Group Plc			265	0,87
	5 Cie de Saint-Gobain	295				GBP 77 BP Plc			333	1,10
	35 Eutelsat Communications SA	341				GBP 10 British American Tobacco Plc			420	1,39
	38 Orange SA	369				GBP 14 Bunzl Plc			288	0,95
	5 Publicis Groupe SA	273				GBP 4 DCC Plc				
	14 Quadient SA	339				GBP 115 Direct Line Insurance Group Plc			414	1,37
	8 Sanofi	658				GBP 31 GlaxoSmithKline Plc			533	1,76
	2 SEB SA	267				GBP 15 Hargreaves Lansdown Plc			269	0,89
	3 Vinci SA	317				GBP 37 IG Group Holdings Plc			407	1,34
		3.245				GBP 20 Imperial Brands Plc			362	1,19
						GBP 98 J Sainsbury Plc			347	1,15
						GBP 95 Kingfisher Plc			386	1,27
						GBP 566 Lloyds Banking Group Plc			287	0,95
						GBP 10 Persimmon Plc			326	1,07
						GBP 29 Sage Group Plc/The			252	0,83
						GBP 29 Tate & Lyle Plc			240	0,79
						GBP 10 Unilever Plc			475	1,57
						GBP 346 Vodafone Group Plc			492	1,62
									6.525	21,53
Deutschland - 9,92 % (28. Februar 2021: 11,28 %)			Vereinigte Staaten - 1,37 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			414			1,37	
	3 Allianz SE	536				CHF 5 Swiss Re AG				
	9 Deutsche Post AG	545				Summe Stammaktien (Kosten 28.426 EUR)			29.477	97,27
	2 Hannover Rueck SE	299				Vorzugsaktien - 1,20 % (28. Februar 2021: 0,00 %)				
	1 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	304				Deutschland - 1,20 % (28. Februar 2021: 0,00 %)				
	6 SAP SE	768				2 Volkswagen AG			362	1,20
	10 TAG Immobilien AG	287				Summe Vorzugsaktien (Kosten 402 EUR)			362	1,20
	112 Telefonica Deutschland Holding AG	266				Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 28.828 EUR)			29.839	98,47
		3.005				Devisenterminkontrakte - 0,02 % (28. Februar 2021: 0,02 %)				
						Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			6	0,02
Italien - 0,99 % (28. Februar 2021: 2,24 %)			Schweden - 6,73 % (28. Februar 2021: 4,31 %)			280			0,92	
	60 Snam SpA	299				SEK 10 ICA Gruppen AB			404	1,33
Jordanien - 1,11 % (28. Februar 2021: 1,01 %)			Schweiz - 15,06 % (28. Februar 2021: 20,27 %)			356			1,18	
GBP	11 Hikma Pharmaceuticals Plc	335				SEK 37 Skandinaviska Enskilda Banken AB			424	1,40
Niederlande - 4,23 % (28. Februar 2021: 3,56 %)			Schweden - 6,73 % (28. Februar 2021: 4,31 %)			208			0,69	
	18 Koninklijke Ahold Delhaize NV	511				SEK 37 Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'			367	1,21
									2.039	6,73
						Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			29.845	98,49
						Devisenterminkontrakte - (0,14 %) (28. Februar 2021: (0,04 %))				
						Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(42)	(0,14)
						Summe - Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten			(42)	(0,14)
						Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			29.803	98,35
						Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			500	1,65
						Gesamtvermögen			€ 30.303	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 370.000 EUR und machten 1,22 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

- CHF - Schweizer Franken
- DKK - Dänische Krone
- GBP - Britisches Pfund Sterling
- NOK - Norwegische Krone
- SEK - Schwedische Kronen

	% von Gesamt Vermögen
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,90
Finanzderivate	0,02
Sonstige Vermögenswerte	2,08
Gesamtvermögen	100,00

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	AUD	–	€	–
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	SGD	2		–
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–		–
03.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	135	Verkauf	USD	159		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	15	Verkauf	AUD	24		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	CNH	5		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	7.532	Verkauf	EUR	6.406		(28)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SGD	142	Verkauf	EUR	88		1
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	PLN	1.888	Verkauf	EUR	413		5
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CNH	849	Verkauf	EUR	111		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	1	Verkauf	EUR	1		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	2.459	Verkauf	EUR	1.537		(14)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	10	Verkauf	SGD	16		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR	201	Verkauf	USD	236		–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 7 EUR)								€	6
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (15) EUR))									(42)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (8) EUR))								€	(36)

Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,61 % (28. Februar 2021: 0,00 %)			Indonesien – 2,39 % (28. Februar 2021: 2,29 %)			Devisentermingeschäfte - (0,05 %) (28. Februar 2021: (0,09 %))		
5 iShares MSCI All Country Asia ex Japan ETF – ETF	473	1,61	IDR 761 Indofood Sukses Makmur Tbk PT	330	1,12	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 476 USD)	473	1,61	IDR 1.574 Telkom Indonesia Persero Tbk PT	375	1,27	Summe - Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		
Stammaktien — 95,82 % (28. Februar 2021: 97,28 %)			Malaysia - 2,88 % (28. Februar 2021: 2,93 %)			Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Australien – 5,32 % (28. Februar 2021: 4,66 %)			MYR 1.389 Astro Malaysia Holdings Bhd			29,228		
AUD 127 Aurizon Holdings Ltd	350	1,19	MYR 75 Malayan Banking Bhd	151	0,51	Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
AUD 7 JB Hi-Fi Ltd	217	0,74	MYR 250 RHB Bank Bhd	336	1,14	227		
AUD 32 McMillan Shakespeare Ltd	290	0,99		850	2,88	Gesamtnettovermögen		
AUD 119 Orora Ltd	296	1,00	Pakistan – 0,70 % (28. Februar 2021: 0,78 %)			\$29,455		
AUD 5 Rio Tinto Ltd	413	1,40	PKR 208 MCB Bank Ltd	206	0,70	100,00		
	1.566	5,32	Philippinen – 2,71 % (28. Februar 2021: 2,11 %)					
China – 32,02 % (28. Februar 2021: 34,16 %)			PHP 677 Aboltiz Power Corp			380		
HKD 1,100 Bank of China Ltd	385	1,31	PHP 8 Globe Telecom Inc	417	1,42	144A		
HKD 637 Bank of Communications Co Ltd	366	1,24		797	2,71	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.364.000 USD und machten 4,63 % des Nettovermögens aus.		
HKD 1,912 CGN Power Co Ltd, 144A	422	1,43	Singapur – 0,82 % (28. Februar 2021: 0,86 %)			ABKÜRZUNGEN:		
HKD 510 China CITIC Bank Corp Ltd	234	0,79	SGD 17 Jardine Cycle & Carriage Ltd	243	0,82	ADR – American Depositary Receipt.		
HKD 574 China Communications Services Corp Ltd	304	1,03	Südkorea – 12,92 % (28. Februar 2021: 12,32 %)			ETF – Börsengehandelter Fonds (Exchange Traded Fund)		
HKD 878 China Construction Bank Corp	632	2,15	KRW 10 GS Retail Co Ltd	306	1,04	NVDR – Non Voting Depository Receipt.		
HKD 200 China Medical System Holdings Ltd	392	1,33	KRW 4 Hansol Paper Co Ltd	68	0,23	AUD – Australischer Dollar		
HKD 81 China Pacific Insurance Group Co Ltd	229	0,78	KRW 6 KB Financial Group Inc	269	0,91	HKD – Hongkong-Dollar		
HKD 734 China Railway Group Ltd	351	1,19	KRW 25 KT Corp ADR	356	1,21	IDR – Indonesische Rupiah		
HKD 203 China Shenhua Energy Co Ltd	449	1,52	KRW 6 KT&G Corp	429	1,46	INR – Indische Rupie		
HKD 63 China Vanke Co Ltd	170	0,58	KRW 30 LG Uplus Corp	359	1,22	KRW – Südkoreanischer Won		
HKD 358 China Yuhua Education Corp Ltd, 144A	191	0,65	KRW 24 Samsung Electronics Co Ltd	1.562	5,30	MYR – Malaysischer Ringgit		
HKD 497 CITIC Ltd	616	2,09	KRW 2 SK Telecom Co Ltd	457	1,55	PHP – Philippinischer Peso		
HKD 1,147 CITIC Telecom International Holdings Ltd	397	1,35		3.806	12,92	PKR – Pakistan Rupie		
HKD 725 Dali Foods Group Co Ltd, 144A	405	1,38	Taiwan – 16,37 % (28. Februar 2021: 18,14 %)			SGD – Singapur-Dollar		
HKD 127 EEKA Fashion Holdings Ltd	171	0,58	TWD 220 Asia Cement Corp	356	1,21	THB – Thailändischer Baht		
HKD 365 Far East Horizon Ltd	414	1,41	TWD 14 Asustek Computer Inc	163	0,55	TWD – Taiwanesischer Dollar		
HKD 338 Fu Shou Yuan International Group Ltd	305	1,04	TWD 51 Chicony Electronics Co Ltd	144	0,49			
HKD 54 Hengan International Group Co Ltd	312	1,06	TWD 308 Kindom Development Co Ltd	470	1,60			
HKD 370 PICC Property & Casualty Co Ltd	334	1,13	TWD 200 Lite-On Technology Corp	440	1,49			
HKD 480 Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	346	1,17	TWD 30 Micro-Star International Co Ltd	141	0,48			
HKD 184 Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd	364	1,24	TWD 58 Pacific Hospital Supply Co Ltd	151	0,51			
HKD 503 Sinopec Engineering Group Co Ltd	266	0,90	TWD 14 Poya International Co Ltd	255	0,87			
HKD 190 Tingyi Cayman Islands Holding Corp	338	1,15	TWD 350 SinoPac Financial Holdings Co Ltd	180	0,61			
HKD 344 Uni-President China Holdings Ltd	350	1,19	TWD 137 Synnex Technology International Corp	265	0,90			
HKD 374 Yuexiu Property Co Ltd	350	1,19	TWD 80 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.753	5,95			
HKD 616 Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	364	1,23	TWD 193 Uni-President Enterprises Corp	503	1,71			
	9.431	32,02		4.821	16,37			
Hongkong – 9,54 % (28. Februar 2021: 10,61 %)			Thailand – 1,00 % (28. Februar 2021: 1,01 %)					
HKD 68 AIA Group Ltd	808	2,74	THB 101 Tisco Financial Group PCL, NVDR	294	1,00			
HKD 43 CLP Holdings Ltd	430	1,46	Summe Stammaktien (Kosten 28.418 USD)			28,224		
HKD 1.026 Giordano International Ltd	219	0,75	Immobilieninvestmentgesellschaft — 1,70 % (28. Februar 2021: 1,45 %)			95,82		
HKD 81 Hysan Development Co Ltd	289	0,98	Australien – 0,99 % (28. Februar 2021: 0,87 %)					
HKD 68 Luk Fook Holdings International Ltd	188	0,64	AUD 76 Charter Hall Long Wale REIT	291	0,99			
HKD 271 Stella International Holdings Ltd	361	1,23	Hongkong – 0,71 % (28. Februar 2021: 0,58 %)					
HKD 34 VTech Holdings Ltd	334	1,13	HKD 194 Fortune Real Estate Investment Trust	210	0,71			
HKD 89 Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	181	0,61	Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 511 USD)			501		
	2.810	9,54	Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 29.405 USD)			29,198		
Indien – 9,15 % (28. Februar 2021: 7,41 %)			Devisenterminkontrakte – 0,15 % (28. Februar 2021: 0,13 %)					
INR 28 HCL Technologies Ltd	450	1,53	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			43		
INR 31 Infosys Ltd	715	2,43	Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			29,241		
INR 1,269 NHPC Ltd	469	1,59				99,28		
INR 180 Power Grid Corp of India Ltd	432	1,47						
INR 182 REC Ltd	377	1,28						
INR 61 Vedanta Ltd	252	0,85						
	2.695	9,15						

Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	AUD	–	\$	–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	8	Verkauf	AUD	11		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	CNH	7		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	–		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	SGD	47	Verkauf	USD	35		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	PLN	10.464	Verkauf	USD	2.691		42
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	CNH	1.423	Verkauf	USD	219		1
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	–	Verkauf	USD	–		–
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	AUD	3.513	Verkauf	USD	2.583		(13)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 43 USD)								\$	43
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): (29) USD)									(13)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 14 USD)								\$	30

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[⌘]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts		
Stammaktien - 0,00 % (28. Februar 2021: 97,68 %)			ABKÜRZUNGEN:	
Griechenland - 0,00 % (28. Februar 2021: 0,66 %)			EUR	- Euro
EUR	1	FF Group †	HKD	- Hongkong-Dollar
Hongkong - 0,00 % (28. Februar 2021: 0,67 %)				
HKD	38	Hanergy Mobile Energy Holding Group Co.Ltd †		% von Gesamt
Summe Stammaktien (Kosten 44 USD)			Analyse des Gesamtvermögens	
			Vermögen	
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten			Sonstige Vermögenswerte	
			100,00	
Gesamtvermögen			Gesamtvermögen	
			100,00	
Gesamtvermögen				
			\$-	

- 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 %.

† Nicht liquide.

⌘ Mit Wirkung zum 14. April 2021 hat der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund den Handel eingestellt.

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	
Stammaktien - 99,53 % (28. Februar 2021: 94,92 %)			EUR	5 Endesa SA	125	1,04			
Australien - 2,01 % (28. Februar 2021: 2,47 %)			EUR	5 Naturgy Energy Group SA	130	1,09			
AUD	47 Aurizon Holdings Ltd	128	1,06	EUR	7 Red Electrica Corp SA	145	1,20		
AUD	1 Rio Tinto Ltd	114	0,95			516	4,30		
		242	2,01	Schweden - 0,55 % (28. Februar 2021: 0,47 %)					
Österreich - 1,24 % (28. Februar 2021: 1,28 %)			SEK	3 Swedbank AB	66	0,55			
EUR	3 Oesterreichische Post AG	148	1,24	Schweiz - 2,94 % (28. Februar 2021: 3,72 %)					
Kanada - 2,69 % (28. Februar 2021: 2,75 %)			CHF	1 Logitech International SA	123	1,02			
CAD	2 Canadian Imperial Bank of Commerce	184	1,53	CHF	1 Roche Holding AG	231	1,92		
CAD	5 Canadian Utilities Ltd	139	1,16			354	2,94		
		323	2,69	Taiwan - 6,98 % (28. Februar 2021: 6,29 %)					
China - 4,88 % (28. Februar 2021: 4,24 %)			TWD	85 Asia Cement Corp	138	1,14			
HKD	266 China Petroleum & Chemical Corp	128	1,07	TWD	113 King Yuan Electronics Co Ltd	185	1,54		
HKD	57 Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	115	0,95	TWD	54 Lite-On Technology Corp	119	0,99		
HKD	102 CITIC Ltd	127	1,05	TWD	39 Quanta Computer Inc	110	0,92		
HKD	252 Huishang Bank Corp Ltd †	84	0,70	TWD	39 Radiant Opto-Electronics Corp	139	1,16		
HKD	183 Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	133	1,11	TWD	13 Simplo Technology Co Ltd	148	1,23		
		587	4,88			839	6,98		
Finnland - 0,90 % (28. Februar 2021: 0,86 %)			Türkei - 1,05 % (28. Februar 2021: 0,87 %)						
EUR	3 Orion Oyj	108	0,90	TRY	56 Ereğli Demir ve Çelik Fabrikalari TAS	127	1,05		
Frankreich - 1,47 % (28. Februar 2021: 1,37 %)			Großbritannien - 4,12 % (28. Februar 2021: 3,66 %)						
EUR	2 Sanofi	176	1,47	GBP	39 Direct Line Insurance Group Plc	168	1,39		
Deutschland - 3,87 % (28. Februar 2021: 3,60 %)			GBP	7 GlaxoSmithKline Plc	148	1,23			
EUR	8 Deutsche Telekom AG	169	1,41	GBP	6 Imperial Brands Plc	118	0,98		
EUR	1 Muenchener Rueckversicherungs Gesellschaft AG in Muenchen	173	1,44	GBP	17 Legal & General Group Plc	62	0,52		
EUR	3 Talanx AG	123	1,02			496	4,12		
		465	3,87	Vereinigte Staaten - 48,68 % (28. Februar 2021: 40,71 %)					
Hongkong - 1,08 % (28. Februar 2021: 2,03 %)			1 3M Co	140	1,17				
HKD	13 CLP Holdings Ltd	130	1,08	2 AbbVie Inc	213	1,77			
Japan - 8,31 % (28. Februar 2021: 10,96 %)			3 AES Corp/The	141	1,17				
JPY	1 Daito Trust Construction Co Ltd	110	0,91	3 Altria Group Inc	140	1,16			
JPY	5 KDDI Corp	159	1,32	1 Amgen Inc	177	1,47			
JPY	16 Marubeni Corp	126	1,05	6 AT&T Inc	167	1,39			
JPY	16 Mitsubishi Chemical Holdings Corp	140	1,17	3 Bristol-Myers Squibb Co - Broadcom Inc	187	1,56			
JPY	- Nintendo Co Ltd	144	1,20	2 Cardinal Health Inc	95	0,79			
JPY	7 Nippon Telegraph & Telephone Corp	176	1,47	4 Cisco Systems Inc/Delaware	236	1,96			
JPY	11 SoftBank Corp	143	1,19	1 Clorox Co/The	118	0,98			
		998	8,31	2 CVS Health Corp	181	1,51			
Malaysia - 1,80 % (28. Februar 2021: 1,59 %)			5 Flowers Foods Inc	123	1,02				
MYR	428 Astro Malaysia Holdings Bhd	111	0,93	2 General Mills Inc	127	1,06			
MYR	52 Malayan Banking Bhd	105	0,87	3 Gilead Sciences Inc	191	1,59			
		216	1,80	7 H&R Block Inc	174	1,45			
Niederlande - 1,35 % (28. Februar 2021: 1,00 %)			1 Hershey Co/The	151	1,26				
EUR	5 Koninklijke Ahold Delhaize NV	163	1,35	8 Hewlett Packard Enterprise Co - Home Depot Inc/The	121	1,00			
Russland - 1,31 % (28. Februar 2021: 0,87 %)			5 HP Inc	161	1,34				
EUR	19 Gazprom PJSC ADR	158	1,31	3 Intel Corp	173	1,44			
Spanien - 4,30 % (28. Februar 2021: 3,81 %)			1 International Business Machines Corp	175	1,46				
EUR	5 Enagas SA	116	0,97	3 International Paper Co	156	1,30			
				1 J M Smucker Co/The	124	1,03			
				1 Johnson & Johnson	208	1,73			
				1 Kimberly-Clark Corp	125	1,04			
				4 Kroger Co/The	175	1,45			
				- Lockheed Martin Corp	163	1,36			
				1 Microsoft Corp	181	1,51			
				- Northrop Grumman Corp	154	1,28			
				5 Pfizer Inc	243	2,02			
				1 Prudential Financial Inc	148	1,23			
				1 Swiss Re AG	137	1,14			
				1 Target Corp	205	1,70			
				3 Walgreens Boots Alliance Inc	157	1,31			
				1 Walmart Inc	170	1,42			
					5.852	48,68			
					11.964	99,53			
			Summe Stammaktien (Kosten 10.293 USD)						

Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 10.293 USD)			11.964	99,53
Devisenterminkontrakte - 0,01 % (28. Februar 2021: 0,04 %)				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			-	0,01
Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			11.964	99,54
Devisenterminkontrakte - (0,03 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			(3)	(0,03)
Summe - Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten			(3)	(0,03)
Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			11.961	99,51
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen			60	0,49
Gesamtnettovermögen			\$12.021	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 133.000 USD und machten 1,11 % des Nettovermögens aus.

† Illiquide

ABKÜRZUNGEN:

ADR	- Amerikanischer Hinterlegungsschein.
AUD	- Australischer Dollar
CAD	- Kanadischer Dollar
CHF	- Schweizer Franken
EUR	- Euro
GBP	- Britisches Pfund Sterling
HKD	- Hongkong-Dollar
JPY	- Japanischer Yen
MYR	- Malaysischer Ringgit
SEK	- Schwedische Krone
SGD	- Singapur-Dollar
TRY	- Türkische Lira
TWD	- Taiwanesischer Dollar

Analyse des Gesamtvermögens			% von Gesamt Vermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden			98,96
Sonstige Vermögenswerte			1,04
Gesamtvermögen			100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD 3	Verkauf AUD 3	\$ -
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf USD -	Verkauf SGD -	-
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf SGD 76	Verkauf USD 56	-
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf AUD 853	Verkauf USD 628	(3)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 5 USD)				\$ -
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): - USD)				(3)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 5 USD)				\$ (3)

Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Stammaktien - 96,63 % (28. Februar 2021: 96,27 %)			Singapur - 10,01 % (28. Februar 2021: 8,92 %)		
China - 36,10 % (28. Februar 2021: 37,92 %)			Südkorea - 16,49 % (28. Februar 2021: 17,83 %)		
HKD 210 Alibaba Group Holding Ltd	4.386	5,31	SGD 864 Singapore Technologies Engineering Ltd	2.423	2,94
HKD 1.920 CSPC Pharmaceutical Group Ltd	2.434	2,95	SGD 190 United Overseas Bank Ltd	3.601	4,36
HKD 211 ENN Energy Holdings Ltd	4.176	5,05	SGD 158 Venture Corp Ltd	2.241	2,71
HKD 1.618 Guangdong Investment Ltd	2.245	2,72		8.265	10,01
HKD 688 Minth Group Ltd	2.853	3,45	Taiwan - 11,10 % (28. Februar 2021: 10,18 %)		
HKD 259 Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2.005	2,43	KRW 3 LG Chem Ltd	2.125	2,57
HKD 113 Shenzhou International Group Holdings Ltd	2.455	2,97	KRW 2 LG Household & Health Care Ltd	2.396	2,90
HKD 92 Tencent Holdings Ltd	5.698	6,90	KRW 22 Orion Corp/Republic of Korea	2.365	2,87
HKD 742 Tongcheng-Elong Holdings Ltd	1.728	2,09	KRW 102 Samsung Electronics Co Ltd	6.733	8,15
HKD 982 TravelSky Technology Ltd	1.838	2,23		13.619	16,49
	29.818	36,10	Taiwan - 11,10 % (28. Februar 2021: 10,18 %)		
Hongkong - 10,49 % (28. Februar 2021: 8,84 %)			TWD 241 Feng TAY Enterprise Co Ltd	1.871	2,26
HKD 318 AIA Group Ltd	3.801	4,60	TWD 333 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	7.299	8,84
29 Jardine Matheson Holdings Ltd	1.577	1,91		9.170	11,10
HKD 149 Techtronic Industries Co Ltd	3.291	3,98	Summe Stammaktien (Kosten 65.945 USD)		
	8.669	10,49		79.819	96,63
Indien - 12,44 % (28. Februar 2021: 12,58 %)			Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
INR 197 HDFC Bank Ltd	4.245	5,14		79.819	96,63
INR 72 Hero MotoCorp Ltd	2.705	3,27	Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
INR 64 Tata Consultancy Services Ltd	3.328	4,03		79.819	96,63
	10.278	12,44	Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
				2.781	3,37
			Gesamtnettvermögen		
				\$82.600	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 %.

ABKÜRZUNGEN:

HKD	-	Hongkong-Dollar
INR	-	Indische Rupie
KRW	-	Südkoreanischer Won
SGD	-	Singapur-Dollar
TWD	-	Taiwanesischer Dollar

Analyse des Gesamtvermögens

	% von Gesamt Vermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,41
Sonstige Vermögenswerte	3,59
Gesamtvermögen	100,00

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Stammaktien - 99,42 % (28. Februar 2021: 94,80 %)		
Australien - 2,74 % (28. Februar 2021: 2,74 %)		
AUD	18 CSL Ltd	4.147 2,74
China - 7,89 % (28. Februar 2021: 9,84 %)		
	15 Alibaba Group Holding Ltd	
ADR		2.589 1,71
HKD	56 Tencent Holdings Ltd	3.445 2,28
HKD	382 Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	5.912 3,90
		11.946 7,89
Dänemark - 2,80 % (28. Februar 2021: 2,76 %)		
DKK	24 Coloplast A/S	4.240 2,80
Frankreich - 6,66 % (28. Februar 2021: 5,86 %)		
EUR	5 Kering SA	4.296 2,83
EUR	12 L'Oreal SA	5.796 3,83
		10.092 6,66
Deutschland - 2,58 % (28. Februar 2021: 2,85 %)		
EUR	11 adidas AG	3.910 2,58
Hongkong - 2,67 % (28. Februar 2021: 3,16 %)		
HKD	338 AIA Group Ltd	4.042 2,67
Irland - 7,68 % (28. Februar 2021: 6,00 %)		
EUR	27 Kerry Group Plc	3.906 2,58
EUR	68 Kingspan Group Plc	7.722 5,10
		11.628 7,68
Italien - 6,16 % (28. Februar 2021: 6,43 %)		
EUR	19 Ferrari NV	4.029 2,66
EUR	82 Moncler SpA	5.306 3,50
		9.335 6,16
Schweden - 11,27 % (28. Februar 2021: 9,66 %)		
SEK	145 Assa Abloy AB	4.669 3,08
SEK	95 Atlas Copco AB	6.542 4,32
SEK	337 Hexagon AB	5.855 3,87
		17.066 11,27
Taiwan - 5,18 % (28. Februar 2021: 5,85 %)		
TWD	358 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	7.846 5,18
Großbritannien - 7,07 % (28. Februar 2021: 4,06 %)		
GBP	172 Dr. Martens Plc	1.001 0,66

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
	98 Farfetch Ltd	4.101 2,71
	18 Linde Plc	5.606 3,70
		10.708 7,07
Vereinigte Staaten - 36,72 % (28. Februar 2021: 35,59 %)		
	8 Adobe Inc	5.550 3,67
	12 ANSYS Inc	4.480 2,96
	12 Autodesk Inc	3.804 2,51
	11 Illumina Inc	5.236 3,46
	22 Masimo Corp	5.930 3,92
	13 Mastercard Inc	4.534 2,99
	23 Microsoft Corp	7.046 4,65
	30 NVIDIA Corp	6.644 4,39
	23 ResMed Inc	6.683 4,41
	17 Veeva Systems Inc 'A'	5.696 3,76
		55.603 36,72
Summe Stammaktien (Kosten 120.932 USD)		
		150.563 99,42
Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 120.932 USD)		
		150.563 99,42
Devisenterminkontrakte - 0,14 % (28. Februar 2021: 0,03 %)		
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	217 0,14
Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
		150.780 99,56
Devisenterminkontrakte - (0,02 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)		
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(39) (0,02)
Summe - Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten		
		(39) (0,02)
Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
		150.741 99,54
Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
		696 0,46
Gesamtneuvermögen		
		\$151.437 100,00

- Beträge, die mit „-“ bezeichnet sind, betreffen 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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 5.912.000 USD und machten 3,90 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

ADR	- Amerikanischer Hinterlegungsschein.
AUD	- Australischer Dollar
DKK	- Dänische Krone
EUR	- Euro
GBP	- Britisches Pfund Sterling
HKD	- Hongkong-Dollar
SEK	- Schwedische Krone
TWD	- Taiwanesischer Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% von Gesamt Vermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	99,29
Finanzderivate	0,14
Sonstige Vermögenswerte	0,57
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD 1.888	Verkauf
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	USD 93	Verkauf
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 40	Verkauf
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	GBP 1.958	Verkauf
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	EUR 42.289	Verkauf
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 36 USD)				\$ 217
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): - USD)				(39)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 36 USD)				\$ 178

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Stammaktien — 58,13 % (28. Februar 2021: 53,23 %)			Immobilieninvestmentgesellschaften — 40,65 % (28. Februar 2021: 45,81 %)			Devisenterminkontrakte — (0,01 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)		
Australien — 16,91 % (28. Februar 2021: 15,32 %)			Australien — 19,31 % (28. Februar 2021: 19,08 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (3) (0,01)		
AUD	91 APA Group	2,17	AUD	148 Charter Hall Long Wale REIT	2,01	Summe - Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten (3) (0,01)		
AUD	325 Aurizon Holdings Ltd	3,18	AUD	387 Charter Hall Retail REIT	1,076	Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 27.745 98,80		
AUD	1.066 AusNet Services Ltd	5,37	AUD	162 GPT Group/The	574	Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen 339 1,20		
AUD	474 Spark Infrastructure Group	3,46	AUD	416 Scentre Group	866	Gesamtnetovermögen \$28.084 100,00		
AUD	74 Transurban Group	2,73	AUD	328 Shopping Centres Australasia Property Group	643	- 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 %.		
	4.749	16,91	AUD	103 Stockland	349	ABKÜRZUNGEN:		
China — 8,28 % (28. Februar 2021: 7,49 %)			AUD	855 Vicinity Centres	1,078	AUD	- Australischer Dollar	
HKD	1,116 Guangdong Investment Ltd	5,51	AUD	133 Waypoint REIT	271	HKD	- Hongkong-Dollar	
HKD	1,318 Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	2,77		5.422	19,31	INR	- Indische Rupie	
	2.327	8,28	Hongkong — 7,38 % (28. Februar 2021: 10,41 %)			MYR	- Malaysischer Ringgit	
Hongkong — 6,42 % (28. Februar 2021: 7,41 %)			HKD	892 Fortune Real Estate Investment Trust	3,43	NZD	- Neuseeländischer Dollar	
HKD	111 CLP Holdings Ltd	3,96	HKD	121 Link REIT	1,110	PHP	- Philippinischer Peso	
HKD	303 HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	1,07		2.072	7,38	SGD	- Singapur-Dollar	
HKD	79 Wharf Real Estate Investment Co Ltd	1,39	Indien — 4,45 % (28. Februar 2021: 3,61 %)			THB	- Thailändischer Baht	
	391	6,42	INR	255 Embassy Office Parks REIT	4,45	Analyse des Gesamtvermögens		
	1.803	6,42	Neuseeland — 1,45 % (28. Februar 2021: 2,32 %)			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 97,53		
Indien — 8,66 % (28. Februar 2021: 7,87 %)			NZD	494 Kiwi Property Group Ltd	1,45	Finanzderivate 0,03		
INR	3,329 NHPC Ltd	4,38	Singapur — 8,06 % (28. Februar 2021: 10,39 %)			Sonstige Vermögenswerte 2,44		
INR	502 Power Grid Corp of India Ltd	4,28	SGD	368 CapitaLand Integrated Commercial Trust	2,01	Gesamtvermögen 100,00		
	2.432	8,66	SGD	327 Frasers Centrepoint Trust	2,01			
Malaysia — 4,56 % (28. Februar 2021: 4,32 %)			SGD	197 Keppel DC REIT	1,30			
MYR	197 Petronas Gas Bhd	2,83	SGD	355 Mapletree Industrial Trust	2,74			
MYR	465 Westports Holdings Bhd	1,73		2.263	8,06			
	1.281	4,56	Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 10.801 USD) 11.414 40,65					
Neuseeland — 2,61 % (28. Februar 2021: 1,88 %)			Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 26.636 USD) 27.740 98,78					
NZD	128 Contact Energy Ltd	2,61	Devisenterminkontrakte — 0,03 % (28. Februar 2021: 0,01 %)					
Philippinen — 2,81 % (28. Februar 2021: 2,12 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 8 0,03					
PHP	140 Manila Electric Co	2,81	Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 27.748 98,81					
Singapur — 3,62 % (28. Februar 2021: 3,69 %)								
SGD	544 Ascendas India Trust	2,07						
SGD	601 NetLink NBN Trust	1,55						
	1.017	3,62						
Thailand — 4,26 % (28. Februar 2021: 3,13 %)								
THB	3.048 Digital Telecommunications Infrastructure Fund	4,26						
	1.196	4,26						
Summe Stammaktien (Kosten 15.835 USD) 16.326 58,13								

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	Verkauf	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	Verkauf	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	Verkauf	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	Verkauf	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	Verkauf	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	Verkauf	
15.09.2021	BNY Mellon	Kauf	Verkauf	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 3 USD)				\$ 8
Nicht realisierte Wertminderung von Devisentermingeschäften (31. August 2021 (in Tsd.): (1) USD)				(3)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): 2 USD)				\$ 5

Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
Stammaktien - 99,58 % (28. Februar 2021: 98,03 %)			Russland - 3,80 % (28. Februar 2021: 2,96 %)		
Brasilien - 3,21 % (28. Februar 2021: 2,97 %)			7 LUKOIL PJSC ADR 612 1,28		
BRL	183 B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	498 1,04	33 Sberbank of Russia PJSC ADR 585 1,22		
BRL	176 Cosan SA	752 1,57	7 TCS Group Holding Plc GDR 625 1,30		
BRL	119 Odontoprev SA	288 0,60	1.822 3,80		
1.538 3,21			Südkorea - 17,22 % (28. Februar 2021: 17,49 %)		
Chile - 1,54 % (28. Februar 2021: 1,38 %)			KRW 2 LG Chem Ltd 1.370 2,86		
GBP	37 Antofagasta Plc	738 1,54	KRW - LG Household & Health Care Ltd 489 1,02		
China - 32,13 % (28. Februar 2021: 37,67 %)			KRW 3 NAVER Corp 957 2,00		
HKD	53 Alibaba Group Holding Ltd	1.106 2,31	KRW 58 Samsung Electronics Co Ltd 3.815 7,96		
	6 Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.074 2,24	KRW 1 Samsung SDI Co Ltd 876 1,82		
HKD	198 Brilliance China Automotive Holdings Ltd †∞	91 0,19	KRW 8 SK Hynix Inc 746 1,56		
HKD	202 China Gas Holdings Ltd	584 1,22	8.253 17,22		
HKD	83 China Merchants Bank Co Ltd	684 1,43	Taiwan - 15,37 % (28. Februar 2021: 12,86 %)		
CNH	13 Contemporary Amperex Technology Co Ltd	960 2,01	TWD 51 Delta Electronics Inc 496 1,04		
HKD	10 JD.com Inc ADR	797 1,66	TWD 37 Globalwafers Co Ltd 1.156 2,41		
HKD	46 Meituan 'B', 144A	1.480 3,09	3 Sea Ltd ADR 1.023 2,13		
HKD	112 Minth Group Ltd	465 0,97	TWD 214 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd 4.690 9,79		
CNH	164 Ping An Bank Co Ltd	451 0,94	7.365 15,37		
HKD	116 Ping An Insurance Group Co of China Ltd	898 1,87	Vereinigte Staaten - 3,03 % (28. Februar 2021: 2,82 %)		
EUR	12 Prosus NV	1.031 2,15	2 EPAm Systems Inc 1.452 3,03		
HKD	112 Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	718 1,50	Summe Stammaktien (Kosten 39.939 USD) 47.719 99,58		
HKD	28 Sunny Optical Technology Group Co Ltd	857 1,79	Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 47.719 99,58		
HKD	53 Tencent Holdings Ltd	3.241 6,76	Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 47.719 99,58		
CNH	42 Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	481 1,00	Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen 201 0,42		
HKD	198 Xinyi Solar Holdings Ltd	479 1,00	Gesamtnettvermögen \$47.920 100,00		
15.397 32,13					
Hongkong - 2,21 % (28. Februar 2021: 2,21 %)			- 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 %.		
HKD	89 AIA Group Ltd	1.061 2,21	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 2021 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.480.000 USD und machten 3,09 % des Nettovermögens aus.		
Ungarn - 2,71 % (28. Februar 2021: 1,90 %)			† Illiquide.		
HUF	22 OTP Bank Nyrt	1.298 2,71	∞ Das Wertpapier wurde vom Manager oder dem jeweiligen Anlagemanager nach bestem Wissen oder nach dessen freiem Ermessen bewertet.		
Indien - 14,50 % (28. Februar 2021: 10,67 %)					
INR	21 Asian Paints Ltd	910 1,90			
INR	33 HDFC Bank Ltd	719 1,50			
INR	109 ICICI Bank Ltd	1.068 2,23			
INR	16 Kotak Mahindra Bank Ltd	381 0,79			
INR	7 Maruti Suzuki India Ltd	687 1,43			
INR	32 Reliance Industries Ltd	985 2,06			
INR	56 Titan Co Ltd	1.476 3,08			
INR	7 UltraTech Cement Ltd	723 1,51			
6.949 14,50					
Indonesien - 2,04 % (28. Februar 2021: 2,17 %)					
IDR	2.309 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	634 1,32			
IDR	1.436 Telkom Indonesia Persero Tbk PT	342 0,72			
976 2,04					
Mexiko - 0,71 % (28. Februar 2021: 0,57 %)					
MXN	119 Orbia Advance Corp SAB de CV	339 0,71			
Peru - 0,79 % (28. Februar 2021: 1,54 %)					
	4 Credicorp Ltd	380 0,79			
Philippinen - 0,32 % (28. Februar 2021: 0,38 %)					
PHP	149 Robinsons Retail Holdings Inc	151 0,32			

ABKÜRZUNGEN:

- ADR - Amerikanischer Hinterlegungsschein.
- GDR - Global Depositary Receipt.
- BRL - Brasilianischer Real
- CNY - Chinesischer Renminbi
- EUR - Euro
- GBP - Britisches Pfund Sterling
- HKD - Hongkong-Dollar
- HUF - Ungarischer Forint
- IDR - Indonesische Rupiah
- INR - Indische Rupie
- KRW - Südkoreanischer Won
- MXN - Mexikanischer Peso
- PHP - Philippinischer Peso
- TWD - Taiwanischer Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% von Gesamtvermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,88
Sonstige Vermögenswerte	1,12
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 2021

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts
Stammaktien - 99,36 % (28. Februar 2021: 97,24 %)			Schweiz - 5,63 % (28. Februar 2021: 5,47 %)		
Dänemark - 4,72 % (28. Februar 2021: 2,82 %)			CHF 6 Partners Group Holding AG 9.738 4,05		
DKK 192 Ambu A/S 'B'	5.125	2,13	CHF 28 Temenos AG	3.803	1,58
DKK 42 Coloplast A/S	6.230	2,59		13.541	5,63
	11.355	4,72	Großbritannien - 7,19 % (28. Februar 2021: 4,67 %)		
Frankreich - 18,53 % (28. Februar 2021: 17,33 %)			369 Allfunds Group Plc 5.638 2,34		
192 Dassault Systemes SE	9.287	3,86	GBP 302 Dr. Martens Plc	1.492	0,62
19 Kering SA	12.896	5,36	USD 109 Farfetch Ltd	3.867	1,61
25 L'Oreal SA	9.813	4,08	GBP 879 THG Plc	6.291	2,62
24 Sartorius Stedim Biotech	12.573	5,23		17.288	7,19
	44.569	18,53	Vereinigte Staaten - 4,83 % (28. Februar 2021: 6,76 %)		
Deutschland - 15,79 % (28. Februar 2021: 16,60 %)			USD 9 Mettler-Toledo International Inc 11.613 4,83		
33 adidas AG	9.932	4,13	Summe Stammaktien (Kosten 200.307 USD) 239.007 99,36		
297 Infineon Technologies AG	10.747	4,47	Summe der ergebniswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 200.307 USD) 239.007 99,36		
34 Linde Plc	9.122	3,79	Devisenterminkontrakte - 0,02 % (28. Februar 2021: 0,00 %)		
99 Nemetschek SE	8.184	3,40	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 47 0,02		
	37.985	15,79	Summe der erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 239.054 99,38		
Irland - 7,39 % (28. Februar 2021: 6,44 %)			Devisenterminkontrakte - (0,01 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)		
54 Kerry Group Plc	6.698	2,78	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (23) (0,01)		
115 Kingspan Group Plc	11.081	4,61	Summe - Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten (23) (0,01)		
	17.779	7,39	Summe erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 239.031 99,37		
Italien - 9,72 % (28. Februar 2021: 13,12 %)			Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen 1.516 0,63		
73 Ferrari NV	13.330	5,54	Gesamtvermögen € 240.547 100,00		
185 Moncler SpA	10.068	4,18			
	23.398	9,72			
Niederlande - 10,14 % (28. Februar 2021: 8,97 %)					
35 ASML Holding NV	24.387	10,14			
Polen - 1,26 % (28. Februar 2021: 1,75 %)					
184 InPost SA	3.033	1,26			
Schweden - 14,16 % (28. Februar 2021: 13,31 %)					
SEK 379 Assa Abloy AB	10.324	4,29			
SEK 192 Atlas Copco AB	11.224	4,67			
SEK 850 Hexagon AB	12.511	5,20			
	34.059	14,16			

- Die mit „-“ gekennzeichneten Beträge sind entweder 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

ABKÜRZUNGEN:

CHF	- Schweizer Franken
DKK	- Dänische Krone
GBP	- Britisches Pfund Sterling
SEK	- Schwedische Krone
USD	- US-Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% von Gesamtvermögen
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	99,30
Finanzderivate	0,02
Sonstige Vermögenswerte	0,68
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf EUR 2.604	Verkauf BRL 16.032	€ (23)
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf BRL 450	Verkauf EUR 74	-
01.09.2021	BNY Mellon	Kauf BRL 15.581	Verkauf EUR 2.523	29
01.10.2021	BNY Mellon	Kauf BRL 15.707	Verkauf EUR 2.542	18
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): - EUR)				€ 47
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): - EUR)				(23)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (31. August 2021 (in Tsd.): - EUR)				€ 24

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

Bilanz

	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	
(in Tsd.)	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
UMLAUFVERMÖGEN								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 1	\$ 1	\$ 93	\$ 611	\$ 35.132	\$ 43.021	€ 5.638	€ 4.405
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	-	-	2.768	3.468	8.069	10.044	2.109	1.119
Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Anlagen	951.625	910.476	275.693	322.429	1.589.978	1.733.256	105.558	105.074
Verpfändete Anlagen	-	-	-	-	44	46	-	-
Optionen	-	-	72	125	762	787	-	-
Swapkontrakte	-	-	2.999	4.060	14.229	17.737	15	217
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	-	-	13	12	1.500	1.679	186	42
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	-	-	205	270	1.725	2.931	120	855
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Forderungen aus verkauften Anlagen	-	-	2.411	10.194	37.310	45.144	-	-
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	-	-	505	806	6.809	3.754	-	-
Zinsen und sonstige Erträge	613	1.135	1.504	1.562	8.943	9.724	736	842
Dividendenforderungen	-	-	3	3	9	12	15	26
Forderungen aus Verwaltungskosten	-	-	-	-	-	-	-	-
Sonstige Vermögenswerte	-	-	-	-	-	-	-	-
Gesamtumlaufvermögen	952.239	911.612	286.266	343.540	1.704.510	1.868.135	114.377	112.580
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	-	-	1.733	-	2.004	5	-	-
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	-	-	2.747	4.191	1.501	5.760	53	361
Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	-	-	16	354	94	1.931	5	31
Swapkontrakte	-	-	360	247	4.995	1.290	234	105
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	-	-	-	-	1.294	2.446	6	187
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	-	-	115	949	2.542	5.784	506	509
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	39.998	28.840	9.841	38.192	67.049	179.021	-	-
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	6	6	52	50	50	57	-	-
Verbindlichkeiten aus Verwaltungskosten (Erläuterung 3)	28	22	182	185	815	802	3	3
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	23	21	19	18	85	81	9	7
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	-	-	20	20	45	53	-	-
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	265	119	54.307	23.242	-	-
Zinsverbindlichkeiten	-	-	-	-	-	-	-	-
Dividende zahlbar	-	-	-	-	-	-	-	-
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	393	393	58	85	207	245	39	54
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	40.448	29.282	15.408	44.410	134.988	220.717	855	1.257
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 911.791	\$ 882.330	\$ 270.858	\$ 299.130	\$ 1.569.522	\$ 1.647.418	€ 113.522	€ 111.323
	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	
(in Tsd.)	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
UMLAUFVERMÖGEN								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 540	\$ 1.647	\$ 14	\$ 14	\$ 17	\$ 16	\$ 421	\$ 1.409
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	214	225	-	-	-	-	816	536
Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Anlagen	92.465	102.709	-	-	-	-	49.869	47.327
Verpfändete Anlagen	-	-	-	-	-	-	-	-
Optionen	-	-	-	-	-	-	5	-
Swapkontrakte	-	-	-	-	-	-	6	56
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	67	158	-	-	-	-	79	175
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	234	52	-	-	-	-	35	281
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Forderungen aus verkauften Anlagen	2.764	1.252	-	-	-	-	-	446
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	143	262	-	-	-	-	-	-
Zinsen und sonstige Erträge	911	978	-	-	-	-	148	168
Dividendenforderungen	6	7	-	-	-	-	-	1
Forderungen aus Verwaltungskosten	-	-	-	-	-	-	-	-
Sonstige Vermögenswerte	-	-	-	-	-	-	-	-
Gesamtumlaufvermögen	97.344	107.290	14	14	17	16	51.379	50.399
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	-	1	-	-	-	-	8	7
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	239	52	-	-	-	-	7	144
Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	-	-	-	-	-	-	3	13
Swapkontrakte	-	-	-	-	-	-	15	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	83	76	-	-	-	-	129	119
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	-	-	-	-	-	-	216	104
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	982	3.209	-	-	-	-	-	1.156
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	33	28	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Verwaltungskosten (Erläuterung 3)	91	89	-	-	-	-	6	6
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	11	9	5	5	5	5	8	6
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	9	7	-	-	-	-	1	1
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	164	1.152	1	1	1	1	-	-
Zinsverbindlichkeiten	-	-	-	-	-	-	-	-
Dividende zahlbar	-	-	-	-	-	-	-	-
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	91	105	8	8	8	8	30	45
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	1.703	4.728	14	14	17	16	423	1.601
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 95.641	\$ 102.562	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 50.956	\$ 48.798

