

# Jahresbericht und geprüfter Abschluss

**Legg Mason**

**Global Funds Plc**

Ein Dachfonds mit getrennter  
Haftung zwischen Teilfonds

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022

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, Royce Global Small Cap Premier 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 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 (Kaptalanlagegesetzbuch) gemeldet.

# Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Informationen	3
Schreiben an die Gesellschafter	16
Bericht des Verwaltungsrats	17
Bericht der unabhängigen Wirtschaftsprüfer	38
Bericht der Verwahrstelle	40
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	41
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	42
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	53
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	70
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	74
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	77
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	82
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	87
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	90
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	92
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	96
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	99
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	101
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	104
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>	110
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	114
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	116
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	126
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	136
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>	142
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup>	149
Anlageportfolio – Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	152
Anlageportfolio – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	159
Anlageportfolio – Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	164
Anlageportfolio – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	166
Anlageportfolio – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>	170
Anlageportfolio – Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	172
Anlageportfolio – Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	174
Anlageportfolio – Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	177
Anlageportfolio – Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	182
Anlageportfolio – Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund <sup>^</sup>	184
Anlageportfolio – Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	186
Anlageportfolio – Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund <sup>^</sup>	188
Anlageportfolio – Legg Mason ClearBridge Value Fund	190
Anlageportfolio – Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	192
Anlageportfolio – Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	194
Anlageportfolio – Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	196
Anlageportfolio – Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	198
Anlageportfolio – Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund <sup>^</sup>	200
Anlageportfolio – Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	202
Anlageportfolio – Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup>	203
Anlageportfolio – Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup>	205
Anlageportfolio – Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup>	206
Anlageportfolio – Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	207
Anlageportfolio – Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	211
Anlageportfolio – Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>	213
Anlageportfolio – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund	214
Anlageportfolio – Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	216
Anlageportfolio – Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>^</sup>	218
Anlageportfolio – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund	219
Anlageportfolio – Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	221
Anlageportfolio – Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	222
Anlageportfolio – Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	223
Anlageportfolio – Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	225
Anlageportfolio – Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>	226
Bilanz – Legg Mason Global Funds Plc	228
Gesamtergebnisrechnung – Legg Mason Global Funds Plc	248
Entwicklung des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreiben ist – Legg Mason Global Funds Plc	258
Erläuterungen zum Abschluss - Legg Mason Global Funds Plc	288

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Inhaltsverzeichnis – (Fortsetzung)

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft) – Legg Mason Global Funds Plc	366
Ergänzende Informationen – Fondsperformancedaten (ungeprüft) – Legg Mason Global Funds Plc	373
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	386
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	386
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	386
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	387
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	387
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	387
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	388
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	388
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	388
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	389
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	389
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	389
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	390
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	390
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>	390
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	391
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	391
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	392
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	392
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>	392
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup>	393
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	393
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	394
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	394
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	395
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>	395
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	396
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	396
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	396
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	397
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund <sup>^</sup>	397
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	397
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund <sup>^</sup>	398
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason ClearBridge Value Fund	398
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	399
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	399
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	400
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	400
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund <sup>^</sup>	401
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	401
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup>	402
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup>	402
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup>	403
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Royal US Small Cap Opportunity Fund	403
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	403
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>	404
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund	404
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	405
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>^</sup>	405
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund	406
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	406
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>^</sup>	407
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	407
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	408
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	408
Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>	408
OGAW-Vergütungsrichtlinie (ungeprüft)	410
Anhang: Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFTR)	411
Anhang: Offenlegung verbundener Personen	412

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Allgemeine Informationen

## Verwaltungsrat

Joseph Carrier (USA)  
 Fionnuala Doris (Irland) (unabhängig)  
 William Jackson (Vereinigtes Königreich)  
 Joseph Keane (Irland) (unabhängig)  
 Joseph LaRocque (USA)  
 Jaspal Sagger (Großbritannien)  
 Jane Trust (USA)

## Geschäftssitz

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

## Secretary

Bradwell Limited  
 Ten Earlsfort Terrace, Dublin 2  
 Irland

## Master Distributor und Master Shareholder Servicing Agent

Franklin Distributors, LLC  
 (gültig ab 9. August 2021)  
 Ein Franklin Parkway  
 San Mateo, CA 94403  
 USA

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

## Zusätzliche Vertriebshändler und Aktionärs-Servicestellen

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

Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc.  
 (gültig ab 3. Mai 2021)  
 8F, Nr. 87  
 Abschn. 4, Zhong Xiao E. Rd., Taipeh  
 Taiwan

Legg Mason Investments (Europe) Limited  
 (mit Stand vom 7. August 2021 eingestellt)  
 201 Bishopsgate  
 EC2M 3AB London  
 Großbritannien

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

Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited  
 7 Temasek Boulevard, Nr. 38 03  
 Suntec Tower One  
 Singapur, 038987

Legg Mason Investments (Taiwan) Ltd.  
 (mit Stand vom 3. Mai 2021 eingestellt)  
 55. Etage – 1, Taipei 101 Tower  
 Nr. 7, Xin Yi Road  
 Section 5, Taipei, 110  
 Taiwan

## Status des meldenden Fonds und des Vertriebshändlers (nur für britische Anteilhaber relevant)

Aktionäre in Großbritannien können anhand der Liste des HM Revenue and Customs' Reporting Fund auf der Website <https://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds> ermitteln, welche Anteilsklassen der Gesellschaft in das britische Berichtsfondssystem aufgenommen wurden und welche Anteilsklassen den britischen Berichtsstatus erhalten haben. Diese Liste wird von HM Revenue and Customs monatlich aktualisiert.

Weitere Informationen finden Sie im ergänzenden Prospekt für Anleger aus dem Vereinigten Königreich oder wenden Sie sich an 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  
 Wirtschaftsprüfer und gesetzlich vorgeschriebene Wirtschaftsprüfungsgesellschaft  
 One Spencer Dock  
 North Wall Quay, Dublin 1  
 Irland

## Verwaltungsstelle

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

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter(n)
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund*	27. Februar 2004	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund*	24. Februar 2004	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, Nr. 23-01 Singapur 049145</p>
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund*	21. Oktober 2011	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</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, Nr. 23-01 Singapur 049145</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliarios Limitada Durchschn. Pres. Juscelino Kubitschek Nr. 1455 – 15. Etage – 04543011 Sao Paulo - Brasilien</p>
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund*	20. April 2007	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, Nr. 23-01 Singapur 049145</p>
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund <sup>^*b</sup>	20. April 2007 (Handel eingestellt am 8. November 2019)	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter(n)
<b>Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund<sup>A*</sup></b>	20 April 2007 (Handel eingestellt am 2. August 2019)	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
<b>Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund*</b>	20 April 2007	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
<b>Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund*</b>	12 Juni 2008	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, Nr. 23-01 Singapur 049145</p>
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund*</b>	3 Juni 2009	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</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, Nr. 23-01 Singapur 049145</p>

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter(n)
<b>Legg Mason Western Asset UK£ Core Plus Bond Fund<sup>^*p</sup></b>	19 November 2010 (Handel eingestellt am 24. Februar 2014)	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, Nr. 23-01 Singapur 049145</p>
<b>Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^*</sup></b>	3 Dezember 2010	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, Nr. 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>
<b>Legg Mason Western Asset UK£ Long Duration Fund<sup>^*p</sup></b>	19 November 2010 (Handel eingestellt am 24. Februar 2014)	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, Nr. 23-01 Singapur 049145</p>
<b>Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>^*</sup></b>	19 November 2010	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, Nr. 23-01 Singapur 049145</p> <p>Western Asset Management Company Pty Limited Ebene 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australien</p>