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 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
\$ 5.473 5	\$ 493 55	\$ 29.899 1.995	\$ 37.188 2.397	\$ 990 856	\$ 85 613	\$ 1.031 249	\$ 405 145	\$ 1.181 88	\$ 314 35
54.418	26.004	320.810	610.246	255.384	222.241	46.986	22.292	43.305	39.436
-	-	-	115	-	-	-	-	-	-
-	-	-	213	-	-	17	8	10	9
-	-	-	-	21	39	-	-	-	-
16	3	834	9.596	13	28	35	62	16	6
-	58	51	1.115	12	-	9	77	5	65
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
279	26	2.153	585	95	1.331	-	-	-	660
2.908	20	1.173	137	374	1.168	-	1	-	-
709	323	3.085	5.789	3.017	2.425	526	229	500	426
-	-	-	-	1	1	-	-	-	-
1	-	-	-	-	-	-	-	1	-
63.809	26.982	360.000	667.381	260.763	227.931	48.853	23.219	45.106	40.951
-	3	618	2.161	1.244	-	-	-	-	-
-	-	7	654	12	45	-	96	-	-
-	-	-	-	-	-	9	14	1	3
-	-	-	-	32	26	11	12	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	1.891	2.105	18	1	45	13	1	5
-	50	337	501	-	85	11	-	2	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3.071	393	502	3.263	1.250	8.157	-	199	-	669
12	11	31	36	53	57	4	4	-	-
46	23	162	160	149	109	25	24	1	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
25	21	24	34	19	14	20	17	7	5
4	-	11	11	13	9	2	-	-	-
8	-	540	2.346	582	212	27	14	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
34	48	204	179	70	89	41	57	25	36
3.200	549	4.327	11.450	3.442	8.804	195	450	37	718
\$ 60.609	\$ 26.433	\$ 355.673	\$ 655.931	\$ 257.321	\$ 219.127	\$ 48.658	\$ 22.769	\$ 45.069	\$ 40.233
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 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
\$ 829 2.002	\$ 443 2.328	\$ 1.276 5.823	\$ 3.354 4.175	\$ -	\$ -	\$ 4.871 3.193	\$ 5.680 1.911	\$ 399 1.918	\$ 398 1.924
559.687	620.688	501.384	504.382	-	-	235.930	282.688	86.097	81.267
-	-	-	-	-	-	100	415	-	-
-	-	-	-	-	-	24	-	-	-
-	-	-	-	-	-	32	531	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
437	310	1.009	7.530	-	-	996	1.652	120	110
795	-	359	1.417	-	-	349	1.236	42	128
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9.759	-	3.831	-	-	-	2.946	3.757	596	129
41	7.311	573	3.116	-	-	-	45	8	97
6.252	7.501	2.417	2.542	-	-	1.511	1.841	721	792
-	9	7	9	-	-	48	55	6	7
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
579.802	638.590	516.679	526.525	-	-	250.000	299.811	89.907	84.852
486 5	489 350	1 7	7 134	-	-	197	1.231	24	77 11
-	-	-	-	-	-	82	81	-	-
-	-	1.147	1.036	-	-	20	-	836	636
-	-	-	-	-	-	289	-	-	-
1.070	948	3.588	1.529	-	-	-	1.236	251	193
-	1.195	1.020	6	-	-	1.052	742	100	147
-	-	-	-	-	-	441	-	-	-
396	3.989	6.767	4.084	-	-	-	9.895	1.399	999
8	8	-	-	-	-	10.819	-	-	-
316	324	170	144	-	-	-	56	4	2
-	-	-	-	-	-	42	-	-	-
34	33	30	27	-	-	-	17	9	7
26	30	12	9	-	-	17	-	1	-
8.371	3.431	1.148	771	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
403	884	58	79	-	-	-	261	39	55
11.115	11.681	13.948	7.826	-	-	123	13.519	2.663	2.127
\$ 568.687	\$ 626.909	\$ 502.731	\$ 518.699	\$ -	\$ -	\$ 236.918	\$ 286.292	\$ 87.244	\$ 82.725

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	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 [^]	
(in Tsd.)	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
UMLAUFRVERMÖGEN								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	€ 2.045	€ 8.537	\$ 214.727	\$ 154.233	\$ 31	\$ 31	\$ 9.514	\$ 18.081
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	46.393	–	400.031	539.919	–	–	2.206	3.043
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Anlagen	223	45.985	5.423.025	127.577	–	–	1.100.230	1.047.405
Verpfändete Anlagen	–	–	2.263	8.834	–	–	–	–
Optionen	–	–	24.238	31.628	–	–	937	868
Swapkontrakte	–	252	411.605	633.939	–	–	4.668	7.272
Swaptions	–	–	235	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	154	4	26.803	90.962	–	–	698	22.104
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	34.000	117.968	–	–	686	2.034
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	158	–	18.063	–	–	–	206	3.832
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	1.665	28.771	–	–	14	326
Zinsen und sonstige Erträge	559	593	59.167	78.282	–	–	10.392	9.183
Dividendenforderungen	–	–	22	26	–	–	30	31
Forderungen aus Verwaltnungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	49.532	55.371	6.615.844	7.812.139	31	31	1.129.581	1.114.179
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	1	55.445	138.953	–	–	–	90
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	61	258.738	520.034	–	–	1.357	3.962
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	28.164	33.532	–	–	157	920
Swapkontrakte	–	–	86.099	30.745	–	–	1.712	1.784
Swaptions	1	–	120	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	109	32.481	39.458	–	–	9.562	949
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	59.551	194.870	–	–	692	2.125
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	554	57.491	146.253	–	–	5.597	22.201
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltnungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	6.023	6.299	–	–	22	21
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	7	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltnungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	5	319	341	3	5	60	52
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	392	407	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	246	13.318	48.497	–	–	57	47
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	36	50	3.240	6.670	28	26	144	170
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	44	1.026	601.381	1.166.059	31	31	19.360	32.321
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	€ 49.488	€ 54.345	\$ 6.014.463	\$ 6.646.080	\$ –	\$ –	\$ 1.110.221	\$ 1.081.858
(in Tsd.)	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
UMLAUFRVERMÖGEN								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 121	\$ 200	\$ 1.063	\$ 672	\$ 1.583	\$ 669	\$ –	\$ 60
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	596	453	1.501	61	11.941	7.455	–	15
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Anlagen	23.282	25.159	271.016	370.018	700.111	724.287	12.092	11.887
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	10	3	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	519	590	–	–	–	–	221	264
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	32	21	853	4.100	9.325	19.726	1	52
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	72	69	–	–	–	545	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	198	315	273	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	76	497	–	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	141	128	2.184	2.665	4.646	5.221	184	198
Dividendenforderungen	–	–	874	723	409	483	–	–
Forderungen aus Verwaltnungsgebühren	7	41	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	1	–
Gesamtumlaufvermögen	24.978	26.979	277.840	378.736	728.015	758.386	12.499	12.476
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	250	–	1.695	2.340	15	18.219	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	270	3.610	830	5.485	143	128
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	8	11	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	32	–	–	–	–	–	44	8
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	35	73	2.651	2.715	10.890	4.911	67	30
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	91	168	–	–	804	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	1.420	4.493	272	–	–	–	–	198
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltnungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	175	235	269	246	2	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltnungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	9	4	17	26	41	37	6	4
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	24	26	1	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	329	940	–	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	18	37	649	937	516	814	36	49
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	1.863	4.786	6.082	10.829	13.366	29.712	298	417
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 23.115	\$ 22.193	\$ 271.758	\$ 367.907	\$ 714.649	\$ 728.674	\$ 12.201	\$ 12.059

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 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
\$ -	\$ 42	\$ -	\$ 94	\$ 91.737	\$ 26.279	£ 1.100	£ 1.020	\$ 72	\$ 43
-	-	2.021	3.431	4.285	2.510	230	121	262	862
-	-	1.175.048	1.085.315	1.254.730	973.160	76.383	74.495	190.435	188.791
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	76	109	-	-	-	-	-	16
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	1.244	962	4	9	-	49	22	3.528
-	-	110	-	229	1.252	6	38	42	48
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	190.225	60.507	-	-	192	570
-	-	-	23.825	-	-	-	-	-	-
-	-	4.306	2.676	2.831	2.644	1.080	1.067	1.546	1.455
-	-	4	7	7	8	3	3	2	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	42	1.182.809	1.116.419	1.544.048	1.066.369	78.802	76.793	192.573	195.315
-	-	848	30	-	3	1	-	1.023	-
-	-	-	-	353	196	-	-	8	4
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	666	1.514	583	332	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	122	862	-	-	32	-	1.396	48
-	-	121	492	315	1.278	28	65	63	197
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	2.727	4.008	514.490	240.947	-	-	390	3.394
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	349	332	-	1	-	-	6	10
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	5	63	52	56	40	7	5	14	12
-	-	4	8	-	-	-	-	-	1
-	-	-	3.681	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	37	245	278	128	156	29	38	36	53
-	42	5.145	11.257	515.925	242.953	97	108	2.936	3.719
\$ -	\$ -	\$ 1.177.664	\$ 1.105.162	\$ 1.028.123	\$ 823.416	£ 78.705	£ 76.685	\$ 189.637	\$ 191.596
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		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 [^]	
Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
\$ 1.541	\$ 1.441	\$ 253	\$ 85.706	\$ 9.610	\$ 6.012	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
3.067	6.695	-	75	1	4.340	1.810	384	-	26
269.942	590.514	-	-	1.272.013	427.083	58.581	51.652	10.977	11.653
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	14.518	10.441	65	105	196	223
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.125	2.835	-	926	2.651	2.025	62	250	2	27
-	-	-	-	177	234	8	41	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	256	-	-	11.337	1.738	-	456	-	-
1	88	-	-	10.388	4.987	30	155	-	-
2.713	4.805	-	47	10.193	4.085	426	399	167	179
893	658	8	6	10	4	1	13	-	-
-	-	-	6	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	3	-	-	-	-	-
279.282	607.292	261	86.766	1.330.901	460.949	60.983	53.455	11.342	12.108
4	10.267	-	5.108	8.909	-	-	750	-	-
330	5.780	-	90	6.679	3.823	120	120	36	49
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	843	-	41	8
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3.181	3.975	-	1.932	922	1.778	60	346	25	29
73	723	-	-	-	379	-	79	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	21.394	1.070	1.742	-	-	198
-	-	-	-	26	16	-	-	-	-
149	188	-	-	849	272	49	38	1	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
18	35	3	8	64	22	7	10	5	3
-	1	-	-	92	32	1	1	-	-
78	111	-	79.242	664	188	1	12	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
169	491	258	386	31	84	192	79	27	47
4.002	21.571	261	86.766	39.630	7.664	3.015	1.435	135	334
\$ 275.280	\$ 585.721	\$ -	\$ -	\$ 1.291.271	\$ 453.285	\$ 57.968	\$ 52.020	\$ 11.207	\$ 11.774

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	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	
	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
(in Tsd.)								
UMLAUFVERMÖGEN								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ –	\$ 16	\$ 17.423	\$ 7.852	\$ –	\$ 1	\$ 17.261	\$ 11.359
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	10.620	11.245	–	–	–	–
Erfolgswirksam num bezulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Anlagen	–	–	141.719	366.879	2.197	1.903	722.688	493.419
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	5.292	5.291	6	3	25	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	998	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	189.065	–	–	–	1.950	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	389	4.692
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	5.081	4.080	–	–	–	–
Dividendenforderungen	–	–	1	1	2	1	213	109
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	3	7	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	1	–	–	–
Gesamtumlautvermögen	–	16	369.201	396.346	2.209	1.915	742.526	509.579
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	2.887	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	590	1.037	–	–	–	–
Erfolgswirksam num bezulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	6.017	1.896	–	–	14	1
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	3.854	1.176	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	–	1.738	–	–	–	55	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	19	–	–	507	281
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	3	3	25	24	5	4	51	36
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	57	19
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	237.022	5	–	–	284	55
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	13	859	893	18	32	78	102
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	–	16	250.122	5.050	23	36	3.933	494
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ –	\$ –	\$ 119.079	\$ 391.296	\$ 2.186	\$ 1.879	\$ 738.593	\$ 509.085

	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 [^]	
	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
(in Tsd.)								
UMLAUFVERMÖGEN								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 2.292	\$ 3.461	\$ 437	\$ 1.728	\$ 34.068	\$ 3.086	\$ 93	\$ 216
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam num bezulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Anlagen	752.465	789.786	43.016	37.033	1.242.610	635.560	13.552	10.927
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	69	141	9	16	208	1.741	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	187	–	–	–	1.730	–	62	278
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	152	367	1	–	21.813	5.155	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	7	6	–	–	–	–
Dividendenforderungen	161	175	71	62	902	542	10	10
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	13	–	–	–
Gesamtumlautvermögen	755.326	793.930	43.541	38.845	1.301.344	646.084	13.717	11.431
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	1.096	–	–	–	–	2	1
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam num bezulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	64	32	7	2	1.019	45	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	186	–	–	–	13.127	–	37	313
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	581	546	41	31	552	246	6	4
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	70	64	9	7	65	33	7	4
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	74	71	6	3	57	27	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	536	1.082	–	61	998	482	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	318	341	39	52	1	25	17	20
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	1.829	3.232	102	156	15.819	860	67	342
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 753.497	\$ 790.698	\$ 43.439	\$ 38.689	\$ 1.285.525	\$ 645.224	\$ 13.650	\$ 11.089

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Global 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	
Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
\$ 74	\$ 74	\$ 57	\$ 57	\$ -	\$ 28	\$ 14.003	\$ 2.979	\$ 32.282	\$ 20.383
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	209.301	203.955	2.084.615	1.810.957
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	1.680	1.202
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	358	-	7.569	-
-	-	-	-	-	-	292	45	2.929	8.722
-	-	-	-	-	-	141	192	1.119	1.268
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
74	74	57	57	-	28	224.095	207.171	2.130.195	1.842.533
-	-	-	-	-	-	-	4	1.680	6.848
-	-	-	-	-	-	-	-	-	620
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	932	2.409
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	199	3.759	2.660
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	218	184	1.410	1.186
-	-	2	4	2	2	22	19	152	142
-	-	-	-	-	-	36	27	181	159
44	44	-	-	-	-	69	655	5.264	17.184
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
30	30	55	53	-	26	60	75	229	273
74	74	57	57	-	28	405	1.163	13.607	31.481
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 223.690	\$ 206.008	\$ 2.116.588	\$ 1.811.052
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund ^{^α}		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
€ 19.887	€ 21.227	\$ 49	\$ 99	\$ 9.706	\$ -	\$ 1.441	\$ 26.924	\$ -	\$ 848
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
662.174	607.551	2.927	2.726	90.815	-	1.053.667	1.248.814	99.522	90.103
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.015	230	7	4	197	-	965	503	1	3
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.810	28.556	-	27	1.267	-	4.632	3.301	309	475
2.125	783	-	-	2.228	-	23.088	30.654	127	1.465
-	-	2	-	-	-	-	29	-	-
2.070	1.545	10	1	257	-	901	371	15	34
-	-	-	4	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
689.081	659.892	2.995	2.861	104.470	-	1.084.694	1.310.596	99.974	92.928
-	6	-	-	2	-	1	8	67	-
-	250	-	-	-	-	-	1.310	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
677	558	-	-	6	-	409	611	-	3
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.810	50.148	-	69	1.177	-	3.702	12.581	147	1.554
544	1.725	2	-	280	-	-	-	-	-
561	457	2	-	109	-	984	963	113	91
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
48	50	7	4	7	-	62	71	12	9
64	50	-	-	26	-	169	164	20	15
4.084	1.534	-	-	-	-	3.182	5.816	193	94
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
71	101	68	63	9	-	150	202	52	66
7.859	54.879	79	136	1.616	-	8.659	21.726	604	1.832
€ 681.222	€ 605.013	\$ 2.916	\$ 2.725	\$ 102.854	\$ -	\$ 1.076.035	\$ 1.288.870	\$ 99.370	\$ 91.096

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	Legg Mason PCM US Equity Fund [^]		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund		Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund [^]	
	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
(in Tsd.)								
UMLAUFVERMÖGEN								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 23	\$ 23	€ 261	€ 181	\$ 416	\$ 1.094	\$ 1	\$ 60
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Anlagen	–	–	29.839	33.006	29.198	30.642	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	6	7	43	43	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	–	–	–	234	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	137	2	5	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	–	–	15	–	–	–
Dividendenforderungen	–	–	237	450	136	136	–	–
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlautvermögen	23	23	30.480	33.646	29.813	32.149	1	60
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	–	–	–	21	482	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	42	15	13	29	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	–	–	–	–	55	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	33	29	35	36	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	8	6	9	7	–	–
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	4	1	4	3	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	1	120	7	285	–	59
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	23	23	89	107	269	215	1	1
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	23	23	177	278	358	1.112	1	60
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ –	\$ –	€ 30.303	€ 33.368	\$ 29.455	\$ 31.037	\$ –	\$ –

	Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund [^]	
	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
(in Tsd.)								
UMLAUFVERMÖGEN								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	€ 63	€ 3.508	\$ –	\$ 51	\$ 23	\$ 119	¥ –	¥ 1.340
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	798	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Anlagen	–	36.537	–	–	–	–	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	347	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	77	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	819	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	–	44	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlautvermögen	63	42.130	–	51	23	119	–	1.340
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	33	–	–	–	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	286	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	492	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	589	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	53	–	–	–	–	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	3	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	6	11	–	–	–	3	–	–
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	3	–	–	–	–	–	76
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	235	–	51	–	96	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	7	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	6	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	54	72	–	–	23	20	–	1.264
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	63	1.787	–	51	23	119	–	1.340
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	€ –	€ 40.343	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	¥ –	¥ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund ^µ		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Congruix Japan Equity Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]	
Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
\$ 65	\$ 178 18	\$ 54	\$ 38	¥ 93.532	¥ 90.733	\$ 2.897	\$ 2.907	\$ 30	\$ 30
-	14.646	11.964	12.688	-	-	79.819	77.091	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	13	-	5	-	-	-	-	-	-
-	-	1	-	-	-	-	447	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	19	70	34	-	-	13	207	-	-
-	-	1	-	-	-	63	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
66	14.874	12.090	12.765	93.532	90.733	82.792	80.652	30	30
-	-	-	-	-	-	32	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	3	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	104	-	-
-	-	-	-	-	-	-	313	-	-
-	-	13	11	-	-	62	58	-	-
2	5	6	5	-	-	14	11	3	5
-	-	1	-	-	-	4	1	-	-
-	-	-	1	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
64	130	46	63	93.532	90.733	80	85	27	25
66	135	69	80	93.532	90.733	192	572	30	30
\$ -	\$ 14.739	\$ 12.021	\$ 12.685	¥ -	¥ -	\$ 82.600	\$ 80.080	\$ -	\$ -
Legg Mason Martin Currie North American 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 Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund [^]	
Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
\$ -	\$ -	\$ 723	\$ 5.338	\$ 407	\$ 196	\$ 453	\$ 762	\$ -	\$ 22
-	-	150.563	98.926	27.740	26.321	47.719	40.978	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	217	36	8	3	-	-	-	-
-	-	-	-	99	-	-	49	-	-
-	-	106	103	-	1	64	242	-	-
-	-	-	-	13	-	2	-	-	-
-	-	27	28	176	178	21	105	-	-
-	-	1	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	151.637	104.431	28.443	26.699	48.259	42.136	-	22
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	39	-	3	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	196	-	-	98	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	108	34	20	17	32	26	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	13	10	6	4	8	7	-	2
-	-	14	2	5	3	3	2	-	-
-	-	-	-	-	-	58	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	26	36	129	98	238	202	-	20
-	-	200	82	359	123	339	335	-	22
\$ -	\$ -	\$ 151.437	\$ 104.349	\$ 28.084	\$ 26.576	\$ 47.920	\$ 41.801	\$ -	\$ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]		Legg Mason Global Funds Plc	
	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021	Zum 31. August 2021	Zum 28. Februar 2021
UMLAUFVERMÖGEN				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	€ 1.629	€ 3.107	\$ 583.919	\$ 530.282
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	469.407	610.869
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:				
Anlagen	239.007	108.300	24.958.823	24.320.640
Verpfändete Anlagen	–	–	2.407	9.410
Optionen	–	–	26.075	33.641
Swapkontrakte	–	–	449.173	675.948
Swaptions	–	–	235	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	47	–	58.346	178.667
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	39.295	131.917
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	93
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	492.191	171.451
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	10	–	78.585	127.759
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	137.901	154.736
Dividendenforderungen	4	34	9.379	8.075
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	17	58
Sonstige Vermögenswerte	2	–	24	–
Gesamtumlaufermögen	240.699	111.441	27.305.777	26.953.546
KURZFRISTIGE PASSIVA:				
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	–	79.188	186.999
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	274.148	559.727
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:				
Optionen	–	–	28.478	36.896
Swapkontrakte	–	–	97.981	37.765
Swaptions	–	–	120	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	23	–	80.268	72.200
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	70.984	211.755
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	594
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	–	773.858	784.346
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	1.199	2.667
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	85	30	15.529	14.011
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	4	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	28	20	1.711	1.585
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	1	–	1.396	1.177
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	1	–	332.341	192.552
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	9
Dividende zahlbar	–	–	–	7
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	14	20	11.679	17.484
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	152	70	1.768.884	2.119.774
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	€ 240.547	€ 111.371	\$ 25.536.893	\$ 24.833.772

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/K/0 EUR/0 JPY/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 JPY/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 Franklin MV European Equity Growth and Income Fund (ehemals Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund), den Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund, den Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und den Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021 zum USD-EUR-Wechselkurs von 0,8469 umgerechnet (28. Februar 2021: 0,8288).

Die Yen-Beträge 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 2021 zum USD/JPY-Wechselkurs von 110,0150 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2021: 106,5950).

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 2021 zum USD/GBP-Wechselkurs von 0,7274 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2021: 0,7178).

μ Mit Wirkung zum 14. April 2021 hat der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund den Handel eingestellt.

α Mit Wirkung zum 30. April 2021 begann der Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund mit dem Handel.

β Ab dem 1. Juni 2021 stellte der Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund[^] den Handel ein.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2021			28. Februar 2021			29. Februar 2020		
	VL gesamt (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil	VL gesamt (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil	VL gesamt (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund (Fortsetzung)									
Klasse F USD, thesaurierend	\$ 29	–	138,23	\$ 28	–	134,31	\$ 24	–	117,06
Klasse X EUR, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	4.586	43	96,16
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	2.765	74	143,64	3.041	82	139,65	2.393	76	122,75
Klasse GA USD, thesaurierend	7.212	46	156,33	7.174	47	152,29	7.271	54	133,42
Klasse GA EUR, thesaurierend	134	1	168,43	–	1	160,59	202	1	153,73
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	24	–	143,61	–	23	–	–	–	138,15
Klasse LM SGD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	17.978	27.864	0,90
Klasse GE USD, thesaurierend	514	4	143,94	503	4	140,75	444	4	124,24
Klasse GE EUR, thesaurierend	–	–	–	–	–	151,55	14	–	143,53
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^μ									
Klasse A USD thesaurierend	\$ –	–	–	\$ 141	2	81,33	\$ 154	2	66,82
Klasse A USD, ausschüttend (A)	–	–	–	69	1	84,68	61	1	70,77
Klasse A EUR, thesaurierend	–	–	–	1	–	119,52	4	–	101,53
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	–	–	–	40	–	105,28	33	–	95,61
Klasse B USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	127	1	97,35
Klasse B USD, ausschüttend (A)	–	–	–	9	–	82,73	8	–	69,02
Klasse C USD, thesaurierend	–	–	–	9	–	84,77	40	1	70,01
Klasse C USD, ausschüttend (A)	–	–	–	91	1	82,69	74	1	68,98
Klasse E USD, thesaurierend	–	–	–	32	–	95,64	37	–	79,18
Klasse Premier EUR, thesaurierend	–	–	–	14.347	90	132,45	11.647	89	117,89
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 2.463	12	198,94	\$ 2.204	12	178,06	\$ 2.144	13	167,25
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	502	5	106,90	738	8	98,07	1.278	13	96,81
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	628	9	100,89	693	10	92,91	930	15	94,24
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	177	13	106,92	1.174	93	97,94	1.189	95	97,16
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	57	71	1,08	33	44	0,99	13	19	0,99
Klasse X USD, thesaurierend	1	–	103,96	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	1.767	16	110,36	1.872	19	98,27	1.736	19	91,36
Klasse GA USD, thesaurierend	4.048	20	202,69	3.683	20	181,40	3.700	22	170,54
Klasse GA EUR, thesaurierend	1.685	6	245,93	1.656	6	215,40	1.794	7	221,32
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	347	1	209,11	321	1	186,39	362	2	198,41
Klasse GE USD, thesaurierend	49	–	187,75	44	–	168,67	42	–	159,76
Klasse GE EUR, thesaurierend	297	1	227,64	267	1	200,13	281	1	207,22
Legg Mason Martin Currie Asia LongTerm Unconstrained Fund^α									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 25	–	151,54	\$ 2	–	159,99	\$ 1	–	122,73
Klasse M GBP, ausschüttend (A)	2.672	102	18,98	2.890	105	19,71	66.097	3.138	16,35
Klasse E USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	119,66
Klasse F USD, thesaurierend	1	–	156,36	1	–	164,53	1	–	125,42
Klasse M USD ausschüttend (A)	54.299	3.328	16,32	57.186	3.332	17,16	43.809	3.334	13,14
Klasse M EUR, ausschüttend (A)	271	13	17,91	286	13	18,44	26.826	1.585	15,40
Klasse Premier USD, thesaurierend	25.283	219	115,34	19.627	162	121,06	8.127	88	91,83
Klasse Premier GBP, thesaurierend	49	–	116,12	88	1	120,25	19.856	156	98,52
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^{αβ}									
Klasse A (PF) USD, thesaurierend	€ –	–	–	€ –	1	97,46	€ 1	–	95,92
Klasse A (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	1	–	100,77	1	–	107,81
Klasse A (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	6.106	538	13,70	8.361	628	14,63
Klasse A (PF) EUR, thesaurierend	–	–	–	2.601	28	91,77	5.417	55	99,31
Klasse A (PF) EUR, ausschüttend (A)	–	–	–	2.836	238	11,92	8.237	640	12,88
Klasse A (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	4	–	12,54	256	16	13,50
Klasse E (PF) USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	93,03
Klasse E (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1	–	104,61
Klasse F (PF) USD, thesaurierend	–	–	–	1	–	99,51	1	–	97,37
Klasse F (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	1	–	102,68	1	–	109,36
Klasse J (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1.834	20	100,79
Klasse J (PF) JPY, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	43.642	560	9.311,54
Klasse M (PF) USD ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	2.236	195	13,84	2.484	186	14,72
Klasse M (PF) EUR, thesaurierend	–	–	–	3.504	37	93,51	32.284	321	100,67
Klasse M (PF) EUR, ausschüttend (A)	–	–	–	7.263	582	12,47	59.347	4.428	13,40
Klasse M (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	1.284	85	13,06	2.199	134	14,01
Klasse M (PF) NOK, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	21	2	94,45	23	2	102,03
Klasse M (PF) SEK, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	928	102	92,98	1.841	197	99,89
Klasse Premier (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	11.374	135	101,29	21.333	218	107,53
Klasse Premier (PF) BRL, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	2.182	152	97,18	2.583	124	103,14
Legg Mason Martin Currie Global LongTerm Unconstrained Fund^α									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 5.709	24	233,53	\$ 1.557	8	202,89	\$ 319	2	153,08
Klasse A EUR, thesaurierend	4.445	17	218,78	2.320	10	186,03	992	6	153,71
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	29.116	212	116,50	–	–	–	–	–	–
Klasse E USD, thesaurierend	4.481	29	155,85	1.896	14	135,92	1	–	103,20
Klasse F USD, thesaurierend	179	2	99,67	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD, thesaurierend	129	1	112,94	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend	91	–	227,20	81	–	192,44	11	–	158,08
Klasse X GBP, thesaurierend	2.028	6	232,28	1.685	6	198,38	883	4	160,85
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1.759	6	223,23	851	3	193,82	159	1	147,96
Klasse Premier USD, thesaurierend	41.276	167	246,83	14.752	69	213,26	5.674	36	159,16
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	913	4	154,48	749	4	133,90	324	2	101,84
Klasse S USD, thesaurierend	11.667	90	129,71	33.171	296	111,88	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	19.241	138	117,67	–	–	–	–	–	–
Klasse S GBP, thesaurierend	30.403	91	243,60	47.287	164	207,39	25.817	120	166,80
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)	5.959	61	97,21	5.757	60	96,60	457	5	101,08
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	3	–	90,84
Klasse A AUD, ausschüttend (M) Plus	471	6	99,49	455	6	93,44	455	6	115,43
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus (e)	474	4	90,97	458	4	88,46	457	4	101,17
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	3	–	91,23
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	81	114	0,96	67	95	0,94	76	103	1,03
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	576	7	110,30	379	5	109,14	–	–	–
Klasse D CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1	–	111,75	1	–	110,34	–	–	–
Klasse D HKD, ausschüttend (M) Plus	1	–	112,48	1	–	110,55	–	–	–
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	938	1.132	1,11	1.015	1.230	1,10	–	–	–
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	1.158	10	112,03	505	5	110,45	–	–	–
Klasse D USD, thesaurierend	5.947	50	118,67	5.734	50	114,42	–	–	–
Klasse X AUD, thesaurierend	285	3	121,14	233	3	111,09	85	1	130,12
Klasse X USD, thesaurierend	5.855	45	129,49	5.601	45	124,63	440	4	123,73
Klasse S GBP, thesaurierend	494	3	130,03	474	3	123,09	468	3	131,91
Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)	494	4	101,45	474	3	98,77	468	3	110,75
Klasse LM AUD, thesaurierend	5.350	60	121,19	5.422	64	110,28	5.324	64	127,89

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2021			28. Februar 2021			29. Februar 2020		
	VL gesamt (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil	VL gesamt (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil	VL gesamt (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^α									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 7.697	60	128,36	\$ 4.928	37	133,66	\$ 1.598	17	93,97
Klasse E USD, thesaurierend	791	5	144,39	477	3	150,92	1	–	106,74
Klasse F USD, thesaurierend	6.091	38	161,15	2.510	15	167,30	1	–	116,91
Klasse X USD, thesaurierend	772	6	137,70	801	6	142,84	559	6	99,68
Klasse Premier USD, thesaurierend	8.114	58	139,51	7.740	54	144,46	2.796	28	100,46
Klasse S USD, thesaurierend	2.924	17	169,06	3.225	18	174,89	1.725	14	121,37
Klasse S EUR, thesaurierend	21.531	136	134,14	22.120	135	135,80	22.741	200	103,45
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^α									
Klasse A EUR, thesaurierend	€ 2.050	11	183,96	€ 869	6	148,44	€ 569	5	119,97
Klasse X EUR, thesaurierend	1.275	7	187,87	661	4	151,02	546	5	121,14
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	2.584	140	112,85	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend	29.682	156	189,72	17.885	117	152,24	2.129	17	121,70
Klasse S USD, thesaurierend	84.030	826	120,18	87.876	1.077	98,43	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend	120.926	733	165,00	4.080	31	132,14	2.894	28	105,21

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/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.

μ Mit Wirkung zum 14. April 2021 hat der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund den Handel eingestellt.

α Mit Wirkung zum 30. April 2021 begann der Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund mit dem Handel.

β Ab dem 1. Juni 2021 stellte der Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund^α den Handel ein.

^ 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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
	ANLAGEERTRÄGE:							
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 369	\$ 2.362	\$ 3.552	\$ 4.032	\$ 22.798	\$ 23.340	€ 726	€ 727
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten: (Erläuterung 2)								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	30	(2.041)	5.460	7.658	31.408	(47)	2.857
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	4.695	3.161	10.353	8.347	784	(2.402)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	369	2.392	6.206	12.653	40.809	63.095	1.463	1.182
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	2.619	3.151	1.124	1.254	4.859	4.433	18	17
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	117	139	87	97	470	482	36	37
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	123	157	297	271	1	1
Anwaltsgebühren	12	10	2	1	11	6	1	1
Prüfungsgebühren	11	10	22	20	22	20	12	12
Druckgebühren	37	35	12	11	68	52	4	4
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	13	9	11	4
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	3	2	1	1	5	3	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	47	60	22	29	108	135	10	13
Gesamtaufwendungen	2.846	3.407	1.393	1.570	5.853	5.411	93	89
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	(2.522)	(1.431)	–	–	–	–	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	324	1.976	1.393	1.570	5.853	5.411	93	89
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	45	416	4.813	11.083	34.956	57.684	1.370	1.093
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	(37)	(665)	(803)	(1.074)	(1.311)	(1.245)	(1)	(2)
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	8	(249)	4.010	10.009	33.645	56.439	1.369	1.091
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	–	1	(5)	(44)	(94)	2	(13)
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 8	\$ (249)	\$ 4.011	\$ 10.004	\$ 33.601	\$ 56.345	€ 1.371	€ 1.078

(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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
	ANLAGEERTRÄGE:							
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 2.376	\$ 2.456	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.207	\$ 198
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	1	–	5	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten: (Erläuterung 2)								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	2.094	(1.291)	–	–	1	–	1.454	2.158.056
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(885)	2.280	–	–	–	–	(438)	(2.156.699)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	3.585	3.445	–	–	1	–	2.228	1.555
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	554	489	–	–	–	–	37	33
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	33	33	–	–	–	–	18	18
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	57	46	–	–	–	–	6	5
Anwaltsgebühren	1	–	–	–	–	–	–	–
Prüfungsgebühren	15	21	–	–	–	–	15	14
Druckgebühren	4	4	–	–	–	–	2	1
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	1	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	14	19	–	–	–	–	8	8
Gesamtaufwendungen	678	612	–	–	1	–	86	79
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	(2)	–	–	–	–	(1)	(1)
Nettoaufwendungen insgesamt	678	610	–	–	1	–	85	78
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	2.907	2.835	–	–	–	–	2.143	1.477
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	(1.281)	(1.190)	–	–	–	–	–	(86)
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	1.626	1.645	–	–	–	–	2.143	1.391
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(8)	(10)	–	–	–	–	1	(3)
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 1.618	\$ 1.635	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2.144	\$ 1.388

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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
\$ 805	\$ 649	\$ 10.318	\$ 14.947	\$ 6.260	\$ 5.090	\$ 749	\$ 446	\$ 895	\$ 857
-	-	1	3	-	-	-	-	-	-
-	-	(11)	(2)	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
551	(436)	16.689	(9.676)	3.442	(4.494)	(109)	480	272	247
(189)	706	(15.527)	28.436	(559)	3.656	(10)	29	(242)	(243)
1.167	919	11.470	33.708	9.143	4.252	630	955	925	4.242
209	136	991	1.149	775	564	156	138	5	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
14	11	158	205	72	54	14	9	15	26
18	11	67	81	69	56	11	9	-	-
-	-	4	3	1	1	-	-	-	-
15	14	22	21	15	21	12	14	11	10
1	1	24	25	9	6	1	1	2	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	5	6	-	1	-	-	-	-
-	-	2	1	1	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	8	43	78	20	22	8	9	6	7
265	181	1.316	1.569	962	725	202	180	39	34
(9)	(12)	(1)	-	-	-	(7)	(11)	-	-
256	169	1.315	1.569	962	725	195	169	39	34
911	750	10.155	32.139	8.181	3.527	435	786	886	827
(236)	(233)	(3.289)	(4.091)	(1.400)	(1.821)	(298)	(134)	(816)	(808)
675	517	6.866	28.048	6.781	1.706	137	652	70	19
(2)	(2)	(124)	(254)	(25)	(13)	(11)	(9)	1	1
\$ 673	\$ 515	\$ 6.742	\$ 27.794	\$ 6.756	\$ 1.693	\$ 126	\$ 643	\$ 71	\$ 20
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 ^A		Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund ^A		Legg Mason Western Asset Global Credit Fund ^A	
Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
\$ 11.611	\$ 11.583	\$ 2.785	\$ 2.349	\$ -	\$ -	\$ 2.714	\$ 2.390	\$ 1.074	\$ 1.129
2	2	-	-	-	-	-	-	-	-
(14)	21	-	1	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(2.691)	7.007	8.805	(1.462)	-	-	2.965	149.262.925	1.742	514
(3.439)	(3.218)	(15.138)	24.106	-	-	(22)	(149.258.037)	(681)	1.334
5.469	15.395	(3.548)	24.994	-	-	5.657	7.278	2.135	2.977
2.217	2.005	990	463	-	-	301	232	21	28
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
180	169	153	102	-	-	82	70	28	27
170	159	64	10	-	-	-	-	3	4
4	3	3	1	-	-	2	1	1	-
22	21	15	14	-	-	15	14	15	14
26	19	22	10	-	-	12	9	3	3
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	1	4	2	-	-	1	1	1	1
2	1	1	-	-	-	1	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
54	67	40	32	-	-	22	36	10	11
2.675	2.445	1.292	634	-	-	436	364	82	88
(1)	(25)	(2)	-	-	-	-	-	-	-
2.674	2.420	1.290	634	-	-	436	364	82	88
2.795	12.975	(4.838)	24.360	-	-	5.221	6.914	2.053	2.889
(6.161)	(6.798)	(1.638)	(1.988)	-	-	-	-	-	-
(3.366)	6.177	(6.476)	22.372	-	-	5.221	6.914	2.053	2.889
(344)	(360)	6	(24)	-	-	(27)	(83)	-	(10)
\$ (3.710)	\$ 5.817	\$ (6.470)	\$ 22.348	\$ -	\$ -	\$ 5.194	\$ 6.831	\$ 2.053	\$ 2.879

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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenden-ertrag und Anleihezinsen	€ 1.018	€ 1.230	\$ 142.994	\$ 154.982	\$ –	\$ –	\$ 25.989	\$ 21.368
Zinsen	–	–	17	6	–	–	–	1
Ausgleich	(1)	–	(811)	137	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	39	(326)	325.097	491.278.643	–	–	20.003	9.874.403
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	279	(1.381)	(74.100)	(490.987.581)	–	–	(31.723)	(9.860.235)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	1.335	(477)	393.197	446.187	–	–	14.269	35.537
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	2	37.611	39.773	–	–	135	127
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	18	19	1.888	2.102	–	–	331	265
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	2.406	2.602	–	–	–	–
Anwaltsgebühren	–	–	47	32	–	–	8	4
Prüfungsgebühren	12	12	22	20	–	–	15	14
Druckgebühren	2	2	286	256	–	–	47	29
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	17	6	95	60	–	–	6	2
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	21	14	–	–	3	2
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	7	9	417	594	–	–	70	69
Gesamtaufwendungen	56	50	42.793	45.453	–	–	615	512
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	56	50	42.793	45.453	–	–	615	512
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	1.279	(527)	350.404	400.734	–	–	13.654	35.025
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(153)	(184)	(25.128)	(29.855)	–	–	(19)	(28)
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	1.126	(711)	325.276	370.879	–	–	13.635	34.997
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	–	(3.879)	(7.036)	–	–	(180)	(239)
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ 1.126	€ (711)	\$ 321.397	\$ 363.843	\$ –	\$ –	\$ 13.455	\$ 34.758
(in Tsd.)	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]	
	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenden-ertrag und Anleihezinsen	\$ 299	\$ –	\$ 3.743	\$ 10.608	\$ 11.371	\$ 11.431	\$ 325	\$ 300
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	–	(21)	(141)	–	(100)	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	1	–	(4.618)	(47.742)	(5.581)	18.166	408	(430)
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	445	–	(3.026)	59.828	(20.756)	59.781	(188)	752
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	745	–	(3.922)	22.553	(14.966)	89.278	545	622
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	1.158	2.333	1.616	2.117	29	23
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	9	–	95	237	219	241	6	6
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	151	220	4	15	–	–
Anwaltsgebühren	–	–	2	4	5	4	–	–
Prüfungsgebühren	20	–	22	20	15	13	15	14
Druckgebühren	1	–	15	31	32	28	1	–
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	1	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	2	2	2	1	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	12	–	32	110	55	75	6	7
Gesamtaufwendungen	42	–	1.477	2.958	1.948	2.494	57	50
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(42)	–	–	–	–	–	(19)	(19)
Nettoaufwendungen insgesamt	–	–	1.477	2.958	1.948	2.494	38	31
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	745	–	(5.399)	19.595	(16.914)	86.784	507	591
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(279)	–	(554)	(2.361)	(674)	(2.052)	(3)	(3)
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	466	–	(5.953)	17.234	(17.588)	84.732	504	588
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(1)	–	(100)	(166)	(410)	(377)	1	–
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 465	\$ –	\$ (6.053)	\$ 17.068	\$ (17.998)	\$ 84.355	\$ 505	\$ 588

Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund ^A		Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund ^A		Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund ^A		Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund ^A		Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund ^A	
Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
\$ -	\$ -	\$ 18.881	\$ 28.570	\$ 10.323	\$ 13.651	£ 884	£ 1.353	\$ 2.868	\$ 2.221
-	-	-	12	-	2	-	-	-	-
-	-	(12)	1	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	(7.772)	(100.179)	256	(2.415)	110	499	3.700	1.619
-	-	22.701	(185.292)	(6.862)	(5.088)	1.068	560	(2.324)	3.631
-	-	33.798	(256.888)	3.717	6.150	2.062	2.412	4.244	7.471
-	-	2.158	2.601	5	6	-	-	33	48
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	346	374	284	256	25	37	58	38
-	-	33	41	-	-	-	-	1	6
-	-	8	8	6	4	1	-	1	-
-	-	22	14	15	14	8	8	15	14
-	-	47	57	39	34	3	4	8	4
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	13	-	2	1	1	-	-
-	-	3	3	2	2	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	54	130	46	73	5	9	15	13
-	-	2.671	3.241	397	391	43	59	131	123
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	2.671	3.241	397	391	43	59	131	123
-	-	31.127	(260.129)	3.320	5.759	2.019	2.353	4.113	7.348
-	-	(1.523)	(2.119)	-	-	-	-	-	-
-	-	29.604	(262.248)	3.320	5.759	2.019	2.353	4.113	7.348
-	-	-	-	-	-	1	(1)	(8)	(13)
\$ -	\$ -	\$ 29.604	\$ (262.248)	\$ 3.320	\$ 5.759	£ 2.020	£ 2.352	\$ 4.105	\$ 7.335
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund ^A		Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund ^A		Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund ^A		Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund ^A	
Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
\$ 5.369	\$ 9.327	\$ -	\$ 21.353	\$ 13.855	\$ 1.333	\$ 1.160	\$ 702	\$ 300	\$ 275
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	(6.624)	95	7	-	-	-	-
-	-	33	-	-	-	-	-	-	-
(8.102)	(8.115)	1.878	(131.542)	(11.521)	5.249	825	(1.938)	17	323
5.796	36.830	(1.878)	72.851	8.371	4.088	(388)	(3.146)	(203)	499
3.063	38.042	33	(43.962)	10.800	10.677	1.597	(4.382)	114	1.097
1.080	1.169	-	903	3.567	355	289	178	23	20
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
111	173	-	340	255	30	20	20	6	6
6	10	-	-	402	43	11	3	-	-
3	2	-	7	4	-	-	-	-	-
14	21	-	14	15	14	15	14	15	14
20	19	-	52	26	2	2	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	-	-	1	-	-	-	-	-	-
2	1	-	3	1	-	-	-	-	-
-	-	33	-	-	-	-	-	-	-
40	53	-	112	59	20	10	10	5	9
1.277	1.448	33	1.432	4.329	464	347	226	49	49
-	-	-	-	-	(5)	(5)	(14)	(18)	(22)
1.277	1.448	33	1.432	4.329	459	342	212	31	27
1.786	36.594	-	(45.394)	6.471	10.218	1.255	(4.594)	83	1.070
(54)	(86)	-	(15.152)	(7.053)	(1.148)	-	-	(651)	(535)
1.732	36.508	-	(60.546)	(582)	9.070	1.255	(4.594)	(568)	535
(96)	(297)	-	(468)	(259)	(15)	(28)	(11)	1	(1)
\$ 1.636	\$ 36.211	\$ -	\$ (61.014)	\$ (841)	\$ 9.055	\$ 1.227	\$ (4.605)	\$ (567)	\$ 534

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung- (Fortsetzung)

(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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
	ANLAGEERTRÄGE:							
Bruttodividendenentrag und Anleihezinsen	\$ –	\$ –	\$ 10.406	\$ 9.698	\$ 20	\$ 30	\$ 6.166	\$ 3.545
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	–	–	–	–	–	1	2
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam num bezulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten: Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	(8.840)	(19.891)	178	97	33.146	546
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	(16.316)	35.287	87	105	26.047	20.757
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	–	–	(14.750)	25.094	285	232	65.360	24.850
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	32	81	5	4	2.760	1.152
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	114	108	3	4	211	104
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	1	1	–	–	286	63
Anwaltsgebühren	–	–	3	2	–	–	4	1
Prüfungsgebühren	–	–	14	13	14	13	11	14
Druckgebühren	–	–	17	13	–	–	26	11
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	1	1	–	–	1	1
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	–	–	25	32	5	5	43	35
Gesamtaufwendungen	–	–	207	251	27	26	3.342	1.381
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückübertragung von Spesen (Erläuterung 3)	–	–	–	–	(21)	(20)	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	–	–	207	251	6	6	3.342	1.381
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	–	–	(14.957)	24.843	279	226	62.018	23.469
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	–	–	(1)	–	–	–	(148)	(7)
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	–	–	(14.958)	24.843	279	226	61.870	23.462
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	–	(312)	(511)	(6)	(9)	(1.466)	(857)
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ –	\$ (15.270)	\$ 24.332	\$ 273	\$ 217	\$ 60.404	\$ 22.605
(in Tsd.)	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^	
	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
	ANLAGEERTRÄGE:							
Bruttodividendenentrag und Anleihezinsen	\$ 2.909	\$ 4.617	\$ 1.001	\$ 749	\$ 5.651	\$ 635	\$ 79	\$ 63
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	(1)	(41)	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam num bezulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten: Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	39.321	22.000	445	(3.066)	15.471	3.726	611	(44)
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(21.813)	27.790	4.702	4.022	132.339	25.248	684	2.056
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	20.416	54.366	6.148	1.705	153.461	29.609	1.374	2.075
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	3.527	3.437	240	205	2.791	261	44	29
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	244	260	17	16	318	38	7	5
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	456	445	38	33	325	63	1	1
Anwaltsgebühren	6	4	–	–	6	–	–	–
Prüfungsgebühren	22	21	15	14	11	7	7	7
Druckgebühren	33	32	2	1	36	2	–	–
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	1	16	–	–	1	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	2	2	–	–	1	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	58	98	10	12	58	9	9	5
Gesamtaufwendungen	4.349	4.315	322	281	3.547	380	68	47
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückübertragung von Spesen (Erläuterung 3)	–	–	(13)	(15)	(46)	(16)	(13)	(11)
Nettoaufwendungen insgesamt	4.349	4.315	309	266	3.501	364	55	36
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	16.067	50.051	5.839	1.439	149.960	29.245	1.319	2.039
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(70)	(419)	(133)	(169)	(28)	(7)	–	–
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	15.997	49.632	5.706	1.270	149.932	29.238	1.319	2.039
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(558)	(849)	(191)	(137)	(1.485)	(172)	(15)	(15)
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 15.439	\$ 48.783	\$ 5.515	\$ 1.133	\$ 148.447	\$ 29.066	\$ 1.304	\$ 2.024

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Global 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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 1.344	\$ 1.680	\$ 6.107	\$ 6.628
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	2	-	-	-	-	-	(2)	-	-
-	-	-	-	-	-	17.710	8.409	91.622	68.272
-	-	-	-	-	-	17.859	21.131	280.405	437.917
-	2	-	-	-	-	36.913	31.218	378.134	512.817
-	-	-	-	-	-	1.252	1.022	7.913	6.472
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	69	62	605	538
-	-	-	-	-	-	204	161	1.028	884
-	-	-	-	-	-	1	1	13	7
-	-	-	-	-	-	15	14	22	20
-	-	-	-	-	-	9	7	81	54
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	2	-	-	-	-	1	-	6	3
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	20	24	135	150
-	2	-	-	-	-	1.571	1.291	9.803	8.128
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	2	-	-	-	-	1.571	1.291	9.803	8.128
-	-	-	-	-	-	35.342	29.927	368.331	504.689
-	-	-	-	-	-	(17)	(44)	-	(3)
-	-	-	-	-	-	35.325	29.883	368.331	504.686
-	-	-	-	-	-	(363)	(484)	(1.705)	(1.919)
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 34.962	\$ 29.399	\$ 366.626	\$ 502.767
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund ^{^a}		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
€ 9.538	€ 11.020	\$ 51	\$ 44	\$ 599	\$ -	\$ 6.388	\$ 1.603	\$ 455	\$ 590
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(122)	(5)	-	-	11	-	-	-	-	(3)
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
15.371	(48.882)	(77)	(10)	(23)	-	264.066	(32.502)	11.047	(2.825)
77.497	(41.732)	242	(321)	2.110	-	(171.565)	53.129	(8.670)	4.294
102.284	(79.599)	216	(287)	2.697	-	98.889	22.230	2.832	2.056
3.134	3.288	16	12	191	-	7.182	2.096	700	400
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
203	229	3	4	10	-	406	129	35	23
351	413	2	2	46	-	1.256	373	125	76
4	3	-	-	-	-	9	10	1	-
12	12	4	10	8	-	22	20	15	14
24	26	-	-	-	-	56	15	4	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
51	111	-	-	-	-	-	-	-	-
2	1	-	-	-	-	3	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
40	71	5	6	5	-	104	54	14	14
3.821	4.154	30	34	260	-	9.038	2.698	894	529
-	(2)	(14)	(18)	(6)	-	-	(1)	-	(3)
3.821	4.152	16	16	254	-	9.038	2.697	894	526
98.463	(83.751)	200	(303)	2.443	-	89.851	19.533	1.938	1.530
(2.048)	(1.908)	(8)	(8)	(871)	-	-	-	(54)	(64)
96.415	(85.659)	192	(311)	1.572	-	89.851	19.533	1.884	1.466
(1.281)	(1.669)	(6)	(4)	(81)	-	(1.671)	(417)	(92)	91
€ 95.134	€ (87.328)	\$ 186	\$ (315)	\$ 1.491	\$ -	\$ 88.180	\$ 19.116	\$ 1.792	\$ 1.557

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung- (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason PCM US Equity Fund [^]		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund		Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Battery March International Large Cap Fund [^]	
	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen	\$ -	\$ -	€ 931	€ 1.051	\$ 1.108	\$ 1.651	\$ -	\$ -
Zinsen	-	-	-	-	-	-	-	-
Ausgleich	-	-	-	(6)	(2)	(14)	-	-
Sonstige Erträge	-	-	-	-	-	-	-	-
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-	-	597	(3.180)	(308)	(3.445)	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-	-	3.638	(441)	218	708	-	-
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	-	-	5.166	(2.576)	1.016	(1.100)	-	-
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	-	-	192	193	215	250	-	-
Erfolgspremien (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	-	-	12	15	13	20	-	-
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	-	-	20	20	35	50	-	-
Anwaltsgebühren	-	-	-	-	-	-	-	-
Prüfungsgebühren	-	-	8	19	11	10	-	-
Druckgebühren	-	-	1	1	2	2	-	-
Dividendenaufwand	-	-	-	-	-	-	-	-
Zinsaufwendungen	-	-	1	1	-	-	-	-
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	-	-	-
Sonstige Aufwendungen	-	-	6	10	10	17	-	-
Gesamtaufwendungen	-	-	240	259	286	349	-	-
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	-	-	(3)	(8)	(13)	(10)	-	-
Nettoaufwendungen insgesamt	-	-	237	251	273	339	-	-
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	-	-	4.929	(2.827)	743	(1.439)	-	-
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	-	-	(185)	(247)	(346)	(452)	-	-
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	-	-	4.744	(3.074)	397	(1.891)	-	-
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	-	-	(379)	(117)	(113)	(152)	-	-
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -	\$ -	€ 4.365	€ (3.191)	\$ 284	\$ (2.043)	\$ -	\$ -

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^] β		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund [^]	
	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen	€ 220	€ 1.098	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	¥ -	¥ -
Zinsen	-	1	-	-	-	-	-	-
Ausgleich	-	-	-	-	-	-	-	-
Sonstige Erträge	4	-	-	-	-	-	-	-
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	4.781	(8.672)	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(2.150)	(4.584)	-	-	-	-	-	-
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	2.855	(12.157)	-	-	-	-	-	-
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	140	950	-	-	-	-	-	-
Erfolgspremien (Erläuterung 3)	3	-	-	-	-	-	-	-
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	10	49	-	-	-	-	-	-
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	21	167	-	-	-	-	-	-
Anwaltsgebühren	-	1	-	-	-	-	-	-
Prüfungsgebühren	12	12	-	-	-	-	-	-
Druckgebühren	1	6	-	-	-	-	-	-
Dividendenaufwand	88	1.232	-	-	-	-	-	-
Zinsaufwendungen	32	368	-	-	-	-	-	-
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	4	-	-	-	-	-	-	-
Sonstige Aufwendungen	9	23	-	-	-	-	-	-
Gesamtaufwendungen	320	2.808	-	-	-	-	-	-
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(29)	(63)	-	-	-	-	-	-
Nettoaufwendungen insgesamt	291	2.745	-	-	-	-	-	-
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	2.564	(14.902)	-	-	-	-	-	-
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	-	-	-	-	-	-	-	-
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	2.564	(14.902)	-	-	-	-	-	-
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(97)	(187)	-	-	-	-	-	-
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ 2.467	€ (15.089)	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	¥ -	¥ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund ^µ		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Congruix Japan Equity Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]	
Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
\$ 22	\$ 226	\$ 386	\$ 399	¥ –	¥ –	\$ –	\$ 944	\$ 1.568	\$ –
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	1	(304)	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
2.561	(670)	212	(520)	–	–	235	(5.944)	–	–
(2.629)	916	959	(86)	–	–	(5.009)	10.343	–	–
(46)	472	1.557	(207)	–	–	(3.829)	5.663	–	–
4	30	83	78	–	–	380	502	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1	7	7	7	–	–	29	40	–	–
–	1	8	8	–	–	105	145	–	–
–	–	–	–	–	–	1	1	–	–
14	14	12	14	–	–	7	7	–	–
–	–	–	1	–	–	4	5	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
6	11	7	8	–	–	9	19	–	–
25	63	117	116	–	–	535	719	–	–
(23)	(24)	(9)	(11)	–	–	(83)	(115)	–	–
2	39	108	105	–	–	452	604	–	–
(48)	433	1.449	(312)	–	–	(4.281)	5.059	–	–
(1)	(2)	(53)	(78)	–	–	–	–	–	–
(49)	431	1.396	(390)	–	–	(4.281)	5.059	–	–
(2)	(26)	(65)	(62)	–	–	(49)	(64)	–	–
\$ (51)	\$ 405	\$ 1.331	\$ (452)	¥ –	¥ –	\$ (4.330)	\$ 4.995	\$ –	\$ –
Legg Mason Martin Currie North American 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 Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund [^]	
Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
\$ –	\$ –	\$ 597	\$ 245	\$ 827	\$ 215	\$ 349	\$ 375	\$ –	\$ –
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	10.291	228	113	(677)	960	(955)	–	–
–	–	10.164	10.713	303	75	(2.570)	5.288	–	–
–	–	21.052	11.186	1.243	(387)	(1.261)	4.708	–	–
–	–	502	135	123	17	180	97	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	46	19	11	6	17	13	–	–
–	–	51	7	38	4	14	5	–	–
–	–	1	–	–	–	–	–	–	–
–	–	11	7	11	10	7	6	–	–
–	–	5	1	1	–	2	1	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	1	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	12	9	8	9	11	12	–	–
–	–	628	179	192	46	231	134	–	–
–	–	–	(2)	(15)	(19)	(9)	(10)	–	–
–	–	628	177	177	27	222	124	–	–
–	–	20.424	11.009	1.066	(414)	(1.483)	4.584	–	–
–	–	–	–	(258)	(58)	–	–	–	–
–	–	20.424	11.009	808	(472)	(1.483)	4.584	–	–
–	–	(51)	(29)	(59)	(20)	(40)	(42)	–	–
\$ –	\$ –	\$ 20.373	\$ 10.980	\$ 749	\$ (492)	\$ (1.523)	\$ 4.542	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung- (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]		Legg Mason Global Funds Plc	
	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
ANLAGEERTRÄGE:				
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	€ 941	€ 35	\$ 366.996	\$ 400.345
Zinsen	–	–	20	27
Ausgleich	–	–	(906)	(7.074)
Sonstige Erträge	–	–	39	2
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	962	21	858.695	652.304.129
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	38.646	553	265.668	(651.546.859)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	40.549	609	1.490.512	1.150.570
AUFWENDUNGEN:				
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	388	19	95.325	85.028
Erfolgprämien (Erläuterung 3)	–	–	4	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	59	5	7.673	7.366
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	4	2	8.392	6.748
Anwaltsgebühren	1	–	179	123
Prüfungsgebühren	6	6	785	755
Druckgebühren	6	–	1.074	887
Dividendenaufwand	–	–	105	1.384
Zinsaufwendungen	8	1	273	670
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	69	46
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	39	2
Sonstige Aufwendungen	11	3	1.891	2.481
Gesamtaufwendungen	483	36	115.809	105.490
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	(10)	(2.930)	(1.910)
Nettoaufwendungen insgesamt	483	26	112.879	103.580
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	40.066	583	1.377.633	1.046.990
FINANZIERUNGSKOSTEN:				
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	–	–	(57.446)	(76.519)
Gewinn/(Verlust) während des Berichtszeitraums	40.066	583	1.320.187	970.471
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(107)	(4)	(16.087)	(17.403)
(Abnahme)/Zunahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ 39.959	€ 579	\$ 1.304.100	\$ 953.068

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

Gewinne und Verluste ergaben sich ausschließlich aus dem laufenden Geschäft, mit Ausnahme des Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^] und des Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], die den Betrieb eingestellt haben. 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, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund (ehemals 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[^] und Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum bis zum 31. August 2021 zum US/EUR-Wechselkurs von 0,8376 umgerechnet (31. August 2020: 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 2021 zum USD/GBP-Wechselkurs von 0,7195 in US-Dollar umgerechnet (31. August 2020: 0,7965).

μ Mit Wirkung zum 14. April 2021 hat der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund den Handel eingestellt.

α Mit Wirkung zum 30. April 2021 begann der Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund mit dem Handel.

β Ab dem 1. Juni 2021 stellte der Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund[^] den Handel ein.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

Entwicklung des den Inhabern von einlösbaren Beteiligungsanteilen zurechenbaren Nettovermögens

(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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	€	€
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 8	\$ (249)	\$ 4.011	\$ 10.004	\$ 33.601	\$ 56.345	€ 1.371	€ 1.078
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	706.817	949.579	39.172	128.400	426.161	528.001	1.518	200
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	36	987	570	472	952	784	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(677.400)	(861.293)	(72.025)	(142.462)	(538.610)	(419.042)	(690)	(15.109)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	29.453	89.273	(32.283)	(13.590)	(111.497)	109.743	828	(14.909)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	29.461	89.024	(28.272)	(3.586)	(77.896)	166.088	2.199	(13.831)
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	882.330	997.244	299.130	316.407	1.647.418	1.534.643	111.323	124.128
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	\$ 911.791	\$ 1.086.268	\$ 270.858	\$ 312.821	\$ 1.569.522	\$ 1.700.731	€ 113.522	€ 110.297

(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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 1.618	\$ 1.635	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2.144	\$ 1.388
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	29.311	29.673	–	–	–	–	1.144	477
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	268	233	–	–	–	–	–	48
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(38.118)	(45.463)	–	–	–	–	(1.130)	(2.877)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	(8.539)	(15.557)	–	–	–	–	14	(2.352)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(6.921)	(13.922)	–	–	–	–	2.158	(964)
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	102.562	107.743	–	–	–	–	48.798	47.508
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	\$ 95.641	\$ 93.821	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 50.956	\$ 46.544

(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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
	€	€	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ 1.126	€ (711)	\$ 321.397	\$ 363.843	\$ –	\$ –	\$ 13.455	\$ 34.758
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	12	6	583.406	911.311	–	–	38.348	136.410
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	77	182	519	748	–	–	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(6.072)	(3.050)	(1.536.939)	(1.858.012)	–	–	(23.440)	(34.806)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	(5.983)	(2.862)	(953.014)	(945.953)	–	–	14.908	101.604
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(4.857)	(3.573)	(631.617)	(582.110)	–	–	28.363	136.362
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	54.345	57.103	6.646.080	7.637.950	–	–	1.081.858	871.997
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	€ 49.488	€ 53.530	\$ 6.014.463	\$ 7.055.840	\$ –	\$ –	\$ 1.110.221	\$ 1.008.359

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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
\$ 673	\$ 515	\$ 6.742	\$ 27.794	\$ 6.756	\$ 1.693	\$ 126	\$ 643	\$ 71	\$ 20
43.177	8.109	72.761	43.659	100.058	72.138	29.328	2.860	6.775	3.015
253	265	527	742	1.014	1.364	313	153	816	807
(9.927)	(3.247)	(380.288)	(135.805)	(69.634)	(61.107)	(3.878)	(4.225)	(2.826)	(8.983)
33.503	5.127	(307.000)	(91.404)	31.438	12.395	25.763	(1.212)	4.765	(5.161)
34.176	5.642	(300.258)	(63.610)	38.194	14.088	25.889	(569)	4.836	(5.141)
26.433	21.041	655.931	734.170	219.127	169.193	22.769	18.805	40.233	42.544
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 60.609	\$ 26.683	\$ 355.673	\$ 670.560	\$ 257.321	\$ 183.281	\$ 48.658	\$ 18.236	\$ 45.069	\$ 37.403

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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
\$ (3.710)	\$ 5.817	\$ (6.470)	\$ 22.348	\$ -	\$ -	\$ 5.194	\$ 6.831	\$ 2.053	\$ 2.879
34.748	82.406	105.388	147.666	-	-	26.608	54.950	3.399	8.541
109	131	1	13	-	-	-	-	-	-
(89.369)	(110.584)	(114.887)	(40.976)	-	-	(81.176)	(71.816)	(933)	(14.799)
(54.512)	(28.047)	(9.498)	106.703	-	-	(54.568)	(16.866)	2.466	(6.258)
(58.222)	(22.230)	(15.968)	129.051	-	-	(49.374)	(10.035)	4.519	(3.379)
626.909	573.934	518.699	276.535	-	-	286.292	263.958	82.725	79.161
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 568.687	\$ 551.704	\$ 502.731	\$ 405.586	\$ -	\$ -	\$ 236.918	\$ 253.923	\$ 87.244	\$ 75.782

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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
\$ -	\$ -	\$ 29.604	\$ (262.248)	\$ 3.320	\$ 5.759	£ 2.020	£ 2.352	\$ 4.105	\$ 7.335
-	-	186.477	168.646	205.798	624	-	-	3.306	2.101
-	-	-	13	-	-	-	-	-	-
-	-	(143.579)	(668.702)	(4.411)	(282.043)	-	-	(9.370)	(7.671)
-	-	42.898	(500.043)	201.387	(281.419)	-	-	(6.064)	(5.570)
-	-	72.502	(762.291)	204.707	(275.660)	2.020	2.352	(1.959)	1.765
-	-	1.105.162	1.921.028	823.416	1.076.665	76.685	113.272	191.596	123.718
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ -	\$ -	\$ 1.177.664	\$ 1.158.737	\$ 1.028.123	\$ 801.005	£ 78.705	£ 115.624	\$ 189.637	\$ 125.483

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]	
	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 465	\$ –	\$ (6.053)	\$ 17.068	\$ (17.998)	\$ 84.355	\$ 505	\$ 588
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	179	–	24.224	69.491	23.881	16.795	199	30
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	279	–	93	197	4	263	1	2
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(1)	–	(114.413)	(426.096)	(19.912)	(156.237)	(563)	(51)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	457	–	(90.096)	(356.408)	3.973	(139.179)	(363)	(19)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	922	–	(96.149)	(339.340)	(14.025)	(54.824)	142	569
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	22.193	–	367.907	930.667	728.674	834.603	12.059	10.656
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	\$ 23.115	\$ –	\$ 271.758	\$ 591.327	\$ 714.649	\$ 779.779	\$ 12.201	\$ 11.225

(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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ –	\$ (15.270)	\$ 24.332	\$ 273	\$ 217	\$ 60.404	\$ 22.605
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	–	–	2.934	8.635	57	–	265.298	32.856
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	–	–	8	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	–	–	(259.881)	(12.721)	(23)	(1.997)	(96.202)	(43.348)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	(256.947)	(4.086)	34	(1.997)	169.104	(10.492)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	–	–	(272.217)	20.246	307	(1.780)	229.508	12.113
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	391.296	382.082	1.879	3.301	509.085	325.900
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	\$ –	\$ –	\$ 119.079	\$ 402.328	\$ 2.186	\$ 1.521	\$ 738.593	\$ 338.013

(in Tsd.)	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 [^]	
	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 15.439	\$ 48.783	\$ 5.515	\$ 1.133	\$ 148.447	\$ 29.066	\$ 1.304	\$ 2.024
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	36.326	38.317	1.398	1.797	640.807	166.315	1.330	61
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	3	19	–	1	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(88.966)	(285.247)	(2.166)	(4.406)	(148.953)	(35.377)	(73)	(713)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	(52.640)	(246.930)	(765)	(2.590)	491.854	130.939	1.257	(652)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(37.201)	(198.147)	4.750	(1.457)	640.301	160.005	2.561	1.372
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	790.698	945.826	38.689	39.784	645.224	49.672	11.089	8.463
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	\$ 753.497	\$ 747.679	\$ 43.439	\$ 38.327	\$ 1.285.525	\$ 209.677	\$ 13.650	\$ 9.835

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
\$ 1.636	\$ 36.211	\$ -	\$ (61.014)	\$ (841)	\$ 9.055	\$ 1.227	\$ (4.605)	\$ (567)	\$ 534
20.899	69.899	-	11.409	904.276	75.784	8.021	12.523	-	-
7	43	-	-	259	46	-	-	-	-
(332.983)	(57.412)	-	(905.623)	(65.708)	(26.109)	(3.300)	(4.869)	-	-
(312.077)	12.530	-	(894.214)	838.827	49.721	4.721	7.654	-	-
(310.441)	48.741	-	(955.228)	837.986	58.776	5.948	3.049	(567)	534
585.721	548.932	-	1.590.814	453.285	71.029	52.020	43.385	11.774	10.534
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 275.280	\$ 597.673	\$ -	\$ 635.586	\$ 1.291.271	\$ 129.805	\$ 57.968	\$ 46.434	\$ 11.207	\$ 11.068

Legg Mason ClearBridge Global 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 den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 34.962	\$ 29.399	\$ 366.626	\$ 502.767
-	-	-	-	-	-	25.751	11.634	370.750	380.639
-	-	-	-	-	-	2	8	-	-
-	-	-	-	-	-	(43.033)	(38.802)	(431.840)	(493.886)
-	-	-	-	-	-	(17.280)	(27.160)	(61.090)	(113.247)
-	-	-	-	-	-	17.682	2.239	305.536	389.520
-	-	-	-	-	-	206.008	193.438	1.811.052	1.521.006
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 223.690	\$ 195.677	\$ 2.116.588	\$ 1.910.526

Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund ^{^α}		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
€ 95.134	€ (87.328)	\$ 186	\$ (315)	\$ 1.491	\$ -	\$ 88.180	\$ 19.116	\$ 1.792	\$ 1.557
152.206	229.906	5	7	101.304	-	841.579	110.126	36.140	4.976
3	-	-	1	59	-	-	-	-	-
(171.134)	(254.916)	-	-	-	-	(1.142.594)	(139.424)	(29.658)	(12.466)
(18.925)	(25.010)	5	8	101.363	-	(301.015)	(29.298)	6.482	(7.490)
76.209	(112.338)	191	(307)	102.854	-	(212.835)	(10.182)	8.274	(5.933)
605.013	773.938	2.725	2.686	-	-	1.288.870	448.058	91.096	68.057
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
€ 681.222	€ 661.600	\$ 2.916	\$ 2.379	\$ 102.854	\$ -	\$ 1.076.035	\$ 437.876	\$ 99.370	\$ 62.124

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason PCM US Equity Fund [^]		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund		Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund [^]	
	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -	\$ -	€ 4.365	€ (3.191)	\$ 284	\$ (2.043)	\$ -	\$ -
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	-	-	4.802	1.654	1.899	7.725	-	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	62	93	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-	-	(12.232)	(6.187)	(3.827)	(32.487)	-	-
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	(7.430)	(4.533)	(1.866)	(24.669)	-	-
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-	-	(3.065)	(7.724)	(1.582)	(26.712)	-	-
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	-	-	33.368	40.774	31.037	64.036	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Ende des Berichtszeitraums	\$ -	\$ -	€ 30.303	€ 33.050	\$ 29.455	\$ 37.324	\$ -	\$ -

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund ^{^β}		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund [^]	
	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ 2.467	€ (15.089)	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	¥ -	¥ -
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	4.064	11.929	-	-	-	-	-	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	-	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(46.874)	(82.082)	-	-	-	-	-	-
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	(42.810)	(70.153)	-	-	-	-	-	-
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(40.343)	(85.242)	-	-	-	-	-	-
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	40.343	189.847	-	-	-	-	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Ende des Berichtszeitraums	€ -	€ 104.605	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	¥ -	¥ -

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund ^{^μ}		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Congruix Japan Equity Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]	
Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
\$ (51)	\$ 405	\$ 1.331	\$ (452)	¥ –	¥ –	\$ (4.330)	\$ 4.995	\$ –	\$ –
–	28	429	125	–	–	7.360	5.611	–	–
1	1	–	–	–	–	3	–	–	–
(14.689)	(160)	(2.424)	(642)	–	–	(513)	(113.000)	–	–
(14.688)	(131)	(1.995)	(517)	–	–	6.850	(107.389)	–	–
(14.739)	274	(664)	(969)	–	–	2.520	(102.394)	–	–
14.739	12.185	12.685	13.469	–	–	80.080	164.718	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$ –	\$ 12.459	\$ 12.021	\$ 12.500	¥ –	¥ –	\$ 82.600	\$ 62.324	\$ –	\$ –
Legg Mason Martin Currie North American 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 Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund [^]	
Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
\$ –	\$ –	\$ 20.373	\$ 10.980	\$ 749	\$ (492)	\$ (1.523)	\$ 4.542	\$ –	\$ –
–	–	88.306	28.717	1.332	2.239	12.348	3.025	–	–
–	–	–	–	164	10	–	–	–	–
–	–	(61.591)	(7.271)	(737)	(196)	(4.706)	(1.017)	–	–
–	–	26.715	21.446	759	2.053	7.642	2.008	–	–
–	–	47.088	32.426	1.508	1.561	6.119	6.550	–	–
–	–	104.349	34.180	26.576	8.241	41.801	29.421	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$ –	\$ –	\$ 151.437	\$ 66.606	\$ 28.084	\$ 9.802	\$ 47.920	\$ 35.971	\$ –	\$ –

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]		Legg Mason Global Funds Plc	
	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020	Für den sechs Monate zum 31. August 2021	Für den sechs Monate zum 31. August 2020
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ 39.959	€ 579	\$ 1.304.100	\$ 953.068
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN				
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	113.804	325	6.384.508	4.607.569
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	6.419	7.648
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(24.587)	(637)	(6.963.688)	(7.967.224)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	89.217	(312)	(572.761)	(3.352.007)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	129.176	267	731.339	(2.398.939)
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN				
Zu Beginn des Berichtszeitraums	111.371	6.138	24.833.772	26.557.820
Währungsumrechnung	–	–	(28.218)	97.333
Ende des Berichtszeitraums	€ 240.547	€ 6.405	\$ 25.536.893	\$ 24.256.214

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

Alle Euro-Zahlen, mit Ausnahme des Nettovermögens zu Beginn des Zeitraums, das den 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 Franklin MV European Equity Growth and Income Fund (ehemals Legg Mason QSMV European Equity Growth and Income Fund), den Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] und den Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und den Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund wurden für die Berechnung der Gesamtsumme des am 31. August 2021 zu Ende gegangenen Berichtszeitraum im Legg Mason Global Funds Plc unter Verwendung des USD/EUR-Wechselkurses von 0,8376 (31. August 2020: 0,8912) in US-Dollar umgerechnet.

Das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen zu Berichtsbeginn für den Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, den Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, den Franklin MC European Equity Growth and Income Fund (ehemals Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund), den Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], den Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und den Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags zum 29. Februar 2021 zum USD/EUR-Durchschnittskurs von 0,8288 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2020: 0,9058).

Alle britischen Pfund-Beträge, mit Ausnahme des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens zu Berichtsbeginn, 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 2021 zum USD/GBP-Durchschnittskurs von 0,7195 (31. August 2020: 0,7965) in US-Dollar umgerechnet.

Das Nettovermögen zu Anfang 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 unter Verwendung des USD/GBP-Wechselkurses zum 28. Februar 2021 von 0,7178 in US-Dollar umgerechnet (28 Februar 2021: 0,7799).

μ Mit Wirkung zum 14. April 2021 hat der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund den Handel eingestellt.

α Mit Wirkung zum 30. April 2021 begann der Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund mit dem Handel.

β Ab dem 1. Juni 2021 stellte der Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund[^] den Handel ein.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	774	939		
Eingelöst	(816)	(1.017)		
Nettoabnahme	(42)	(78)		
Klasse A USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	303.414	588.008		
Eingelöst	(274.391)	(498.009)		
Nettozunahme	29.023	89.999		
Klasse B USD, thesaurierend				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	–	–		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	–	4		
Eingelöst	–	(4)		
Nettozunahme	–	–		
Klasse C USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	52	515		
Eingelöst	(147)	(370)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(95)	145		
Klasse X USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	337.191	274.235		
Eingelöst	(332.058)	(266.399)		
Nettozunahme	5.133	7.836		
Klasse A (G) USD, thesaurierend				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	42	1		
Eingelöst	(58)	(120)		
Nettoabnahme	(16)	(119)		
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	–	(96)		
Nettoabnahme	–	(96)		
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	25	288		
Eingelöst	(63)	(508)		
Nettoabnahme	(38)	(220)		
Klasse A USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	88	143		
Eingelöst	(65)	(426)		
Nettozunahme/(-abnahme)	23	(283)		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	7	21		
Eingelöst	(24)	(10)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(17)	11		
Klasse C USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	5	45		
Eingelöst	(36)	(15)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(31)	30		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	–	29		
Eingelöst	(19)	–		
Netto(abnahme)/-zunahme	(19)	29		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	90	248		
Eingelöst	(249)	(54)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(159)	194		
Klasse F USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	73	94		
Eingelöst	(86)	(10)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(13)	84		
Klasse X USD, thesaurierend				
Verkauft	3	6		
Eingelöst	(2)	(3)		
Nettozunahme	1	3		
Klasse X USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(1)		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	3	104		
Eingelöst	(9)	(73)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(6)	31		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	2	17		
Eingelöst	(9)	–		
Netto(abnahme)/-zunahme	(7)	17		
Klasse LM USD, thesaurierend				
Verkauft	33	–		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	32	–		
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	160	507		
Eingelöst	(357)	(230)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(197)	277		
Klasse A USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	102	129		
Eingelöst	(110)	(113)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(8)	16		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	16	246		
Eingelöst	(119)	(18)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(103)	228		
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	51	26		
Eingelöst	(17)	(7)		
Nettozunahme	34	19		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	8	63		
Eingelöst	(32)	(29)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(24)	34		
Klasse B USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme	–	–		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	6	71		
Eingelöst	(53)	(25)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(47)	46		
Klasse C USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	2	32		
Eingelöst	(23)	(10)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(21)	22		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	35	93		
Eingelöst	(96)	(31)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(61)	62		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	1.920	903		
Eingelöst	(839)	(1.060)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1.081	(157)		
Klasse F USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	42	83		
Eingelöst	(40)	(61)		
Nettozunahme	2	22		
Klasse X USD, thesaurierend				
Verkauft	4	73		
Eingelöst	(110)	(71)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(106)	2		
Klasse X USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	2	19		
Eingelöst	(15)	–		
Netto(abnahme)/-zunahme	(13)	19		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	12	34		
Eingelöst	(117)	(7)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(105)	27		
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Eingelöst	(4)	–		
Nettoabnahme	(4)	–		

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – (Fortsetzung)		
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	423	1.300
Eingelöst	(1.333)	(777)
Netto(abnahme)/-zunahme	(910)	523
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	12	–
Eingelöst	–	(442)
Nettozunahme/(-abnahme)	12	(442)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	151	156
Eingelöst	(437)	(250)
Nettoabnahme	(286)	(94)
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	185	–
Nettozunahme	185	–
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	(3)
Nettoabnahme	(1)	(3)
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	14	1
Eingelöst	(5)	–
Nettozunahme	9	1
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Eingelöst	–	(137)
Nettoabnahme	–	(137)
Klasse GA EUR, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	176	26
Eingelöst	(30)	(4)
Nettozunahme	146	22
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	53	3
Eingelöst	(11)	(8)
Netto(abnahme)/-zunahme	42	(5)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	1	–
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(1)
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	1
Eingelöst	–	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	4	(1)
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse B USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	20	18
Eingelöst	(18)	(5)
Nettozunahme	2	13
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	26	1
Eingelöst	(2)	(5)
Netto(abnahme)/-zunahme	24	(4)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	16	12
Eingelöst	(3)	(2)
Nettozunahme	13	10
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	14	4
Nettozunahme	14	4
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(12)	(2)
Nettoabnahme	(11)	(1)
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	36	15
Eingelöst	(16)	(54)
Nettozunahme/(-abnahme)	20	(39)
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	3	12
Eingelöst	(117)	(38)
Nettoabnahme	(114)	(26)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	7	9
Eingelöst	–	(10)
Nettozunahme/(-abnahme)	7	(1)
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	2	3
Eingelöst	(2)	(6)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	3
Eingelöst	(5)	(6)
Nettoabnahme	(2)	(3)
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse A Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(8)	(3)
Nettoabnahme	(7)	(3)
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	671	175
Eingelöst	(542)	(233)
Nettozunahme/(-abnahme)	129	(58)
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	–	(4)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(2)
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	2	1
Eingelöst	(3)	(11)
Nettoabnahme	(1)	(10)
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	4	3
Eingelöst	(4)	(12)
Nettoabnahme	–	(9)
Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	191	9
Eingelöst	(200)	(9)
Nettoabnahme	(9)	–
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(2)	(2)
Nettoabnahme	(1)	(1)

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)				
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	–	(1)	–	–
Nettoabnahme	–	(1)	–	–
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	28	7	–	–
Eingelöst	(9)	(2)	–	–
Nettozunahme	19	5	–	–
Klasse F USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	–	9	–	–
Eingelöst	(14)	(18)	–	–
Nettoabnahme	(14)	(9)	–	–
Klasse X USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	1	2	–	–
Eingelöst	(1)	(10)	–	–
Nettoabnahme	–	(8)	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	79	68	–	–
Eingelöst	(62)	(410)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	17	(342)	–	–
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	228	164	–	–
Eingelöst	(138)	(194)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	90	(30)	–	–
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	13	–	–	–
Nettozunahme	13	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	7	–	–
Eingelöst	(6)	(6)	–	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(6)	1	–	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	–	(25)	–	–
Nettoabnahme	–	(25)	–	–
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)				
Eingelöst	(1)	(8)	–	–
Nettoabnahme	(1)	(8)	–	–
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	1	1	–	–
Eingelöst	(164)	(22)	–	–
Nettoabnahme	(163)	(21)	–	–
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	26	–	–
Eingelöst	(47)	(39)	–	–
Nettoabnahme	(47)	(13)	–	–
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	31	39	–	–
Eingelöst	(33)	(108)	–	–
Nettoabnahme	(2)	(69)	–	–
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	1	–	–
Eingelöst	(1.360)	–	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1.360)	1	–	–
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	147	69	–	–
Eingelöst	(57)	(67)	–	–
Nettozunahme	90	2	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	76	87	–	–
Eingelöst	(63)	(69)	–	–
Nettozunahme	13	18	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	47	84	–	–
Eingelöst	(70)	(10)	–	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(23)	74	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	11	4	–	–
Eingelöst	(3)	(7)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	8	(3)	–	–
Klasse A Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	1	–	–	–
Nettozunahme	1	–	–	–
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	1	–	–	–
Eingelöst	(1)	–	–	–
Nettozunahme	–	–	–	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	391	165	–	–
Eingelöst	(348)	(54)	–	–
Nettozunahme	43	111	–	–
Klasse B USD, thesaurierend				
Verkauft	2	–	–	–
Nettozunahme	2	–	–	–
Klasse B USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	–	1	–	–
Eingelöst	(6)	(2)	–	–
Nettoabnahme	(6)	(1)	–	–
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	1	1	–	–
Eingelöst	(2)	(7)	–	–
Nettoabnahme	(1)	(6)	–	–
Klasse C USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	1	10	–	–
Eingelöst	(2)	(11)	–	–
Nettoabnahme	(1)	(1)	–	–
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	3	1	–	–
Eingelöst	(1)	(4)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(3)	–	–
Klasse E USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	1	–	–	–
Eingelöst	(1)	(15)	–	–
Nettoabnahme	–	(15)	–	–
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	–	–	–
Nettozunahme	1	–	–	–
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	26	10	–	–
Eingelöst	(6)	(5)	–	–
Nettozunahme	20	5	–	–
Klasse F USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	1	1	–	–
Eingelöst	–	(10)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(9)	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	285	232	–	–
Eingelöst	(175)	(189)	–	–
Nettozunahme	110	43	–	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	(6)	–	–	–
Nettoabnahme	(6)	–	–	–
Klasse LM USD, thesaurierend				
Verkauft	–	37	–	–
Nettozunahme	–	37	–	–
Klasse LM USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	3	9	–	–
Eingelöst	(118)	(100)	–	–
Nettoabnahme	(115)	(91)	–	–
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	–	–
Eingelöst	–	(2)	–	–
Nettoabnahme	–	(1)	–	–
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	–	(2)	–	–
Nettoabnahme	–	(2)	–	–
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	7	14	–	–
Eingelöst	(11)	(7)	–	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(4)	7	–	–

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(3)	(2)
Nettoabnahme	(3)	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse A Euro, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	8	50
Eingelöst	(1)	(184)
Netto(abnahme)/-zunahme	7	(134)
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	(3)
Nettoabnahme	(1)	(2)
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(3)	(8)
Nettoabnahme	(3)	(7)
Klasse F USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(3)	(1)
Nettoabnahme	(3)	–
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
LM KLASSE USD, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	282	–
Nettozunahme	282	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	(1)	(2)
Nettoabnahme	(1)	(2)
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(7)
Nettoabnahme	–	(6)
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	20	1
Eingelöst	(3)	–
Nettozunahme	17	1
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	48	38
Eingelöst	(25)	(94)
Nettozunahme/(-abnahme)	23	(56)
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	15	22
Eingelöst	(13)	(41)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(19)
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	3	17
Eingelöst	(22)	(44)
Nettoabnahme	(19)	(27)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	73	4
Eingelöst	(30)	(19)
Nettozunahme/(-abnahme)	43	(15)
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	19	5
Eingelöst	(22)	(30)
Nettoabnahme	(3)	(25)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	19	12
Eingelöst	(21)	(33)
Nettoabnahme	(2)	(21)
Klasse A EUR, thesaurierend		
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse A Euro, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Verkauft	–	5
Eingelöst	(5)	(5)
Nettozunahme	(5)	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	2.358	9.654
Eingelöst	(14.912)	(1.376)
Nettozunahme/(-abnahme)	(12.554)	8.278
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(19)	(6)
Nettoabnahme	(18)	(5)
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	2	1
Eingelöst	–	(4)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(3)
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	7	–
Eingelöst	(2)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(1)
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	30	–
Eingelöst	(5)	(5)
Netto(abnahme)/-zunahme	25	(5)
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	5	5
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme	5	4
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)		
Verkauft	6	3
Eingelöst	(2)	–
Nettozunahme	4	3
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	45	82
Eingelöst	(64)	(114)
Nettoabnahme	(19)	(32)
Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Eingelöst	–	(23)
Nettoabnahme	–	(23)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2	4
Eingelöst	(2)	(8)
Nettoabnahme	–	(4)
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(10)	(3)
Nettoabnahme	(10)	(2)
Klasse L (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(2)	(17)
Nettoabnahme	(1)	(16)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	7	4
Eingelöst	(7)	(18)
Nettoabnahme	–	(14)
Klasse B USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	–	369
Eingelöst	–	(250)
Nettozunahme	–	119
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	32	56
Eingelöst	(65)	(120)
Nettoabnahme	(33)	(64)
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	4	6
Eingelöst	(5)	(11)
Nettoabnahme	(1)	(5)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	68	218
Eingelöst	(328)	(311)
Nettoabnahme	(260)	(93)
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	4	29
Eingelöst	(51)	(92)
Nettoabnahme	(47)	(63)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	13	111
Eingelöst	(94)	(143)
Nettoabnahme	(81)	(32)
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	(5)	–
Nettozunahme	(5)	–
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	36	57
Eingelöst	(128)	(645)
Nettoabnahme	(92)	(588)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	3
Eingelöst	(3)	(1)
Nettozunahme	–	2
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	2	4
Eingelöst	(7)	(8)
Nettoabnahme	(5)	(4)
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	74	265
Eingelöst	(720)	(466)
Nettoabnahme	(646)	(201)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	64	22
Eingelöst	(88)	(257)
Nettoabnahme	(24)	(235)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	2.865	6.170
Eingelöst	(4.307)	(4.234)
Nettozunahme/(-abnahme)	(1.442)	1.936
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	3.461	2.474
Eingelöst	(3.430)	(5.779)
Nettozunahme/(-abnahme)	31	(3.305)
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	(3)	(2)
Nettoabnahme	(3)	(2)
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	(5)	(4)
Nettoabnahme	(5)	(4)
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(3)	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(2)	1
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	6	37
Eingelöst	(40)	(34)
Netto(abnahme)/-zunahme	(34)	3
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	2
Nettozunahme	–	2
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	2	8
Eingelöst	(27)	(3)
Netto(abnahme)/-zunahme	(25)	5
Klasse X USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	3	–
Nettozunahme	3	–
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	13	50
Eingelöst	(35)	(26)
Netto(abnahme)/-zunahme	(22)	24
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	40	116
Eingelöst	(42)	(117)
Nettoabnahme	(2)	(1)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	43	5
Eingelöst	(3)	(4)
Nettozunahme	40	1
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	8	12
Nettozunahme	8	12
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	14
Eingelöst	(10)	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(10)	14
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	–	23
Eingelöst	–	(16)
Nettozunahme	–	7
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	5	–
Nettozunahme	5	–
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	62	72
Eingelöst	(55)	(14)
Nettozunahme	7	58

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	19	45
Eingelöst	(15)	–
Nettozunahme	4	45
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	35	51
Eingelöst	(32)	(2)
Nettozunahme	3	49
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	889	–
Eingelöst	(56)	–
Nettozunahme	833	–
Klasse B USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	40	1
Eingelöst	(3)	–
Nettozunahme	37	1
Klasse C USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	10	7
Eingelöst	(7)	(2)
Nettozunahme	3	5
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	46	13
Eingelöst	(39)	–
Nettozunahme	7	13
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	16	3
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	15	3
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	29	7
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	28	7
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	121	135
Eingelöst	(38)	(23)
Nettozunahme	83	112
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	52	174
Eingelöst	(41)	(55)
Nettozunahme	11	119
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	2
Nettozunahme	–	2
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	(4)	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(3)	2
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	8	98
Eingelöst	(96)	(5)
Netto(abnahme)/-zunahme	(88)	93
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	4	12
Eingelöst	(5)	(10)
Netto(abnahme)/-zunahme	(1)	2
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	193	573
Eingelöst	(516)	(225)
Netto(abnahme)/-zunahme	(323)	348
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	155	–
Nettozunahme	155	–

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Klasse S AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	27
Eingelöst	(20)	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(20)	27
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	110	227
Eingelöst	(484)	(254)
Nettoabnahme	(374)	(27)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	35	127
Eingelöst	(9)	(269)
Nettozunahme/(-abnahme)	26	(142)
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	27
Nettozunahme	–	27
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	9	4
Eingelöst	(10)	(1)
Netto(abnahme)/-zunahme	(1)	3
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	24	–
Nettozunahme	24	–
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	15	60
Eingelöst	(2)	(71)
Nettozunahme/(-abnahme)	13	(11)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	2	–
Eingelöst	(2)	(28)
Nettoabnahme	–	(28)
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5	–
Eingelöst	(3)	–
Nettozunahme	2	–
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund		
Klasse A EUR, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	–	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(2)
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Eingelöst	–	(4)
Nettoabnahme	–	(4)
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Eingelöst	(27)	(12)
Nettoabnahme	(27)	(12)
Klasse LM EUR, ausschüttend (Q)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	(9)	(6)
Nettoabnahme	(8)	(4)
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	316	780
Eingelöst	(1.234)	(1.911)
Nettoabnahme	(918)	(1.131)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	500	415
Eingelöst	(615)	(1.627)
Nettoabnahme	(115)	(1.212)
Klasse A USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	10	775
Eingelöst	(138)	(561)
Netto(abnahme)/-zunahme	(128)	214
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	4
Eingelöst	(15)	(22)
Nettoabnahme	(15)	(18)

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^A – (Fortsetzung)		
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	5	52
Eingelöst	(117)	(209)
Nettoabnahme	(112)	(157)
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	9	9
Eingelöst	(29)	(23)
Nettoabnahme	(20)	(14)
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(23)	(18)
Nettoabnahme	(23)	(16)
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	61
Eingelöst	–	(76)
Nettoabnahme	–	(15)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	470	987
Eingelöst	(687)	(1.603)
Nettoabnahme	(217)	(616)
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	3	13
Eingelöst	(19)	(59)
Nettoabnahme	(16)	(46)
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	1	22
Eingelöst	(37)	(172)
Nettoabnahme	(36)	(150)
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)		
Verkauft	9	11
Eingelöst	(21)	(99)
Nettoabnahme	(12)	(88)
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	38	4
Eingelöst	(60)	(483)
Nettoabnahme	(22)	(479)
Klasse A GBP, thesaurierend		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(1)	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	7	14
Eingelöst	(61)	(73)
Nettoabnahme	(54)	(59)
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	105	108
Eingelöst	(60)	(796)
Nettozunahme/(-abnahme)	45	(688)
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	16.263	9.733
Eingelöst	(20.253)	(27.498)
Nettoabnahme	(3.990)	(17.765)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	6.279	5.870
Eingelöst	(22.469)	(38.644)
Nettoabnahme	(16.190)	(32.774)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	122
Eingelöst	–	(113)
Nettozunahme	–	9
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(1)	1
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	5	39
Eingelöst	(131)	(118)
Nettoabnahme	(126)	(79)
Klasse C USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	(16)	(24)
Nettoabnahme	(15)	(22)
Klasse A NOK, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	217	83
Eingelöst	(72)	(28)
Nettozunahme	145	55

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	3	7
Eingelöst	(87)	(73)
Nettoabnahme	(84)	(66)
Klasse E USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	(14)
Nettoabnahme	(1)	(13)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	2
Eingelöst	(24)	(14)
Nettoabnahme	(21)	(12)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	90	180
Eingelöst	(345)	(435)
Nettoabnahme	(255)	(255)
Klasse F USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	11	13
Eingelöst	(49)	(42)
Nettoabnahme	(38)	(29)
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	189	305
Eingelöst	(532)	(409)
Nettoabnahme	(343)	(104)
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	60	23
Eingelöst	(104)	(309)
Nettoabnahme	(44)	(286)
Klasse X USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	12	12
Eingelöst	(28)	(45)
Nettoabnahme	(16)	(33)
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	36	10
Eingelöst	(25)	(21)
Nettozunahme/(-abnahme)	11	(11)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	178	306
Eingelöst	(314)	(435)
Nettoabnahme	(136)	(129)
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	2	3
Eingelöst	(70)	(11)
Nettoabnahme	(68)	(8)
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	128	10
Eingelöst	(138)	(16)
Nettoabnahme	(10)	(6)
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	5	2
Eingelöst	(2)	(1)
Nettozunahme	3	1
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	74	67
Eingelöst	(217)	(137)
Nettoabnahme	(143)	(70)
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	2	6
Eingelöst	(12)	(6)
Nettoabnahme	(10)	–
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	15	6
Eingelöst	(27)	(17)
Nettoabnahme	(12)	(11)
Klasse X SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	783	793
Eingelöst	(353)	(407)
Nettozunahme	430	386
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	424	847
Eingelöst	(1.145)	(2.118)
Nettoabnahme	(721)	(1.271)
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	192	118
Eingelöst	(433)	(250)
Nettoabnahme	(241)	(132)