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter(n)
<b>Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund*</b>	3 Dezember 2010	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, Nr. 23-01 Singapur 049145</p>
<b>Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^*</b>	5 September 2013	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</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, Nr. 23-01 Singapur 049145</p>
<b>Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^**</b>	16 Dezember 2015 (Handel eingestellt am 10. Dezember 2019)	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
<b>Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^**</b>	16 Dezember 2015	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliarios Limitada Durchschn. Pres. Juscelino Kubitschek Nr. 1455 – 15. Etage – 04543011 Sao Paulo - Brasilien</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, Nr. 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(n)
<b>Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund<sup>^*b</sup></b>	31 Dezember 2015 (Handel eingestellt am 13. November 2019)	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, Nr. 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 Ebene 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australien</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Durchschn. Pres. Juscelino Kubitschek Nr. 1455 – 15. Etage – 04543011 Sao Paulo - Brasilien</p>
<b>Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^*</sup></b>	13 Januar 2016	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
<b>Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^*</sup></b>	13 Januar 2016	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
<b>Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^*</sup></b>	17 November 2016	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, Nr. 23-01 Singapur 049145</p>

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter(n)
<b>Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^*</sup></b>	17 November 2016	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
<b>Legg Mason Western Asset Infrastructure Debt Fund<sup>†*^</sup></b>		<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</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, Nr. 23-01 Singapur 049145</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliarios Limitada Durchschn. Pres. Juscelino Kubitschek Nr. 1455 – 15. Etage – 04543011 Sao Paulo - Brasilien</p>
<b>Legg Mason Western Asset Short-Dated High Yield Fund<sup>†*^</sup></b>		<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
<b>Legg Mason Western Asset Asian Income Fund<sup>*†</sup></b>		<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, Nr. 23-01 Singapur 049145</p>
<b>Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund<sup>^*</sup></b>	11. Januar 2021	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter(n)
<b>Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^*</sup></b>	10. Januar 2022	<p><b>Anlageverwalter:</b> Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p><b>Unteranlageverwalter:</b> Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, Nr. 23-01 Singapur 049145</p> <p>Western Asset Management Company Pty Limited Ebene 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australien</p>
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund<sup>*</sup></b>	1 Oktober 2003	<p><b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA</p>
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^*</sup></b>	3 April 2012	<p><b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA</p>
<b>Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund<sup>^*</sup></b>	30 November 2012	<p><b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA</p>
<b>Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund<sup>*</sup></b>	25 Juni 2010	<p><b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA</p>
<b>Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund<sup>^*p</sup></b>	10. Mai 2012 (Handel eingestellt am 25. Februar 2021)	<p><b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA</p>
<b>Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund<sup>*</sup></b>	3 Juni 2013	<p><b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA</p>
<b>Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^*</sup></b>	30 Juni 2014	<p><b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA</p>
<b>Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^***</sup></b>	31 Dezember 2015	<p><b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA</p>
<b>Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^*</sup></b>	6 April 2017	<p><b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA</p>

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter(n)
<b>Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund**^</b>	9 Dezember 2016	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited Ebene 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien:
<b>Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund**^</b>	31 März 2017	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited Ebene 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien:
<b>Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund**^</b>	30. April 2021	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited Ebene 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien:
<b>Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund**</b>	8 November 2002	<b>Anlageverwalter:</b> Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
<b>Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund**</b>	1 März 2004	<b>Anlageverwalter:</b> Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
<b>Royce Global Small Cap Premier Fund^**</b>	1. Dezember 2021	<b>Anlageverwalter:</b> Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
<b>Legg Mason MV European Equity Growth and Income Fund**</b> (vormals Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund; umbenannt am 9. August 2021)	30 August 2002	<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Advisers, Inc.† Ein Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
<b>Legg Mason MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund**</b> (ehemals Legg Mason QS MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund; umbenannt am 9. August 2021)	25. Februar 2004	<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Advisers, Inc.† Ein Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
<b>Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund**b</b>	20 April 2007 (Handel eingestellt am 25. Februar 2015)	
<b>Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund**b</b>	28 April 2008 (Handel eingestellt am 14. April 2021)	<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Advisers, Inc.† Ein Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
<b>Legg Mason MV Global Equity Growth and Income Fund**</b> (ehemals Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund; umbenannt am 9. August 2021)	29 Dezember 2010	<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Advisers, Inc.† Ein Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
<b>Legg Mason QS US Large Cap Fund^**</b>		<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Advisers, Inc.† Ein Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
<b>Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund**^</b>	11 März 2016	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland  <b>Unteranlageverwalter:</b> Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited 1. George Street, #23-02 Singapur 049145

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter(n)
<b>Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund**<sup>Ab</sup></b>	11 März 2016 (Handel eingestellt am 21. August 2019)	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland  <b>Unteranlageverwalter:</b> Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited 1 George Street, #23-02 Singapur 049145
<b>Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund**<sup>b</sup></b>	11 März 2016 (Handel eingestellt am 1. Juni 2021)	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
<b>Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund**<sup>Ab</sup></b>	11 März 2016 (Handel am 31. Juli 2017 eingestellt)	
<b>Legg Mason Martin Currie Greater China Fund**<sup>Ab</sup></b>	11 März 2016 (Handel eingestellt am 15. November 2019)	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
<b>Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund**<sup>Ab</sup></b>	11 März 2016 (Handel eingestellt am 31. Mai 2019)	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
<b>Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund**<sup>A</sup></b>	28 Juni 2016	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
<b>Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund**</b>	28 Juni 2016	<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Templeton Australia Limited (ehemals Legg Mason Asset Management Australia Limited, änderte seinen Namen am 1. Oktober 2021) Ebene 47 120 Collins Street, Melbourne VIC 3000 Australien:
<b>Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund**<sup>A</sup></b>	24 November 2017	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
<b>Legg Mason Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund**<sup>A</sup></b>		<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
<b>Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund**<sup>Ab</sup></b>	1 März 2018 (Handel eingestellt am 20. September 2019)	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
<b>Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund**<sup>A</sup></b>	9 November 2018	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

<sup>†</sup> Zum Ende des Geschäftsjahres haben diese Fonds noch nicht mit dem Handel begonnen.

<sup>^</sup> Nicht für den Verkauf an die Öffentlichkeit in Hongkong zugelassen.

<sup>μ</sup> Geldmarktfonds.

\* Rentenfonds (Fonds, die hauptsächlich in festverzinsliche und verzinsliche Wertpapiere investieren).

\*\* Aktienfonds (Fonds, die hauptsächlich in Aktien investieren).

\*\*\* Multi-Asset-Fonds (jeder Fonds, der in der entsprechenden Prospektergänzung als „Multi-Asset-Fonds“ definiert ist).

<sup>μ</sup> Bis zum Widerruf der Ermächtigung der Zentralbank.

<sup>†</sup> Mit Wirkung vom 9. August 2021 fusionierte QS Investors, LLC, 880 Third Avenue, 7th Floor, New York, NY 10022, USA, 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.franklinresources.com](http://www.franklinresources.com)

Für zugelassene Broker in Nord-, Süd- und Mittelamerika

Franklin Templeton Investitionen  
1395 Brickell Avenue  
Suite 1550  
Miami, Florida 33131, USA  
Tel.: + 305 529 4400

[www.franklintempletonoffshore.com](http://www.franklintempletonoffshore.com)

Auf den jeweiligen Internetseiten finden Sie Informationen über:

- Tagespreise
- Literatur, einschließlich Datenblätter mit den neuesten Informationen zu jedem Fonds
- Weitere Informationen über Franklin Templetons Vermögensverwaltungsgesellschaften, die die Fonds verwalten

# Brief an die Anteilsinhaber

## Sehr geehrte Anteilsinhaberin, sehr geehrter Anteilsinhaber,

Wir freuen uns, Ihnen den Jahresbericht für Legg Mason Global Funds Plc (die „Gesellschaft“) für den am 28. Februar 2022 zu Ende gegangenen Zwölfmonatszeitraum zukommen zu lassen. In diesem Bericht heben wir die Haupttreiber der Entwicklung der Anleihe- und Aktienmärkte während des Berichtszeitraums hervor.