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] – (Fortsetzung)				
Klasse Premier AUD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	5		
Eingelöst	(24)	(2)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(24)	3		
Klasse Premier AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)				
Verkauft	35	37		
Eingelöst	(100)	(39)		
Nettoabnahme	(65)	(2)		
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	213	561		
Eingelöst	(588)	(896)		
Nettoabnahme	(375)	(335)		
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	25	42		
Eingelöst	(9)	(62)		
Nettozunahme/(-abnahme)	16	(20)		
Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)				
Verkauft	7	3		
Eingelöst	(2)	(25)		
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(22)		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	507	790		
Eingelöst	(566)	(1.137)		
Nettoabnahme	(59)	(347)		
Klasse Premier EUR, thesaurierend				
Verkauft	17	138		
Eingelöst	(35)	(42)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(18)	96		
Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)				
Verkauft	109	294		
Eingelöst	(486)	(94)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(377)	200		
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	81	127		
Eingelöst	(491)	(685)		
Nettoabnahme	(410)	(558)		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)				
Verkauft	317	271		
Eingelöst	(1.612)	(553)		
Netto Rückgang	(1.295)	(282)		
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	14	7		
Eingelöst	(89)	(160)		
Nettoabnahme	(75)	(153)		
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	16		
Eingelöst	(15)	(57)		
Nettoabnahme	(15)	(41)		
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	13		
Eingelöst	(6)	(448)		
Nettoabnahme	(6)	(435)		
Klasse S USD, thesaurierend				
Eingelöst	(8)	(105)		
Nettoabnahme	(8)	(105)		
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	6	17		
Eingelöst	(195)	(10)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(189)	7		
Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)				
Verkauft	144	260		
Eingelöst	(201)	(147)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(57)	113		
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	(2)		
Nettoabnahme	–	(2)		
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	1	–		
Nettozunahme	1	–		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	1	–		
Nettozunahme	1	–		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	–	15		
Nettozunahme	–	15		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	3	10		
Eingelöst	(39)	(4)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(36)	6		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)				
Verkauft	–	3		
Nettozunahme	–	3		
Klasse S USD, thesaurierend				
Verkauft	6	–		
Eingelöst	(6)	–		
Nettozunahme	–	–		
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	45	19		
Eingelöst	(36)	(16)		
Nettozunahme	9	3		
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	29	21		
Eingelöst	(8)	(13)		
Nettozunahme	21	8		
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	227	395		
Eingelöst	(57)	(95)		
Nettozunahme	170	300		
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	16	12		
Eingelöst	(4)	(13)		
Nettozunahme/(-abnahme)	12	(1)		
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	29	677		
Eingelöst	(36)	(159)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(7)	518		
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]				
Klasse D EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	2		
Eingelöst	(3)	(5)		
Nettoabnahme	(2)	(3)		
Klasse D EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Eingelöst	–	(2)		
Nettoabnahme	–	(2)		
Klasse D USD, thesaurierend				
Eingelöst	(91)	(94)		
Nettoabnahme	(91)	(94)		
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	–	90		
Eingelöst	(107)	–		
Netto(abnahme)/-zunahme	(107)	90		
Klasse D USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	–	283		
Eingelöst	(250)	(59)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(250)	224		
Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	5		
Eingelöst	(5)	–		
Netto(abnahme)/-zunahme	(5)	5		
Klasse F USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse M USD, thesaurierend				
Verkauft	–	8		
Eingelöst	(1)	–		
Netto(abnahme)/-zunahme	(1)	8		
Klasse M USD, ausschüttend (M)				
Eingelöst	(9)	–		
Nettoabnahme	(9)	–		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	116	244		
Eingelöst	(208)	(3.378)		
Nettoabnahme	(92)	(3.134)		

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^] – (Fortsetzung)		
Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)		
Eingelöst	(22)	(19)
Nettoabnahme	(22)	(19)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	637	457
Eingelöst	(407)	(1.448)
Nettozunahme/(-abnahme)	230	(991)
Klasse Premier EUR ausschüttend (Q) (abgesichert)		
Verkauft	15	27
Eingelöst	(100)	(12)
Netto(abnahme)/-zunahme	(85)	15
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)		
Verkauft	9	14
Eingelöst	–	(266)
Nettozunahme/(-abnahme)	9	(252)
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	500
Nettozunahme	–	500
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	539	4
Eingelöst	–	(670)
Nettozunahme/(-abnahme)	539	(666)
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(18)	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(18)	2
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	4
Eingelöst	(22)	(1)
Netto(abnahme)/-zunahme	(21)	3
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	1.814	–
Eingelöst	–	(2.516)
Nettozunahme/(-abnahme)	1.814	(2.516)
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	2	10
Eingelöst	(72)	(9)
Netto(abnahme)/-zunahme	(70)	1
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	26	7
Eingelöst	–	(72)
Nettozunahme/(-abnahme)	26	(65)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(3)	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(2)	1
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]		
Klasse LM USD, ausschüttend (Q)		
Verkauft	5	–
Eingelöst	–	–
Nettozunahme	5	–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	12	8
Eingelöst	(19)	(30)
Nettoabnahme	(7)	(22)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Eingelöst	(3)	–
Nettoabnahme	(3)	–
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	1	3
Eingelöst	(3)	(7)
Nettoabnahme	(2)	(4)
Klasse A USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	9	13
Eingelöst	(12)	(110)
Nettoabnahme	(3)	(97)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(3)	(15)
Nettoabnahme	(3)	(14)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	2	7
Eingelöst	(48)	(59)
Nettoabnahme	(46)	(52)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	–
Eingelöst	(1)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(2)
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(10)	(10)
Nettoabnahme	(9)	(9)
Klasse A EUR, ausschüttend (S)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(6)	(4)
Nettoabnahme	(6)	(3)
Klasse A SGD, thesaurierend		
Verkauft	3.289	829
Eingelöst	(3.327)	(996)
Nettoabnahme	(38)	(167)
Klasse C USD, ausschüttend (S)		
Eingelöst	(5)	(5)
Nettoabnahme	(5)	(5)
Klasse E USD, thesaurierend		
Eingelöst	(4)	(4)
Nettoabnahme	(4)	(4)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Eingelöst	(1)	(4)
Nettoabnahme	(1)	(4)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	1	2
Eingelöst	–	(8)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(6)
Klasse F USD, ausschüttend (S)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse R USD, ausschüttend (S)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	4	2
Eingelöst	(3)	(61)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(59)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	4
Eingelöst	(3)	(23)
Nettoabnahme	(3)	(19)
Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Eingelöst	(4)	(3)
Nettoabnahme	(4)	(3)
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	(1)	(39)
Nettoabnahme	–	(37)
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	23	65
Eingelöst	(40)	(88)
Nettoabnahme	(17)	(23)

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	24	27
Eingelöst	(45)	(136)
Nettoabnahme	(21)	(109)
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	15	35
Eingelöst	(28)	(203)
Nettoabnahme	(13)	(168)
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)		
Verkauft	17	40
Eingelöst	(56)	(64)
Nettoabnahme	(39)	(24)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	–	194
Eingelöst	(143)	(606)
Nettoabnahme	(143)	(412)
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)		
Eingelöst	(1)	(54)
Nettoabnahme	(1)	(54)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	5	91
Eingelöst	(63)	(271)
Nettoabnahme	(58)	(180)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	(338)	(115)
Nettoabnahme	(338)	(115)
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	14
Eingelöst	(3)	(71)
Nettoabnahme	(3)	(57)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	51
Eingelöst	(2)	(489)
Nettoabnahme	(2)	(438)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	11
Eingelöst	(2)	(127)
Nettoabnahme	(2)	(116)
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	32	–
Eingelöst	(8)	(965)
Nettozunahme/(-abnahme)	24	(965)
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	7	6
Eingelöst	(20)	(3)
Netto(abnahme)/-zunahme	(13)	3
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Eingelöst	–	(202)
Nettoabnahme	–	(202)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	3
Eingelöst	–	(120)
Nettoabnahme	–	(117)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	59
Eingelöst	–	(33)
Nettozunahme	–	26
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	3
Eingelöst	–	(3)
Nettozunahme	–	–
Klasse A SGD, thesaurierend		
Verkauft	–	1.844
Eingelöst	–	(3.399)
Nettoabnahme	–	(1.555)
Klasse E USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	(3)	(1)
Nettoabnahme	(3)	(1)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	181	43
Eingelöst	(14)	(402)
Nettozunahme/(-abnahme)	167	(359)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	(81)
Nettoabnahme	–	(81)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	15	20
Eingelöst	(47)	(260)
Nettoabnahme	(32)	(240)
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	6	19
Eingelöst	(57)	(259)
Nettoabnahme	(51)	(240)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	–	5
Eingelöst	–	(119)
Nettoabnahme	–	(114)
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	(15)	–
Nettoabnahme	(15)	–
Klasse LM USD, thesaurierend		
Eingelöst	(43)	–
Nettoabnahme	(43)	–
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	2	–
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(1)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Eingelöst	(4)	–
Nettoabnahme	(4)	–
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	5	4
Eingelöst	(5)	(131)
Netto Rückgang	–	(127)
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(112)
Netto Rückgang	–	(111)
Klasse A SGD, thesaurierend		
Verkauft	11.852	3.397
Eingelöst	(11.933)	(805)
Netto(abnahme)/zunahme	(81)	2.592
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	14	4
Eingelöst	(5)	(1)
Nettozunahme	9	3
Klasse F USD, ausschüttend (M)		
Eingelöst	(9)	–
Nettoabnahme	(9)	–
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	4
Nettozunahme	–	4
Klasse Premier USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Eingelöst	(7)	(10)
Nettoabnahme	(7)	(10)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	58	497
Eingelöst	(812)	(104)
Netto(abnahme)/-zunahme	(754)	393
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	–	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(2)
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Verkauft	2	2
Eingelöst	(2)	(11)
Nettoabnahme	–	(9)
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	3	45
Eingelöst	(1.490)	(156)
Nettoabnahme	(1.487)	(111)

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund[^]				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	–	5		
Eingelöst	–	(17)		
Nettoabnahme	–	(12)		
Klasse BW LM GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)				
Eingelöst	–	(1.311)		
Nettoabnahme	–	(1.311)		
Klasse BW LM GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)				
Eingelöst	–	(4.407)		
Nettoabnahme	–	(4.407)		
Klasse BW Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)				
Verkauft	–	7		
Eingelöst	–	(195)		
Nettoabnahme	–	(188)		
Klasse BW Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)				
Verkauft	–	54		
Eingelöst	–	(295)		
Nettoabnahme	–	(241)		
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	932	87		
Eingelöst	(81)	(61)		
Nettozunahme	851	26		
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	10	–		
Nettozunahme	10	–		
Klasse A USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	132	–		
Eingelöst	(4)	–		
Nettozunahme	128	–		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	1.233	26		
Eingelöst	(63)	(13)		
Nettozunahme	1.170	13		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	83	–		
Eingelöst	(3)	–		
Nettozunahme	80	–		
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	34	–		
Nettozunahme	34	–		
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	69	–		
Nettozunahme	69	–		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	132	5		
Eingelöst	(15)	(4)		
Nettozunahme	117	1		
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)				
Verkauft	109	14		
Eingelöst	(12)	(18)		
Nettoabnahme/-zunahme	97	(4)		
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	162	33		
Eingelöst	(33)	(16)		
Nettozunahme	129	17		
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	33	3		
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettozunahme	32	2		
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	199	–		
Nettozunahme	199	–		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	5.558	–		
Eingelöst	(171)	–		
Nettozunahme	5.387	–		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	25.821	9.899		
Eingelöst	(2.778)	(4.626)		
Nettozunahme	23.043	5.273		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	1.557	–		
Nettozunahme	1.557	–		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	236	–		
Nettozunahme	236	–		
Klasse C USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	8	–		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	7	–		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	156	1		
Eingelöst	(7)	–		
Nettozunahme	149	1		
Klasse E USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	5	–		
Nettozunahme	5	–		
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	26	–		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	25	–		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	287	–		
Eingelöst	(7)	–		
Nettozunahme	280	–		
Klasse F USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	44	–		
Nettozunahme	44	–		
Klasse X USD, thesaurierend				
Verkauft	93	–		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	92	–		
Klasse X USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	1	–		
Nettozunahme	1	–		
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	59	59		
Eingelöst	(1)	(30)		
Nettozunahme	58	29		
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	3	–		
Nettozunahme	3	–		
Klasse X CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)				
Verkauft	24	–		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	23	–		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	182	–		
Eingelöst	(3)	–		
Nettozunahme	179	–		
Klasse X EUR, thesaurierend				
Verkauft	3	–		
Nettozunahme	3	–		
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	37	–		
Eingelöst	(9)	(1)		
Nettozunahme/(-abnahme)	28	(1)		
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	46	1		
Eingelöst	(9)	(5)		
Netto(abnahme)/-zunahme	37	(4)		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	656	5		
Eingelöst	(17)	–		
Nettozunahme	639	5		
Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	162	1		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	161	1		

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)				
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	879	18		
Eingelöst	(35)	(10)		
Nettozunahme	844	8		
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	279	–		
Eingelöst	(3)	(2)		
Nettozunahme/(-abnahme)	276	(2)		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)				
Verkauft	14	–		
Eingelöst	(4)	(1)		
Nettozunahme/(-abnahme)	10	(1)		
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	180	280		
Eingelöst	(750)	(118)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(570)	162		
Klasse S USD, thesaurierend				
Verkauft	577	352		
Nettozunahme	577	352		
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	447	–		
Eingelöst	(35)	(10)		
Nettozunahme/(-abnahme)	412	(10)		
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	59	3		
Eingelöst	(47)	(3)		
Nettozunahme	12	–		
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	–	(7)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(7)		
LM Klasse EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	3	–		
Nettozunahme	3	–		
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(9)	–		
Nettoabnahme	(8)	–		
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	–	106		
Eingelöst	(6)	(5)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(6)	101		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	64	14		
Eingelöst	(22)	(41)		
Netto(abnahme)/-zunahme	42	(27)		
Klasse S BRL, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	22	–		
Eingelöst	(4)	–		
Nettozunahme	18	–		
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]				
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	3.837	10.120		
Eingelöst	(10.720)	(15.084)		
Nettoabnahme	(6.883)	(4.964)		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	–	33		
Eingelöst	(145)	(52)		
Nettoabnahme	(145)	(19)		
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	(3.156)	–		
Nettoabnahme	(3.156)	–		
Klasse LM SGD, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	–	(117)		
Nettoabnahme	–	(117)		
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]				
Klasse A USD thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse S USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(16)		
Nettoabnahme	–	(16)		
Legg Mason ClearBridge Value Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft			532	12
Eingelöst			(72)	(33)
Nettozunahme/(-abnahme)			460	(21)
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Verkauft			31	6
Eingelöst			(14)	(12)
Netto(abnahme)/-zunahme			17	(6)
Klasse A EUR, thesaurierend				
Verkauft			36	–
Eingelöst			(13)	–
Nettozunahme			23	–
Klasse A GBP, ausschüttend (A)				
Verkauft			2	–
Eingelöst			(2)	–
Nettozunahme			–	–
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft			1.223	90
Eingelöst			(510)	(40)
Nettozunahme			713	50
Klasse A SGD, thesaurierend				
Verkauft			2.594	71
Eingelöst			(800)	(312)
Nettozunahme/(-abnahme)			1.794	(241)
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft			92	–
Eingelöst			(44)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)			48	(5)
Klasse C USD, ausschüttend (A)				
Verkauft			4	–
Eingelöst			(1)	(6)
Netto(abnahme)/-zunahme			3	(6)
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft			25	–
Nettozunahme			25	–
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft			50	–
Eingelöst			(1)	–
Nettozunahme			49	–
Klasse F USD ausschüttend (A)				
Verkauft			14	–
Nettozunahme			14	–
Klasse X USD, ausschüttend (A)				
Verkauft			150	6
Eingelöst			(80)	–
Nettozunahme			70	6
Klasse X EUR, thesaurierend				
Verkauft			18	–
Eingelöst			(2)	–
Nettozunahme			16	–
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft			140	183
Eingelöst			(141)	(218)
Nettoabnahme			(1)	(35)
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)				
Verkauft			1	–
Nettozunahme			1	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft			17	–
Eingelöst			(14)	–
Nettozunahme			3	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend				
Verkauft			142	–
Eingelöst			(32)	–
Nettozunahme			110	–
LM Klasse USD, ausschüttend (A)				
Verkauft			89	–
Nettozunahme			89	–
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft			11	10
Eingelöst			(11)	(42)
Nettoabnahme			–	(32)

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund – (Fortsetzung)				
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	1	3		
Eingelöst	(4)	(11)		
Nettoabnahme	(3)	(8)		
Klasse A EUR, thesaurierend				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	(6)		
Nettoabnahme	–	(6)		
Klasse B USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse B USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	2	8		
Eingelöst	(4)	(20)		
Nettoabnahme	(2)	(12)		
Klasse C USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(1)	(7)		
Nettoabnahme	(1)	(6)		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	10	6		
Eingelöst	(6)	(9)		
Nettozunahme/(-abnahme)	4	(3)		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	16	16		
Eingelöst	(24)	(7)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(8)	9		
Klasse F USD ausschüttend (A)				
Verkauft	3	2		
Eingelöst	(3)	(2)		
Nettozunahme	–	–		
Klasse X USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	(1)	(7)		
Nettoabnahme	(1)	(7)		
Klasse X EUR, thesaurierend				
Verkauft	–	1		
Nettozunahme	–	1		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	15	1		
Eingelöst	(3)	(38)		
Nettozunahme/(-abnahme)	12	(37)		
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	–	(2)		
Nettoabnahme	–	(2)		
Klasse Premier EUR, thesaurierend				
Eingelöst	(49)	–		
Netto Rückgang	(49)	–		
Klasse LM USD, thesaurierend				
Verkauft	36	10		
Eingelöst	(10)	(9)		
Nettozunahme	26	1		
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(2)	(4)		
Nettoabnahme	(2)	(3)		
Klasse A (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse L (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	(5)		
Nettoabnahme	(1)	(5)		
Klasse GA USD, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	(1)	(1)		
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft			101	155
Eingelöst			(108)	(217)
Nettoabnahme			(7)	(62)
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Verkauft			18	17
Eingelöst			(29)	(25)
Nettoabnahme			(11)	(8)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft			24	13
Eingelöst			(28)	(22)
Nettoabnahme			(4)	(9)
Klasse A EUR, thesaurierend				
Verkauft			14	56
Eingelöst			(32)	(52)
Netto(abnahme)/-zunahme			(18)	4
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft			24	27
Eingelöst			(10)	(23)
Nettozunahme			14	4
Klasse C USD, ausschüttend (A)				
Verkauft			–	4
Eingelöst			(2)	(11)
Nettoabnahme			(2)	(7)
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft			14	17
Eingelöst			(15)	(46)
Nettoabnahme			(1)	(29)
Klasse E USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst			(2)	(3)
Nettoabnahme			(2)	(3)
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft			136	233
Eingelöst			(89)	(270)
Nettozunahme/(-abnahme)			47	(37)
Klasse F USD ausschüttend (A)				
Verkauft			21	8
Eingelöst			(14)	(23)
Nettozunahme/(-abnahme)			7	(15)
Klasse U USD, thesaurierend				
Verkauft			196	187
Eingelöst			(441)	(399)
Nettoabnahme			(245)	(212)
Klasse U EUR, thesaurierend				
Verkauft			100	437
Eingelöst			(93)	(343)
Nettozunahme			7	94
Klasse X USD, thesaurierend				
Verkauft			16	19
Eingelöst			(46)	(144)
Nettoabnahme			(30)	(125)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft			13	20
Eingelöst			(70)	(30)
Nettoabnahme			(57)	(10)
Klasse X EUR, thesaurierend				
Verkauft			6	4
Eingelöst			(2)	(16)
Nettozunahme/(-abnahme)			4	(12)
Klasse X GBP, thesaurierend				
Verkauft			9	20
Eingelöst			(13)	(9)
Netto(abnahme)/-zunahme			(4)	11
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft			221	398
Eingelöst			(353)	(547)
Nettoabnahme			(132)	(149)
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)				
Verkauft			19	15
Eingelöst			(4)	(10)
Nettozunahme			15	5
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft			581	444
Eingelöst			(50)	–
Nettozunahme			531	444

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund – (Fortsetzung)				
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	23	86		
Eingelöst	(27)	(203)	(1)	(1)
Nettoabnahme	(4)	(117)	(1)	(1)
Klasse Premier EUR, thesaurierend				
Verkauft	116	103		
Eingelöst	(154)	(24)	(1)	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(38)	79	(1)	–
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)				
Verkauft	9	12		
Eingelöst	(4)	(3)		
Nettozunahme	5	9		
Klasse Premier GBP, thesaurierend				
Verkauft	77	46		
Eingelöst	(35)	(36)		
Nettozunahme	42	10		
Klasse LM USD, thesaurierend				
Verkauft	125	42		
Eingelöst	(51)	(51)		
Nettozunahme/(-abnahme)	74	(9)		
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	(1)	(1)		
Klasse A (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	(1)	(1)		
Klasse L (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst	(2)	–		
Nettoabnahme	(2)	–		
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	24	34		
Eingelöst	(48)	(121)		
Nettoabnahme	(24)	(87)		
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	11	4		
Eingelöst	(18)	(22)		
Nettoabnahme	(7)	(18)		
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	10	19		
Eingelöst	(53)	(30)		
Nettoabnahme	(43)	(11)		
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	–	(2)		
Nettoabnahme	–	(2)		
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	95	12		
Eingelöst	(50)	(12)		
Nettozunahme	45	–		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	41		
Eingelöst	(2)	(239)		
Nettoabnahme	(1)	(198)		
Klasse A EUR, thesaurierend				
Verkauft	2	1		
Eingelöst	(5)	(17)		
Nettoabnahme	(3)	(16)		
Klasse A GBP, thesaurierend				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme	–	–		
Klasse A HKD, thesaurierend				
Verkauft	–	24		
Eingelöst	–	(83)		
Nettoabnahme	–	(59)		
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	568	344		
Eingelöst	(625)	(304)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(57)	40		
Klasse B USD, thesaurierend				
Eingelöst			(1)	(1)
Nettoabnahme			(1)	(1)
Klasse B USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst			(1)	–
Nettoabnahme			(1)	–
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft			–	2
Eingelöst			(1)	(6)
Nettoabnahme			(1)	(4)
Klasse C USD, ausschüttend (A)				
Verkauft			–	2
Eingelöst			(4)	(21)
Nettoabnahme			(4)	(19)
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft			5	1
Eingelöst			(1)	(12)
Nettozunahme/(-abnahme)			4	(11)
Klasse E USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst			–	(1)
Nettoabnahme			–	(1)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst			–	(1)
Nettoabnahme			–	(1)
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft			–	6
Eingelöst			(6)	(14)
Nettoabnahme			(6)	(8)
Klasse F USD ausschüttend (A)				
Verkauft			3	1
Eingelöst			(1)	(1)
Nettozunahme			2	–
Klasse X USD, thesaurierend				
Verkauft			3	7
Eingelöst			(5)	(33)
Nettoabnahme			(2)	(26)
Klasse X USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst			–	(4)
Nettoabnahme			–	(4)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst			–	(20)
Nettoabnahme			–	(20)
Klasse X GBP, thesaurierend				
Verkauft			8	25
Eingelöst			(14)	(41)
Nettoabnahme			(6)	(16)
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft			35	40
Eingelöst			(78)	(466)
Nettoabnahme			(43)	(426)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst			–	(3)
Nettoabnahme			–	(3)
Klasse Premier EUR, thesaurierend				
Verkauft			–	3
Eingelöst			(1)	(2)
Netto(abnahme)/-zunahme			(1)	1
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft			1	1
Eingelöst			(1)	(66)
Nettoabnahme			–	(65)
Klasse Premier GBP, thesaurierend				
Eingelöst			–	(3)
Nettoabnahme			–	(3)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)				
Verkauft			3	3
Eingelöst			(33)	(188)
Nettoabnahme			(30)	(185)
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft			7	10
Eingelöst			–	(5)
Nettozunahme			7	5
Klasse A (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst			(4)	(4)
Nettoabnahme			(4)	(4)
Klasse L (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst			(3)	(4)
Nettoabnahme			(3)	(4)

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	3	1
Eingelöst	(5)	(4)
Nettoabnahme	(2)	(3)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	5	5
Eingelöst	(6)	(19)
Nettoabnahme	(1)	(14)
Klasse A USD, ausschüttend (Q)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	3	3
Eingelöst	(2)	(7)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(4)
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	9
Eingelöst	(1)	(1)
Nettozunahme	–	8
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	13	2
Eingelöst	(15)	(60)
Nettoabnahme	(2)	(58)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	91	790
Eingelöst	(34)	(975)
Nettozunahme/(-abnahme)	57	(185)
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse F USD, thesaurierend		
Eingelöst	(4)	(7)
Nettoabnahme	(4)	(7)
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	114	–
Eingelöst	(15)	–
Nettozunahme	99	–
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	34	1
Eingelöst	(1)	(1)
Nettozunahme	33	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	126	3
Eingelöst	(32)	(1)
Nettozunahme	94	2
Klasse A SEK, thesaurierend		
Verkauft	72	5.323
Eingelöst	(222)	(155)
Netto (Abnahme)/Zunahme	(150)	5.168
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	14	4
Nettozunahme	14	4
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	29	13
Eingelöst	(6)	–
Nettozunahme	23	13
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	2	3
Eingelöst	(2)	(10)
Nettoabnahme	–	(7)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	6	23
Eingelöst	(7)	(24)
Nettoabnahme	(1)	(1)
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	11	–
Nettozunahme	11	–
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	18	21
Eingelöst	(3)	(15)
Nettozunahme	15	6
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	96	29
Eingelöst	(35)	(9)
Nettozunahme	61	20
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	760	104
Eingelöst	(43)	–
Nettozunahme	717	104
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5	–
Eingelöst	–	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(2)
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	3	4
Eingelöst	(1)	(2)
Nettozunahme	2	2
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	1.620	213
Eingelöst	(448)	(93)
Nettozunahme	1.172	120
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	42	–
Nettozunahme	42	–
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	165	300
Eingelöst	(31)	(39)
Nettozunahme	134	261
Klasse S GBP, thesaurierend		
Verkauft	378	108
Eingelöst	(108)	(28)
Nettozunahme	270	80
Klasse S GBP, ausschüttend (Q)		
Verkauft	35	12
Eingelöst	(2)	(1)
Nettozunahme	33	11
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Verkauft	73	–
Eingelöst	(4)	–
Nettozunahme	69	–
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	9	–
Eingelöst	–	(5)
Netto(abnahme)/-zunahme	9	(5)
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^		
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2.767	1.566
Eingelöst	(1.959)	(3.482)
Nettozunahme/(-abnahme)	808	(1.916)
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	242	9
Eingelöst	(12)	–
Nettozunahme	230	9
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	2.039	2.578
Eingelöst	(2.027)	(2.008)
Nettozunahme	12	570

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^] – (Fortsetzung)		
Klasse A USD, ausschüttend (Q)		
Verkauft	35	115
Eingelöst	(134)	(213)
Nettoabnahme	(99)	(98)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	320	38
Eingelöst	(192)	(8)
Nettozunahme	128	30
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	3.020	1.207
Eingelöst	(1.020)	(784)
Nettozunahme	2.000	423
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)		
Verkauft	225	58
Eingelöst	(29)	(16)
Nettozunahme	196	42
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	1.488	2.509
Eingelöst	(2.021)	(2.797)
Nettoabnahme	(533)	(288)
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	95	201
Eingelöst	(85)	(123)
Nettozunahme	10	78
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	7.654	1.019
Eingelöst	(5.888)	(919)
Nettozunahme	1.766	100
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	24
Eingelöst	(16)	(3)
Netto(abnahme)/-zunahme	(15)	21
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	369	–
Eingelöst	(2)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	367	(5)
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	99	–
Eingelöst	(26)	–
Nettozunahme	73	–
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	180	60
Eingelöst	(14)	(55)
Nettozunahme	166	5
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	8	18
Eingelöst	(2)	(71)
Netto(abnahme)/-zunahme	6	(53)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	5	–
Eingelöst	–	(12)
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(12)
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	–	6
Eingelöst	–	(6)
Nettozunahme	–	–
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	2	–
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(1)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)		
Verkauft	186	176
Eingelöst	(5)	(212)
Nettozunahme/(-abnahme)	181	(36)
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	1.189	3.873
Eingelöst	(1.455)	(3.528)
Netto(abnahme)/-zunahme	(266)	345
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)		
Verkauft	25	18
Eingelöst	(7)	(1)
Nettozunahme	18	17
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	282	159
Eingelöst	(63)	(43)
Nettozunahme	219	116

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	422	179
Eingelöst	(252)	(115)
Nettozunahme	170	64
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)		
Verkauft	79	77
Eingelöst	–	(252)
Nettozunahme/(-abnahme)	79	(175)
Premier Klasse CAD, ausschüttend (Q) Plus (e)		
Verkauft	19	18
Eingelöst	(762)	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(743)	18
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)		
Verkauft	8	2.494
Eingelöst	(18)	(10)
Netto (Abnahme)/Zunahme	(10)	2.484
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	1.616	3.859
Eingelöst	(1.292)	(6.834)
Nettozunahme/(-abnahme)	324	(2.975)
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	6	7
Eingelöst	(24)	(4)
Netto(abnahme)/-zunahme	(18)	3
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)		
Verkauft	26	619
Eingelöst	(1.607)	(602)
Netto (Abnahme)/Zunahme	(1.581)	17
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)		
Verkauft	390	499
Eingelöst	(274)	(256)
Nettozunahme	116	243
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	29	121
Eingelöst	(654)	(28)
Netto(abnahme)/-zunahme	(625)	93

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]

Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1

Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^]_α

Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	66	–
Nettozunahme	66	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	451	–
Nettozunahme	451	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	170	–
Nettozunahme	170	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	24	–
Nettozunahme	24	–
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	26	–
Nettozunahme	26	–
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	125	–
Nettozunahme	125	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	29.777	–
Nettozunahme	29.777	–
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	14	–
Nettozunahme	14	–
Klasse X EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	10	–
Nettozunahme	10	–

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund^α – (Fortsetzung)		
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	7	–
Nettozunahme	7	–
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	617	236
Eingelöst	(523)	(277)
Nettozunahme/(-abnahme)	94	(41)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	13	11
Eingelöst	(134)	(31)
Nettoabnahme	(121)	(20)
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	98	46
Eingelöst	(95)	(36)
Nettozunahme	3	10
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	414	211
Eingelöst	(328)	(189)
Nettozunahme	86	22
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	137	11
Eingelöst	(108)	(21)
Netto(abnahme)/-zunahme	29	(10)
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	173	10
Eingelöst	(110)	(17)
Nettozunahme/(-abnahme)	63	(7)
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	4	2
Eingelöst	(4)	(2)
Nettozunahme	–	–
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)
Klasse A GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	2	–
Eingelöst	(2)	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	45	14
Eingelöst	(62)	(14)
Nettoabnahme	(17)	–
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	9.278	5.392
Eingelöst	(13.284)	(1.696)
Netto(abnahme)/-zunahme	(4.006)	3.696
Klasse A SGD, thesaurierend		
Verkauft	3.807	1.617
Eingelöst	(6.281)	(1.533)
Netto (Abnahme)/Zunahme	(2.474)	84
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	21	1
Eingelöst	(2)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	19	(1)
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	25	–
Eingelöst	(19)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	6	(1)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	10	–
Eingelöst	(5)	–
Nettozunahme	5	–
Klasse E EUR, thesaurierend		
Verkauft	6	–
Eingelöst	(2)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	4	(1)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	48	3
Eingelöst	(31)	(7)
Netto(abnahme)/-zunahme	17	(4)
Klasse F USD ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse R EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	235	22
Eingelöst	(388)	(45)
Nettoabnahme	(153)	(23)
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	–	(4)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(4)
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	132	1
Eingelöst	(171)	(12)
Nettoabnahme	(39)	(11)
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	150	80
Eingelöst	(205)	(15)
Netto(abnahme)/-zunahme	(55)	65
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	84	10
Eingelöst	(79)	(27)
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(17)
Klasse X GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	14	1
Eingelöst	(10)	(1)
Nettozunahme	4	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	549	131
Eingelöst	(740)	(140)
Nettoabnahme	(191)	(9)
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	380	3
Eingelöst	–	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	380	(2)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	16	7
Eingelöst	(126)	(10)
Nettoabnahme	(110)	(3)
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	25	10
Eingelöst	(28)	(2)
Netto(abnahme)/-zunahme	(3)	8
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	66	28
Eingelöst	(296)	(113)
Nettoabnahme	(230)	(85)
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	100	19
Eingelöst	–	(17)
Nettozunahme	100	2
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	72	17
Eingelöst	(58)	(28)
Nettozunahme/(-abnahme)	14	(11)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	5	1
Eingelöst	(3)	(4)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(3)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	1
Eingelöst	(9)	(1)
Nettozunahme	(5)	–
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	11	3
Eingelöst	(11)	(1)
Nettozunahme	–	2

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund – (Fortsetzung)				
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	4	1		
Eingelöst	(5)	(1)		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	2	1		
Eingelöst	(1)	(2)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(1)		
Klasse C USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	(1)	(2)		
Nettoabnahme	(1)	(2)		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	3	–		
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(1)		
Klasse E USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	18	2		
Eingelöst	(4)	(3)		
Nettozunahme/(-abnahme)	14	(1)		
Klasse F USD ausschüttend (A)				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	–	–		
Klasse R USD, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	(2)		
Nettoabnahme	(1)	(2)		
Klasse X USD, thesaurierend				
Verkauft	18	3		
Eingelöst	(18)	(27)		
Netto Rückgang	–	(24)		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	1	1		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme	1	–		
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	4	–		
Eingelöst	(6)	(6)		
Nettoabnahme	(2)	(6)		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(1)	(2)		
Nettoabnahme	(1)	(1)		
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund				
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	(2)	(3)		
Nettoabnahme	–	(3)		
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	(2)	–		
Nettozunahme	–	–		
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	14	5		
Eingelöst	(6)	(34)		
Nettozunahme/(-abnahme)	8	(29)		
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	1	2		
Eingelöst	(6)	(3)		
Nettoabnahme	(5)	(1)		
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	5	–		
Eingelöst	–	(10)		
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(10)		
Klasse A EUR, thesaurierend				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	–	–		
Klasse A EUR, ausschüttend (A)				
Eingelöst	–	(3)		
Nettoabnahme	–	(3)		
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(3.641)	(182)		
Nettoabnahme	(69)	(65)		
Klasse B USD, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse C USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(7)		
Nettoabnahme	–	(7)		
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	–	(4)		
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(4)		
Klasse F USD, thesaurierend				
Eingelöst	(14)	–		
Nettoabnahme	(14)	–		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	–	2		
Eingelöst	(15)	(5)		
Nettoabnahme	(15)	(3)		
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	7	3		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme	7	2		
Klasse LM USD, thesaurierend				
Verkauft	1	5		
Eingelöst	(39)	(2)		
Netto(abnahme)/-zunahme	(38)	3		
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Verkauft	–	2		
Eingelöst	(3)	(4)		
Nettoabnahme	(3)	(2)		
Klasse A (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse L (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse GA USD, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse GA EUR, thesaurierend				
Eingelöst	(4)	(3)		
Nettoabnahme	(4)	(3)		
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	1	1		
Eingelöst	(6)	(15)		
Nettoabnahme	(5)	(14)		
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	–	32		
Eingelöst	(1)	(34)		
Nettoabnahme	(1)	(2)		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	4	4		
Eingelöst	(11)	(47)		
Nettoabnahme	(7)	(43)		
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	1	4		
Eingelöst	(7)	(12)		
Nettoabnahme	(6)	(8)		

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	–	6
Eingelöst	–	(15)
Nettoabnahme	–	(9)
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	89	16
Eingelöst	(27)	(95)
Nettozunahme/(-abnahme)	62	(79)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	7	88
Eingelöst	(60)	(84)
Netto(abnahme)/-zunahme	(53)	4
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	3
Eingelöst	(8)	(2)
Netto(abnahme)/-zunahme	(8)	1
Klasse GA USD, thesaurierend		
Eingelöst	(1)	(2)
Nettoabnahme	(1)	(2)
Klasse LM SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(27.864)
Nettoabnahme	–	(27.864)
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^μ		
Klasse A USD thesaurierend		
Eingelöst	(2)	–
Nettoabnahme	(2)	–
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse B USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(90)	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(90)	1
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Eingelöst	(3)	(1)
Nettoabnahme	(3)	(1)
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Eingelöst	(1)	(4)
Nettoabnahme	(1)	(4)
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(80)	(3)
Nettoabnahme	(80)	(2)
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	516	58
Eingelöst	(489)	(27)
Nettozunahme	27	31
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(3)	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(3)	1
Klasse GA USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^α		
Klasse M GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	12	92
Eingelöst	(15)	(3.115)
Nettoabnahme	(3)	(3.023)
Klasse M USD ausschüttend (A)		
Eingelöst	(4)	(2)
Nettoabnahme	(4)	(2)
Klasse M EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	24
Eingelöst	–	(1.595)
Nettoabnahme	–	(1.571)
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	57	10
Nettozunahme	57	10
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	–	19
Eingelöst	(1)	(173)
Nettoabnahme	(1)	(154)
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^β		
Klasse A (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	50	172
Eingelöst	(588)	(250)
Nettoabnahme	(538)	(78)
Klasse A (PF) EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(28)	(16)
Nettoabnahme	(28)	(14)
Klasse A (PF) EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(238)	(322)
Nettoabnahme	(238)	(321)
Klasse A (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	–	(16)
Nettoabnahme	–	(16)
Klasse J (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(20)
Nettoabnahme	–	(20)
Klasse J (PF) JPY, thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	(555)
Nettoabnahme	–	(555)
Klasse M (PF) USD ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	(195)	(19)
Nettoabnahme	(195)	(19)
Klasse M (PF) EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	6
Eingelöst	(37)	(82)
Nettoabnahme	(37)	(76)
Klasse M (PF) EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	7	632
Eingelöst	(589)	(1.671)
Nettoabnahme	(582)	(1.039)
Klasse M (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	–	4
Eingelöst	(85)	(37)
Nettoabnahme	(85)	(33)
Klasse M (PF) NOK, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	(2)	–
Nettoabnahme	(2)	–
Klasse M (PF) SEK, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	(102)	–
Nettoabnahme	(102)	–
Klasse Premier (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	38	18
Eingelöst	(173)	(42)
Nettoabnahme	(135)	(24)
Klasse Premier (PF) BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3	4
Eingelöst	(155)	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(152)	4

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	17	–
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	16	–
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^] – (Fortsetzung)		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	212	–
Nettozunahme	212	–
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	8	26
Eingelöst	(1)	(17)
Nettozunahme	7	9
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	18	–
Eingelöst	(3)	–
Nettozunahme	15	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse X USD, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	3
Eingelöst	(1)	(1)
Nettozunahme	3	2
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(1)	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	101	85
Eingelöst	(3)	(22)
Nettozunahme	98	63
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme	–	1
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	65	4
Eingelöst	(271)	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(206)	4
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	142	–
Eingelöst	(4)	–
Nettozunahme	138	–
Klasse S GBP, thesaurierend		
Verkauft	5	38
Eingelöst	(78)	–
Netto(abnahme)/-zunahme	(73)	38
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	112	7
Eingelöst	(93)	(48)
Nettozunahme/(-abnahme)	19	(41)
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	2	5
Nettozunahme	2	5
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	–	1.232
Eingelöst	(98)	–
Netto (Abnahme)/Zunahme	(98)	1.232
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	7	5
Eingelöst	(2)	–
Nettozunahme	5	5
Klasse D USD, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Nettozunahme	–	2
Klasse X AUD, thesaurierend		
Verkauft	1	2
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	–	2

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2020 Anteile (in Tsd.)
Klasse X USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse LM AUD, thesaurierend		
Eingelöst	(4)	–
Nettoabnahme	(4)	–
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	30	15
Eingelöst	(7)	(4)
Nettozunahme	23	11
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	34	7
Eingelöst	(11)	(2)
Nettozunahme	23	5
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	9	4
Eingelöst	(5)	(1)
Nettozunahme	4	3
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	6	3
Eingelöst	(7)	(2)
Netto(abnahme)/-zunahme	(1)	1
Klasse S EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^]		
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	5	–
Nettozunahme	5	–
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	3	–
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(1)
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	140	–
Nettozunahme	140	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	42	2
Eingelöst	(3)	–
Nettozunahme	39	2
Klasse S USD, thesaurierend		
Eingelöst	(251)	–
Nettoabnahme	(251)	–
Klasse S EUR, thesaurierend		
Verkauft	703	1
Eingelöst	(1)	(6)
Nettozunahme/(-abnahme)	702	(5)

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.

μ Mit Wirkung zum 14. April 2021 hat der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund den Handel eingestellt.

α Mit Wirkung zum 30. April 2021 begann der Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund mit dem Handel.

β Ab dem 1. Juni 2021 stellte der Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund[^] den Handel ein.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf 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 28. Februar 2021 verwendet hat.

Übereinstimmungserklärung

Der Abschluss für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021 wurde im Einklang mit Financial Reporting Standard („FRS“) 104: „Interim Financial Reporting“, die Bestimmungen der Europäischen Gemeinschaft von 2011 (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) (in ihrer geänderten Fassung) (die „OGAW-Verordnungen“) und und das Zentralbankaufsichts- und Durchsetzungsgesetz von 2013 (Abschnitt 48 (1)) (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) Regulierungen von 2019 (die „OGAW-Verordnungen der Zentralbank“) erstellt. Der verkürzte Abschluss sollte in Verbindung mit dem geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2021 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 Short-Term 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 Sovereign Credit 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 QS Emerging Markets Equity Fund, Legg Mason Congruix Japan Equity Fund[^], Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund[^], Legg Mason Martin Currie Greater China Fund[^], 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 auf der Basis der Nichtfortführung der Geschäftstätigkeit erstellt, da diese Fonds während des laufenden und des vorangegangenen Geschäftsjahres 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 2021 mit umgekehrten Pensionsgeschäften erzielten Erträge:

Fondsname	31. August 2021 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	23 USD

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 2021 Wertpapierleihgeschäfte getätigt.

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien

Gemäß dem Verwaltungsvertrag zwischen der Gesellschaft und Franklin Templeton International Services S.à r.l (der „Manager“ oder „FTIS“) steht FTIS 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 außerdem für die unverzügliche Zahlung oder Erstattung von Provisionen, Übertragungsgebühren, Registrierungsgebühren, Steuern und ähnlichen Verbindlichkeiten, Kosten und Auslagen an den Manager verantwortlich, die von FTIS ordnungsgemäß zu zahlen sind oder entstehen.