### Bericht über die Weltwirtschaft

Die globalen Volkswirtschaften waren weiterhin von COVID-19 und seinen Varianten, der stark steigenden Inflation sowie der Geld- und Fiskalpolitik betroffen. Ende des Zeitraums fügte der Ausbruch des Krieges in der Ukraine eine weitere Unsicherheit hinzu. In seinem *Weltwirtschaftsausblick* vom Januar 2022 sagte der Internationale Währungsfonds („IWF“): „Die Weltwirtschaft geht schwächer ins Jahr 2022 als bisher erwartet. Da sich die neue COVID-19-Variante von Omicron ausbreitet, haben die Länder die Mobilitätsbeschränkungen wieder eingeführt. Steigende Energiepreise und Versorgungsunterbrechungen haben zu einer höheren und breiteren Inflation als erwartet geführt, insbesondere in den Vereinigten Staaten und vielen Schwellenländern und Entwicklungsländern. Die anhaltende Knappheit des chinesischen Immobiliensektors und die langsamere Erholung des privaten Konsums haben ebenfalls begrenzte Wachstumsaussichten.“ Aus regionaler Sicht erwartet der IWF für 2022 ein BIP-Wachstum in den USA von 4,0 %, verglichen mit einer Expansion von 5,6 % im Jahr 2021. Darüber hinaus erwartet der IWF für 2022 ein BIP-Wachstum in der Eurozone, in Großbritannien und Japan von 3,9 %, 4,7 % bzw. 3,3 %. Zum Vergleich: Das BIP dieser Volkswirtschaften stieg 2021 um 5,2 %, 7,2 % bzw. 1,6 %.

### Marktrückblick – Anleihen<sup>i</sup>

Der globale Rentenmarkt erzielte im Berichtszeitraum schwache Ergebnisse. In den USA stiegen die Renditen kurzfristiger US-Staatsanleihen stark an, da das Federal Reserve Board („Fed“)<sup>ii</sup> begann, seine Anleihekäufe zu reduzieren. Darüber hinaus hat die Zentralbank mit der Inflation ein 40-Jahres-Hoch erreicht und darauf hingewiesen, dass sie bald mit der Anhebung des Leitzinses beginnen würde.<sup>iii</sup> Die Fed begann dann, die Zinsen im März 2022 nach Ende des Berichtszeitraums anzuheben, und rechnet mit sechs weiteren Zinserhöhungen vor Jahresende. Die Renditen langfristiger US-Staatsanleihen stiegen ebenfalls, da das Wirtschaftswachstum widerstandsfähig war und angesichts der erhöhten Inflation (Rendite und Preise bewegen sich in die entgegengesetzte Richtung). Die Renditen zehnjähriger US-Staatsanleihen begannen den Berichtszeitraum mit 1,44 % und beendeten den Berichtszeitraum mit 1,83 %. Dieser Trend trat auch in einer Reihe von Industrieländern außerhalb der USA auf. Insgesamt verzeichneten die Spread-Sektoren (Nicht-US-Staatsanleihen), darunter Investment-Grade-<sup>iv</sup>-Unternehmensanleihen, Unternehmensanleihen mit niedrigerem Rating<sup>v</sup> auf US-Dollar lautende Staatsanleihen aus Schwellenländern, negative Renditen.

### Marktbewertung – Globale Aktien<sup>vi</sup>

Der globale Aktienmarkt erzielte im Berichtszeitraum gemischte Ergebnisse. Den Markt unterstützten die Einführung mehrerer COVID-19-Impfstoffe, das Wirtschaftswachstum und die Unternehmensgewinne, die häufig die Erwartungen übertrafen. Diese positiven Entwicklungen wurden jedoch durch die Erwartung einer Straffung der Geldpolitik und eine Reihe geopolitischer Ereignisse, einschließlich des Krieges in der Ukraine, ausgeglichen. Insgesamt erzielten US-Aktien im Berichtszeitraum starke Ergebnisse. Aktien aus Industrieländern legten zu, wenn auch in geringem Umfang, während Schwellenländeraktien schwache Ergebnisse erzielten.

<sup>i</sup> Festertrag – Anleihen.

<sup>ii</sup> US Federal Reserve – die Zentralbank der Vereinigten Staaten und das mächtigste Finanzinstitut der Welt.

<sup>iii</sup> Der Bundesfondssatz ist der vom Offenmarktausschuss des Bundes festgelegte Zielzinssatz, zu dem Geschäftsbanken einander über Nacht ihre Überschussreserven leihen und verleihen.

Wir danken Ihnen für Ihr anhaltendes Vertrauen.

Mit freundlichen Grüßen

Franklin Templeton International Services S.à r.l

März 2022

*Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein zuverlässiger Hinweis auf zukünftige Ergebnisse. Die Informationen sind nicht als Prognose zukünftiger Ereignisse, Garantie zukünftiger Ergebnisse oder Anlageberatung gedacht.*

Alle Daten zum 28. Februar 2022, sofern nicht anders angegeben.

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.

Diese Informationen wurden aus Quellen erstellt, die als zuverlässig erachtet werden, die jedoch nicht von der Gesellschaft oder dem verbundenen Unternehmen von Franklin Resources, Inc. (zusammen „Franklin Templeton“) garantiert werden, und stellen keine vollständige Zusammenfassung oder Aussage aller verfügbaren Daten dar.

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 andere relevante Dokumente können in einer Reihe von Sprachen bei BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company, One Dockland Central, Guild Street, IFSC, Dublin 1, Irland, [www.franklinresources.com](http://www.franklinresources.com) und am eingetragenen Sitz bezogen werden.

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

<sup>iv</sup> Investment Grade – eine Bonität, die bedeutet, dass eine Staats- oder Unternehmensanleihe ein relativ geringes Ausfallrisiko aufweist.

<sup>v</sup> Unternehmensanleihe – eine Anleihe, die von einem Unternehmen ausgegeben wird, um effektiv Geld zu sammeln, um sein Geschäft auszubauen.

<sup>vi</sup> Eigenkapital – Beteiligung an einer Kapitalgesellschaft in Form von Stammaktien oder Vorzugsaktien.

# Bericht des Verwaltungsrats

Die Direktoren der Gesellschaft (die „Direktoren“) legen ihren Jahresbericht zusammen mit dem geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 vor.

## Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat ist für die Erstellung des Berichts des Verwaltungsrats und des Abschlusses gemäß irischem Recht verantwortlich.

Gemäß irischem Gesellschaftsrecht ist der Verwaltungsrat verpflichtet, für jedes Geschäftsjahr einen Abschluss zu erstellen, der ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage der Gesellschaft zum Ende des Geschäftsjahrs und des Gewinns oder Verlustes der Gesellschaft für das Geschäftsjahr vermittelt. Der Verwaltungsrat hat den Abschluss im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen einschließlich des Financial Reporting Standard („FRS“) 102: „Der im Vereinigten Königreich und in der Republik Irland geltende Financial Reporting Standard“ („FRS102“).

Gemäß irischem Gesellschaftsrecht darf der Verwaltungsrat den Abschluss nur genehmigen, wenn er davon überzeugt ist, dass er ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage der Gesellschaft zum Ende des Geschäftsjahrs und des Gewinns oder Verlustes der Gesellschaft für das Geschäftsjahr vermittelt.