Die maximale Verwaltungsgebühr für jede Anteilsklasse (als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des jeweiligen Fonds, der auf diese Klasse entfällt) ist zum Zeitraume wie folgt:

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund		Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	
Klasse A	0,800 %	Klasse A	0,950 %
Klasse B	1,050 %	Klasse B	1,200 %
Klasse C	1,300 %	Klasse C	1,450 %
Klasse E	1,400 %	Klasse E	1,550 %
Klasse X	0,600 %	Klasse F	0,550 %
Klasse Premier	0,300 %	Klasse R	0,550 %
Klasse LM	Keine	Klasse T	0,950 %
Klasse A (G)	0,800 %	Klasse X	0,475 %
Klasse L (G)	0,800 %	Klasse Premier	0,300 %
		Klasse S	0,200 %
		Klasse LM	Keine
		Klasse GA	0,820 %
		Klasse GE	1,420 %

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	
Klasse A	1,150 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,400 %	Klasse B	1,750 %
Klasse C	1,650 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	1,750 %	Klasse E	2,100 %
Klasse F	0,550 %	Klasse F	0,800 %
Klasse R	0,750 %	Klasse R	1,100 %
Klasse T	1,150 %	Klasse T	1,500 %
Klasse X	0,575 %	Klasse X	0,750 %
Premier-Klasse	0,300 %	Premier-Klasse	0,550 %
Klasse LM	Keine	Klasse S	0,450 %
Klasse A (G)	1,150 %	Klasse LM	Keine
Klasse B (G)	1,650 %	Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	
Klasse L (G)	1,650 %	Klasse A	1,250 %
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		Klasse B	1,500 %
Klasse A	1,000 %	Klasse C	1,750 %
Klasse B	1,250 %	Klasse E	1,850 %
Klasse C	1,500 %	Klasse F	0,700 %
Klasse E	1,600 %	Klasse R	0,850 %
Klasse F	0,550 %	Klasse T	1,250 %
Klasse R	0,600 %	Klasse X	0,625 %
Klasse T	1,000 %	Premier-Klasse	0,450 %
Klasse X	0,500 %	Klasse LM	Keine
Premier-Klasse	0,300 %	Klasse A (G)	1,250 %
Klasse S	0,200 %	Klasse L (G)	1,750 %
Klasse LM	Keine	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	
Klasse GA	0,820 %	Klasse A	0,900 %
Klasse GE	1,420 %	Klasse B	1,150 %
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund		Klasse C	1,400 %
Klasse A	1,100 %	Klasse E	1,500 %
Klasse B	1,350 %	Klasse F	0,600 %
Klasse C	1,600 %	Klasse R	0,550 %
Klasse E	1,700 %	Klasse T	0,900 %
Klasse F	0,850 %	Klasse X	0,450 %
Klasse R	0,700 %	Premier-Klasse	0,350 %
Klasse X	0,600 %	Klasse S	0,250 %
Premier-Klasse	0,600 %	Klasse LM	Keine
Klasse S	0,550 %	Klasse A (G)	1,100 %
Klasse LM	Keine	Klasse L (G)	1,600 %
Klasse A (G)	1,200 %	Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	
Klasse B (G)	1,700 %	Klasse A	1,100 %
Klasse L (G)	1,700 %	Klasse B	1,350 %
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund		Klasse C	1,600 %
Klasse A	1,100 %	Klasse E	1,700 %
Klasse B	1,350 %	Klasse F	0,850 %
Klasse C	1,600 %	Klasse R	0,700 %
Klasse E	1,700 %	Klasse T	1,100 %
Klasse F	0,650 %	Klasse X	0,600 %
Klasse R	0,700 %	Premier-Klasse	0,600 %
Klasse T	1,100 %	Klasse LM	Keine
Klasse X	0,550 %	Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	
Premier-Klasse	0,400 %	Klasse A	0,850 %
Klasse LM	Keine	Klasse B	1,100 %
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund		Klasse C	1,350 %
Klasse A	1,150 %	Klasse E	1,450 %
Klasse B	1,400 %	Klasse F	0,600 %
Klasse C	1,650 %	Klasse R	0,450 %
Klasse E	1,750 %	Klasse T	0,850 %
Klasse F	0,700 %	Klasse X	0,425 %
Klasse R	0,750 %	Premier-Klasse	0,350 %
Klasse T	1,150 %	Klasse S	0,250 %
Klasse X	0,575 %	Klasse LM	Keine
Premier-Klasse	0,450 %	Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]	
Klasse LM	Keine	Klasse A	1,100 %
Klasse A (G)	1,150 %	Klasse B	1,350 %
Klasse L (G)	1,650 %	Klasse C	1,600 %
Klasse GF	0,950 %	Klasse E	1,700 %
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund		Klasse F	0,650 %
Klasse A	1,500 %	Klasse R	0,700 %
Klasse B	1,750 %	Klasse T	1,100 %
Klasse C	2,000 %	Klasse X	0,550 %
Klasse E	2,100 %	Premier-Klasse	0,400 %
Klasse F	0,800 %	Klasse LM	Keine
Klasse R	1,100 %	Legg Mason Western Asset Global Credit Fund[^]	
Klasse T	1,500 %	Klasse A	1,050 %
Klasse X	0,750 %	Klasse B	1,300 %
Premier-Klasse	0,550 %	Klasse C	1,550 %
Klasse S	0,450 %	Klasse E	1,650 %
Klasse LM	Keine	Klasse F	0,600 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse R	0,650 %
Klasse B (G)	1,750 %	Klasse T	1,050 %
Klasse L (G)	1,750 %	Klasse X	0,525 %
		Premier-Klasse	0,350 %
		Klasse S	0,250 %
		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 Verwaltungsvergütung	Fondsname	Maximale Verwaltungsvergütung
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]	
Klasse A	1,150 %	Klasse A	1,350 %
Klasse B	1,400 %	Klasse B	1,600 %
Klasse C	1,650 %	Klasse C	1,850 %
Klasse E	1,750 %	Klasse E	1,950 %
Klasse F	0,700 %	Klasse F	1,100 %
Klasse R	0,750 %	Klasse J	0,900 %
Klasse T	1,150 %	Klasse R	0,950 %
Klasse X	0,575 %	Klasse X	0,900 %
Premier-Klasse	0,450 %	Premier-Klasse	0,900 %
Klasse S	0,350 %	Klasse LM	Keine
Klasse LM	Keine		
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund[^]	
Klasse A	1,500 %	Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,750 %	Klasse F	0,750 %
Klasse C	2,000 %	Klasse T	1,100 %
Klasse E	2,100 %	Klasse X	0,550 %
Klasse F	1,250 %	Premier-Klasse	0,550 %
Klasse R	1,100 %	Klasse S	0,450 %
Klasse T	1,500 %	Klasse LM	Keine
Klasse X	1,000 %		
Klasse Y	1,000 %	Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
Premier-Klasse	1,000 %	Klasse A	1,150 %
Klasse S	0,600 %	Klasse B	1,400 %
Klasse LM	Keine	Klasse C	1,650 %
		Klasse E	1,750 %
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		Klasse F	0,900 %
Klasse A	1,250 %	Klasse R	0,750 %
Klasse B	1,500 %	Klasse T	1,150 %
Klasse C	1,750 %	Klasse X	0,650 %
Klasse E	1,850 %	Premier-Klasse	0,650 %
Klasse F	0,800 %	Klasse LM	Keine
Klasse R	0,750 %		
Klasse T	1,250 %	Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund[^]	
Klasse X	0,625 %	Klasse A	1,600 %
Premier-Klasse	0,600 %	Klasse B	1,850 %
Klasse S	0,400 %	Klasse C	2,100 %
Klasse LM	Keine	Klasse E	2,350 %
		Klasse F	1,350 %
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		Klasse R	0,900 %
Klasse D	1,200 %	Klasse T	1,600 %
Klasse F	1,200 %	Klasse X	0,800 %
Klasse M	0,600 %	Klasse BW Premier	0,350 %
Premier-Klasse	0,600 %	Premier-Klasse	0,800 %
Klasse LM	Keine	Klasse BW LM	Keine
		Klasse LM	Keine
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	
Klasse A	1,000 %	Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,250 %	Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,500 %	Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,600 %	Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,550 %	Klasse F	0,800 %
Klasse R	0,600 %	Klasse J	0,450 %
Klasse X	0,500 %	Klasse R	0,700 %
Premier-Klasse	0,300 %	Klasse T	1,100 %
Klasse LM	Keine	Klasse X	0,550 %
		Premier-Klasse	0,550 %
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]		Klasse S	0,450 %
Klasse A	0,800 %	Klasse LM	Keine
Klasse R	0,500 %		
Klasse T	0,800 %	Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]	
Klasse X	0,400 %	Klasse A	1,650 %
Premier-Klasse	0,300 %	Klasse B	1,900 %
Klasse S	0,200 %	Klasse C	2,150 %
Klasse LM	Keine	Klasse E	2,250 %
		Klasse F	1,300 %
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]		Klasse J	0,750 %
Klasse A	0,800 %	Klasse R	1,250 %
Klasse R	0,500 %	Klasse T	1,650 %
Klasse T	0,800 %	Klasse X	1,150 %
Klasse X	0,400 %	Premier-Klasse	1,150 %
Premier-Klasse	0,300 %	Klasse S	0,750 %
Klasse S	0,200 %	Klasse LM	Keine
Klasse LM	Keine		
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]		Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]	
Klasse LM	Keine	Klasse A	1,050 %
		Klasse B	1,300 %
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		Klasse C	1,550 %
Klasse A	1,100 %	Klasse E	1,650 %
Klasse B	1,350 %	Klasse F	0,700 %
Klasse C	1,600 %	Klasse T	1,050 %
Klasse E	1,700 %	Klasse X	0,525 %
Klasse F	0,850 %	Premier-Klasse	0,525 %
Klasse R	0,700 %	Klasse S	0,400 %
Klasse T	1,100 %	Klasse LM	Keine
Klasse X	0,600 %		
Premier-Klasse	0,600 %	Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]	
Klasse LM	Keine	Klasse A	2,000 %
		Klasse T	2,000 %
		Klasse U	1,000 %
		Klasse X	1,150 %
		Premier-Klasse	1,150 %
		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	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]		Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund[^]	
Klasse A	1,200 %	Klasse A	1,300 %
Klasse E	1,950 %	Klasse B	1,800 %
Klasse F	0,950 %	Klasse C	1,800 %
Klasse R	0,700 %	Klasse E	2,050 %
Klasse T	1,200 %	Klasse F	1,050 %
Klasse X	0,600 %	Klasse R	0,800 %
Premier-Klasse	0,600 %	Klasse T	1,300 %
Klasse S	0,500 %	Klasse X	0,650 %
Klasse LM	Keine	Premier-Klasse	0,650 %
Legg Mason ClearBridge Value Fund		Klasse S	0,550 %
Klasse A	1,350 %	Klasse LM	Keine
Klasse B	1,850 %	Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]	
Klasse C	1,850 %	Klasse A	1,500 %
Klasse E	2,100 %	Klasse B	2,000 %
Klasse F	1,100 %	Klasse C	2,000 %
Klasse R	0,850 %	Klasse E	2,250 %
Klasse T	1,350 %	Klasse F	1,250 %
Klasse X	0,675 %	Klasse R	1,000 %
Premier-Klasse	0,675 %	Klasse T	1,500 %
Klasse LM	Keine	Klasse X	0,850 %
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Premier-Klasse	0,850 %
Klasse A	1,250 %	Klasse LM	Keine
Klasse B	1,750 %	Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]	
Klasse C	1,750 %	Klasse A	1,650 %
Klasse E	2,000 %	Klasse B	2,150 %
Klasse F	1,000 %	Klasse C	2,150 %
Klasse R	0,750 %	Klasse E	2,400 %
Klasse T	1,250 %	Klasse F	1,400 %
Klasse X	0,625 %	Klasse R	1,150 %
Premier-Klasse	0,625 %	Klasse T	1,650 %
Klasse LM	Keine	Klasse X	1,000 %
Klasse A (G)	1,250 %	Premier-Klasse	1,000 %
Klasse B (G)	1,750 %	Klasse S	0,600 %
Klasse L (G)	1,750 %	Klasse LM	Keine
Klasse GA	1,420 %	Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^]	
Klasse GE	2,170 %	Klasse A	1,500 %
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund		Klasse B	2,000 %
Klasse A	1,250 %	Klasse C	2,000 %
Klasse B	1,750 %	Klasse E	2,250 %
Klasse C	1,750 %	Klasse F	1,250 %
Klasse E	2,000 %	Klasse R	1,000 %
Klasse F	1,000 %	Klasse T	1,500 %
Klasse R	0,750 %	Klasse X	0,850 %
Klasse T	1,250 %	Premier-Klasse	0,850 %
Klasse U	0,525 %	Klasse S	0,400 %
Klasse X	0,625 %	Klasse LM	Keine
Premier-Klasse	0,625 %	Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	
Klasse LM	Keine	Klasse A	1,500 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse B	2,000 %
Klasse L (G)	1,750 %	Klasse C	2,000 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse E	2,250 %
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund		Klasse F	1,250 %
Klasse A	1,300 %	Klasse R	1,000 %
Klasse B	1,800 %	Klasse T	1,500 %
Klasse C	1,800 %	Klasse X	0,750 %
Klasse E	2,050 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse F	1,050 %	Klasse LM	Keine
Klasse R	0,800 %	Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
Klasse T	1,300 %	Klasse A	1,500 %
Klasse X	0,650 %	Klasse B	2,000 %
Premier-Klasse	0,650 %	Klasse C	2,000 %
Klasse LM	Keine	Klasse E	2,250 %
Klasse A (G)	1,300 %	Klasse F	1,250 %
Klasse B (G)	1,800 %	Klasse R	1,000 %
Klasse L (G)	1,800 %	Klasse T	1,500 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse X	0,750 %
Klasse GE	2,170 %	Premier-Klasse	0,750 %
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		Klasse LM	Keine
Klasse A	1,250 %	Klasse A (G)	1,250 %
Klasse B	1,750 %	Klasse L (G)	1,750 %
Klasse C	1,750 %	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund	
Klasse E	2,000 %	Klasse A	1,350 %
Klasse F	1,000 %	Klasse B	1,850 %
Klasse R	0,800 %	Klasse C	1,850 %
Klasse T	1,250 %	Klasse E	2,100 %
Klasse X	0,625 %	Klasse F	1,100 %
Premier-Klasse	0,625 %	Klasse R	0,850 %
Klasse LM	Keine	Klasse T	1,350 %
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]		Klasse X	0,675 %
Klasse A	1,200 %	Premier-Klasse	0,675 %
Klasse B	1,700 %	Klasse S	0,500 %
Klasse C	1,700 %	Klasse LM	Keine
Klasse E	1,950 %	Klasse A (G)	1,350 %
Klasse F	0,950 %	Klasse B (G)	1,850 %
Klasse R	0,700 %	Klasse L (G)	1,850 %
Klasse T	1,200 %	Klasse GA	1,420 %
Klasse X	0,600 %	Klasse GE	2,170 %
Premier-Klasse	0,600 %	Klasse GP	0,850 %
Klasse S	0,400 %		
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 Verwaltungsvergütung	Fondsname	Maximale Verwaltungsvergütung
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]	
Klasse A	1,350 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,850 %	Klasse B	2,000 %
Klasse C	1,850 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,100 %	Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,100 %	Klasse F	1,250 %
Klasse R	0,850 %	Klasse R	1,000 %
Klasse T	1,350 %	Klasse T	1,500 %
Klasse X	0,675 %	Klasse X	0,750 %
Premier-Klasse	0,675 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse S	0,500 %	Klasse S	0,650 %
Klasse LM	Keine	Klasse LM	Keine
Klasse GA	1,620 %	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	
Klasse GE	2,370 %	Klasse A	1,500 %
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^]		Klasse B	2,000 %
Klasse A	1,000 %	Klasse C	2,000 %
Klasse B	1,500 %	Klasse D	1,100 %
Klasse C	1,500 %	Klasse E	2,250 %
Klasse E	1,750 %	Klasse F	1,250 %
Klasse F	0,750 %	Klasse R	1,000 %
Klasse R	0,650 %	Klasse T	1,500 %
Klasse T	1,000 %	Klasse X	0,750 %
Klasse X	0,500 %	Premier-Klasse	0,750 %
Premier-Klasse	0,500 %	Klasse S	0,440 %
Klasse S	0,400 %	Klasse LM	Keine
Klasse LM	Keine	Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]	
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund		Klasse A	1,500 %
Klasse A	1,350 %	Klasse B	2,000 %
Klasse B	1,850 %	Klasse C	2,000 %
Klasse C	1,850 %	Klasse E	2,250 %
Klasse E	2,100 %	Klasse F	1,250 %
Klasse F	1,100 %	Klasse J	0,650 %
Klasse R	0,850 %	Klasse R	1,000 %
Klasse T	1,350 %	Klasse T	1,500 %
Klasse X	0,675 %	Klasse X	0,750 %
Premier-Klasse	0,675 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse S	0,500 %	Klasse S	0,650 %
Klasse LM	Keine	Klasse LM	Keine
Klasse GA	1,420 %	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^]	
Klasse GE	2,170 %	Klasse A	1,500 %
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]		Klasse B	2,000 %
Klasse A	1,500 %	Klasse C	2,000 %
Klasse B	2,000 %	Klasse E	2,250 %
Klasse C	2,000 %	Klasse F	1,250 %
Klasse E	2,250 %	Klasse R	1,000 %
Klasse F	1,250 %	Klasse X	0,750 %
Klasse M	1,000 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse R	1,000 %	Klasse S	0,650 %
Klasse T	1,500 %	Klasse LM	Keine
Premier-Klasse	0,750 %	Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^]	
Klasse LM	Keine	Klasse A (PF)	2,000 %
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^]		Klasse E (PF)	2,750 %
Klasse A (PF)	2,000 %	Klasse F (PF)	1,750 %
Klasse E (PF)	2,750 %	Klasse J (PF)	1,000 %
Klasse F (PF)	1,750 %	Klasse M (PF)	1,500 %
Klasse J (PF)	1,000 %	Klasse R (PF)	1,500 %
Klasse M (PF)	1,500 %	Klasse Premier (PF)	1,500 %
Klasse R (PF)	1,500 %	Klasse LM	Keine
Klasse Premier (PF)	1,500 %		
Klasse LM	Keine		

Die in den obenstehenden Tabellen angegebenen Verwaltungsvergütungen für die einzelnen Fonds gelten für alle in der jeweiligen Spalte aufgeführten Anteilklassen, die der Fonds anbietet. Es werden nicht alle Anteilklassen von jedem Fonds angeboten und zum 31. August 2021 waren nicht alle Anteilklassen in Umlauf. Welche Anteilklassen 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 am 31. August 2021 endenden Berichtszeitraum hat der Verwalter folgende Gebühren erlassen bzw. erstattet:

Fondsname	31. August 2021 in (in Tsd.)	
	Erlassene Verwaltungsvergütung	Verwaltungsvergütung, die erstattet wird, und sonstige Ausgaben, die wiederhergestellt werden
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	2.181 USD	341 USD
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	1 USD	– USD
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	1 USD	– USD
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	1 USD	– USD
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	1 USD	– USD
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	– USD	2 USD
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	– USD	42 USD
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]	19 USD	– USD
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	3 USD	1 USD
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	18 USD	– USD
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	5 USD	16 USD
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	6 USD	– USD
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]	12 USD	– USD

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien– (Fortsetzung)

31. August 2021
in (in Tsd.)

Verwaltungsgebühr,
die erstattet wird,
und sonstige
Ausgaben, die
wiederhergestellt
werden

Fondsname	Erlassene Verwaltungsgebühr	
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	10 USD	2 USD
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^]	3 USD	– USD
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	1 USD	– USD
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]	– USD	23 USD
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund	3 USD	– USD
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]	5 EUR	13EUR
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	– USD	3 USD
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	8 USD	– USD

Mit „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/0 EUR/0 JPY oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 JPY.

Gemäß jedem Anlageverwaltungsvertrag hat jeder Anlageverwalter Anspruch auf eine Anlageverwaltungsgebühr, und jeder Anlageverwalter ist dafür verantwortlich, die Gebühren und Auslagen der Unteranlageverwalter aus seiner eigenen Anlageverwaltungsgebühr (die „Performancegebühren“ enthalten kann) zu zahlen.

Gemäß den Bestimmungen des Hauptvertriebsstellenvertrags zwischen dem Manager, der Gesellschaft und Franklin Distributors, LLC („ehemals Legg Mason Investor Services, LLC“) (der „Master-Distributor“), ist der Master-Distributor ermächtigt, Anteile der Gesellschaft zu vermarkten, zu bewerben, anzubieten und deren Verkauf und Rücknahme zu arrangieren (zusammen als „Vertriebsleistungen“ bezeichnet). Zudem ist der Master-Distributor berechtigt, auf eigene 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 Anlage-Manager und dem Master-Distributor, haftet der Master-Distributor in solchen Fällen gegenüber dem Verwalter für die Erfüllung seiner Aufgaben gemäß dem betreffenden Vertrag. Der Master-Distributor hat gemäß den Anforderungen der Zentralbank Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited und Legg Mason Asset Management Singapore Pte. beauftragt. Begrenzt als zusätzliche Vertriebshändler der Fonds. Der Manager hat sich selbst und Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc. mit der Erbringung bestimmter Vertriebsdienstleistungen beauftragt.

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.

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 Manager, der Gesellschaft und Franklin Distributors hat LLC (der „Hauptanteileseignervertreter“), der Hauptanteilsvertreter für seine Dienste Anspruch auf den Erhalt einer vom Verwalter aus bestimmten Anteilsklassen zu zahlenden Dienstleistungsgebühr.

Gemäß den Bestimmungen des Hauptinformationsstellenvertrags ist der Hauptanteileseignervertreter berechtigt, auf eigene Kosten und Aufwendungen eine oder mehrere Parteien zu bestellen, die sie bei der Erfüllung ihrer Pflichten aus dem Vertrag unterstützen sollen, wobei der Hauptanteileseignervertreter der Gesellschaft gegenüber weiterhin für die Erfüllung ihrer Verpflichtungen aus diesem Vertrag haftet. Gemäß diesem Vertrag hat der Hauptanteileseignervertreter Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited und Legg Mason Asset Management Singapore Pte. beauftragt. Begrenzt als zusätzliche Aktionärsdienstleister der Gesellschaft. Der Manager hat Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc. mit der Erbringung von Aktionärsdienstleistungen in Bezug auf Taiwan beauftragt.

Der Gesamtbetrag der von jeder Aktienklasse gezahlten Informationsstellengebühren entspricht oder hat folgendem entsprochen:

- (i) 0,15 Prozent pro Jahr 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 Corporate 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 Optimiser Fund[^], Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] und Legg Mason Brandywine Global En-hanced Absolute Return Fund[^]; und
- (ii) 0,35 Prozent pro Jahr 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 Sustainability Leaders Fund[^], Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund[^], Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund, Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund (ehemals Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund), Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund (e Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund), Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^], Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund (ehemals 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 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 Martin Currie European Unconstrained Fund[^], Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] und Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^].

Die Informationsstellengebühren müssen für alle Anteilsklassen bezahlt werden, außer für die Anteilsklassen der Klasse F, der Klasse J, der Klasse U, der Klasse Y, der Premier-Anteilsklassen, der LM-Anteilsklassen, der Grandfathered-Anteilsklassen und der Galleon-Anteilsklassen (jeweils wie im Prospekt definiert) zu entrichten, noch sind diese für alle Anteilsklassen zu entrichten, die vom Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund und vom Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^] angeboten werden.

Im Berichtszeitraum zum 31. August 2021 wurde auf folgende Dienstleistungsgebühren verzichtet:

Fondsname	Entfallene Dienstleistungsgebühr Stand 31. August 2021 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	8 USD
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	6 USD
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	1 USD
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	1 USD
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	7 USD
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	46 USD
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]	1 USD
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	2 USD
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^]	3 USD
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund	3 EUR
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	12 USD
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund	6 USD
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	83 USD
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]	11 EUR
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	12 USD
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	1 USD

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien– (Fortsetzung)

Mit „-“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/0 EUR/0 JPY oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 JPY.

Zusätzlich bestimmte Betriebsaufwendungen, einschließlich unter anderem an die Tochtergesellschaften von Franklin Templeton für die Erbringung von Governance-Support und die Berichterstattung an den Verwaltungsrat, für Versicherungsleistungen für den Verwaltungsrat und fortlaufende Registrierungsleistungen in Ländern und Regionen, in denen die Fonds öffentlich angeboten werden. Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021 beliefen sich diese Aufwendungen auf 636.725 USD.

Verbundene Parteien

Jane Trust, Joseph Carrier, Jaspal Sagger und William Jackson sind Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft und sind auch Verwaltungsratsmitglieder und/oder Führungskräfte bestimmter verbundener Unternehmen des Verwalters, des Anlageverwalters, der Vertriebs- und Dienstleistungsstellen. William Jackson und Jane Trust sind ebenfalls Direktoren von FTIS. Die übrigen Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft, wie oben aufgeführt, sind alle entweder Mitarbeiter von FTIS oder einer ihrer Tochtergesellschaften. Abgesehen von den oben genannten Ausnahmen hat bzw. hatte 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 2021 hielten die Fonds in der nachstehenden Tabelle Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen, die denselben Manager, dieselben Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter wie der Fonds ernannt haben oder eine mit diesem Manager, diesen Anlageverwaltern oder Unteranlageverwaltern verbundene Partei ernannt haben.

Nachstehende Tabelle zeigt den von der Gesellschaft gehaltenen Anteil an diesen Organismen für gemeinsame Anlagen:

Fondsname	Zugrunde liegender Organismus für gemeinsame Anlagen	%	31. August 2021 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)	0,11 %	\$2.227
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	4,37 %	\$32.563
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,05 %	€817
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	16,07 %	\$4.901
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro thesaurierend	11,02 %	\$7.209
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,21 %	\$4.347
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro thesaurierend	1,71 %	\$1.120
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,15 %	\$3.060
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,06 %	\$1.204
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1,21 %	\$25.007
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	3,14 %	\$23.402
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,11 %	\$2.226
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,00 %	€5
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	19,34 %	\$144.145
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro thesaurierend	23,45 %	\$15.336
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Legg Mason Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro thesaurierend	14,28 %	\$9.336
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1,82 %	\$37.574
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	4,48 %	\$92.521
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,18 %	\$3.815
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	0,13 %	\$958
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,02 %	\$319
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	2,56 %	\$52.853
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,05 %	\$1.004

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 Anteilklasse PF eine erfolgsabhängige Gebühr („Performancegebühr“) zu erheben (Performancegebührenklassen enthalten ein „(PF)“ im Namen der Anteilklasse).

Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] (bis zum Datum der Beendigung)

Beim Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] wird die Performancegebühr für jede Anteilklasse PF in der Regel (oder wurde in der Regel) in Bezug auf jeden zwölfmonatigen Zeitraum, der am letzten Handelstag jedes Geschäftsjahres endet, berechnet („Berechnungszeitraum“). Für jede Anteilklasse PF ist der erste Berechnungszeitraum der Zeitraum, der an dem Geschäftstag beginnt, der unmittelbar auf den Börsentag folgt, an dem der Nettoinventarwert für die Anteilklasse erstmals berechnet wird (der „Erste Handelstag“), und der am letzten Handelstag des Geschäftsjahres endet, in dem der erste Handelstag eintritt (der „Erste Berechnungszeitraum“).

Für jeden Berechnungszeitraum hat der Anlageverwalter für jeden Anteil der Anteilklasse PF ggf. Anspruch auf eine Performancegebühr in Höhe von 20 % 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 ausgeschüttungen 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 Anteilklasse 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 Anteilklasse PF in Bezug auf den laufenden Berechnungszeitraum davon ausgegangen, dass das Datum des Vertragsendes das Ende des Berechnungszeitraums ist. Sofern ein Anteilinhaber seine Anteile der Anteilklasse PF vor dem Ende eines Berechnungszeitraums einlöst, wird die aufgelaufene und diesen Anteilen zurechenbare Performancegebühr herauskristallisiert und dem Anlageverwalter nach Abzug der fälligen Performancegebühr von den Rücknahmeerlösen gezahlt.

Die High Water Mark in Bezug auf jede PF-Anteilklasse des Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] bezeichnet den größeren der folgenden Werte: (i) dem anfänglichen Angebotspreis pro Anteil; (ii) dem höchsten Nettoinventarwert pro Anteil, der unmittelbar nach dem Ende eines früheren Berechnungszeitraums galt; und (iii) falls die PF-Anteilklasse durch eine Verschmelzung einer Anteilklasse eines anderen vom Unteranlageverwalter verwalteten Fonds aufgelegt wurde, die Hochwassermarkte für diese Anteilklasse am Tag der Verschmelzung, wie sie gemäß dem entsprechenden Angebotsdokument für diesen anderen Fonds berechnet wird.

Der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] führt keine Ausgleichskonten für Anteilinhaber in Bezug auf die aufgelaufenen Performancegebühren.

Während des Berichtszeitraums zum 31. August 2021 abgegrenzte Erfolgspremien werden in der Gesamtergebnisrechnung offengelegt.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien– (Fortsetzung)

Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren

Die Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch, fungiert als Verwahrstelle (die „Verwahrstelle“) und BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company (die „Verwaltungsstelle“) fungiert als Verwaltungsstelle aller Fonds der Gesellschaft. 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 2021 beziehenden erfolgswirksam in der Gesamtergebnisrechnung erfassten Honorare und Auslagen der Mitglieder des Verwaltungsrats beliefen sich auf 69.000 USD.

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 2021
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	77,88
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	24,05
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	95,43
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	26,57
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	64,22
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	21,81
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	20,09
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	43,98
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	85,98
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	41,17
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	57,48
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund [^]	83,69
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	30,68
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	25,00
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	21,44
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	60,13
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	36,19
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	99,92
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	100,00
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	84,75
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	98,69
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	96,79
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]	96,74
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	46,54
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	39,13
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	24,28
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	25,57
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	23,06
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	22,62
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	99,87
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	92,94
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	98,27
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	32,51
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	22,18
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	43,32
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]	63,66
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]	21,91
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	97,98
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^]	80,73
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	33,18
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	32,62
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	90,16
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	26,85
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	54,78
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	21,81
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	42,09
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	45,46
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	27,99

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 Anteilsklasse	der	ausschüttenden 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 rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile – (Fortsetzung)

Im Laufe des Geschäftsjahres haben die folgenden Fonds die Kapitalausschüttung bei ausschüttenden Plus-Anteilsklassen ausgezahlt:

	Ausschüttungen aus dem Kapital für den Zeitraum zum 31. August 2021 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	190 USD
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	11 USD
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	4 USD
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– USD
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	5 USD
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	16 USD
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1 USD
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1 USD
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	10 USD
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A ZAR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	123 USD
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	65 USD
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	– USD
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	5 USD
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1 USD
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– USD
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	95 USD
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	92 USD
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	51 USD
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	631 USD
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	280 USD
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	159 USD
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	185 USD
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	37 USD
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	13 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	11 USD
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – Klasse D AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– USD
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – Klasse D USD ausschüttend (M) Plus	73 USD
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1 USD
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	6 USD
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	– USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	24 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	18 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund [^] – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	11 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	240 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	7 USD
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	29 USD
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	15 USD
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2 USD
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	8 USD
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2 USD
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	593 EUR
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	23 EUR
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	141 EUR
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus	25 EUR
Legg Mason Clear Bridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	36 EUR
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	69 USD
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– USD
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– USD
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	6 USD
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	69 USD
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	83 USD
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Premier Klasse USD ausschüttend (M) Plus	– USD
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse S USD ausschüttend (M) Plus	4 USD
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	40 USD
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	13 EUR
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2 EUR
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus	2 EUR
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2 EUR
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	46 USD
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	24 USD
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3 USD
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	20 USD
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1 USD
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	6 USD
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	6 USD
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	4 USD
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1 USD
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A US\$ ausschüttend (M) Plus	– USD
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	– USD
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	3 USD
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1 USD
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	– USD
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) Plus (abgesichert)	2 USD
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) Plus (abgesichert)	– USD
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	– USD
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) Plus (abgesichert)	5 USD
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) Plus	7 USD

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/0 EUR oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR.

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 Anteilinhaber sollten beachten, dass ein erhöhtes Risiko besteht, dass

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

4. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile – (Fortsetzung)

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 Dividendenausüttung unter diesem Ladesystem führt zu einer entsprechenden unmittelbaren Verringerung des Nettoinventarwerts der Anteilsklassen am Ex-Dividendendatum. Die Anteilinhaber 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.

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 2021 (in Tsd.) belastet wurden
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	2 USD
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– USD
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse USD ausschüttend (M) Plus (e)	23 USD
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	7 USD
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	515 USD
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	2.680 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	377 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	47 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	108 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	170 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus (e)	– USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	47 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A JPY ausschüttend (M) Plus (e)	2 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	510 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	313 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	55 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	108 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus (e)	– USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1.670 USD
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	– USD
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	2 USD
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	42 USD
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	– USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	872 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	282 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	46 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	50 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	96 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	29 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Klasse USD ausschüttend (M) Plus (e)	14 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	37 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	3 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	19 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	4 USD
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	16 USD
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	– USD
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^] – Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– USD
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1 USD
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	3 USD
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	– USD
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– USD
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Premier Klasse GBP ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	– EUR
Legg Mason Clear Bridge Infrastructure Value Fund [^] – Premier Klasse CAD ausschüttend (Q) Plus (e)	35 EUR
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Premier Klasse CAD ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	195 EUR
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	180 USD
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	5 USD
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	5 USD
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	58 USD
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus (e)	5 USD
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – S Klasse GBP ausschüttend (M) Plus (e)	1 USD

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 USD/0 EUR oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR.

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 Euro (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 Anteilinhaber dazu, gleichberechtigt auf anteilmäßiger 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 Anteilinhaber 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 Währungen. 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, gewinnberechtigende 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 Vertriebshändlern 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 die japanische Verteilung nach Ermessen der Direktoren oder Vertriebshändler bestimmt. Anteile der Klasse M sind für professionelle Investoren und Investoren mit einer diskretionellen Anlagevereinbarung mit einem Händler oder einer anderen von einem 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 im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für „geeignete Gegenparteien“ gemäß Definition im Rahmen von MIFID II zur Verfügung. Für Investoren außerhalb der Europäischen Union sind die BW Premier-Anteilsklassen verfügbar für institutionelle Investoren 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 zahlen, 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.

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 entsteht im Allgemeinen bei der Ausschüttung, Rücknahme, dem Rückkauf, der Einziehung oder Übertragung von Anteilen oder am Ende des „relevanten Zeitraums“. 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 steuerpflichtigen Ereignisses 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 steuerbefreite steuerlich in Irland ansässige Anteilsinhaber handelt, die der Gesellschaft die erforderlichen unterschriebenen vorschriftsmäßigen Erklärungen vorgelegt haben.

Darüber hinaus stellen jegliche Transaktionen (bei denen es sich andernfalls um ein steuerpflichtiges Ereignis handeln könnte) in Bezug auf Anteile, die in einem laut Verordnung des irischen Finanzamts anerkannten Clearingsystem gehalten werden, keine steuerpflichtigen Ereignisse 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. Barmittel und Barmitteläquivalente und Margenkonten

Barmittel und andere liquide Mittel werden zum Nennwert und gegebenenfalls unter Berücksichtigung aufgelaufener Zinsen bewertet. Die Barmittel und Barmitteläquivalente und Barmittel-Überziehungssalden eines Fonds werden bei der Depotstelle gehalten. Der Posten „Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung“ weist in der Darstellung der Vermögenslage Einschusszahlungen, Barsicherheiten und realisierte Gewinne und Verluste aus Futures-Kontrakten aus, die noch nicht geliefert wurden. Margeneinlagen und Barsicherheiten, die in Bezug auf OTCs und den Handel mit börsengehandelten Derivaten zum 31. August 2021 gehalten werden, werden bei den folgenden Brokern gehalten: Bank of America Merrill Lynch, Barclays, BNP Paribas, BNY Mellon, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley und UBS.

8. Verpflichtungen und Eventualverbindlichkeiten

Zum 31. August 2021 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 2021 ging Royce & Associates, LP („Royce“) „Soft Commission“-Vereinbarungen mit Brokern ein, erstattete jedoch die entsprechenden Fonds für alle im Rahmen dieser Vereinbarungen entstandenen Forschungskosten.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

10. Wechselkurse

In diesem Abschluss wurden für die jeweiligen auf US-Dollar, Euro,ritisches Pfund und japanischer Yen lautenden Fonds die Beträge in Fremdwährungen anhand folgender Wechselkurse jeweils in US-Dollar, Euro,ritisches Pfund und japanischen Yen umgerechnet:

Auf USD lautende Fonds	Währung	Wechselkurs am 31. August 2021
	Argentinischer Peso	176,3133*
	Australischer Dollar	1,3670
	Brasilianischer Real	5,1708
	Britisches Pfund	0,7274
	Kanadischer Dollar	1,2617
	Chilenischer Peso	773,8450
	Chinesischer Renminbi (CNH)	6,4541
	Chinesischer Renminbi (CNY)	6,4632
	Kolumbianischer Peso	3.769,1500
	Tschechische Krone	21,5279
	Dänische Krone	6,2982
	Ägyptisches Pfund	15,7000
	Euro	0,8469
	Hongkong-Dollar	7,7775
	Ungarischer Forint	295,6130
	Indische Rupie	73,0075
	Indonesische Rupiah	14.262,5000
	Israelischer Schekel	3,2078
	Japanischer Yen	110,0150
	Malaysischer Ringgit	4,1570
	Mexikanischer Peso	20,0840
	Neuseeländischer Dollar	1,4191
	Norwegische Krone	8,6943
	Pakistanische Rupie	166,3500
	Philippinischer Peso	49,7500
	Polnischer Zloty	3,8302
	Russischer Rubel	73,2338
	Singapur-Dollar	1,3445
	Südafrikanischer Rand	14,5263
	Südkoreanischer Won	1.159,4500
	Schwedische Krone	8,6295
	Schweizer Franke	0,9158
	Taiwan-Dollar	27,7135
	Thailändischer Baht	32,2325
	Türkische Lira	8,3165
	Ukrainische Hryvnia	26,9198

Auf EUR lautende Fonds	Währung	Wechselkurs am 31. August 2021
	Australischer Dollar	1,6140
	Britisches Pfund	0,8588
	Kanadischer Dollar	1,4897
	Dänische Krone	7,4366
	Japanischer Yen	129,9003
	Norwegische Krone	10,2657
	Polnischer Zloty	4,5225
	Südafrikanischer Rand	17,1519
	Schwedische Krone	10,1892
	Schweizer Franke	1,0813
	Türkische Lira	9,8197
	US-Dollar	1,1808

Auf GBP lautende Fonds	Währung	Wechselkurs am 31. August 2021
	Euro	1,1644
	US-Dollar	1,3749

* Ermäßigter Tagessatz, basierend auf dem ARS Eqy EqWgt Impli (UNOFFICIAL) Index, gemäß den Anweisungen von FTIS.

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts

Die Gesellschaft hat die Bewertungen zum Marktwert im Rahmen einer Marktwertierarchie klassifiziert, die die Signifikanz von Inputs reflektiert, die bei einer Bewertung zum Marktwert herangezogen werden. Die Marktwertierarchie 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.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle schlüsselt die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum 31. August 2021 gemäß den Bewertungsstufen auf:

	Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	96
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	277	2.138	120	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(131)	(2.636)	(506)	–
	–	146	(498)	(386)	96
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 741.449	\$ 273.297	\$ 1.554.220	€ 104.741	\$ 53.775
Geldmarktinstrumente	210.176	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	2.227	32.563	817	65
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	3.012	16.078	201	16
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(360)	(6.289)	(245)	–
	951.625	278.176	1.596.572	105.514	53.856
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ 169	\$ 3.239	€ –	\$ 482
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	169	3.239	–	482
Anlagen insgesamt	\$ 951.625	\$ 278.491	\$ 1.599.313	€ 105.128	\$ 54.434

	Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US High Yield Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	337	2.608	–	–	120
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	51	12	9	5	234
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(337)	–	(11)	(2)	–
	51	2.620	(2)	3	354
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 285.242	\$ 247.007	\$ 42.132	\$ 43.305	\$ 83.891
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	35.225	4.919	4.854	–	8.452
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	834	34	52	26	67
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(1.891)	(50)	(65)	(2)	(83)
	319.410	251.910	46.973	43.329	92.327
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 4	\$ 143	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	2	707	–	–	2
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	6	850	–	–	2
Anlagen insgesamt	\$ 319.467	\$ 255.380	\$ 46.971	\$ 43.332	\$ 92.683

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^ am 31. August 2021 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	35	795	359	349	42
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(216)	–	(1.020)	(441)	(100)
	(181)	795	(661)	(92)	(58)
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 46.809	\$ 558.483	\$ 476.377	\$ 212.626	\$ 83.801
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	3.060	1.204	25.007	23.402	2.226
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	90	437	1.009	1.052	120
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(147)	(1.070)	(4.735)	(1.361)	(1.087)
	49.812	559.054	497.658	235.719	85.060
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ 70
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	2	70
Anlagen insgesamt	\$ 49.631	\$ 559.849	\$ 496.997	\$ 235.629	\$ 85.072

	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Mortgage- Backed Securities Fund^ am 31. August 2021 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	1.292	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	38.966	1.072	110	229
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(79.984)	(840)	(121)	(315)
	–	(41.018)	1.524	(11)	(86)
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	€ 46.388	\$ 5.254.106	\$ 1.065.630	\$ 1.094.397	\$ 1.161.990
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	5	159.481	24.549	37.574	92.521
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	154	457.915	5.917	1.320	4
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(1)	(126.431)	(11.283)	(788)	(583)
	46.546	5.745.071	1.084.813	1.132.503	1.253.932
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ 11.701	\$ 6.262	\$ 43.077	\$ 219
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	2.497	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	11.701	8.759	43.077	219
Anlagen insgesamt	€ 46.546	\$ 5.715.754	\$ 1.095.096	\$ 1.175.569	\$ 1.254.065

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^] am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund [^] am 31. August 2021 (in Tsd.)	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^] am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^] am 31. August 2021 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	297	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	6	42	72	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(28)	(63)	(99)	–	(804)
	(22)	276	(27)	–	(804)
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	£ 76.383	\$ 185.827	\$ 22.005	\$ 264.635	\$ 681.842
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	4.311	1.277	6.381	18.269
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	22	561	853	9.325
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(32)	(1.396)	(67)	(2.651)	(10.890)
	76.351	188.764	23.776	269.218	698.546
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	£ 76.329	\$ 189.040	\$ 23.749	\$ 269.218	\$ 697.742

	Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^] am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^] am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^] am 31. August 2021 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	164	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	177	8	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(73)	–	–	–
	–	(73)	177	172	–
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 11.586	\$ 263.052	\$ 1.166.848	\$ 54.773	\$ 10.589
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	506	6.890	105.165	3.644	388
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	222	1.125	17.169	127	198
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(111)	(3.181)	(922)	(903)	(66)
	12.203	267.886	1.288.260	57.641	11.109
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 12.203	\$ 267.813	\$ 1.288.437	\$ 57.813	\$ 11.109

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Value Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	2.130	722.688	209.301	2.084.615
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(3.854)	–	–	–	–
	(3.854)	2.130	722.688	209.301	2.084.615
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 135.151	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	6.568	67	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	5.292	6	25	–	1.680
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(6.017)	–	(14)	–	(932)
	140.994	73	11	–	748
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 137.140	\$ 2.203	\$ 722.699	\$ 209.301	\$ 2.085.363

	Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^ am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ am 31. August 2021 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	752.465	42.082	1.242.610	13.552	662.174
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	752.465	42.082	1.242.610	13.552	662.174
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ 934	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	69	9	208	–	1.015
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(64)	(7)	(1.019)	–	(677)
	5	936	(811)	–	338
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 752.470	\$ 43.018	\$ 1.241.799	\$ 13.552	€ 662.512

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^] am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	2.927	90.815	1.000.814	98.518	29.839
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	2.927	90.815	1.000.814	98.518	29.839
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	52.853	1.004	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	7	197	965	1	6
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(6)	(409)	–	(42)
	7	191	53.409	1.005	(36)
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 2.934	\$ 91.006	\$ 1.054.223	\$ 99.523	€ 29.803
	Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^] am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^] am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Pacific Ex Japan Real Income Fund am 31. August 2021 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	29.198	11.964	79.819	150.563	27.740
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	29.198	11.964	79.819	150.563	27.740
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	43	–	–	217	8
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(13)	(3)	–	(39)	(3)
	30	(3)	–	178	5
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 29.228	\$ 11.961	\$ 79.819	\$ 150.741	\$ 27.745

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^] am 31. August 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^] am 31. August 2021 (in Tsd.)
Stufe 1		
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–
Eigenkapitalinstrumente	47.628	239.007
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–
	47.628	239.007
Stufe 2		
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–
Eigenkapitalinstrumente	91	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	47
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(23)
	91	24
Stufe 3		
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–
	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 47.719	€ 239.031

Zum 31. August 2021 gibt es zwei illiquide Wertpapiere, die FF Group und die Hanergy Mobile Energy Holding Group Co Ltd, die innerhalb der Ebene 3 der Fair-Value-Hierarchie des Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^] enthalten sind.

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.

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.

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.

Der Wert der als Sicherheit erhaltenen Basiswerte für gehandelte und von den folgenden Fonds gehaltenen Derivate betrug:

Fonds	Broker	Zum 31. August 2021 Marktwert der Sicherheit in Tsd.
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	BNP Paribas	113 USD
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Goldman Sachs	133 USD
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	JP Morgan	254 USD
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Morgan Stanley	475 USD
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Morgan Stanley	120 USD
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	JP Morgan	204 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	BNP Paribas	1.210 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Goldman Sachs	2.343 USD
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	BNP Paribas	82 USD
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Goldman Sachs	196 USD

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.

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 den Kontrahenten 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.

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.

Im Wesentlichen werden alle von den Fonds gehaltenen Barmittel und Wertpapiere über die Depotbank gehalten, die eine Bonität von 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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Wertpapiersicherheiten – (Fortsetzung)

eine andere Bank übertragen.

Sämtliche als Sicherheit platzierte Wertpapiere sind im Anlageportfolio aufgeführt. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente, die auf den Depotbank- und Margenkonten gehalten werden und die Barmittel sind, werden in der Rechnung der Finanzlage ausgewiesen.

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 den Kontrahenten über den Betrag, der den ihm geschuldeten Betrag übersteigt.

Zur Reduzierung des Gegenparteiausfallrisikos 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 als Sicherheit bei Brokern platziert wurden:

Fonds	Broker	Zum 31. August 2021
		Marktwert der Sicherheit in Tsd.
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Citi	44 USD
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund ^A	Morgan Stanley	100 USD
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund ^A	Citi	2.263 USD

Zum Ende des Berichtszeitraums waren Margin-Konten und eingeschränkte Barmittel und sonstige Forderungen Kreditrisiken ausgesetzt. Der Gesamtbetrag der dem Kreditrisiko ausgesetzten finanziellen Vermögenswerte entspricht in etwa dem Wert, zu dem sie in der Bilanz ausgewiesen sind (ohne Aktien).

13. Angaben zu gegenseitigen Anlagen durch die Fonds innerhalb der Gesellschaft

Bestimmte Fonds investieren in andere Fonds der Gesellschaft. Diese übergreifenden Investitionen wurden im Jahresabschluss der Gesellschaft wie folgt eliminiert:

- die Marktwerte der zugrundeliegenden kollektiven Anlagen wurden in den Gesamtbeträgen der Gesellschaft in der Bilanz der Finanzlage eliminiert;
- die realisierten Gewinne und Verluste, einschließlich Bewegungen bei nicht realisierten Gewinnen und Verlusten, und die relevanten Dividendenerträge und Ausschüttungen aus den übergreifenden Anlagen wurden in den in der Gesamtertragsrechnung ausgewiesenen Gesamtbeträgen der Gesellschaft eliminiert; und
- die monetären Beträge von Käufen und Verkäufen von Anteilen in solchen kollektiven Kapitalanlagen wurden aus dem Nettoerlös aus dem Verkauf von Anteilen bzw. den Kosten der zurückerworbenen Anteile in den Gesamtbeträgen der Gesellschaft, die in der Erklärung der Änderungen des Nettovermögens, die den Inhabern von rückkaufbaren aktienpatierenden Anteilen zuzuschreiben sind, ausgewiesen sind, eliminiert.

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Der Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund hielt zum Ende des Berichtszeitraums 86.378 und 63.363 Anteile am Legg Mason Western Asset US High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund und Legg Mason Western Asset EUR High Yield Fund. Im Berichtszeitraum durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

Fonds	Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund
	Für den Zeitraum zum 31. August 2021 (in Tsd.)	Für den Zeitraum zum 31. August 2021 (in Tsd.)	Für den Zeitraum zum 31. August 2021 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	\$123	\$177	\$—
Rücknahme von Anteilen	(10.502)	—	(2.463)
Realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	613	—	692
Erhaltene Ausschüttungen	—	177	123
Anschaffungskosten	—	8.910	10.273
Beizulegender Zeitwert	—	8.955	14.160
Nicht realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	\$—	\$45	\$3.887

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 46.816 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:

Fonds	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund
	Für den Zeitraum zum 31. August 2021 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	\$2.768
Rücknahme von Anteilen	—
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	—
Erhaltene Ausschüttungen	69
Anschaffungskosten	4.663
Beizulegender Zeitwert	4.854
Nicht realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	\$ 191

^A 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 20.047 bzw. 22.300 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:

Fonds	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund
	Für den Zeitraum zum 31. August 2021 (in Tsd.)	Für den Zeitraum zum 31. August 2021 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	\$1.489	\$-
Rücknahme von Anteilen	(1.500)	(893)
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(4)	235
Erhaltene Ausschüttungen	39	-
Anschaffungskosten	2.075	3.641
Beizulegender Zeitwert	2.078	4.984
Nicht realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	3	\$1.343

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Der Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^] hielt zum Ende des Berichtszeitraums 93.789 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:

Fonds	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund
	Für den Zeitraum zum 31. August 2021 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	\$192
Rücknahme von Anteilen	-
Realisierter Nettogewinn(-verlust) aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	-
Erhaltene Ausschüttungen	192
Anschaffungskosten	9.150
Beizulegender Zeitwert	9.723
Nicht realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	\$573

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] hielt zum Ende des Berichtszeitraums 29.816 Anteile an Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]. Im Berichtszeitraum durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

Fonds	Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]
	Für den Zeitraum zum 31. August 2021 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	\$-
Rücknahme von Anteilen	(7.509)
Realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	698
Erhaltene Ausschüttungen	-
Anschaffungskosten	3.500
Beizulegender Zeitwert	3.859
Nicht realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam num beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	\$359

14. Bedeutende Ereignisse

Mit Wirkung zum 27. November 2020 hat der Manager Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc. ermächtigt, Gesellschafterdienstleistungen und Vertriebsdienstleistungen in Bezug auf Taiwan zu erbringen.

Am 9. März 2021 wurde von der Gesellschaft aktualisierte Haupt- und Fachprospekte herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt. Die wesentlichen Änderungen umfassten Aktualisierungen, die vorgenommen wurden, um zu beschreiben, wie der Manager die Richtlinien der Anlageverwalter in Bezug auf die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken in seinen Anlageentscheidungsprozess umgesetzt hat. Diese Änderungen sind erforderlich, um Artikel 6 der EU-Verordnung zur Offenlegung nachhaltiger Finanzen (Verordnung (EU) 2019/2088) zu erfüllen.

Mit Wirkung zum 14. April 2021 hat der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund den Handel eingestellt.

Mit Wirkung zum 30. April 2021 begann der Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund mit dem Handel.

Am 17. Mai 2021 wurde ein aktualisierter Expertenprospekt von der Gesellschaft herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt. Die wichtigsten Änderungen sind:

- Aktualisierung der Anlagepolitik von Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund, Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund, Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser, Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund und Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund;
- Benchmark-Änderungen für Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund, Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund und Legg Mason ClearBridge Value Fund;
- Zugabe von neuen Währungen, HUF und CZK, zu bestimmten Ergänzungen;
- Entfernung von Shell Fund – Legg Mason Western Asset US Dollar Liquidity Fund;
- Korrektur der Ersetzung von RARE durch ClearBridge im Fachprospekt des Unternehmens;
- Korrektur der Handelsfrist auf 4pm EST im Legg Mason Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund (bis heute nicht eingeführt);
- Klarstellung, dass das Kreditverbot eine Überziehungsfazilität auf Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund nicht verhindert.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

14. Bedeutende Ereignisse – (Fortsetzung)

Mit Wirkung zum 20. Mai 2021 wurde Jane Trust zum Mitglied des Verwaltungsrats von FTIS ernannt.

Ab dem 1. Juni 2021 stellte der Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund^A den Handel ein.

Mit Wirkung vom 7. August 2021 hat Legg Mason Investments (Europe) Limited seine Tätigkeit als Beauftragter oder Vertriebshändler der Gesellschaft eingestellt. Folglich trat Legg Mason Investment (Europe) Limited seine jeweiligen Rechte und Obligationen an Franklin Distributors, LLC (früher bekannt als Legg Mason Investor Services, LLC) in Bezug auf die bestehenden Beteiligungsverwaltungsverträge und Vertriebsvereinbarungen mit Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited und Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited.

Am 09. August 2021 wurde von der Gesellschaft ein aktualisierter Verkaufsprospekt herausgegeben und durch die Zentralbank genehmigt. Mit Wirkung zum gleichen Datum fusionierte QS Investors, LLC, 880 Third Avenue, 7th Floor, New York, NY 10022 USA mit Franklin Advisers, Inc., One Franklin Parkway, San Mateo, CA 94403, USA. Die wesentlichen Änderungen des Prospekts umfassten infolgedessen Änderungen der Namen der folgenden Fonds:

- Franklin MV European Equity Growth and Income Fund (ehemals Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund).
- Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund (ehemals Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund).
- Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund (vormals Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund).

Während des Zeitraums hat sich die Ausbreitung von COVID-19 weiterhin stark auf die Weltwirtschaft und die Finanzmärkte ausgewirkt. Es ist noch zu früh, die endgültigen Auswirkungen von COVID-19 zu beurteilen. Die Länge und das Ausmaß des Abschwungs – wie auch seine Auswirkungen auf die Finanzmärkte – werden von mehreren Faktoren abhängen, zu denen unter anderem die Anstrengungen zum „Abflachen der Kurve“ durch weitreichende Beschränkungen des öffentlichen Lebens (Lockdowns), Quarantäne und Abstandsregeln gehören. In der Zwischenzeit wurden weltweit aggressive geld- und haushaltspolitische Maßnahmen ergriffen.

Während des Berichtszeitraums zum 31. August 2021 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

Es gab keine wesentlichen Ereignisse nach dem Bilanzstichtag, die im Abschluss offengelegt werden müssten.

17. Genehmigung des Halbjahresberichts und ungeprüften Abschlusses

Der Halbjahresbericht und der ungeprüfte Zwischenabschluss wurden am 19. Oktober 2021 dem Verwaltungsrat vorgelegt und von diesem zur Kenntnis genommen und zur Einreichung bei der Zentralbank sowie zur Verteilung an die Anteilinhaber genehmigt.

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios - TER)

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittsvermögen täglich in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021**	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittsvermögen täglich in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021**
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund		
Klasse A USD thesaurierend	0,10	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	0,10	
Klasse B USD, thesaurierend	0,11	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	0,09	
Klasse C USD, thesaurierend	0,10	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	0,11	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,10	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	0,10	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	0,10	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	0,09	
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,21	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,21	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,55	
Klasse C USD, thesaurierend	1,71	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,70	
Klasse E USD, thesaurierend	1,81	
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 LM USD, thesaurierend	0,11	
Klasse GA USD, thesaurierend	0,93	
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	1,39	
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	1,89	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,89	
Klasse E USD, thesaurierend	1,99	
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)	0,82	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,39	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	0,39	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,39	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,09	
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)	1,71	
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)	1,77	
Klasse F EUR, ausschüttend (Q)	0,70	
Klasse X EUR, thesaurierend	0,48	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,42	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,12	
Klasse GA EUR, thesaurierend	0,94	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	0,94	
Klasse GE EUR, thesaurierend	1,53	
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,40	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,40	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,40	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,40	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,40	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,40	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,40	
Klasse B USD, thesaurierend	1,64	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,65	
Klasse C USD, thesaurierend	1,90	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,90	
Klasse F USD, thesaurierend	1,00	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,90	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,75	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,46	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,46	
Klasse B (G) USD, ausschüttend (D)	1,97	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,96	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,96	
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,35	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,35	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,35	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,35	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,35	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,35	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,35	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,35	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,35	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,60	
Klasse C USD, thesaurierend	1,85	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,85	
Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35	
Klasse E USD, thesaurierend	1,95	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,95	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,95	
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,95	
Klasse F USD, thesaurierend	0,75	
Klasse F USD ausschüttend (D)	0,75	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,80	
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,80	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,50	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	0,50	
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,50	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,50	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,50	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,10	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,10	
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,40	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,41	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,40	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,41	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,41	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,35	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,41	
Klasse B USD, thesaurierend	1,65	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,66	
Klasse C USD, thesaurierend	1,90	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,90	
Klasse E USD, thesaurierend	2,00	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	2,00	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,00	
Klasse F USD, thesaurierend	0,80	
Klasse F USD ausschüttend (D)	0,81	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,83	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,56	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,56	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,11	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,11	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,26	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,26	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,76	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,76	
Klasse GF USD, thesaurierend	1,05	

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) – (Fortsetzung)

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021**	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021**
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,80	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,80	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,80	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,79	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,80	
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,80	
Klasse A GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,80	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,80	
Klasse C USD, thesaurierend	2,30	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	2,30	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	2,57	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,55	
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	2,55	
Klasse F USD, thesaurierend	1,09	
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,20	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,83	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,85	
Klasse Premier GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	0,83	
LM KLASSE USD, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,14	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,55	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,55	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	2,05	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	2,05	
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,81	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,97	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,04	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,17	
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,53	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,53	
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	1,53	
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,56	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,55	
Klasse B USD, thesaurierend	1,79	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,78	
Klasse C USD, thesaurierend	2,03	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	2,03	
Klasse E USD, thesaurierend	2,14	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	2,15	
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	2,14	
Klasse F USD, thesaurierend	0,84	
Klasse F USD ausschüttend (D)	0,84	
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 (D) (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	1,20	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,20	
Klasse B USD, thesaurierend	1,45	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	1,70	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,18	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,00	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (A)	1,00	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (A)	1,50	
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)	1,34	
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	1,34	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	1,34	
Klasse B USD, thesaurierend	1,59	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,58	
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	0,94	
Klasse F USD ausschüttend (D)	0,94	
Klasse X USD thesaurierend	0,84	
Klasse X USD ausschüttend (M)	0,84	
Klasse X EUR, thesaurierend	0,83	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	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 EUR, ausschüttend (M)	0,69	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M)	0,69	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,09	
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,10	
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,09	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,09	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse A SEK ausschüttend (M) (abgesichert)	0,99	
Klasse B USD, thesaurierend	1,34	
Klasse C USD, thesaurierend	1,59	
Klasse C USD, ausschüttend (M)	1,59	
Klasse E USD, thesaurierend	1,69	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,69	
Klasse F USD, thesaurierend	0,69	
Klasse F USD ausschüttend (D)	0,69	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,67	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,44	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,44	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,44	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,44	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,34	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,34	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,34	
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,09	
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]		
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,40	
Klasse X USD thesaurierend	0,80	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,50	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,11	
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	0,10	
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,34	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,34	
Klasse X USD thesaurierend	0,49	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,14	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,14	
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund		
Klasse A EUR, ausschüttend (D)	1,45	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	0,84	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,60	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,15	
Klasse LM EUR, ausschüttend (Q)	0,15	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios - TER)

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittsfondsvermögen täglich in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021**	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittsfondsvermögen täglich in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021**
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (S)	1,74	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,74	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,74	
Klasse A GBP, thesaurierend	1,74	
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,74	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,67	
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse B USD, thesaurierend	1,99	
Klasse C USD, thesaurierend	2,24	
Klasse C USD, ausschüttend (S)	2,24	
Klasse A JPY, ausschüttend (M) Plus (e)	1,74	
Klasse A NOK, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse E USD, thesaurierend	2,34	
Klasse E USD ausschüttend (S)	2,34	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,34	
Klasse F USD, thesaurierend	1,34	
Klasse F USD, ausschüttend (S)	1,34	
Klasse X USD thesaurierend	1,24	
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,24	
Klasse X USD, ausschüttend (S)	1,24	
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)	1,24	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,24	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,24	
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,24	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,24	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,24	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,24	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,24	
Klasse X SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,24	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,09	
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	1,09	
Klasse Premier AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	1,07	
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	1,09	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,09	
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier JPY, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,10	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse S USD, thesaurierend	0,69	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,69	
Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	0,09	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,09	
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,49	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,47	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,49	
Klasse C USD, thesaurierend	2,05	
Klasse F USD, thesaurierend	0,88	
Klasse X CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,86	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,69	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,69	
Klasse S USD, thesaurierend	0,49	
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	
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
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	1,29	
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 EUR ausschüttend (Q) (abgesichert)	0,69	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,69	
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	0,69	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,09	
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,25	
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	0,11	
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	
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]		
LM Klasse USD, ausschüttend (Q)	0,00	
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (S)	1,37	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (S)	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1,37	
Klasse A GBP, thesaurierend	1,37	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,36	
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1,37	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,37	
Klasse B USD, thesaurierend	1,61	
Klasse B USD, ausschüttend (S)	1,62	
Klasse C USD, thesaurierend	1,87	
Klasse C USD, ausschüttend (S)	1,87	
Klasse E USD, thesaurierend	1,97	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	1,97	
Klasse F USD, thesaurierend	0,97	
Klasse F USD, ausschüttend (S)	0,97	
Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,97	
Klasse X USD thesaurierend	0,87	
Klasse X USD, ausschüttend (S)	0,87	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,87	
Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,87	
Klasse X GBP, thesaurierend	0,87	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	0,87	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,87	
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)	0,87	
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,87	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,72	
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	0,72	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,72	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,72	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,72	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,72	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11	
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,12	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) – (Fortsetzung)

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittsvermögen täglich in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021**	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittsvermögen täglich in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021**
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,59	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,59	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,59	
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,58	
Klasse C USD, thesaurierend	2,09	
Klasse E USD, thesaurierend	2,19	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,19	
Klasse F USD, thesaurierend	1,19	
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,19	
Klasse X USD thesaurierend	1,14	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,14	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,14	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,99	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,99	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,99	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,99	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,99	
Klasse Premier SGD thesaurierend (abgesichert)	0,99	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10	
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,09	
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,40	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,40	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,75	
Premier Klasse GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,75	
Klasse S CAD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,60	
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,40	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,40	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,45	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,40	
Klasse C USD, thesaurierend	1,90	
Klasse E USD, thesaurierend	2,00	
Klasse F USD, thesaurierend	1,01	
Klasse F USD, ausschüttend (M)	1,00	
Klasse X USD thesaurierend	0,90	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,90	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	0,90	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	0,75	
Premier Klasse NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,75	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,10	
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,10	
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,34	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,34	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,34	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,33	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,34	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,33	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,40	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,32	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,40	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,34	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,34	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,40	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,34	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,40	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,34	
Klasse A HKD, thesaurierend	1,40	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,33	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34	
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,33	
Klasse C USD, thesaurierend	1,83	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,84	
Klasse E USD, thesaurierend	1,94	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,93	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,94	
Klasse F USD, thesaurierend	0,88	
Klasse F USD ausschüttend (D)	0,89	
Klasse X USD thesaurierend	0,78	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,79	
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,79	
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)	0,77	
Klasse X CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,78	
Klasse X EUR, thesaurierend	0,79	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,78	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,79	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,79	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,63	
Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,64	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,63	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,64	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,63	
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	0,64	
Klasse S USD, thesaurierend	0,44	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,44	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,44	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,44	
LM Klasse EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	0,08	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,10	
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,95	
Klasse X USD ausschüttend (M)	1,45	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,30	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,15	
Klasse S SGD, thesaurierend (abgesichert)	0,70	
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,35	
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)	2,25	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,40	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,30	
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,10	
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,70	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,76	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,51	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios - TER)

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittsvermögen täglich in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021**		Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittsvermögen täglich in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021**
Legg Mason ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,79	Klasse A USD thesaurierend	1,75
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,79	Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,75
Klasse A EUR, thesaurierend	1,79	Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,75
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,79	Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,75
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	1,78	Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	1,75
Klasse A SGD, thesaurierend	1,79	Klasse A EUR, thesaurierend	1,75
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,79	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,75
Klasse C USD, thesaurierend	2,29	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,75
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,29	Klasse A GBP, thesaurierend	1,75
Klasse E USD, thesaurierend	2,54	Klasse A HKD, thesaurierend	1,75
Klasse F USD, thesaurierend	1,19	Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,75
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,19	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,75
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,11	Klasse B USD, thesaurierend	2,25
Klasse X EUR, thesaurierend	1,11	Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,25
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,77	Klasse C USD, thesaurierend	2,25
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,77	Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,25
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,76	Klasse E USD, thesaurierend	2,50
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,76	Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,50
LM Klasse USD, ausschüttend (A)	0,09	Klasse E EUR thesaurierend	2,48
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,50
Klasse A USD thesaurierend	1,71	Klasse F USD, thesaurierend	1,15
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,71	Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,15
Klasse A EUR, thesaurierend	1,71	Klasse X USD thesaurierend	1,10
Klasse B USD, thesaurierend	2,21	Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,10
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,21	Klasse X EUR, thesaurierend	1,10
Klasse C USD, thesaurierend	2,21	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,10
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,21	Klasse X GBP, thesaurierend	1,10
Klasse E USD, thesaurierend	2,46	Klasse Premier USD, thesaurierend	0,75
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,46	Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,75
Klasse F USD, thesaurierend	1,11	Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,75
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,11	Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,75
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,09	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,75
Klasse X EUR, thesaurierend	1,09	Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	0,75
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,74	Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,75
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,74	Klasse LM EUR, thesaurierend	0,10
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,74	Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,40
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11	Klasse B (G) USD, thesaurierend	1,90
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,11	Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,90
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,36	Klasse GA EUR, thesaurierend	1,52
Klasse B (G) USD, thesaurierend	2,35	Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,52
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,86	Klasse GE USD, thesaurierend	2,27
Klasse GA USD, thesaurierend	1,53	Klasse GE EUR, thesaurierend	2,27
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,53	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,53	Klasse A USD thesaurierend	1,75
Klasse GE USD, thesaurierend	2,28	Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,75
Klasse GE EUR, thesaurierend	2,28	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,75
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund		Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,75
Klasse A USD thesaurierend	1,69	Klasse A USD, ausschüttend (Q)	1,75
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,69	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,75
Klasse A EUR, thesaurierend	1,69	Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,75
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,69	Klasse A EUR, thesaurierend	1,75
Klasse B USD, thesaurierend	2,19	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,75
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,19	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,75
Klasse C USD, thesaurierend	2,19	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,75
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,19	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,75
Klasse E USD, thesaurierend	2,44	Klasse C USD, thesaurierend	2,25
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,44	Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,25
Klasse F USD, thesaurierend	1,09	Klasse C USD, ausschüttend (Q)	2,25
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,09	Klasse F USD, thesaurierend	1,15
Klasse U USD, thesaurierend	0,62	Klasse F EUR, thesaurierend	1,15
Klasse U EUR, thesaurierend	0,62	Klasse F EUR, ausschüttend (A)	1,15
Klasse X USD thesaurierend	1,07	Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,13
Klasse X EUR, thesaurierend	1,06		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,07		
Klasse X GBP, thesaurierend	1,07		
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,72		
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,71		
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,71		
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,72		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,72		
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,71		
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,71		
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		

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) – (Fortsetzung)

	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021**	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021**
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,63	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,63	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,63	
Klasse A SEK, thesaurierend	1,50	
Klasse F USD, thesaurierend	1,03	
Klasse X USD thesaurierend	1,03	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,03	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,03	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,03	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,03	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,03	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,68	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,68	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,68	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,68	
Klasse S USD, thesaurierend	0,48	
Klasse S EUR, thesaurierend	0,48	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,48	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,48	
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,48	
Klasse S GBP, ausschüttend (Q)	0,48	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,08	
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 E USD, thesaurierend (abgesichert)	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	1,04	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	1,04	
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	1,04	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,84	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,83	
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	0,84	
Premier Klasse CAD, ausschüttend (Q) Plus (e)	0,84	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,84	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	0,84	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,84	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	0,84	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)	0,84	
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	2,11	
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	2,11	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,31	
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	1,31	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,97	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,97	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,97	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,96	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,96	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,97	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,97	
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,24	
Klasse X EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	1,24	
Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,88	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,85	
Klasse S USD, thesaurierend	0,53	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	0,52	
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)	1,94	
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)	1,94	
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 USD, thesaurierend	1,44	
Klasse R EUR, thesaurierend	1,44	
Klasse X USD thesaurierend	1,19	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,19	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,19	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,18	
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	0,84	
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	1,99	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	2,00	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,99	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,98	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,99	
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	2,00	
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,99	
Klasse C USD, thesaurierend	2,49	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,50	
Klasse E USD, thesaurierend	2,74	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,74	
Klasse E EUR thesaurierend	2,75	
Klasse F USD, thesaurierend	1,40	
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,40	
Klasse R USD, thesaurierend	1,50	
Klasse X USD thesaurierend	1,23	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,23	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,90	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,90	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	0,90	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,15	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,40	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,90	

[^] 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 den Berichtszeitraum zum 31. August 2021**	Verhältnis des Gesamtbetriebskosten in WE(1) bis zum Durchschnittfondsvermögen täglich in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2021**
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,82	
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	1,83	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,83	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (abgesichert) Plus	1,82	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,83	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,82	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,82	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,83	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	1,82	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,83	
Klasse B USD, thesaurierend	2,33	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,32	
Klasse C USD, thesaurierend	2,32	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,32	
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	2,56	
Klasse F USD, thesaurierend	1,23	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,18	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,82	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,82	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,21	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,55	
Klasse B (G) USD, thesaurierend	2,06	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	2,06	
Klasse GA USD, thesaurierend	1,62	
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,62	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,62	
Klasse GE USD, thesaurierend	2,37	
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,85	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,85	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,85	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,85	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,85	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,85	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,85	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,84	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,34	
Klasse C USD, thesaurierend	2,35	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,35	
Klasse E USD, thesaurierend	2,72	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,72	
Klasse F USD, thesaurierend	1,37	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,92	
Klasse GA USD, thesaurierend	1,89	
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,89	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,89	
Klasse GE USD, thesaurierend	2,64	
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,85	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,85	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,85	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,85	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,85	
Klasse X USD thesaurierend	1,18	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,82	
Klasse GA USD, thesaurierend	1,90	
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,90	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,90	
Klasse GE USD, thesaurierend	2,65	
Klasse GE EUR, thesaurierend	2,65	
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,97	
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	0,78	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,79	
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,95	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,96	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,95	
Klasse E USD, thesaurierend	2,71	
Klasse F USD, thesaurierend	1,35	
Klasse X USD thesaurierend	1,19	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,21	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,21	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,21	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,86	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,87	
Klasse S USD, thesaurierend	0,51	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,52	
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 CNH, 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	0,59	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)	0,59	
Klasse LM AUD, thesaurierend	0,15	
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	2,00	
Klasse E USD, thesaurierend	2,75	
Klasse F USD, thesaurierend	1,40	
Klasse X USD thesaurierend	1,25	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,90	
Klasse S USD, thesaurierend	0,70	
Klasse S EUR, thesaurierend	0,70	
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^]		
Klasse A EUR, thesaurierend	1,95	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,21	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,83	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,85	
Klasse S USD, thesaurierend	0,44	
Klasse S EUR, thesaurierend	0,44	

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands

Für den Zeitraum zum 31. August 2021

Gemäß den OGAW-Verordnungen wird eine Aufstellung über die wichtigsten Veränderungen in der Zusammensetzung des Anlageportfolios jedes Fonds während des Zeitraums vorgelegt, um zu gewährleisten, dass die Anteilinhaber 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 den Berichtszeitraum 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	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 20.05.2021	56.403	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 17.06.2021	61.313
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 29.07.2021	49.997	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 20.05.2021	56.404
United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 1,846 %, fällig 31.10.2021	45.041	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 26.08.2021	55.000
United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, fällig 15.08.2021	41.170	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 29.04.2021	50.000
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31.08.2021	40.127	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 29.07.2021	50.000
Federal Home Loan Banks, Series 0000, 0,055 %, fällig 20.12.2021	40.000	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 19.08.2021	42.427
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 26.08.2021	39.998	United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, fällig 15.08.2021	40.818
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 14.09.2021	39.998	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 31.03.2021	40.021
Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,050 %, fällig 09.06.2022	39.994	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31.08.2021	40.007
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 13.07.2021	37.067	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 11.03.2021	39.190
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 17.06.2021	36.313	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 13.07.2021	37.071
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 23.09.2021	29.999	Federal Home Loan Banks, 0,050 %, fällig 23.08.2021	35.000
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 02.09.2021	29.599	Federal Home Loan Banks, 0,070 %, fällig 03.03.2021	30.000
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 27.07.2021	27.578	Federal Home Loan Banks, Series 0, 0,075 %, fällig 24.06.2021	30.000
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 19.08.2021	27.426	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 27.07.2021	27.579
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 31.08.2021	26.559	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 31.08.2021	26.560
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.11.2021	25.160	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 04.03.2021	25.008
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31.05.2021	25.075	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31.05.2021	25.005
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 05.10.2021	25.050	United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, fällig 15.05.2021	25.002
Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0, 0,150 %, fällig 22.02.2022	25.014	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 31.05.2021	25.002
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 15.07.2021	25.000	Federal Home Loan Banks, 0,050 %, fällig 09.08.2021	25.000
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 12.11.2021	24.997	Federal Home Loan Banks, 0,150 %, fällig 27.04.2021	25.000
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 16.11.2021	24.996	Federal Home Loan Banks, Series 0, 0,080 %, fällig 14.06.2021	25.000
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 26.11.2021	24.996	Federal Home Loan Banks, Series 00, 0,065 %, fällig 13.04.2021	25.000
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 11.03.2021	24.190	Federal Home Loan Banks, Series 00, 0,080 %, fällig 16.07.2021	25.000
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 10.06.2021	23.789	Federal Home Loan Banks, Series 00, 0,080 %, fällig 26.05.2021	25.000
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 13.05.2021	20.862	Federal Home Loan Banks, Series 0001, 0,035 %, fällig 14.05.2021	25.000
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 22.07.2021	20.570	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 15.07.2021	25.000
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.04.2021	20.055	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 02.09.2021	24.999
Federal Home Loan Banks, 0,060 %, fällig 13.01.2022	20.000	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 16.11.2021	24.997
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 26.10.2021	19.997	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 10.06.2021	23.789
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 16.03.2021	19.625	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 13.05.2021	20.862
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 27.05.2021	19.282	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 22.07.2021	20.571
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 21.09.2021	17.297	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 12.08.2021	20.118
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 18.03.2021	16.606	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.04.2021	20.006
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.08.2021	16.449	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 16.03.2021	19.625
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 27.04.2021	15.088	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 27.05.2021	19.282
		United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 14.09.2021	18.415
		United States Treasury Note/Bond, 8,125 %, fällig 15.05.2021	18.000
		United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 18.03.2021	16.606
		United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 23.03.2021	16.566
		United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.08.2021	16.366
		United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 27.04.2021	15.088

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	57.045	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	67.428
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	14.881	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	14.958
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	9.057	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	13.349
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	8.075	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	8.083
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	7.659	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	7.985
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.04.2028	6.634	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	7.665
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	4.350	United States Treasury Bill, 0,000 %, fällig 29.04.2021	4.770
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.05.2031	4.232	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.05.2025	4.516
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.06.2028	4.106	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	4.350
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.918	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.944
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.831	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.843
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.629	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.641
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	3.459	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	3.571
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	3.251	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	3.464
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.243	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.404
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.205	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30.09.2027	3.326
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.135	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	3.239
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.025	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.222
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 15.02.2031	2.966	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.06.2028	3.188
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	2.896	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.159
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	2.828	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.04.2028	3.040
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	2.686	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.029
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	2.594	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.024
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	2.527	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 15.02.2031	2.994
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31.08.2028	2.475	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.08.2030	2.985

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.05.2026	103.704	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.05.2025	97.718
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	59.033	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	60.657
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	36.825	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	59.326
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	33.417	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	34.157
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	28.769	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	33.431
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	24.737	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	28.797
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.06.2028	22.969	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	22.681
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	22.680	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,300 %, fällig 15.10.2021	20.655
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	18.753	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	18.807
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	15.671	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	15.684
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	15.527	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	15.551
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	15.395	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	15.385
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.04.2028	14.972	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.04.2028	14.956
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31.08.2028	14.760	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	14.475
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	14.490	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	14.339
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	14.321	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 31.12.2027	13.929
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	13.638	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	13.591
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	13.591	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.11.2040	13.082
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	12.709	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	12.719
United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, fällig 31.07.2028	11.531	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 29.02.2028	11.987
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	11.177	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	11.212
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31.05.2028	11.124	United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, fällig 31.07.2028	11.210
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 1,500 %	10.858		
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500 %	10.774		
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	10.577		
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.05.2041	10.123		
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	10.003		
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	9.711		

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

	KOSTEN (in Tsd.) EUR		ERLÖSE (in Tsd.) EUR
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	5.529	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	2.205
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 2007, 4,250 %, fällig 04.07.2039	1.845	United Kingdom Gilt, 2,500 %, fällig 22.07.2065	1.190
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	1.587	Australia Government Bond, Series 162, 1,750 %, fällig 21.06.2051	1.054
Romanian Government International Bond, 2,000 %, fällig 14.04.2033	1.056	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,000 %, fällig 01.12.2025	1.027
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	659	Wells Fargo & Co, 0,080 %, fällig 26.04.2021	930
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,750 %, fällig 12.03.2029	574	Volkswagen Leasing GmbH, 0,000 %, fällig 06.07.2021	900
Indonesia Government International Bond, 1,400 %, fällig 30.10.2031	570	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,500 %, fällig 15.08.2046	800
Netflix Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2029	389	Romanian Government International Bond, 2,000 %, fällig 28.01.2032	779
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig 01.06.2028	344	Saudi Government International Bond, 2,000 %, fällig 09.07.2039	667
UBS AG/London, 0,500 %, fällig 31.03.2031	319	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, fällig 15.02.2049	600
MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, fällig 10.03.2034	317	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,200 %, fällig 24.07.2025	564
United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	196	RCI Banque SA, 0,100 %, fällig 12.04.2021	540
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.06.2033	170	Indonesia Government International Bond, 0,900 %, fällig 14.02.2027	537
CSC Holdings LLC, 4,500 %, fällig 15.11.2031	165	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA, 0,750 %, fällig 25.07.2021	520
IPD 3 BV, 5,500 %, fällig 01.12.2025	103	BNP Paribas SA, 2,875 %, fällig 20.03.2026	460
T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	90	Aviva Plc, 6,125 %, fällig 05.07.2043	427
Devon Energy Corp, 144A, 8,250 %, fällig 01.08.2023	61	LHC3 Plc, 4,125 %, fällig 15.08.2024	296
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	60	Indonesia Government International Bond, 1,450 %, fällig 18.09.2026	247
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 0,400 %, fällig 15.05.2030	47	Cooperatieve Rabobank UA, 6,625 %, Perpetual	200
T-Mobile USA Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.04.2031	33	Canadian Government Real Return Bond, Series CPI, 0,500 %, fällig 01.12.2050	184
		CSC Holdings LLC, 4,500 %, fällig 15.11.2031	168

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	793	L Brands Inc, 6,694 %, fällig 15.01.2027	493
Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, fällig 10.08.2026	632	Silversea Cruise Finance Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 01.02.2025	363
Oasis Petroleum Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.06.2026	630	Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,500 %, fällig 01.04.2028	274
American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 20.04.2026	497	MoneyGram International Inc, 5,375 %, fällig 01.08.2026	246
L Brands Inc, 6,694 %, fällig 15.01.2027	486	DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	236
Penn Virginia Escrow LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.08.2026	482	Service Properties Trust, 5,500 %, fällig 15.12.2027	224
Scientific Games International Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.03.2026	482	Burford Capital Global Finance LLC, 6,250 %, fällig 15.04.2028	221
United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	473	Natwest Group Plc, 8,625 %, Perpetual	210
Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	454	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.08.2026	208
Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, fällig 15.08.2026	433	Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, fällig 01.05.2026	207
Service Properties Trust, 4,350 %, fällig 01.10.2024	431	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 6,000 %, fällig 15.02.2025	206
Range Resources Corp, 9,250 %, fällig 01.02.2026	428	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2028	205
Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, fällig 01.04.2026	405	Ford Motor Credit Co LLC, 3,087 %, fällig 09.01.2023	204
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig 01.06.2028	400	Signature Aviation US Holdings Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.05.2026	195
Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, fällig 15.04.2026	393	GMAC Capital Trust I, Series 2 Pfd	185
RR Donnelley & Sons Co, 144A, 6,125 %, fällig 01.11.2026	386	WPX Energy Inc, 8,250 %, fällig 01.08.2023	183
EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15.05.2026	377	Carriage Services Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.06.2026	179
AdaptHealth LLC, 144A, 6,125 %, fällig 01.08.2028	373	Bausch Health Cos Inc, 7,000 %, fällig 15.03.2024	173
Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15.11.2028	370	Oasis Petroleum Inc	165
1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.01.2028	365	CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 5,250 %, fällig 01.06.2025	164
		Michaels Cos Inc./The, 5,000 %, fällig 08.04.2028	164
		Unisys Corp, 144A, 6,875 %, fällig 01.11.2027	164

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	16.382	United States Treasury Note/Bond, 0,875 %, fällig 15.11.2030	18.701
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	11.638	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	16.371
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30.11.2025	11.395	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 31.10.2023	14.872
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.05.2031	6.911	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class M	14.053
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2041	6.381	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	11.558
China Government Bond, 4,290 %, fällig 22.05.2029	6.192	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	11.021
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.04.2028	4.363	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset US High Yield Fund – LM	
United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 15.05.2024	3.953	Class US\$ Distributing (M)	10.502
China Government Bond, 3,100 %, fällig 29.06.2022	3.585	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30.11.2025	8.766
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2025	3.475	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.05.2031	6.883
Bank of America Corp, 3,311 %, fällig 22.04.2042	3.278	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2041	6.338
Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07.04.2026	3.240	Australia Government Bond, Series 162, 1,750 %, fällig 21.06.2051	6.315
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	3.238	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.11.2024	5.228
Natwest Group Plc, 4,500 %, fällig 31.03.2070	3.226	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.04.2028	4.355
Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, fällig 18.03.2031	2.550	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.11.2046	4.210
ADA Finance SA, 5,000 %, fällig 30.06.2027	2.246	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,624 %, Perpetual	4.154
Turkey Government International Bond, 5,600 %, due 14.11.2024	2.246	Indonesia Treasury Bond, Series FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	4.116
China Government Bond, 3,950 %, fällig 29.06.2043	1.737	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 15.05.2024	3.953
JPMorgan Chase & Co, 3,328 %, fällig 22.04.2052	1.641	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17.03.2024	3.879
Saga Plc, 5,500 %, fällig 15.07.2026	1.598	Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, Series 2020 DNA1, Class B1, 144A, 2,418 %, fällig 25.01.2050	3.759
Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01.04.2028	1.429	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2023	3.656
American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 20.04.2026	1.411		

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	69.648	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	70.498
DISH DBS Corp, 144A, 5,125 %, fällig 01.06.2029	2.410	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.05.2032	1.777
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	1.777	Silversea Cruise Finance Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 01.02.2025	1.452
United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	1.606	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2028	1.295
Penn Virginia Escrow LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.08.2026	1.564	United Airlines Inc, 4,500 %, fällig 14.04.2028	1.204
Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	1.563	HCX Investments Holdco LP, 4,500 %, fällig 01.08.2029	1.116
Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.06.2029	1.430	Vertical US Newco Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.07.2027	1.111
Colgate Energy Partners III LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029	1.417	Sprint Communications Inc, 11,500 %, fällig 15.11.2021	1.105
Endo Luxembourg Finance Co I Sarl / Endo US Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2029	1.402	Sprint Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2023	1.081
WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2029	1.378	Boyne USA Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.05.2025	1.040
Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.06.2029	1.340	Century Communities Inc, 5,875 %, fällig 15.07.2025	1.026
American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01.10.2029	1.310	WW International Inc, 144A, 8,625 %, fällig 01.12.2025	1.012
Sensata Technologies BV, 144A, 4,000 %, fällig 15.04.2029	1.265	Caesars Resort Collection LLC, 4,621 %, fällig 20.07.2025	1.000
Starwood Property Trust Inc, 144A, 3,625 %, fällig 15.07.2026	1.240	Genesee & Wyoming Inc, 2,254 %, fällig 30.12.2026	993
American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029	1.222	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	971
Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2029	1.211	Whatabrands LLC, 2,832 %, fällig 03.08.2026	962
Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	1.204	Ken Garff Automotive LLC, 144A, 4,875 %, fällig 15.09.2028	853
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	1.194	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2030	838
United Airlines Inc, 4,500 %, fällig 14.04.2028	1.194	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 4,375 %, fällig 01.04.2031	823
Scientific Games International Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.05.2028	1.192	GMAC Capital Trust I, Series 2	811

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US\$ Distributing (M)	2.768	Qatar Petroleum, 3,300 %, fällig 12.07.2051	1.102
Qatar Petroleum, 3,300 %, fällig 12.07.2051	1.100	Qatar Petroleum, 2,250 %, fällig 12.07.2031	1.090
Qatar Petroleum, 2,250 %, fällig 12.07.2031	1.088	Chile Government International Bond, 2,550 %, fällig 27.07.2033	602
ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27.04.2026	787	Chinalco Capital Holdings Ltd, 4,000 %, fällig 25.08.2021	460
Chile Government International Bond, 2,550 %, fällig 27.07.2033	598	Klabn Austria GmbH, 3,200 %, fällig 12.01.2031	455
Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS, 5,750 %, fällig 06.07.2026	597	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 01.04.2056	455
Sasol Financing USA LLC, 4,375 %, fällig 18.09.2026	586	GC Treasury Center Co Ltd, 2,980 %, fällig 18.03.2031	448
Bahamas Government International Bond, 5,750 %, fällig 16.01.2024	539	Thaioil Treasury Center Co Ltd, 3,500 %, fällig 17.10.2049	417
Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13.07.2031	530	Senegal Government International Bond, 5,375 %, fällig 08.06.2037	404
NBK Tier 1 Financing Ltd, 3,625 %, Perpetual	525	Cemex SAB de CV, 5,125 %, fällig 08.09.2169	403
Dominican Republic International Bond, 144A, 4,875 %, fällig 23.09.2032	522	Interchile SA, 4,500 %, fällig 30.06.2056	401
Senegal Government International Bond, 6,750 %, fällig 13.03.2048	476	Cia de Minas Buenaventura SAA, 5,500 %, fällig 23.07.2026	394
Chile Government International Bond, 3,100 %, fällig 22.01.2061	475	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 16.04.2050	394
Banco General SA, 5,250 %, Perpetual	469	Honduras Government International Bond, 6,250 %, fällig 19.01.2027	382
Sagcor Financial Co Ltd, 5,300 %, fällig 13.05.2028	468	Hutama Karya Persero PT, 3,750 %, fällig 11.05.2030	316
Ooredoo International Finance Ltd, 2,625 %, fällig 08.04.2031	462	Lukoil International Finance BV, 6,656 %, fällig 07.06.2022	316
Inversiones CMPC SA, 3,000 %, fällig 06.04.2031	458	Vietnam	
OCP SA, 5,125 %, fällig 23.06.2051	457	Government International Bond, 144A, 4,800 %, fällig 19.11.2024	289
GC Treasury Center Co Ltd, 2,980 %, fällig 18.03.2031	444	Chile Government International Bond, 3,100 %, fällig 22.01.2061	285
Russian Agricultural Bank OJSC Via RSHB Capital SA, 8,500 %, fällig 16.10.2023	441	Ooredoo International Finance Ltd, 2,625 %, fällig 08.04.2031	268
Lukoil International Finance BV, 6,656 %, fällig 07.06.2022	435	China SCE Group Holdings Ltd, 7,375 %, fällig 09.04.2024	267
		Inversiones CMPC SA, 3,000 %, fällig 06.04.2031	264
		Gran Colombia Gold Corp, 6,875 %, fällig 09.08.2026	249
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2025	237

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – (Fortsetzung)

	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE VERKÄUFE	
Qatar Government International Bond, 4,400 %, fällig 16.04.2050	235
Dominican Republic International Bond, 4,500 %, fällig 30.01.2030	229
Guatemala Government Bond, 5,375 %, fällig 24.04.2032	229
Grupo Energia Bogota SA ESP, 4,875 %, fällig 15.05.2030	222
Kenya Government International Bond, 6,300 %, fällig 23.01.2034	220
Corp Financiera de Desarrollo SA, 4,750 %, fällig 15.07.2025	218
OCP SA, 4,500 %, fällig 22.10.2025	218
Senegal Government International Bond, 6,250 %, fällig 23.05.2033	213
Petroleos del Peru SA, 5,625 %, fällig 19.06.2047	210
Dominican Republic International Bond, 144A, 4,875 %, fällig 23.09.2032	208
Investment Energy Resources Ltd, 6,250 %, fällig 26.04.2029	208
Aeropuerto Internacional De Tocumen, 5,125 %, fällig 11.08.2061	206
ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27.04.2026	206
Bahamas Government International Bond, 144A, 5,750 %, fällig 16.01.2024	206
Country Garden Holdings Co Ltd, 4,750 %, fällig 28.09.2023	205
Aeropuerto Internacional De Tocumen, 4,000 %, fällig 11.08.2041	202
AIA Group Ltd, 2,700 %, fällig 07.10.2169	201
Grupo Axo, 5,750 %, fällig 08.06.2026	201
Limak Iskenderun Uluslararası Lim, 9,500 %, fällig 10.07.2036	201
Tullow Oil Plc, 10,250 %, fällig 15.05.2026	201
Banco Nacional de Comercio Exterio, 2,720 %, fällig 11.08.2031	200
MercadoLibre Inc, 2,375 %, fällig 14.01.2026	200
Pakistan Government International Bond, 6,000 %, fällig 08.04.2026	200
Pakistan Government International Bond, 7,375 %, fällig 08.04.2031	200
Pakistan Government International Bond, 8,875 %, fällig 08.04.2051	200
Chile Government International Bond, 3,100 %, fällig 07.05.2041	199
Frontera Energy Corp, 7,875 %, fällig 21.06.2028	199
HSBC Holdings Plc, 4,600 %, Perpetual	199
Coastal Emerald Ltd, 3,950 %, fällig 01.08.2022	198
Frigorifico Concepcion, 7,7000 %, fällig 21.07.2028	197
Banco Nacional de Panama, 2,500 %, fällig 11.08.2030	192
Paraguay Government International Bond, 2,739 %, fällig 29.01.2033	192
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6230, 7,700 %, fällig 16.03.2039	191
Mexican Bonos, Series M, 5,750 %, fällig 05.03.2026	189
Shimao Group Holdings Ltd, 3,450 %, fällig 11.01.2031	187

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Senegal Government International Bond, 5,375 % fällig 08.06.2037	794	Senegal Government International Bond, 5,375 %, fällig 08.06.2061	795
Cia de Minas Buenaventura SAA, 5,500 %, fällig 23.07.2026	694	Cia de Minas Buenaventura SAA, 5,500 %, fällig 07/23/26	693
Keny Government Intrnational Bond, 6,300 %, fällig 23.01.2034	670	Kenya Government International Bond, 6,300 %, fällig 23.01.2034	671
Ukraine Government International Bond, 6,876 % fällig 21.05.2029	620	Ukraine Government International Bond, 6,876 %, fällig 21.05.2029	621
Sagicor Financial Co Ltd, 5,300 %, fällig 13.05.2028	606	Investment Energy Resources Ltd, 6,250 %, fällig 26.04.2029	615
Banco GNB Sudameris SA VAR, 7,500 %, fällig 16.04.2031	600	Cemex SAB de CV VAR, 5,125 %, fällig 08.09.2069	605
Cemex SAB de CV VAR, 5,125 %, fällig 08.09.2069	600	Banco GNB Sudameris SA VAR, 7,500 %, fällig 16.04.2031	602
Investment Energy Resources Ltd, 6,25 %, fällig 26.04.2029	600	Chile Government International Bond, 3,100 %, fällig 22.01.2061	571
ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27.04.2026	590	Frontera Energy Corp, 7,875 %, fällig 06.21.2028	539
Chile Government International Bond, 3,100 %, fällig 22.01.2061	570	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17.03.2024	446
Frontera Energy Corp, 7,875 %, fällig 21.06.2028	536	Country Garden Holdings Co Ltd, 4,750 %, fällig 28.09.2023	410
Türkiye İhracat Kredi Bankası AS, 5,750 %, fällig 06.07.2026	527	BOC Aviation Ltd, 2,750 %, fällig 18.09.2022	407
OCP SA, 5,125 %, fällig 23.06.2051	511	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV, 2,431 %, fällig 01.07.2031	401
Eskom Holdings SOC Ltd, 6,350 %, fällig 10.08.2028	449	Qatar Petroleum, 3,300 %, fällig 12.07.2051	401
Country Garden Holdings Co Ltd, 5,400 %, fällig 27.05.2025	430	Qatar Petroleum, 2,250 %, fällig 12.07.2031	396
First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 15.10.2027	430	Lukoil International Finance BV, 6,656 %, fällig 07.06.2022	391
Banco General SA, 5,250 %, Perpetual VAR	400	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 16.04.2050	338
Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13.07.2031	400	Hutchison Whampoa International 14 Ltd, 3,625 %, fällig 31.10.2024	337
Qatar Petroleum, 3,300 %, fällig 15.07.2051	400	Tullow Oil PLC, 10,250 %, fällig 15.05.2026	309
Inversiones CMPC SA, 3,000 %, fällig 06.04.2031	398	Interchile SA, 4,500 %, fällig 30.06.2056	300
Qatar Petroleum, 2,250 %, fällig 12.07.2031	396	BRF SA, 4,875 %, fällig 24.01.2030	290
Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6,000 %, fällig 25.10.2023	365	OCP SA, 5,625 %, fällig 25.04.2024	277
Sasol Financing USA LLC, 4,375 %, fällig 18.09.2026	350	Petroleos del Peru SA, Series FEB, 5,625 %, fällig 19.06.2047	252
Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 16.04.2050	337	Prosus NV, 5,500 %, fällig 21.07.2025	232
Huarong Finance 2019 Co Ltd, 2,125 %, fällig 30.09.2023	310	Prosus NV, 4,850 %, fällig 06.07.2027	232
Interchile S.A., 4,500 %, fällig 30.06.2056	300	Petroleos del Peru SA, 5,625 %, fällig 19.06.2047	231
Mizrahi Tefahot Bank Ltd, 144A, 3,077 %, fällig 07.04.2031	300	Thaioil Treasury Center Co Ltd, 4,625 %, fällig 20.11.2028	227
Tullow Oil PLC, 10,250 %, fällig 15.05.2026	300	Gran Colombia Gold Corp, 6,875 %, fällig 09.08.2026	219
Comision Federal de Electricidad, 3,875 %, fällig 26.07.2033	280	OCP SA, 4,500 %, fällig 22.10.2025	218
Petroleos del Peru SA, 5,625 %, fällig 19.06.2047	252	Alibaba Group Holding Ltd, 3,600 %, fällig 28.11.2024	217
Sands China Ltd, 5,400 %, fällig 08.08.2028	231	CBQ Finance Ltd, 5,000 %, fällig 24.05.2023	215
		Banco de Credito del Peru VAR, 3,25 %, fällig 30.09.2031	214
		Inversiones CMPC SA, 3,850 %, fällig 13.01.2030	214
		Senegal Government International Bond, 6,250 %, fällig 23.05.2033	213
		Lukoil International Finance BV, 4,563 %, fällig 24.04.2023	212
		Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 3,625 %, fällig 12.01.2023	210
		Kia Motors Corp, 3,000 %, fällig 25.04.2023	208
		Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 5,650 %, fällig 19.03.2022	207

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – (Fortsetzung)