Bei der Erstellung dieses Abschlusses muss der Verwaltungsrat:

- geeignete Rechnungslegungsgrundsätze auswählen und dann konsequent anwenden;
- Beurteilungen und Schätzungen zu treffen, die angemessen und umsichtig sind;
- Angabe, ob der Abschluss in Übereinstimmung mit den geltenden Rechnungslegungsstandards erstellt wurde, und Identifizierung der betreffenden Standards, vorbehaltlich wesentlicher Abweichungen von diesen Standards, die in den Anmerkungen zum Abschluss offengelegt und erläutert werden; und
- den Jahresabschluss auf der Grundlage der Unternehmensfortführung zu erstellen, es sei denn, es ist unangemessen anzunehmen, dass das Unternehmen seine Geschäftstätigkeit fortführen wird.

Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, sicherzustellen, dass angemessene Aufzeichnungen geführt werden, die ausreichend sind, um:

- die Transaktionen des Unternehmens korrekt aufzuzeichnen und zu erklären;
- die Vermögenswerte, Verbindlichkeiten, Finanzlage und Gewinne oder Verluste der Gesellschaft jederzeit mit angemessener Genauigkeit zu begleichen; und
- Den Verwaltungsrat zu befähigen, sicherzustellen, dass der Jahresabschluss den Anforderungen des Companies Act von 2014 entspricht und die Prüfung dieser Abschlüsse ermöglicht.

Zu diesem Zweck hat der Verwaltungsrat einen erfahrenen Verwalter, BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company ernannt, um die Geschäftsbücher zu führen und weitere Verwaltungsaufgaben wahrzunehmen.

Der Verwaltungsrat ist außerdem dafür verantwortlich, das Vermögen der Gesellschaft zu schätzen. In Erfüllung dieser Verantwortung haben sie The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch, damit beauftragt, die Vermögenswerte der Gesellschaft in Übereinstimmung mit der Satzung der Gesellschaft zu verwahren. Der Verwaltungsrat ist außerdem dafür verantwortlich, angemessene Maßnahmen zur Verhinderung betrügerischer Handlungen und anderer Unregelmäßigkeiten sowie zu deren Aufdeckung zu ergreifen.

Die Verwaltungsratsmitglieder sind für die Pflege und Integrität der Jahresabschlüsse der Gesellschaft verantwortlich, die auf der Website der verbundenen Unternehmen von Franklin Templeton enthalten sind, die die Fonds vertreiben. Die für die Erstellung und Veröffentlichung von Abschlüssen geltenden Rechtsvorschriften in Irland können von den Rechtsvorschriften anderer Länder abweichen.

## Überprüfung von Geschäfts- und zukünftigen Entwicklungen

Der Brief an die Anteilinhaber auf Seite 16 beinhaltet eine Darstellung der Faktoren, die zur Performance der Fonds im Berichtsjahr beigetragen haben. Die Verwaltungsratsmitglieder erwarten keine Änderungen der Anlageziele der bestehenden Fonds, außer wie in Anmerkung 16 – Nachfolgende Ereignisse dieses Jahresabschlusses angegeben.

Zum 28. Februar 2022 ist die Gesellschaft mit 54 aktiven Fonds (2021: 53 Fonds) in Betrieb. Einzelheiten zu ihren Nettoinventarwerten zum 28. Februar 2022 sind in der Bilanz auf den Seiten 226 bis 245 offengelegt.

Mit Wirkung zum 14. April 2021 stellte der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

Mit Wirkung zum 30. April 2021 begann der Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup> mit dem Handel.

Mit Wirkung zum 1. Juni 2021 stellte der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

Mit Wirkung zum 1. Dezember 2021 begann der Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup> mit dem Handel.

Mit Wirkung zum 10. Januar 2022 begann der Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup> mit dem Handel.

## Ziele und Richtlinien des Risikomanagements

Informationen zu bestimmten Zielen und Grundsätzen des Risikomanagements der Gesellschaft sind in Erläuterung 12 zum Abschluss enthalten.