	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE VERKÄUFE	
Aeroporto Internacional De Tocumen, 5,125 %, fällig 11.08.2061	206
VTR Comunicaciones SpA, 5,125 %, fällig 15.01.2028	206
DAE Funding LLC, 5,000 %, fällig 01.08.2024	205
Fomento Economico Mexicano SAB de CV, 3,500 %, fällig 16.01.2050	205
Qatar Petroleum, 3,125 %, fällig 12.07.2041	205
ABQ Finance Ltd, 3,500 %, fällig 22.02.2022	204
China Aoyuan Group Ltd, 7,950 %, fällig 07.09.2021	204
GS Caltex Corp, 3,000 %, fällig 12.06.2022	204
NBK SPC Ltd, 2,750 %, fällig 30.05.2022	204
Sagicor Financial Co Ltd, 5,300 %, fällig 13.05.2028	203
Aeroporto Internacional De Tocumen, 4,00 %, fällig 08.11.2041	202
Grupo Axo SAPI de CV, 5,750 %, fällig 08.06.2026	201
Limak Iskenderun Uluslararası Liman İşletmeciliği AS, 9,500 %, fällig 10.07.2036	201
Banco Nacional de Comercio Exterior VAR, 2,720 %, fällig 11/08/31	200
Chile Government International Bond, 2,550 %, fällig 27.07.2033	200
Pakistan Government International Bond, 6,000 %, fällig 08.04.2026	200
Pakistan Government International Bond, 7,375 %, fällig 08.04.2031	200
Pakistan Government International Bond, 8,875 %, fällig 04.08.2051	200
Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 7,900 %, fällig 11.05.2021	200
Chile Government International Bond, 3,100 %, fällig 07.05.2041	199
GC Treasury Center Co Ltd 2,980 %, fällig 18.03.2031	199
Klabn Austria GmbH, 3,200 %, fällig 12.01.2031	198
Frigerifico Concepcion SA, 7,700 %, fällig 21.07.2028	197
Volcan Cia Minera SAA, 4,375 %, fällig 11.02.2026	197
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd, 3,100 %, fällig 02.02.2031	192

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	2.802	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.05.2032	2.802
United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	2.483	Saga Plc, 3,375 %, fällig 12.05.2024	1.706
Saga Plc, 5,500 %, fällig 15.07.2026	2.125	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US\$ Distributing (M)	1.500
Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US\$ Distributing (M)	1.489	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	1.248
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31.01.2026	1.478	United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 28.02.2026	1.235
Mexico Government International Bond, 2,659 %, fällig 24.05.2031	1.450	Delta Air Lines Inc, 5,750 %, fällig 29.04.2023	1.194
Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01.02.2029	1.314	United Airlines Holdings Inc, 4,250 %, fällig 01.10.2022	1.040
Saga Plc, 3,375 %, fällig 12.05.2024	1.301	Petrobras Global Finance BV, 7,375 %, fällig 17.01.2027	1.029
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	1.247	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,200 %, fällig 21.07.2021	1.000
United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 28.02.2026	1.234	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	910
DIRECTV Financing LLC, 5,750 %, fällig 22.07.2027	1.148	Legg Mason Global Funds Plc – Western Asset Euro High Yield Fund – LM Class Euro (Accumulating)	893
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,200 %, fällig 21.07.2021	1.000	Indonesia Government International Bond, 1,850 %, fällig 12.03.2031	762
Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, fällig 17.06.2031	962	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31.01.2026	738
MGM China Holdings Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2027	880	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.01.2028	736
Peruvian Government International Bond, 1,862 %, fällig 01.12.2032	856	Natwest Group Plc, 8,625 %, Perpetual	676
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	798	Paraguay Government International Bond, 144A, 5,000 %, fällig 15.04.2026	667
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig 01.06.2028	791	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.05.2030	654
Petroleos del Peru SA, 144A, 4,750 %, fällig 19.06.2032	773	Ford Motor Credit Co LLC, 3,375 %, fällig 13.11.2025	652
Dominican Republic International Bond, 144A, 4,500 %, fällig 30.01.2030	762	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 31.08.2022	616
United Airlines Inc, 4,500 %, fällig 14.04.2028	752	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.08.2030	588
Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	731		
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc., 3,686 %, fällig 21.08.2026	730		
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.01.2028	729		
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	706		
WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2029	558		
Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6,000 %, fällig 25.10.2023	550		

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	7.541	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	5.421
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15.07.2021	2.538	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15.07.2021	2.497
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15.07.2022	2.428	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15.07.2025	2.444
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Series I/L, 0,100 %, fällig 15.04.2023	2.047	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15.01.2030	1.379
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15.01.2022	1.454	Spain Government Inflation Linked Bond, 144A, 0,700 %, fällig 30.11.2033	1.173
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	1.012	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,750 %, fällig 15.02.2045	1.056
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,850 %, fällig 25.07.2027	383	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	563
Romanian Government International Bond, 2,000 %, fällig 14.04.2033	249	United Kingdom Gilt, 2,500 %, fällig 22.07.2065	479
MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, fällig 10.03.2034	237	Australia Government Bond, Series 162, 1,750 %, fällig 21.06.2051	434
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15.01.2027	195	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Series I/L, 0,100 %, fällig 15.04.2046	411
Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	120	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,250 %, fällig 15.08.2048	369
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 3,875 %, fällig 15.04.2029	119	United Kingdom Gilt Inflation Linked, Series 3MO, 0,125 %, fällig 22.03.2068	347
Indonesia Treasury Bond, Series FR79, 8,375 %, fällig 15.04.2039	118	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,500 %, fällig 15.08.2046	166
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15.01.2030	97	Canadian Government Real Return Bond, Series CPI, 0,500 %, fällig 01.12.2050	80
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15.07.2025	93	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 22, 0,100 %, fällig 10.03.2027	10
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15.01.2026	78	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 23, 0,100 %, fällig 10.03.2028	4
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500 %, fällig 15.01.2028	61		
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 3,100 %, fällig 15.09.2026	55		
Spain Government Inflation Linked Bond, 144A, 0,700 %, fällig 30.11.2033	37		
Japanese Government CPI Linked Bond, Series 22, 0,100 %, fällig 10.03.2027	28		

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	55.529	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	72.470
China Development Bank, Series 2103, 3,300 %, fällig 03.03.2026	12.168	Singapore Government Bond, 1,875 %, fällig 01.03.2050	11.614
Temasek Financial I Ltd, 2,800 %, fällig 17.08.2071	9.197	Korea Development Bank/The, 4,650 %, fällig 12.03.2021	10.617
China Government Bond, Series INBK, 1,990 %, fällig 09.04.2025	7.589	QNB Finance Ltd, 5,100 %, fällig 14.05.2021	5.435
Bank Mandiri Persero Tbk PT, 2,000 %, fällig 19.04.2026	2.968	Legg Mason Western Asset Asian Bond Trust – Class A (SGD) Accumulating	4.808
Country Garden Holdings Co Ltd, 3,125 %, fällig 22.10.2025	2.105	Bank of East Asia Ltd/The, 4,000 %, fällig 03.11.2026	3.717
Keppel REIT, 3,150 %, fällig 11.03.2070	1.274	Guotai Junan International Holdings Ltd, 2,900 %, fällig 12.05.2021	3.606
FLCT Treasury Pte Ltd, 2,180 %, fällig 26.07.2028	923	Shimao Group Holdings Ltd, 5,750 %, fällig 15.03.2021	3.539
		AIMS APAC REIT, 5,650 %, Perpetual	3.469
		Philippine Government International Bond, 5,000 %, fällig 23.03.2021	3.072
		Bank Mandiri Persero Tbk PT, 2,000 %, fällig 19.04.2026	3.020
		Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 7,900 %, fällig 11.05.2021	3.000
		Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd, 5,350 %, fällig 11.03.2024	2.312
		Singapore Airlines Ltd, 3,030 %, fällig 28.03.2024	1.922
		Singapore Airlines Ltd, 3,035 %, fällig 11.04.2025	1.913
		Country Garden Holdings Co Ltd, 5,800 %, fällig 12.03.2021	1.693
		China Development Bank, Series 1803, 4,620 %, fällig 09.03.2021	1.534
		Industrial Bank of Korea, 3,900 %, Perpetual	1.331
		Surbana Jurong Pte Ltd, 2,480 %, fällig 10.02.2031	1.310
		Keppel REIT, 3,150 %, fällig 11.03.2070	1.261

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	89.597	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	88.642
Charles Schwab Corp/The, 1,950 %, fällig 01.12.2031	7.487	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 31.03.2022	12.246
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.03.2026	5.312	Intel Corp, 3,400 %, fällig 25.03.2025	4.244
Credit Suisse AG/London, 1,125 %, fällig 15.12.2025	4.969	TJX Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15.04.2025	2.200
Vonovia SE, 0,750 %, fällig 01.09.2032	2.923	Honeywell International Inc, 2,500 %, fällig 01.11.2026	2.196
Swedbank AB, 0,300 %, fällig 20.05.2027	2.712	Richemont International Holding SA, 0,750 %, fällig 26.05.2028	1.877
Vonovia SE, 0,375 %, fällig 16.06.2027	2.678	Waste Management Inc, 3,500 %, fällig 15.05.2024	1.797
Nidec Corp, 0,046 %, fällig 30.03.2026	2.115	Honeywell International Inc, 0,000 %, fällig 10.03.2024	1.507
Banco Santander SA, 0,625 %, fällig 24.06.2029	2.017	Aviva Plc, 1,875 %, fällig 13.11.2027	1.084
London Stock Exchange Group Plc, 1,625 %, fällig 06.04.2030	1.706	Wells Fargo & Co, 3,069 %, fällig 24.01.2023	718
Standard Chartered Plc, 1,44A, 1,214 %, fällig 23.03.2025	580	Santander UK Plc, 1,625 %, fällig 10.05.2021	565
		Bank of Montreal, Series D, 3,100 %, fällig 13.04.2021	500
		Euronext NV, 1,000 %, fällig 18.04.2025	500
		Thales SA, 0,875 %, fällig 19.04.2024	488
		Richemont International Holding SA, 1,000 %, fällig 26.03.2026	475
		UBS Group AG, 3,000 %, fällig 15.04.2021	400
		Leeds Building Society, 2,625 %, fällig 01.04.2021	330
		Close Brothers Finance Plc, 3,875 %, fällig 27.06.2021	250
		Coöperatieve Rabobank UA/NY, 3,125 %, fällig 26.04.2021	250
		Oracle Corp, 2,500 %, fällig 15.10.2022	226

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.08.2025	10.693	Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	7.753
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	7.626	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30.04.2025	7.712
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	7.294	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	7.628
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.11.2047	7.112	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	6.533
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	6.478	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.08.2025	6.397
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 31.07.2021	5.973	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 30.06.2025	6.176
United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 30.06.2025	5.934	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 31.07.2021	5.945
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	5.071	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.08.2024	4.921
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	4.591	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 30.11.2024	4.674
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30.04.2025	3.655	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.08.2022	4.016
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.023	Australia Government Bond, Series 162, 1,750 %, fällig 21.06.2051	3.788
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	2.895	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.031
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	2.485	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2022	2.987
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	2.476	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	2.913
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	2.275	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	2.892
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	2.208	Orbia Advance Corp SAB de CV, 4,875 %, fällig 19.09.2022	2.819
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.05.2026	1.958	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	2.586
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	1.879	United Kingdom Gilt, 2,500 %, fällig 22.07.2065	2.500
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 %	1.771	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	2.487
Fannie Mae Pool 'FM7740', 2,500 %, fällig 01.06.2051	1.660	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	2.463
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	1.443	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	2.300
Romanian Government International Bond, 2,000 %, fällig 14.04.2033	1.389	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	2.276
Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	1.335	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual	2.110
		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	1.876
		United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	1.857

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund[^]

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	12.038	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	10.753
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2030	957	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.02.2028	877
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2027	735	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2027	722
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.02.2028	671	Microsoft Corp, 3,700 %, fällig 08.08.2046	508
FedEx Corp, 0,950 %, fällig 04.05.2033	539	Technip Energies NV, 1,125 %, fällig 28.05.2028	460
Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	508	Mercialys SA, 4,625 %, fällig 07.07.2027	430
EDP – Energias de Portugal SA, 1,875 %, fällig 02.08.2081	478	Engie SA, 2,875 %, fällig 10.10.2022	414
Neste Oyj, 0,750 %, fällig 25.03.2028	472	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21.04.2023	412
Telefonica Europe BV, 2,376 %, Perpetual	471	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10.01.2039	410
Technip Energies NV, 1,125 %, fällig 28.05.2028	462	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual	410
Marks & Spencer Plc, 3,750 %, fällig 19.05.2026	429	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 1,750 %, fällig 14.06.2022	402
Netflix Inc, 3,625 %, fällig 15.06.2030	423	HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.06.2026	393
Natwest Group Plc, 4,500 %, Perpetual	403	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30.09.2027	388
HCA Inc, 3,500 %, fällig 01.09.2030	398	Vale SA, 3,750 %, fällig 10.01.2023	379
Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, fällig 17.06.2031	380	Cooperatieve Rabobank UA, 2,500 %, fällig 26.05.2026	378
Air France-KLM, 3,785 %, fällig 01.07.2026	356	CRH America Finance Inc, 4,500 %, fällig 04.04.2048	361
UCB SA, 1,000 %, fällig 30.03.2028	355	Petrobras Global Finance BV, 6,900 %, fällig 19.03.2049	356
Valeo, 1,000 %, fällig 03.08.2028	354	Air France-KLM, 3,785 %, fällig 01.07.2026	353
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	321	Braskem Finance Ltd, 6,450 %, fällig 03.02.2024	353
CTP NV, 1,250 %, fällig 21.06.2029	313	DNB Bank ASA, 6,500 %, Perpetual	333
		Digital Dutch Finco BV, 1,000 %, fällig 15.01.2032	314
		EDP Finance BV, 144A, 1,710 %, fällig 24.01.2028	302
		Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2030	297
		Smurfit Kappa Treasury ULC, 1,500 %, fällig 15.09.2027	293
		UniCredit SpA, 1,250 %, fällig 25.06.2025	287
		Vonovia Finance BV, 2,250 %, fällig 07.04.2030	272

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund

	KOSTEN (in Tsd.) €		ERLÖSE (in Tsd.) €
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
ZF Finance GmbH, 2,000 %, fällig 06.05.2027	1.000	3AB Optique Developpement SAS, 4,000 %, fällig 01.10.2023	949
Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07.04.2026	828	Pinnacle Bidco Plc, 6,375 %, fällig 15.02.2025	819
Saga Plc, 5,500 %, fällig 15.07.2026	791	Saga Plc, 3,375 %, fällig 12.05.2024	785
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 4,875 %, fällig 01.06.2028	579	ZF Finance GmbH, 3,000 %, fällig 21.09.2025	742
PCF GmbH, 4,750 %, fällig 15.04.2026	566	Miller Homes Group Holdings Plc, 5,500 %, fällig 15.10.2024	694
Douglas GmbH, 6,000 %, fällig 08.04.2026	560	Smurfit Kappa Treasury ULC, 1,500 %, fällig 15.09.2027	548
ARD Finance SA, 5,000 %, fällig 30.06.2027	543	IHO Verwaltungs GmbH, 3,750 %, fällig 15.09.2026	541
Nexi SpA, 1,625 %, fällig 30.04.2026	540	Parts Europe SA, 6,500 %, fällig 16.07.2025	527
Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, fällig 15.07.2026	506	Schoeller Packaging BV, 6,375 %, fällig 01.11.2024	520
Picard Groupe SAS, 3,875 %, fällig 01.07.2026	500	doValue SpA, 5,000 %, fällig 04.08.2025	495
Renault SA, 2,500 %, fällig 01.04.2028	500	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4,375 %, fällig 15.01.2028	494
Ideal Standard International SA, 6,375 %, fällig 30.07.2026	495	Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250 %, fällig 15.05.2029	494
Vmed O2 UK Financing I Plc, 4,500 %, fällig 15.07.2031	467	Kapla Holding SAS, 3,375 %, fällig 15.12.2026	453
CT Investment GmbH, 5,500 %, fällig 15.04.2026	410	Novafives SAS, 5,000 %, fällig 15.06.2025	376
Marcolin SpA, 6,125 %, fällig 15.11.2026	400	Repsol International Finance BV, 4,500 %, fällig 25.03.2075	376
Grupo Antolin-Irausa SA, 3,500 %, fällig 30.04.2028	350	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,624 %, Perpetual	350
Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01.04.2028	339	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	330
Altice Financing SA, 4,250 %, fällig 15.08.2029	331	Altice Financing SA, 3,000 %, fällig 15.01.2028	325
Altice Financing SA, 3,000 %, fällig 15.01.2028	326	Belden Inc, 4,125 %, fällig 15.10.2026	318
Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 3,000 %, fällig 15.06.2029	300	KME SE, 6,750 %, fällig 01.02.2023	294
Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA, 5,250 %, fällig 01.04.2026	290	Faurecia SE, 2,375 %, fällig 15.06.2029	284
Faurecia SE, 2,375 %, fällig 15.06.2029	282	INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750 %, fällig 15.07.2026	279
Casino Guichard Perrachon SA, 3,992 %, Perpetual	272	Nexi SpA, 1,625 %, fällig 30.04.2026	269
Neinor Homes SA, 4,500 %, fällig 15.10.2026	272	Codere Finance 2 Luxembourg SA, 10,750 %, fällig 01.11.2023	267
Transcom Holding AB, 0,000 %, fällig 15.12.2026	239	Tendram	251
Premier Foods Finance Plc, 3,500 %, fällig 15.10.2026	232	Brands SAU, 5,250 %, fällig 15.09.2024	242
TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig 15.05.2026	214	Transcom Holding AB, 0,000 %, fällig 15.12.2026	239
Air France-KLM, 3,875 %, fällig 01.07.2026	199	Mercialys SA, 4,625 %, fällig 07.07.2027	237
Heimstaden AB, 4,250 %, fällig 09.03.2026	198	SPCM SA, 2,625 %, fällig 01.02.2029	201
Hestia Holding, 4,000 %, fällig 01.06.2027	194	Banjay Entertainment SASU, 3,500 %, fällig 01.03.2025	198
Nobel Bidco BV, 3,125 %, fällig 15.06.2028	190	Air France-KLM, 3,875 %, fällig 01.07.2026	194
International Design Group SPA, 4,250 %, fällig 15.05.2026	180	Hestia Holding, 4,000 %, fällig 30.06.2027	158
Energizer Gamma Acquisition BV, 3,500 %, fällig 30.06.2029	170	Ortho Clinical Diagnostics S.A., 3,500 %, fällig 17.01.2027	151
TI Automotive Finance Plc, 3,750 %, fällig 15.04.2029	150	ELM BV for Firmenich International SA, 3,750 %, Perpetual	145
		Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, fällig 13.07.2044	151
		Verisure Holding AB, 2,750 %, fällig 21.10.2022	140

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	1.941.893	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	2.009.702
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.05.2031	195.888	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.05.2031	196.530
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	157.171	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	166.685
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	124.846	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	160.999
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.06.2028	119.700	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.06.2028	120.775
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.04.2028	112.678	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 30.04.2028	113.825
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31.08.2028	104.609	China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050	106.369
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.05.2045	97.072	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual	106.289
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31.05.2028	95.117	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	102.777

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, fällig 31.07.2028	90.116	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 29.02.2028	97.009
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.05.2041	76.548	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31.05.2028	95.372
Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	65.390	United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, fällig 31.07.2028	90.363
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2041	37.706	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6230, 7,700 %, fällig 16.03.2039	77.252
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	25.896	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.05.2041	64.730
Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	25.138	Natwest Group Plc, 5,125 %, fällig 28.05.2024	64.202
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.03.2026	24.339	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31.08.2028	62.080
Bausch Health Cos Inc, 144A, 4,875 %, fällig 01.06.2028	19.814	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2023	58.318
India Government Bond, 5,790 %, fällig 11.05.2030	19.803	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,850 %, fällig 01.09.2049	50.867
Credit Agricole SA, 7,500 %, Perpetual	18.729	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2041	49.387
Energy Transfer LP, 5,300 %, fällig 15.04.2047	18.213	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.05.2045	48.838
		Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig 31.07.2023	17.478	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 15.02.2031	9.822
Natwest Group Plc, 4,500 %, Perpetual	4.283	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 4,750 %, fällig 23.08.2022	7.110
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 01.03.2026	3.761	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10.01.2039	5.940
Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.06.2029	3.470	CWGS Group, LLC, 3,500 %, fällig 08.11.2023	5.683
United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15.01.2030	3.464	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	5.519
Carnival Corp, 144A, 9,875 %, fällig 01.08.2027	3.454	Occidental Petroleum Corp, 7,150 %, fällig 15.05.2028	5.106
Endo Luxembourg Finance Co I Sarl / Endo US Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2029	3.404	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, fällig 26.06.2024	4.365
Carnival Plc, 7,875 %, fällig 01.06.2027	3.353	CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	3.838
Viper Energy Partners LP, 144A, 5,375 %, fällig 01.11.2027	3.266	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Series 2019 BOLT, Class C, 144A, 3,912 %, fällig 15.07.2034	3.639
Michaels Cos Inc/The, 5,000 %, fällig 08.04.2028	3.188	Hertz Vehicle Financing II LP, Series 2016 2A, Class D, 144A, 5,970 %, fällig 25.03.2022	3.500
One Call Corp, 6,250 %, fällig 07.04.2027	3.156	Newell Brands Inc, 4,700 %, fällig 01.04.2026	3.424
DISH DBS Corp, 144A, 5,125 %, fällig 01.06.2029	3.115	Comstock Resources Inc, 9,750 %, fällig 15.08.2026	3.418
Sensata Technologies BV, 144A, 4,000 %, fällig 15.04.2029	3.020	Blackstone Mortgage Trust Inc, 4,375 %, fällig 05.05.2022	3.388
Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	3.008	AbbVie Inc, 4,050 %, fällig 21.11.2039	3.364
Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 5,375 %, fällig 15.10.2023	2.991	DAE Funding LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.11.2023	3.343
StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029	2.971	HCA Inc, 5,500 %, fällig 15.06.2047	3.292
Liberty Interactive LLC, 8,500 %, fällig 15.07.2029	2.938	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	3.145
Colgate Energy Partners III LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029	2.927	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 01.03.2024	3.109
Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, fällig 15.04.2027	2.893	Michaels Stores Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.07.2027	2.830
Alterra Mountain Co, 2,842 %, fällig 30.07.2028	2.892	Prosus NV, 144A, 4,850 %, fällig 06.07.2027	2.821

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	267.353	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	288.823
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	104.496	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	60.081
NRZ Excess Spread-Collateralized Notes, Series 2021 FHT1, Class A, 144A, 3,104 %, fällig 25.07.2026	10.190	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Series 2019 BOLT, Class D, 144A, 6,662 %, fällig 15.07.2034	11.441
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2020 1A, Class D, 144A, 3,340 %, fällig 20.08.2026	8.500	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Series 2019 BOLT, Class C, 144A, 3,912 %, fällig 15.07.2034	5.535
National Collegiate Student Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class B, 0,584 %, fällig 27.07.2037	8.489	PMT Credit Risk Transfer Trust 2019-3R, Series 2019 3R, Class A, 144A, 2,788 %, fällig 27.10.2022	3.976
PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Series 2021 1R, Class A, 144A, 2,996 %, fällig 27.02.2024	8.210	Redwood Funding Trust 2019-1, Series 2019 1, Class PT, 144A, 4,213 %, fällig 27.09.2024	2.995
Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Series 2021 MN2, Class M2, 144A, 3,400 %, fällig 25.07.2041	6.840	BX Trust 2021-VIEW, Series 2021 VIEW, Class D, 3,050 %, fällig 15.06.2023	2.250
ZH Trust 2021-1, Series 2021 1, Class B, 144A, 3,262 %, fällig 18.02.2027	6.540	PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Series 2021 1R, Class A, 144A, 2,996 %, fällig 27.02.2024	2.026
Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-2, Series 2018 2, Class BX, 0,279 %, fällig 25.11.2057	5.932	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-NNN MZ, Series 2020 NNNZ, Class M, 144A, 8,542 %, fällig 16.01.2037	1.215
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Series 2021 DNA5, Class B2, 144A, 5,550 %, fällig 25.01.2034	5.530	National Collegiate Student Loan Trust 2006-4, Series 2006 4, Class A4, 0,394 %, fällig 25.05.2032	1.163
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SPI2, Class B, 144A, 3,811 %, fällig 25.05.2048	5.502	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SPI3, Class B, 144A, 4,147 %, fällig 25.08.2048	1.145
Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Class E, 144A, 3,426 %, fällig 11.11.2034	3.972	BX Trust 2021-VIEW, Series 2021, Class E, 3,750 %, fällig 15.06.2023	870
UBS Commercial Mortgage Trust 2018-NYCH, Series 2018 NYCH, Class F, 144A, 3,917 %, fällig 15.02.2032	3.904	Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Series 2015 R4, Class 4A2, 144A, 4,500 %, fällig 27.01.2030	839
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C07, Class 1B1, 4,084 %, fällig 25.05.2030	3.294	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust Series 2005-19XS, Series 19XS, Class 1A2B, 0,444 %, fällig 25.10.2035	2005
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Series 2021 4GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig 20.07.2048	2.726	HERO Funding Trust 2016-1, Series 2016 1A, Class R, 144A, 0,000 %, fällig 20.09.2041	735
Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Series 2021 2GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig 20.03.2048	2.285	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-8, Series 2005 8, Class 2A2, 1,598 %, fällig 19.09.2035	690
BX Trust 2021-VIEW, Series 2021 VIEW, Class D, 144A, 2,996 %, fällig 15.06.2023	2.250	DSL A Mortgage Loan Trust 2005-AR3, Series 2005 AR3, Class 2A1B, 0,567 %, fällig 19.07.2045	548
BX Trust 2021-VIEW, Series 2021 VIEW, Class D, 3,050 %, fällig 15.06.2023	2.250	SLM Student Loan Trust 2004-10, Series 2004 10, Class B, 0,495 %, fällig 25.01.2040	544
BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA, Series 2018 BIOA, Class D, 144A, 1,417 %, fällig 15.03.2037	2.222	NRZ Excess Spread-Collateralized Notes, Series 2021 FHT1, Class A, 144A, 3,104 %, fällig 25.07.2026	429
CHT 2017-COSMO Mortgage Trust, Series 2017 COSMO, Class E, 144A, 3,096 %, fällig 15.11.2036	2.215	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series 2006-C5, Series 2006 C5, Class A1, 5,373 %, fällig 15.12.2039	414

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	201.186	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	202.906
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	198.404	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	147.310
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	147.302	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	116.194
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	115.465	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	94.791
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 02.09.2021	99.995	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	87.478
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	87.328	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	81.702
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	81.142	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 15.07.2021	80.000
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 15.07.2021	80.000	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 22.07.2021	80.000
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 22.07.2021	80.000	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 12.08.2021	80.000
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 12.08.2021	79.998	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	79.171
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	79.085	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	73.962
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	75.573	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	68.180
United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 05.10.2021	69.996	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	64.655
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	67.497	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	55.202
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	64.607	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	51.650
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	55.502	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	46.485
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500 %	49.254	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	40.447
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	46.595	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	37.275
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	40.173	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 %	35.961
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	37.262	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	34.130
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000 %	36.439	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	32.772
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 %	35.958	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 %	31.668
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	34.175	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	30.207
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	32.700	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	29.158
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	30.345	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	27.373
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	29.096	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	26.988
		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	26.398
		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	26.388
		United States Cash Management Bill, zero coupon, fällig 18.05.2021	25.930

Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

	KOSTEN (in Tsd.) GBP		ERLÖSE (in Tsd.) GBP
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Vattenfall AB, 2,500 %, fällig 29.06.2083	570	European Investment Bank, 5,375 %, fällig 07.06.2021	772
Swedbank AB, 1,375 %, fällig 08.12.2027	550	BP Capital Markets Plc, 2,030 %, fällig 14.02.2025	662
Natwest Group Plc, 2,105 %, fällig 28.11.2031	460	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/London, 1,500 %, fällig 31.07.2022	474
Paragon Treasury Plc, 2,000 %, fällig 07.05.2036	389	Telereal Secured Finance Plc, 4,010 %, fällig 10.12.2031	369
Bank of America Corp, 1,667 %, fällig 02.06.2029	330	Bunzl Finance Plc, 2,250 %, fällig 11.06.2025	273
Close Brothers Group Plc, 2,000 %, fällig 11.09.2031	318	Credit Agricole SA, 7,500 %, Perpetual	245
JPMorgan Chase & Co, 1,895 %, fällig 28.04.2033	300	United Kingdom Gilt, 4,750 %, fällig 07.12.2030	233
BNP Paribas SA, 2,000 %, fällig 24.05.2031	299	Orange SA, 5,750 %, Perpetual	230
Coventry Building Society, 2,000 %, fällig 20.12.2030	298	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10.01.2039	226
London Stock Exchange Group Plc, 1,625 %, fällig 06.04.2030	277	United Kingdom Gilt, 4,500 %, fällig 07.12.2042	208
Assura Financing Plc, 1,625 %, fällig 30.06.2033	266	Berkeley Group Plc/The, 2,500 %, fällig 11.08.2031	152
United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig 22.07.2027	261	ING Bank NV, 5,375 %, fällig 15.04.2021	100
Credit Agricole SA, 7,500 %, Perpetual	245	United Kingdom Gilt, 0,875 %, fällig 22.10.2029	91
United Kingdom Gilt, 0,625 %, fällig 07.06.2025	203	Aviva Plc, 6,125 %, Perpetual	76
Anglian Water Osprey Financing Plc, 2,000 %, fällig 31.07.2028	159	Aspire Defence Finance Plc, Series A, 4,674 %, fällig 31.03.2040	7
Berkeley Group Plc/The, 2,500 %, fällig 11.08.2031	149	Mitchells & Butlers Finance Plc, Series B1, 5,965 %, fällig 15.12.2023	6
Backward 2017 Ltd, 2,125 %, fällig 25.03.2053	137	Dignity Finance Plc, Series A, 3,546 %, fällig 31.12.2034	4
Gatwick Funding Ltd, 2,500 %, fällig 15.04.2030	99	Greene King Finance Plc, Series A2, 5,318 %, fällig 15.09.2031	4
		Tesco Property Finance 3 Plc, 5,744 %, fällig 13.04.2040	4
		Mitchells & Butlers Finance Plc, Series B2, 6,013 %, fällig 15.12.2028	2

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	32.016	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	37.929
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.05.2031	4.351	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.05.2031	4.381
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 15.02.2031	2.543	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 15.02.2031	2.538
Verizon Communications Inc, 3,700 %, fällig 22.03.2061	1.729	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10.01.2039	2.206
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	1.638	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	1.916
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	1.229	KeyBank NA/Cleveland OH, Series BKN, 0,423 %, fällig 03.01.2024	1.830
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.05.2041	1.181	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	1.247
Citigroup Inc, 2,561 %, fällig 01.05.2032	1.010	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	1.157
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.03.2026	1.006	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.03.2026	1.007
Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	957	Guardian Life Global Funding, 144A, 0,875 %, fällig 10.12.2025	982
Verizon Communications Inc, 3,550 %, fällig 22.03.2051	806	Societe Generale SA, 144A, 1,488 %, fällig 14.12.2026	981
Equifax Inc, 2,350 %, fällig 15.09.2031	778	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,200 %, fällig 21.07.2021	970
BNP Paribas SA, 144A, 1,675 %, fällig 30.06.2027	770	Nasdaq Inc, 0,445 %, fällig 21.12.2022	950
Mexico Government International Bond, 4,280 %, fällig 14.08.2041	750	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.05.2041	948
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	722	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	891
Energy Transfer LP, Series G, 7,125 %, Perpetual	699	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,500 %, fällig 14.12.2023	796
Comcast Corp, 144A, 2,887 %, fällig 01.11.2051	640	Barclays Plc, 6,125 %, Perpetual	714
SYNNEX Corp, 144A, 1,250 %, fällig 09.08.2024	640	BNP Paribas SA, 144A, 3,052 %, fällig 13.01.2031	707
Qatar Petroleum, 144A, 2,250 %, fällig 12.07.2031	604	Diamondback Energy Inc, 5,375 %, fällig 31.05.2025	703
Fairfax Financial Holdings Ltd, 3,375 %, fällig 03.03.2031	599	Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig 28.10.2024	646

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

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

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	4.978	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	5.561
Freddie Mac Pool 'SD0176', 3,500 %, fällig 01.12.2049	725	United States Treasury Bill, zero coupon, fällig 04.05.2021	2.080
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	605	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 31.12.2027	1.219
Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	597	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	742
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.05.2031	572	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	613
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	510	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	611
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	509	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	604
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	505	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	509
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	505	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	506
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	501	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	505
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	415	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	505
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500 %	414	Ginnie Mae II Pool, 3,000 %, fällig 20.11.2049	427
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	414	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	415
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	414	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	415
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	413	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	414
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	405	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	414
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.04.2028	399	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	405
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	387	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.05.2031	400
Legg Mason China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	357	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.04.2028	389
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	352	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.06.2028	344
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.06.2028	340	United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, fällig 30.04.2028	340
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31.05.2028	339	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	312
United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, fällig 31.07.2028	339	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	306
Ginnie Mae II Pool 'MA7473', 3,000 %, fällig 20.07.2051	316	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	305
Fannie Mae 1,500 % 04.01.2036	308	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	304
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	304	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 0,000 %	303
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	303	Fannie Mae, 1,500 %, fällig 04.01.2036	303
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	302	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	273
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	302		
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.05.2041	281		
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	273		
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	224		

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	106.799	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	115.713
United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,064 %, fällig 31.01.2023	54.497	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,155 %, fällig 31.07.2022	63.358
Norway Government Bond, 2,000 %, fällig 24.05.2023	18.639	United Kingdom Gilt, 1,750 %, fällig 07.09.2022	39.073
Republic of Poland Government Bond, 2,250 %, fällig 25.04.2022	18.514	United States Treasury Floating Rate Note, 0,144 %, fällig 30.04.2022	25.798
Republic of Poland Government Bond, Series 1023, 4,000 %, fällig 25.10.2023	18.286	Norway Government Bond, 2,000 %, fällig 24.05.2023	19.112
Korea Treasury Bond, Series 4412, 4,750 %, fällig 10.12.2030	17.993	Republic of Poland Government Bond, 2,250 %, fällig 25.04.2022	19.045
Korea Treasury Bond, Series 4412, 2,750 %, fällig 10.12.2044	15.677	Korea Treasury Bond, Series 4412, 4,750 %, fällig 10.12.2030	17.920
Czech Republic Government Bond, 0,450 %, fällig 25.10.2023	13.922	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15.05.2050	17.578
Canada Government Bond, 0,250 %, fällig 01.11.2022	9.338	Czech Republic Government Bond, 0,450 %, fällig 25.10.2023	14.061
Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480 %, fällig 15.03.2023	6.674	Canada Government Bond, 0,250 %, fällig 01.11.2022	9.366
Western Australian Treasury Corp, Series 23, 6,000 %, fällig 16.10.2023	3.297	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029	6.785
Queensland Treasury Corp, Series 23, 144A, 4,250 %, fällig 21.07.2023	3.104	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	4.059
Malaysia Government Bond, Series 0117, 3,882 %, fällig 10.03.2022	1.910	Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	3.620
New South Wales Treasury Corp, 4,000 %, fällig 20.04.2023	1.585	Queensland Treasury Corp, Series 21, 5,500 %, fällig 21.06.2021	3.554
		Western Australian Treasury Corp, Series 21, 7,000 %, fällig 15.07.2021	3.493
		Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	3.037
		Republic of Poland Government Bond, Series 0421, 2,000 %, fällig 25.04.2021	2.749
		Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	2.565
		Australia Government Bond, Series 128, 5,750 %, fällig 15.07.2022	2.057
		Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	1.827

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	217.658	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	241.445
United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,064 %, fällig 31.01.2023	77.076	United States Treasury Floating Rate Note, 0,144 %, fällig 30.04.2022	112.948
Korea Treasury Bond, Series 3012, 1,500 %, fällig 10.12.2030	62.156	Ford Motor Credit Co LLC, 1,048 %, fällig 05.04.2021	21.080
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	36.299	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,155 %, fällig 31.07.2022	20.161
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTFN, 10,000 %, fällig 01.01.2031	29.535	Republic of South Africa Government Bond, Series 2032, 8,250 %, fällig 31.03.2032	18.742
China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050	21.260	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTFN, 10,000 %, fällig 01.01.2027	17.014
Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	20.015	Republic of South Africa Government Bond, Series R213, 7,000 %, fällig 28.02.2031	16.657
Indonesia Treasury Bond, Series FR68, 8,375 %, fällig 15.03.2034	13.510	Caterpillar Financial Services Corp, 0,447 %, fällig 15.03.2021	10.380
Caterpillar Financial Services Corp, 0,200 %, fällig 17.11.2022	9.020	General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	8.455
Indonesia Treasury Bond, Series FR80, 7,500 %, fällig 15.06.2035	7.885	Anglo American Capital Plc, 144A, 5,625 %, fällig 01.04.2030	7.941
United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,084 %, fällig 31.07.2023	7.491	Southwest Airlines Co, 5,125 %, fällig 15.06.2027	7.456
United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,079 %, fällig 30.04.2023	6.812	Wells Fargo & Co, 1,240 %, fällig 26.07.2021	6.868

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^] – (Fortsetzung)

		ERLÖSE (in Tsd.) USD
	WICHTIGE VERKÄUFE	
	Angel Oak Mortgage Trust 2020-1, Series 2020 1, Class A1, 144A, 2,466 %, fällig 25.12.2059	6.056
	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	4.853
	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029	3.875
	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	3.237
	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	2.754
	Towd Point Mortgage Trust 2018-5, Series 2018 5, Class A1, 144A, 3,250 %, fällig 25.07.2058	2.444
	Angel Oak Mortgage Trust 2019-6, Series 2019 6, Class A1, 144A, 2,620 %, fällig 25.11.2059	2.082
	Hess Corp, 5,600 %, fällig 15.02.2041	1.699

Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund[^]

	KOSTEN (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
	WICHTIGE KÄUFE	
	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	2.858
	Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig 15.11.2029	229
	Natwest Group Plc, 4,600 %, Perpetual	227
	Alcoa Nederland Holding BV, 4,125 %, fällig 31.03.2029	211
	ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27.04.2026	208
	Gol Finance SA, 144A, 8,000 %, fällig 30.06.2026	202
	Vmed 02 UK Financing 1 Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	202
	SierraCol Energy Andina LLC, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2028	201
	XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026	199
	Central Garden & Pet Co, 4,125 %, fällig 30.04.2031	198
	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 30.03.2031	145
	MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2028	145
	Haemonetics Corp, 144A, zero coupon, fällig 01.03.2026	124
	Clearway Energy Operating LLC, 3,750 %, fällig 15.02.2031	123
	Michaels Cos Inc/The, 5,250 %, fällig 01.05.2028	120
	T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	118
	Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15.01.2026	118
	Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15.01.2026	115
	Navistar International Corp, 9,500 %, fällig 01.05.2025	114
	GPS Hospitality Holding Co LLC / GPS Finco Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.08.2028	114
	Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2028	111
	Tenet Healthcare Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.06.2029	110
	XHR LP, 144A, 4,875 %, fällig 01.06.2029	80
		75
		75
	WICHTIGE VERKÄUFE	
	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	2.858
	Embraer Netherlands Finance BV, 144A, 6,950 %, fällig 17.01.2028	229
	Braskem Netherlands Finance BV, 8,500 %, fällig 23.01.2081	227
	CSN Inova Ventures, 144A, 6,750 %, fällig 28.01.2028	211
	Vista Outdoor Inc, 5,875 %, fällig 01.10.2023	208
	Braskem Idesa SAPI, 7,450 %, fällig 15.11.2029	202
	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 6,125 %, Perpetual	202
	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21.04.2023	201
	Banco do Brasil SA/Cayman, 6,250 %, Perpetual	199
	Yapi ve Kredi Bankasi AS, 7,875 %, fällig 22.01.2031	198
	Credito Real SAB de CV SOFOM ER, 144A, 8,000 %, fällig 21.01.2028	185
	Turkey Government International Bond, 5,950 %, fällig 15.01.2031	179
	Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	148
	Petrobras Global Finance BV, 5,600 %, fällig 03.01.2031	129
	Air Canada, 9,000 %, fällig 22.06.2024	126
	Clearway Energy Operating LLC, 3,750 %, fällig 15.02.2031	120
	Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15.01.2026	114
	Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.09.2025	107
	Tronox Inc, 6,500 %, fällig 15.04.2026	103
	Antero Resources Corp, 5,625 %, fällig 01.06.2023	60

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
	WICHTIGE KÄUFE	
	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	203.532
	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,064 %, fällig 31.01.2023 FRN	86.166
	Republic of Poland Government Bond, Series 1023, 4,000 %, fällig 25.10.2023	84.282
	Republic of Poland Government Bond, 2,250 %, fällig 25.04.2022	60.304
	Canadian Government Bond, 1,500 %, fällig 01.02.2022	31.048
	Norway Government Bond, Series 475, 144A, 2,000 %, fällig 24.05.2023	27.619
	Korea Treasury Bond, Series 3106, 2,000 %, fällig 10.06.2031	25.478
	Czech Republic Government Bond, 0,450 %, fällig 25.10.2023	14.060
	China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050	11.983
	Korea Treasury Bond, Series 5103, 1,875 %, fällig 10.03.2051	9.493
	Athene Global Funding, 144A, 0,750 %, fällig 24.05.2024 FRN	9.438
	Caterpillar Financial Services Corp, 0,200 %, fällig 17.11.2022 FRN	9.136
	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,084 %, fällig 31.07.2023 FRN	8.343
	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,079 %, fällig 30.04.2023 FRN	8.290
	Queensland Treasury Corp, Series 23, 144A, 4,250 %, fällig 21.07.2023	8.179
	Western Australian Treasury Corp, Series 23, 6,000 %, fällig 16.10.2023	7.941
	New South Wales Treasury Corp, 4,000 %, fällig 20.04.2023	7.664
		7.281
		6.916
		6.819
	WICHTIGE VERKÄUFE	
	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	203.532
	United States Treasury Floating Rate Note, 0,085 %, fällig 31.07.2022	86.166
	United Kingdom Gilt, 1,750 %, fällig 07.09.2022	84.282
	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,064 %, fällig 31.01.2023 FRN	60.304
	Republic of Poland Government Bond, 2,250 %, fällig 25.04.2022	31.048
	Canadian Government Bond, 1,500 %, fällig 01.02.2022	27.619
	United States Treasury Floating Rate Note, 0,085 %, fällig 31.10.2022	25.478
	Czech Republic Government Bond, 0,450 %, fällig 25.10.2023	14.060
	Norway Government Bond, Series 475, 144A, 2,000 %, fällig 24.05.2023	11.983
	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029	9.493
	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	9.438
	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	9.136
	Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	8.343
	General Electric Co, 4,350 %, fällig 01.05.2050	8.290
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTFN, 10,000 %, fällig 01.01.2027	8.179
	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	7.941
	Colombian TES, Series B, 6,250 %, fällig 26.11.2025	7.664
	Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	7.281
	Australia Government Bond, Series 128, 5,750 %, fällig 15.07.2022	6.916
	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,881 %, fällig 23.02.2023 FRN	6.819

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
	WICHTIGE KÄUFE	
	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	336.327
	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	29.956
	Freddie Mac StacR Remic Trust 2020-HQA2, Series 2020 HQA2, Class M2, 144A, 3,184 %, fällig 25.03.2050	11.346
	Korea Treasury Bond, 1,500 %, fällig 10.12.2030	10.003
	French Republic Government Bond OAT, 144A, 0,750 %, fällig 25.05.2052	9.721
	Oaktown Re V Ltd, Series 2020 2A, Class M1B, 144A, 3,684 %, fällig 25.10.2030	8.543
	Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Class B1, 144A, 3,311 %, fällig 25.03.2058	7.095
	Towd Point Mortgage Trust 2016-2, Series 2016 2, Class B2, 144A, 3,429 %, fällig 25.08.2055	6.528
		6.173
		4.962
	WICHTIGE VERKÄUFE	
	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	336.327
	Korea Treasury Bond, 1,500 %, fällig 10.12.2030	29.956
	United States Treasury Floating Rate Note, 0,085 %, fällig 31.10.2022	11.346
	Egypt Treasury Bills, zero coupon, fällig 15.06.2021	10.003
	Egypt Treasury Bills, zero coupon, fällig 24.08.2021	9.721
	Western Digital Corp, 1,500 %, fällig 01.02.2024	8.543
	Clearway Energy Operating LLC, 3,750 %, fällig 15.02.2031	7.095
	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 6,250 %, fällig 15.05.2026	6.528
	Egypt Treasury Bills, Series 182D, zero coupon, fällig 09.03.2021	6.173
	Toyota Motor Corp, 0,681 %, fällig 25.03.2024	4.962

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Spain Government Bond, Series 30Y, 144A, 2,700 %, fällig 31.10.2048	13.779	Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.10.2024	4.512
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CAC, 144A, 2,450 %, fällig 01.09.2050	13.194	Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, fällig 15.04.2026	4.346
Graphic Packaging International LLC, 144A, 1,512 %, fällig 15.04.2026	12.957	Steris Irish FinCo UnLtd Co, 2,700 %, fällig 15.03.2031	4.175
Athene Global Funding, 144A, 0,914 %, fällig 19.08.2024	11.760	reddie Mac Stacr Remic Trust 2020-HQA2, Series 2020 HQA2, Class M2, 144A, 3,184 %, fällig 25.03.2050	4.016
T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	11.707	Egypt Treasury Bills, Series 182D, zero coupon, fällig 09.03.2021	3.535
AT&T Inc, 2,750 %, fällig 01.06.2031	11.643	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 4,000 %, fällig 15.01.2030	3.253
DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	11.066	Antero Resources Corp, 5,625 %, fällig 01.06.2023	2.805
MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2028	10.649	Occidental Petroleum Corp, 2,700 %, fällig 15.02.2023	2.702
Graham Holdings Co, 144A, 5,750 %, fällig 01.06.2026	10.438	Navistar International Corp, 9,500 %, fällig 01.05.2025	2.689
Egypt Treasury Bills, zero coupon, fällig 14.09.2021	10.066	Dominion Energy Inc, 1,450 %, fällig 15.04.2026	2.608
Bain Capital Specialty Finance Inc, 2,950 %, fällig 10.03.2026	9.854		
CommScope Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.07.2028	9.777		

Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	26.917	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	25.813
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1B1, 144A, 4,434 %, fällig 25.10.2030	2.881	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Series 2019 DNA4, Class B2, 144A, 6,368 %, fällig 25.10.2049	2.912
American Credit Acceptance Receivables Trust 2019-3, Series 2019 3, Class F, 144A, 5,420 %, fällig 12.05.2026	2.541	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29, Series 2015 GC29, Class C, 4,151 %, fällig 10.04.2048	2.605
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Series 2020 SBT1, Class 1M2, 144A, 3,734 %, fällig 25.02.2040	2.308	Eagle RE 2018-1 Ltd, 3,109 %, fällig 25.11.2028	1.514
STACR Trust 2018-HRP2, Series 2018 HRP2, Class B1, 144A, 4,284 %, fällig 25.02.2047	1.755	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1B1, 144A, 4,434 %, fällig 25.10.2030	1.441
Connecticut Avenue Securities Trust 2018-R07, Series 2018 R07, Class 1B1, 144A, 4,434 %, fällig 25.04.2031	1.741	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C15, Series 2013 C15, Class C, 5,196 %, fällig 15.11.2045	1.431
China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050	1.583	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K042, Class X1, 1,165 %, fällig 25.12.2024	1.257
Eagle RE 2018-1 Ltd, 3,109 %, fällig 25.11.2028	1.509	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R02, Series 2019 R02, Class 1B1, 144A, 4,268 %, fällig 25.08.2031	1.213
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC17, Series 2013 GC17, Class C, 5,260 %, fällig 10.11.2046	1.370	Republic of Korea Government Bond, 1,875 %, fällig 10.03.2051	1.211
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2020 HQA5, Class B2, 144A, 7,450 %, fällig 25.11.2050	1.343	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R01, Series 2019 R01, Class 2B1, 144A, 4,468 %, fällig 25.07.2031	1.117
Republic of Korea Government Bond, 1,875 %, fällig 10.03.2051	1.237	Apple Inc	1.100
Barings CLO Ltd 2018-II, Series 2018 2X, Class D, 5,676 %, fällig 15.04.2030	1.130	Annaly Capital Management Inc	1.062
Apple Inc	1.099	STACR Trust 2018-HRP2, Series 2018 HRP2, Class B1, 144A, 2,509 %, fällig 25.02.2047	964
Bellemeade Re 2020-2 Ltd, Series 2020 2A, Class M2, 144A, 6,084 %, fällig 26.08.2030	1.057	Amazon.com Inc	957
Westlake Automobile Receivables Trust 2018-3, Series 2018 3A, Class F, 144A, 6,020 %, fällig 18.02.2025	1.043	WF-RBS Commercial Mortgage Trust, 3,803 %, fällig 11.15.2047	928
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Series 2014 LC14, Class D, 144A, 4,586 %, fällig 15.03.2047	1.017	MTRO Commercial Mortgage Trust 2019-TECH, Series 2019 TECH, Class E, 144A, 2,162 %, fällig 15.12.2033	887
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Series 2021 DNA5, Class B1, 144A, 3,100 %, fällig 25.01.2034	1.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1M2C, 2,268 %, fällig 25.10.2030	856
Atrium XIV LLC 14A, Class E, 144A, 5,776 %, fällig 23.08.2030	993	STACR Trust 2018-HRP1, Series 2018 HRP1, Class B1, 144A, 3,868 %, fällig 25.04.2043	849
Amazon.com Inc	970	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05, Class 1B1, 4,334 %, fällig 25.01.2031	784
STACR Trust 2018-HRP2, Series 2018 HRP2, Class B1, 144A, 2,509 %, fällig 25.02.2047	961	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA1, Series 2021 DNA1, Class B2, 144A, 4,795 %, fällig 25.01.2051	780
Home RE 2021-2 Ltd, Series 2021 2, Class M2, 144A, 3,300 %, fällig 25.01.2034	950	Octagon Investment Partners 26 Ltd, Series 2016 1A, Class ER, 144A, 5,641 %, fällig 15.07.2030	766
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA1, Series 2021 DNA1, Class B1, 144A, 2,700 %, fällig 25.01.2051	941	Canadian Natural Resources Ltd	711
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NX55, Series 2016 NX55, Class D, 5,151 %, fällig 15.01.2059	930	Progress Residential 2018-SFR1 Trust, Series 2018 SFR1, Class F, 144A, 4,778 %, fällig 17.03.2035	650
WF-RBS Commercial Mortgage Trust, 3,803 %, fällig 11.15.2047	909	Petroleos Mexicanos, 4,500 %, fällig 23.01.2026	614
CONSUMER LOAN UNDERLYING BOND CLUB CERTIFICATE ISSUER TRUST I SERIES 2019-HP1, Series 2019 HP1, Class C, 144A, 4,700 %, fällig 15.12.2026	875		
Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Series 2019 DNA4, Class B1, 144A, 6,356 %, fällig 25.10.2049	802		
Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Series 2021 MN2, Class M2, 144A, 3,400 %, fällig 25.07.2041	800		
American Credit Acceptance Receivables Trust 2020-3, Series 2020 3, Class F, 144A, 5,940 %, fällig 14.06.2027	759		
American Credit Acceptance Receivables Trust 2020-4, Series 2020 4, Class F, 144A, 5,220 %, fällig 13.08.2027	732		
Regatta XI Funding Ltd, Series 2018 1A, Class E, 144A, 5,634 %, fällig 17.07.2031	706		

Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	2.555	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	2.597
First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 15.10.2027	220	Embraer Netherlands Finance BV, 144A, 6,950 %, fällig 17.01.2028	229
Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig 15.11.2029	205	Braskem Netherlands Finance BV, 8,500 %, fällig 23.01.2081	228
Natwest Group Plc, 4,600 %, Perpetual	202	CSN Inova Ventures, 144A, 6,750 %, fällig 28.01.2028	211
Alcoa Nederland Holding BV, 4,125 %, fällig 31.03.2029	200	BRF SA, 3,950 %, fällig 22.05.2023	208
ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27.04.2026	200	Braskem Idesa SAPI, 7,450 %, fällig 15.11.2029	202
Gol Finance SA, 144A, 8,000 %, fällig 30.06.2026	200	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 6,125 %, Perpetual	197
Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	200	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21.04.2023	196
SierraCol Energy Andina LLC, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2028	199	Credito Real SAB de CV SOFOM ER, 144A, 8,000 %, fällig 21.01.2028	185
XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026	198	Turkey Government International Bond, 5,950 %, fällig 15.01.2031	179
Energear Israel Finance Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 30.03.2031	140	Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	153
		Air Canada, 144A, 7,750 %, fällig 15.04.2021	130

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Central Garden & Pet Co, 4,125 %, fällig 30.04.2031	135	Iron Mountain Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.03.2028	126
Clearway Energy Operating LLC, 3,750 %, fällig 15.02.2031	120	Petrobras Global Finance BV, 5,600 %, fällig 03.01.2031	124
T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	115	Air Canada, 9,000 %, fällig 22.06.2024	121
MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2028	114	Clearway Energy Operating LLC, 3,750 %, fällig 15.02.2031	120
Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig 01.05.2028	112	Antero Resources Corp, 5,000 %, fällig 01.03.2025	118
Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15.01.2026	109	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,375 %, fällig 15.04.2026	114
Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15.01.2026	109	Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15.01.2026	109
Navistar International Corp, 3,500 %, fällig 01.05.2025	105	TEGNA Inc, 4,625 %, fällig 15.03.2028	109
TEGNA Inc, 4,625 %, fällig 15.03.2028	105	TEGNA Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.03.2028	105
GPS Hospitality Holding Co LLC / GPS Finco Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.08.2028	100	Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.09.2025	102
Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2028	80	Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.03.2024	97
Tenet Healthcare Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.06.2029	70	Tronox Inc, 6,500 %, fällig 15.04.2026	83
XHR LP, 144A, 4,875 %, fällig 01.06.2029	65		

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,064 %, fällig 31.01.2023	40.120	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,064 %, fällig 31.01.2023	50.512
Turkey Government Bond, 11,700 %, fällig 13.11.2030	38.240	United States Treasury Floating Rate Note, 0,085 %, fällig 31.10.2022	36.184
Korea Treasury Bond, Series 3106, 2,000 %, fällig 10.06.2031	19.354	United States Treasury Floating Rate Note, 0,085 %, fällig 31.07.2022	28.520
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	13.970	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	27.536
China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050	10.789	Turkey Government Bond, 11,700 %, fällig 13.11.2030	27.335
Korea Treasury Bond, Series 5103, 1,875 %, fällig 10.03.2051	7.656	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029	26.380
Athene Global Funding, 144A, 0,750 %, fällig 24.05.2024	6.138	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	20.954
Caterpillar Financial Services Corp, 0,200 %, fällig 17.11.2022	4.755	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	16.724
Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	780	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2029	16.091
Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	626	Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	9.688
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2029	509	Legg Mason Global Funds Plc – Brandywine Global Credit Opportunities Fund – LM Class US\$ Accumulating	7.509
Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	385	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	7.169
		Russian Federal Bond – OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10.04.2030	7.080
		Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	6.854
		Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	6.681
		Ford Motor Credit Co LLC, 1,048 %, fällig 05.04.2021	5.580
		Caterpillar Financial Services Corp, 0,447 %, fällig 15.03.2021	5.420
		Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	4.892
		Bank of Nova Scotia/The, 0,597 %, fällig 15.09.2023	4.861
		Malaysia Government Bond, Series 0117, 3,882 %, fällig 10.03.2022	4.637
		Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,850 %, fällig 17.03.2023	4.230
		Athene Global Funding, 144A, 0,750 %, fällig 24.05.2024	4.182
		Petroleos Mexicanos, 7,690 %, fällig 23.01.2050	3.938

Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	198	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	186
Cigna Corp	85	Lowe's Companies Inc	75
Lowe's Companies Inc	70	eBay Inc	64
JPMorgan Chase & Co	58	Johnson Controls International plc	63
General Motors Co	56	Cummins Inc	62
iShares Russell 1000 Value ETF – ETF	55	LyondellBasell Industries NV	52
Nucor Corp	46	T Rowe Price Group Inc	50
Regeneron Pharmaceuticals Inc	32	iShares Russell 1000 Value ETF – ETF	45
Berkshire Hathaway Inc 'B'	31	Newmont Corp	41
Dominion Energy Inc	30	Discover Financial Services	38
Anthem Inc	28	Biogen Inc	38
Corteva Inc	26	Lennar Corp	34
J M Smucker Co/The	19	BlackRock Inc	33
O'Reilly Automotive Inc.	19	Ameriprise Financial Inc	33
BlackRock Inc	16	United Rentals Inc	33
Intel Corp	14	MGM Resorts International	29
Capital One Financial Corp	14	Celanese Corp 'A'	27
Mosaic Co/The	14	Eastman Chemical Co	25
Kinder Morgan Inc	14	O'Reilly Automotive Inc.	23
Advance Auto Parts Inc	13	Quanta Services Inc	17

Legg Mason ClearBridge Value Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Signature Bank/New York NY	13.028	Walt Disney Co/The	10.673
Cisco Systems Inc/Delaware	12.344	Micron Technology Inc	9.892
Vertex Pharmaceuticals Inc	10.783	CVS Health Corp	9.023
Biogen Inc	10.345	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	8.947
Unum Group	10.168	Hartford Financial Services Group Inc/The	7.788
Schlumberger NV	9.487	TJX Cos Inc/The	7.663
Cigna Corp	8.364	Ulta Beauty Inc	7.311

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason ClearBridge Value Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Bank of New York Mellon Corp/The	8.160	NXP Semiconductors NV	7.152
Anheuser-Busch InBev SA/NV ADR	7.510	Cigna Corp	6.932
Alibaba Group Holding Ltd	7.286	Comcast Corp	6.843
Facebook Inc 'A'	6.899	Newmont Corp	6.678
Splunk Inc	6.839	Citigroup Inc	6.168
Fidelity National Information Services Inc	6.647	Alibaba Group Holding Ltd	6.040
Devon Energy Corp	6.636	Curtiss-Wright Corp	5.780
General Electric Co	6.464	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	5.127
Simon Property Group Inc	6.299	Arista Networks Inc	4.818
Synchrony Financial	6.262	Eli Lilly & Co	4.298
Coty Inc	6.243	Amazon.com Inc	4.076
Bank of America Corp	6.157	Toll Brothers Inc	3.404
Quanta Services Inc	6.043	Kimco Realty Corp	3.237
Air Liquide SA	6.039	DXC Technology Co	3.233
Marubeni Corp	5.988	Baidu Inc ADR	2.951
Capri Holdings Ltd	5.766	Goldman Sachs Group Inc/The	2.932
Wells Fargo & Co	5.739	AbbVie Inc	2.703
American International Group Inc	5.356	EQT Corp	2.690
Equitable Holdings Inc	4.926	Synchrony Financial	2.588
BioMarin Pharmaceutical Inc	4.727	Freeport-McMoRan Inc	2.554
ViacomCBS Inc 'B'	4.647	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	2.168
Freeport-McMoRan Inc	4.444	Bank of America Corp	2.139
DXC Technology Co	4.273	Volkswagen AG	1.891
Southwest Airlines Co	4.137	Charles Schwab Corp/The	1.851
Goodyear Tire & Rubber Co/The	4.030	KION Group AG	1.821
Oracle Corp	3.867	Equitable Holdings Inc	1.792
OneMain Holdings Inc	3.768		
UnitedHealth Group Inc	3.743		
Uber Technologies Inc	3.405		
Goldman Sachs Group Inc/The	3.371		

Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Cisco Systems Inc/Delaware	863	Chevron Corp	2.619
Activision Blizzard Inc	667	Pinterest Inc	1.818
Hartford Financial Services Group Inc/The	525	Cognizant Technology Solutions Corp	1.810
Waste Management Inc	311	Adobe Inc	1.516
Amazon.com Inc	291	Apple Inc	1.442
Toll Brothers Inc	230	Microsoft Corp	1.396
Enphase Energy Inc	213	Amazon.com Inc	1.317
Coca-Cola Co/The	207	International Business Machines Corp	1.308
Microsoft Corp	205	Comcast Corp	1.257
Pioneer Natural Resources Co	190	PPG Industries Inc	1.238
salesforce.com Inc	171	Berkshire Hathaway Inc	1.185
Alphabet Inc 'A'	168	Visa Inc 'A'	1.112
TJX Cos Inc/The	155	Walt Disney Co/The	1.071
CME Group Inc	147	Amgen Inc	958
Apple Inc	141	Facebook Inc 'A'	946
Fidelity National Information Services Inc	122	Home Depot Inc/The	920
General Motors Co	109	United Parcel Service Inc 'B'	832
Medtronic Plc	102	Thermo Fisher Scientific Inc	771
JPMorgan Chase & Co	85	JPMorgan Chase & Co	718
Visa Inc 'A'	73	ArcelorMittal SA	696
Home Depot Inc/The	71	Procter & Gamble Co/The	630
Alphabet Inc	68	Oracle Corp	612
Facebook Inc 'A'	68	3M Co	611
		ASML Holding NV	546
		Canadian Pacific Railway Ltd	498
		Honeywell International Inc	483
		Johnson & Johnson	436
		UnitedHealth Group Inc	432
		Travelers Cos Inc/The	424
		Becton Dickinson and Co	422
		Alphabet Inc	372

Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Netflix Inc	30.315	Zoetis Inc	43.899
CVS Health Corp	29.430	Amgen Inc	38.987
Eaton Corp PLC	27.540	Texas Instruments Inc	27.431
Sea Ltd ADR	19.052	Alibaba Group Holding Ltd ADR	25.908
Intuitive Surgical, Inc	17.494	Comcast Corp	25.472
ASML Holding NV	14.680	VMware Inc	17.813
UiPath Inc	14.040	Costco Wholesale Corp	17.333
salesforce.com Inc	11.886	ASML Holding NV	15.808
Atlassian Corp Plc	9.195	UnitedHealth Group Inc	9.811
Amazon.com Inc	7.038	Alexion Pharmaceuticals Inc	9.285
Workday Inc 'A'	6.286	Akamai Technologies Inc	7.784
Tractor Supply Co	4.645	Ulta Beauty Inc	6.969
Facebook Inc 'A'	2.981	Nutanix Inc	6.886

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund– (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
IHS Markit Ltd	2.856	Microsoft Corp	6.252
Uber Technologies Inc	2.706	Advance Auto Parts Inc	5.068
Alcon Inc	2.344	Home Depot Inc/The	4.971
Monster Beverage Corp	2.101	Amazon.com Inc	4.636
Fidelity National Information Services Inc	2.094	Apple Inc	3.582
		Equinix Inc	2.808
		Facebook Inc 'A'	2.019

Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
DocuSign Inc 'A'	15.482	Nuance Communications Inc	35.775
Match Group Inc	12.084	Comcast Corp	13.199
HubSpot Inc	10.702	Discovery Inc	8.951
Facebook Inc 'A'	8.122	Liberty Broadband Corp	8.070
Lyft Inc	7.580	Seagate Technology Plc	6.667
Guardant Health Inc	2.580	NOV Inc	5.896
		Nucor Corp	5.340
		Biogen Inc	4.005
		Intel Corp	3.883
		AMC Networks Inc	3.754
		Lions Gate Entertainment Corp	3.199
		Liberty Media Corp-Liberty Formula One	3.042
		ViacomCBS Inc 'B'	2.820
		World Wrestling Entertainment Inc 'A'	1.860
		Qurate Retail Inc	1.859
		Discovery Inc	1.603
		Alkermes Plc	1.220
		Voyager Therapeutics Inc	788

Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
ViacomCBS Inc, Series A Pfd	789	Broadcom Inc, Series A	841
Cisco Systems Inc/Delaware	692	Microchip Technology Inc	667
B. Riley Financial Inc	685	B. Riley Financial Inc	658
Shenandoah Telecommunication	654	American Financial Group Inc	376
American Financial Group Inc	426	Shenandoah Telecommunication	370
Equitrans Midstream Corp	326	AGNC Investment Corp	359
Enbridge Inc	318	Williams Cos Inc/The	233
TC Energy Corp	290	ASML Holding NV	201
ONEOK Inc	289	Ares Capital Corp	192
Williams Cos Inc/The	235	Becton Dickinson and Co, Series B	191
Oracle Corp	227	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 15.06.2023	177
Ares Capital Corp	198	Microsoft Corp	153
South Jersey Industries Inc Pfd	197	Merck & Co Inc	107
Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,250 %, fällig 15.06.2023	177	Johnson & Johnson	95
ASML Holding NV	170	Cango Inc/KY	88
Pfizer Inc	120	Equinix Inc	78
Verizon Communications Inc	103	KKR & Co Inc, Series C	68
Cango Inc/KY	101	Cisco Systems Inc/Delaware	55
Weyerhaeuser Co	96	Crown Castle International Corp	44
Coca-Cola Co/The	83	Chubb Ltd	42

Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Microsoft Corp	28.180	Unilever Plc ADR	16.570
Amazon.com Inc	22.433	Becton Dickinson and Co	13.844
Apple Inc	21.370	Apple Inc	9.903
Thermo Fisher Scientific Inc	20.916	Vital Farms Inc	5.964
Cisco Systems Inc/Delaware	18.431	Herman Miller Inc	5.531
McCormick & Co Inc/MD	18.397	Hartford Financial Services Group Inc/The	5.489
Bank of America Corp	13.974	Trane Technologies Plc	4.761
Progyny Inc	13.886	TE Connectivity Ltd	3.801
CVS Health Corp	11.911	Array Technologies Inc	3.517
UnitedHealth Group Inc	11.515	Costco Wholesale Corp	3.464
Amgen Inc	11.267	Comcast Corp	3.398
Hasbro Inc	10.941	Charles Schwab Corp/The	3.346
Home Depot Inc/The	10.884	Lam Research Corp	2.976
Shoals Technologies Group Inc 'A'	10.850	Bank of America Corp	2.538
TE Connectivity Ltd	10.620	Microsoft Corp	2.489
Trane Technologies Plc	10.463	Home Depot Inc/The	975
Comcast Corp	10.236	Danaher Corp	852
Morgan Stanley	10.093	UnitedHealth Group Inc	828
Gilead Sciences Inc	10.076	Amgen Inc	742
Danaher Corp	9.982	CVS Health Corp	737
Costco Wholesale Corp	9.915		
Walt Disney Co/The	9.621		
Regal Beloit Corp	9.528		

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^– (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN
	(in Tsd.) USD
Charles Schwab Corp/The	9.513
Progressive Corp/The	9.433
Resideo Technologies Inc	9.400
Ball Corp	9.275
Hartford Financial Services Group Inc/The	9.225
Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP	8.977
Marriott International Inc/MD	8.916
Aptiv Plc	8.816
First Republic Bank/CA	8.725
Trex Co Inc	8.605
Lam Research Corp	8.224
BlackRock Inc	8.149
Herman Miller Inc	8.124
Visa Inc 'A'	8.108
Booking Holdings Inc	7.819
Synopsys Inc	7.769
NIKE Inc	7.652
NextEra Energy Inc	7.651
Hain Celestial Group Inc/The	7.343
BioMarin Pharmaceutical Inc	7.138
Ecolab Inc	7.063
SunOpta Inc	6.868
Keysight Technologies Inc	6.675
Unilever Plc ADR	6.646
Autodesk Inc	6.585
T-Mobile US Inc	6.413
salesforce.com Inc	6.225
Equinix Inc	6.008
Vestas Wind Systems A/S ADR	5.817

Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE
			(in Tsd.) USD
BNP Paribas SA	195	Nintendo Co Ltd	172
Recruit Holdings Co Ltd	193	Tencent Holdings Ltd	168
Old Dominion Freight Line Inc	188	Legrand SA	136
Keyence Corp	184	Tokyo Electron Ltd	136
Hoya Corp	173	NextEra Energy Inc	132
Kroger Co/The	152	Vestas Wind Systems A/S	116
United Rentals Inc	146	salesforce.com Inc	112
Sea Ltd ADR	142	Roche Holding AG	112
Intesa Sanpaolo SpA	128	Daiichi Sankyo Co Ltd	103
Waste Management Inc	128	Samsung Electronics Co Ltd	103
Sandvik AB	127	Merck & Co Inc	98
Constellation Software Inc/Canada	112	TeamViewer AG, 144A	95
Coty Inc	109	Arista Networks Inc	92
DocuSign Inc 'A'	100	Apple Inc	91
UnitedHealth Group Inc	95	Nihon M&A Center Inc	85
McCormick & Co Inc/MD	90	Equinix Inc	82
Alcon Inc	89	MorphoSys AG ADR	80
Marriott International Inc/MD	72	Adyen NV, 144A	79
Argenx SE ADR	65	T-Mobile US Inc	66
Nestle SA	65	Spotify Technology SA	64
Samsung Electronics Co Ltd	59	Ulta Beauty Inc	62
Avantor Inc	54	Guardant Health Inc	50
FANUC Corp	53	Thomson Reuters Corp	46
Zai Lab Ltd ADR	53	Amazon.com Inc	41
Dexcom Inc	49	Fidelity National Information Services Inc	39
Ecolab Inc	48	Microsoft Corp	38
United Parcel Service Inc 'B'	48	Procter & Gamble Co/The	38
Cellnex Telecom SA, 144A	46	Diageo Plc ADR	35
Marvell Technology Inc	46	Just Eat Takeaway.com NV, 144A	35
Amadeus IT Group SA	44	NVIDIA Corp	34
Just Eat Takeaway.com NV, 144A	42		
CRH Plc ADR	41		
London Stock Exchange Group Plc	41		

Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE
			(in Tsd.) EUR
Pembina Pipeline Corp	22.226	Sempra Energy	20.204
SBA Communications Corp 'A'	19.133	Atlantia SpA	20.092
Alliant Energy Corp	15.892	Orsted AS, 144A	17.923
Canadian National Railway Co	13.296	Pinnacle West Capital Corp	16.143
CenterPoint Energy Inc	12.867	Cheniere Energy Inc	14.468
Enbridge Inc	12.014	Atlas Arteria Ltd	11.495
Dominion Energy Inc	10.378	CSX Corp	11.461
Entergy Corp	10.211	Cellnex Telecom SA, 144A	11.250
Exelon Corp	9.558	NextEra Energy Partners LP	11.006
CMS Energy Corp	6.907	Transurban Group	10.446
East Japan Railway Co	6.835	Public Service Enterprise Group Inc	8.994
Aeroports de Paris	6.431	Crown Castle International Corp	8.100

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^] – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE

Iberdrola SA	
Cellnex Telecom SA, 144A	
EDP – Energias de Portugal SA	
American Tower Corp	
Ferrovial SA	
Southern Co/The	
Eiffage SA	
Sydney Airport	
Southern Co/The	
Severn Trent Plc	

KOSTEN (in Tsd.) EUR

5.968
5.449
4.861
3.888
3.797
3.706
3.552
3.476
3.472
3.301

WICHTIGE VERKÄUFE

Snam SpA
Union Pacific Corp
NextEra Energy Inc
Terna – Rete Elettrica Nazionale
Severn Trent Plc
Ferrovial SA
American Tower Corp
Alliant Energy Corp
Sydney Airport
Vinci SA
Getlink SE

ERLÖSE (in Tsd.) EUR

6.820
6.386
6.117
5.546
5.450
5.283
5.184
4.218
3.099
2.920
2.536

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE

Shanghai International Port 'A'
Xinyi Energy Holdings Ltd
China Longyuan Power Group Corp Ltd
China Resources Power Holdings Co Ltd
Jasa Marga Persero Tbk PT
Power Grid Corp of India Ltd
China Resources Gas Group Ltd
China Gas Holdings Ltd
International Container Terminal Services Inc
Gujarat State Petronet Ltd
Malaysia Airports Holdings Bhd
CCR SA
EcoRodovias Infraestrutura e Logistica SA
China Tower Corp Ltd, 144A
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV

KOSTEN (in Tsd.) USD

55
53
43
42
26
26
25
21
19
16
16
15
15
12
12

WICHTIGE VERKÄUFE

Gujarat Gas Ltd
Shanghai International Airport Co Ltd
Agua Andinas SA
Electricity Generating PCL
ENN Energy Holdings Ltd
Indraprastha Gas Ltd
Telesites SAB de CV
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV
Petronet LNG Ltd
Ratch Group PCL
Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA
China Gas Holdings Ltd
Container Corp Of India Ltd
CFE Capital S de RL de CV
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV

ERLÖSE (in Tsd.) USD

78
49
39
38
34
32
31
26
25
25
22
12
11
3
1

Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE

Sydney Airport
Exelon Corp
Enbridge Inc
Atlas Arteria Ltd
Crown Castle International Corp
Clearway Energy Inc 'C'
SSE Plc
Pembina Pipeline Corp
Southern Co/The
AusNet Services Ltd
Public Service Enterprise Group Inc
Snam SpA
National Grid Plc
Vinci SA
Getlink SE
Aena SME SA, 144A
Transurban Group
Gibson Energy Inc
Enagas SA
EDP – Energias de Portugal SA
Iberdrola SA
TC Energy Corp
Brookfield Renewable Corporation
Eiffage SA
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV
Ferrovial SA
Red Electrica Corp SA
NextEra Energy Partners LP
Spark Infrastructure Group
CPFL Energia SA
Entergy Corp
CFE Capital S de RL de CV
Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA
CCR SA

KOSTEN (in Tsd.) USD

4.364
4.361
3.978
3.949
3.887
3.812
3.543
3.484
3.356
3.335
3.327
3.174
3.125
2.806
2.716
2.624
2.545
2.458
2.337
2.326
2.303
2.242
2.168
2.163
2.064
1.944
1.892
1.805
1.625
1.470
1.353
1.241
1.199
927

WICHTIGE VERKÄUFE

Sydney Airport
Pinnacle West Capital Corp
Spark Infrastructure Group
Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA
Pennon Group Plc
AusNet Services Ltd
SSE Plc
Agua Andinas SA
Atlas Arteria Ltd
CFE Capital S de RL de CV
Brookfield Renewable Corporation
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV

ERLÖSE (in Tsd.) USD

908
732
688
418
304
254
69
59
12
11
2
1

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

WICHTIGE KÄUFE

Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)
Overstock.com Inc
Texas Capital Bancshares Inc
Skechers USA Inc
Emergent BioSolutions Inc
Fabrinet
Herman Miller Inc
Marcus Corp/The

KOSTEN (in Tsd.) USD

189.806
8.909
8.876
8.398
6.316
5.731
5.628
5.381

WICHTIGE VERKÄUFE

Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)
Olin Corp
Lydall Inc
Surgery Partners Inc
Alcoa Corp
US Concrete Inc
Avid Technology Inc
Ferro Corp

ERLÖSE (in Tsd.) USD

228.760
16.077
15.859
13.336
13.214
12.793
10.258
10.188

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Chesapeake Energy Corp	5.229	American Woodmark Corp	9.612
Commercial Metals Co	5.190	Louisiana-Pacific Corp	9.135
VSE Corp	5.123	II-VI Inc	9.000
Nordstrom Inc	4.990	Owens & Minor Inc	8.892
Astronics Corp	4.955	Intrepid Potash Inc	8.843
Designer Brands Inc	4.917	LGI Homes Inc	8.669
CIRCOR International Inc	4.889	B Riley Financial Inc	8.570
Conn's Inc	4.855	Herc Holdings Inc	8.525
WESCO International Inc	4.851	Community Health Systems Inc	8.174
Univar Solutions Inc	4.849	America's Car-Mart Inc/TX	7.816
Organon & Co	4.833	BJ's Restaurants Inc	7.677
Primoris Services Corp	4.755	MGP Ingredients Inc	7.495

Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	25.090	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	25.508
Cohu Inc	2.321	Kulicke & Soffa Industries Inc	1.485
Meridian Bioscience Inc	1.613	Insight Enterprises Inc	1.468
Simulations Plus Inc	1.432	Bio-Techne Corp	1.433
CMC Materials Inc	1.354	Wolverine World Wide Inc	1.130
Computer Task Group Inc	1.340	John Bean Technologies Corp	1.085
Great Lakes Dredge & Dock Corp	1.264	Colfax Corp	1.083
Air Lease Corp 'A'	1.175	MAXIMUS Inc	1.046
Meritor Inc	1.175	Stella-Jones Inc	1.001
Gibraltar Industries Inc	1.144	J2 Global Inc	987
MKS Instruments Inc	997	Houlihan Lokey Inc 'A'	871
Harmony Biosciences Holdings Inc	967	iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	798
iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	960	Johnson Outdoors Inc	761
John Bean Technologies Corp	915	TGS NOPEC Geophysical Co ASA	723
Colfax Corp	880	Comfort Systems USA Inc	700
ESCO Technologies Inc	860	Saia Inc	697
Innospec Inc	841	Heidrick & Struggles International Inc	680
Vectrus Inc	827	MKS Instruments Inc	658
Kulicke & Soffa Industries Inc	737	Kennedy-Wilson Holdings Inc	654
Pason Systems Inc	716	Kadant Inc	590
nLight Inc	696	Inter Parfums Inc	579
Korn Ferry	688		
MasterCraft Boat Holdings Inc	685		
Forrester Research Inc	662		
Movado Group Inc	651		

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	477	Deutsche Telekom AG	616
SAP SE	460	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	408
Volkswagen AG	402	TOTAL SE	405
Carrefour SA	390	LEG Immobilien AG	382
Persimmon Plc	338	Novo Nordisk A/S	374
Securitas AB	332	Pandora A/S	374
Ageas SA/NV	325	Talanx AG	370
Yara International ASA	325	Royal Dutch Shell Plc 'A'	362
NN Group NV	315	Roche Holding AG	357
Electrolux AB	309	Publicis Groupe SA	340
SEB SA	307	Unilever Plc	337
J Sainsbury Plc	299	Helvetia Holding AG	329
Hargreaves Lansdown Plc	298	Swisscom AG	329
DCC Plc	286	CRH Plc	317
Valmet Oyj	282	Kesko Oyj	310
TAG Immobilien AG	273	Baloise Holding AG	296
Cie de Saint-Gobain	271	Evraz Plc	287
Rio Tinto Plc	156	Klepierre SA	276
Nordea Bank Abp	107	Novartis AG	264
Telenet Group Holding NV	96	Allianz SE	259
		Tate & Lyle Plc	252
		CRH Plc	246
		Swiss Prime Site AG	243
		Swedish Match AB	225
		IG Group Holdings Plc	222
		Kuehne + Nagel International AG	217
		GlaxoSmithKline Plc	213
		Logitech International SA	211
		Swedish Match AB	199
		Sanofi	175
		Koninklijke Ahold Delhaize NV	166
		Skandinaviska Enskilda Banken AB	159
		Bunzl Plc	156
		Coloplast A/S	154
		Galp Energia SGPS SA	151

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – (Fortsetzung)

	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
WICHTIGE VERKÄUFE	
Vodafone Group Plc	146
Direct Line Insurance Group Plc	143
Kingfisher Plc	140
Admiral Group Plc	138
Snam SpA	136
Endesa SA	135
Telefonica SA	135

Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
iShares MSCI All Country Asia ex Japan ETF – ETF	2.132	iShares MSCI All Country Asia ex Japan ETF – ETF	1.688
Bank of China Ltd	415	Guangdong Investment Ltd	384
PICC Property & Casualty Co Ltd	344	President Chain Store Corp	370
RHB Bank Bhd	325	MISC Bhd	356
JB Hi-Fi Ltd	236	China Aircraft Leasing Group Holdings Ltd	332
Asustek Computer Inc	189	Huaneng Power International Inc	331
Micro-Star International Co Ltd	168	HKT Trust & HKT Ltd	325
SinoPac Financial Holdings Co Ltd	157	SCI Pharmtech Inc	250
Malayan Banking Bhd	151	Nan Kang Rubber Tire Co Ltd	228
		Public Bank Bhd	215
		Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	186
		Lifestyle International Holdings Ltd	171
		Infosys Ltd	153
		Synnex Technology International Corp	145
		China Medical System Holdings Ltd	116
		Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	98
		Kindom Development Co Ltd	87
		Lite-On Technology Corp	86
		Asia Cement Corp	80
		Samsung Electronics Co Ltd	64
		Yuexiu Property Co Ltd	63
		Far East Horizon Ltd	62

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
PTT PCL	40	Tencent Holdings Ltd	303
Minor International PCL	33	Alibaba Group Holding Ltd ADR	163
Kasikornbank PCL	27	Naspers Ltd	115
PTT Global Chemical PCL	20	SK Innovation Co Ltd	108
CP ALL PCL	17	Formosa Petrochemical Corp	106
Home Product Center PCL	15	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	106
Advanced Info Service PCL	8	Korea Electric Power Corp	96
Krung Thai Bank PCL	4	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	96
Siam Commercial Bank PCL/The	4	Kweichow Moutai Co Ltd	95
Thai Union Group PCL	3	Central Pattana PCL	93
		China Petroleum & Chemical Corp	93
		Dialog Group Bhd	91
		Sberbank of Russia PJSC	91
		Astra International Tbk PT	90
		Xiaomi Corp 'B', 144A	90
		Reliance Industries Ltd	89
		Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	87
		OTP Bank Nyrt	85
		Petronas Chemicals Group Bhd	84
		ENN Energy Holdings Ltd	83

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Hewlett Packard Enterprise Co	122	Assicurazioni Generali SpA	168
Home Depot Inc/The	122	Kimco Realty Corp	162
Lite-On Technology Corp	112	Starwood Property Trust Inc	157
Johnson & Johnson	63	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	153
AT&T Inc	56	Ford Motor Co	149
Intel Corp	40	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A'	145
		Public Storage	137
		HKT Trust & HKT Ltd	129
		Klepierre SA	128
		Tohoku Electric Power Co Inc	111
		Petrobras Distribuidora SA	108
		Southern Co/The	105
		Sagen MI Canada Inc	87
		Pinnacle West Capital Corp	68
		Marubeni Corp	66
		Broadcom Inc	61
		Target Corp	55
		Snam SpA	53
		Mitsubishi Chemical Holdings Corp	48
		Oesterreichische Post AG	40

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE VERKÄUFE

	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Rio Tinto Ltd	40
CVS Health Corp	38
Quanta Computer Inc	29
Walmart Inc	28
Hershey Co/The	26
Talanx AG	25

Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^

WICHTIGE KÄUFE

LG Chem Ltd	1.825
Tongcheng-Elong Holdings Ltd	1.795
Alibaba Group Holding Ltd	1.476
United Overseas Bank Ltd	768
TravelSky Technology Ltd	767
Tencent Holdings Ltd	512
Samsung Electronics Co Ltd	493
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	429
HDFC Bank Ltd	410
AIA Group Ltd	395
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	352
Feng TAY Enterprise Co Ltd	336
ENN Energy Holdings Ltd	216
Jardine Matheson Holdings Ltd	213
Minth Group Ltd	186
Hero MotoCorp Ltd	177
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	174
Tata Consultancy Services Ltd	172
Singapore Technologies Engineering Ltd	169
Guangdong Investment Ltd	163
Techtronic Industries Co Ltd	162
Orion Corp/Republic of Korea	156
LG Household & Health Care Ltd	146
Shenzhou International Group Holdings Ltd	145
Venture Corp Ltd	127

KOSTEN (in Tsd.) USD

WICHTIGE VERKÄUFE

	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Coway Co Ltd	1.849
Godrej Consumer Products Ltd	1.284
Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.148
HDFC Bank Ltd ADR	9

Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^

WICHTIGE KÄUFE

Aalberts SA	828
Legrand SA	816
TOMRA Systems ASA	433

KOSTEN (in Tsd.) EUR

WICHTIGE VERKÄUFE

	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
SGS SA	1.968
Sika AG	1.963
Linde Plc	1.935
Bureau Veritas SA	1.816
BIM Biresik Magazalar AS	1.634
Cie de Saint-Gobain	1.500
OTP Bank Nyrt	1.492
Air Liquide SA	1.409
Poste Italiane SpA, 144A	1.374
Vontobel Holding AG	1.351
Siemens Gamesa Renewable Energy SA	1.310
Novo Nordisk A/S	1.295
Verbund AG	1.287
STMicroelectronics NV	1.197
VAT Group AG, 144A	1.194
Bakkafrost P/F	1.118
Royal Unibrew A/S	1.105
Britvic Plc	1.097
ABB Ltd	1.018
Fluidra SA	1.000
Legrand SA	976
Nexans SA	942
Aalberts SA	920
Schneider Electric SE	917
Autoliv Inc	911
Kingspan Group Plc	904
UniCredit SpA	890
TOMRA Systems ASA	870
JDE Peet's NV	839
Auto Trader Group Plc, 144A	802
Carlsberg AS	776
Orsted AS, 144A	693
Vestas Wind Systems A/S	686
Barclays Plc	659

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
NVIDIA Corp	5.033	Mettler-Toledo International Inc	4.542
Farfetch Ltd	4.892	Starbucks Corp	2.884
Autodesk Inc	3.936	CyberArk Software Ltd	2.435
Veeva Systems Inc 'A'	3.193	Accenture Plc 'A'	2.346
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.799	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.108
Kingspan Group Plc	2.275	Kingspan Group Plc	1.043
Microsoft Corp	2.207	Microsoft Corp	961
Atlas Copco AB	2.199	Atlas Copco AB	939
Moncler SpA	1.966	Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	921
Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	1.965	ResMed Inc	865
Masimo Corp	1.956	L'Oreal SA	856
L'Oreal SA	1.906	Moncler SpA	849
Linde Plc	1.887	Masimo Corp	841
Mastercard Inc	1.852	Illumina Inc	812
Illumina Inc	1.819	NVIDIA Corp	805
ResMed Inc	1.784	Linde Plc	804
Tencent Holdings Ltd	1.668	Veeva Systems Inc 'A'	763
Assa Abloy AB	1.612	Adobe Inc	738
AIA Group Ltd	1.610	Hexagon AB	736
ANSYS Inc	1.588	Mastercard Inc	731
Adobe Inc	1.580	Kering SA	729
Kering SA	1.561	Assa Abloy AB	689
Coloplast A/S	1.437	ANSYS Inc	647
adidas AG	1.436	Coloplast A/S	642
CSL Ltd	1.432	Farfetch Ltd	632
Ferrari NV	1.429	AIA Group Ltd	619
Kerry Group Plc	1.330	adidas AG	605
Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.323	CSL Ltd	605
Hexagon AB	1.212	Ferrari NV	587
Mettler-Toledo International Inc	1.152	Kerry Group Plc	561
Starbucks Corp	675	Tencent Holdings Ltd	554
		Alibaba Group Holding Ltd ADR	481
		Autodesk Inc	428

Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Guangdong Investment Ltd	597	CapitaLand Integrated Commercial Trust	797
Frasers Centrepoint Trust	408	Hui Xian Real Estate Investment Trust	698
AusNet Services Ltd	401	Dexus REIT	628
Digital Telecommunications Infrastructure Fund	327	APA Group	420
Scentre Group	307	CLP Holdings Ltd	201
Transurban Group	263	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	199
Manila Electric Co	206	Kiwi Property Group Ltd	192
Contact Energy Ltd	203	Mapletree Industrial Trust	111
Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	196	Link REIT	108
Vicinity Centres	194	Contact Energy Ltd	84
Spark Infrastructure Group	193	Fortune Real Estate Investment Trust	69
CLP Holdings Ltd	172	Stockland	41
Dexus REIT	168	Keppel DC REIT	1
Embassy Office Parks REIT	156		
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	122		
NHPC Ltd	113		
Stockland	98		
GPT Group/The	70		
Link REIT	70		
Petronas Gas Bhd	70		
Ascendas India Trust	56		
Charter Hall Long WALE REIT	45		

Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Samsung Electronics Co Ltd	945	EPAm	
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	917	Systems Inc	664
Tencent Holdings Ltd	842	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	569
Sea Ltd ADR	801	Largan Precision Co Ltd	369
China Merchants Bank Co Ltd	751	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	210
Alibaba Group Holding Ltd ADR	621	Samsung Electronics Co Ltd	199
ICICI Bank Ltd	560	Southern Copper Corp	191
Globalwafers Co Ltd	374	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	160
LG Chem Ltd	366	TCS Group Holding Plc GDR	158
Antofagasta Plc	361	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS	156
Meituan 'B', 144A	361	Tencent Holdings Ltd	155
EPAm Systems Inc	308	Alibaba Group Holding Ltd ADR	130
Titan Co Ltd	301	LG Chem Ltd	81
OTP Bank Nyrt	269	Meituan 'B', 144A	66
Prosus NV	269	Titan Co Ltd	66
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	253	OTP Bank Nyrt	58
AIA Group Ltd	248	Prosus NV	53
		AIA Group Ltd	51

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^– (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Reliance Industries Ltd	215	ICICI Bank Ltd	46
SK Hynix Inc	206	NAVER Corp	46
NAVER Corp	205	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	46
Asian Paints Ltd	190	Reliance Industries Ltd	45
Samsung SDI Co Ltd	182		
Sunny Optical Technology Group Co Ltd	178		
JD.com Inc ADR	176		
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	165		
Maruti Suzuki India Ltd	164		
China Gas Holdings Ltd	160		
Contemporary Amperex Technology Co Ltd	159		
HDFC Bank Ltd	158		
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	154		
UltraTech Cement Ltd	150		
LUKOIL PJSC ADR	144		
TCS Group Holding Plc GDR	136		
B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	131		
Sberbank of Russia PJSC ADR	128		
Ping An Bank Co Ltd	127		

Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
ASML Holding NV	7.828	Moncler SpA	4.045
Ambu A/S 'B'	7.088	CyberArk Software Ltd	2.658
Moncler SpA	5.422	Temenos AG	939
Kering SA	5.387	ASML Holding NV	410
Ferrari NV	5.243	JDE Peet's NV	322
Allfunds Group Plc	4.824		
Farfetch Ltd	4.339		
Atlas Copco AB	4.202		
Infineon Technologies AG	4.178		
Assa Abloy AB	3.961		
Mettler-Toledo International Inc	3.880		
adidas AG	3.863		
Sartorius Stedim Biotech	3.785		
Kingspan Group Plc	3.672		
Partners Group Holding AG	3.597		
L'Oreal SA	3.594		
Linde Plc	3.452		
Dassault Systemes SE	3.034		
Nemetschek SE	2.999		
Hexagon AB	2.984		
THG Plc	2.725		
Kerry Group Plc	2.489		
Coloplast A/S	2.340		
Temenos AG	1.528		
InPost SA	1.223		
Hexagon AB	1.185		

^ 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 und Total Return Swaps sowie der absolute beizulegende Zeitwert als Anteil des Nettoinventarwerts jedes Fonds, analysiert nach Gegenparteien, zum 31. August 2021 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	80.000	80.000	8,77
JP Morgan	USA	80.176	80.176	8,80
Royal Bank of Canada	Kanada	50.000	50.000	5,48
		210.176	210.176	23,05

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	3.948	3.948	0,70
JP Morgan	USA	4.048	4.048	0,71
		7.996	7.996	1,41

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 2021 aufgeführt:

Fonds	Emittent der Sicherheit*	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	United States Treasury	US-Dollar	214.380 USD

* Wenn zum 31. August 2021 weniger als zehn Emittenten von Sicherheiten vorhanden waren, wurden alle Emittenten aufgenommen.

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Art und der Qualität der erhaltenen unbaren Sicherheiten zum 31. August 2021:

Fonds	Art der Sicherheit	Qualität der Sicherheit	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen	Investment Grade	214.380 USD

Die nachfolgende Laufzeitanalyse basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitstermin der umgekehrten Rückkaufvereinbarungen und Total Return Swaps sowie der zugehörigen erhaltenen/(gestellten) Sicherheiten zum 31. August 2021.

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	-	\$210.176	-	-	-	-	-	\$ 210.176
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Erhaltene unbare Sicherheiten Total Return Swaps	-	-	-	-	-	\$ 7.996	-	\$ 7.996

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 2021 werden in getrennten Konten bei The Bank of New York Mellon im Namen des Unternehmens gehalten. Erhaltene Sicherheiten werden nicht weiterverwendet.

Total Return Swaps werden bilateral abgewickelt. Es werden keine Sicherheiten bereitgestellt oder erhalten, um die Positionen der Total Return Swaps zum 31. August 2021 zu öffnen.

Alle Kosten und Renditen aus umgekehrten Rückkaufvereinbarungen, Total Return Swaps laufen in voller Höhe für den Fonds auf.