## Ergebnisse für das Jahr und den Stand der Dinge am 28. Februar 2022

Die Bilanz zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 sowie die Gesamtergebnisrechnung für die Geschäftsjahre zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 sind auf den Seiten 226 bis 245 bzw. 246 bis 255 dargelegt.

## Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen

Die Ausschüttungen an die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile für die Geschäftsjahre zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 sind in der Gesamtergebnisrechnung dargelegt.

## Signifikante Ereignisse

Siehe Erläuterung 14 mit Einzelheiten zu bedeutenden Ereignissen im Geschäftsjahresverlauf.

## Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Siehe Erläuterung 16 mit Einzelheiten zu wichtigen Ereignissen nach dem Jahresende.

## Direktoren

Die Namen der Personen, die derzeit Verwaltungsratsmitglieder sind oder die zu irgendeinem Zeitpunkt während des Geschäftsjahrs als Verwaltungsratsmitglied tätig waren, sind unten aufgeführt.

Joseph Carrier (USA)  
 Fionnuala Doris (Irland) (unabhängig)  
 William Jackson (Vereinigtes Königreich)  
 Joseph Keane (Irland) (unabhängig)  
 Joseph LaRocque (USA)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

## Direktoren – (Fortsetzung)

Jaspal Sagger (Großbritannien)  
Jane Trust (USA)

## Interessen der Direktoren und des Sekretärs

Der Verwaltungsrat und der Sekretär und ihre Familien hatten zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 keine Anteile an den Aktien der Gesellschaft. Kein Verwaltungsratsmitglied hatte zu irgendeinem Zeitpunkt während des Geschäftsjahres ein wesentliches Interesse an einem bedeutenden Vertrag, der während oder am Ende des Geschäftsjahres in Bezug auf das Geschäft der Gesellschaft bestand.

## Erklärung zur Unternehmensführung

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft (der „Verwaltungsrat“) hat alle Maßnahmen bewertet, die im freiwilligen Corporate Governance Code für Organismen für gemeinsame Anlagen und Verwaltungsgesellschaften enthalten sind, der von den Irish Funds im Dezember 2011 veröffentlicht wurde (der „Irish Funds Code“). Der Verwaltungsrat hat alle Praktiken und Verfahren des Corporate Governance-Code im Irish Funds Code übernommen.

## Compliance-Erklärung des Direktors

Die Unternehmenspolitik der Gesellschaft ist darauf ausgerichtet, die einschlägigen Verpflichtungen (gemäß dem Companies Act von 2014) zu erfüllen. Gemäß Section 225(2) des Companies Act von 2014 bestätigt der Verwaltungsrat, dass er dafür verantwortlich ist, die Erfüllung der einschlägigen Verpflichtungen sicherzustellen. Der Verwaltungsrat hat eine Grundsatzerklärung zur Compliance gemäß Section 225(3)(a) des Companies Act von 2014 entwickelt, sowie eine Compliance-Richtlinie in Bezug auf die bestehenden Vorkehrungen und Strukturen, die nach Ansicht des Verwaltungsrats darauf ausgerichtet sind, die einschlägigen Verpflichtungen der Gesellschaft im Wesentlichen zu erfüllen. Bei der Erfüllung seiner Aufgaben gemäß Section 225 stützte sich der Verwaltungsrat unter anderem auf Dienstleistungen, Empfehlungen und/oder Zusicherungen Dritter, die nach Ansicht des Verwaltungsrats über die erforderlichen Kenntnisse und Erfahrungen verfügen, um die wesentliche Erfüllung der einschlägigen Verpflichtungen der Gesellschaft sicherzustellen.

## Relevante Audit-Informationen

Soweit dem Verwaltungsrat bekannt ist, liegen keine relevanten Prüfungsinformationen vor, die den Abschlussprüfern der Gesellschaft nicht bekannt sind, und der Verwaltungsrat hat alle Schritte unternommen, die von ihm erwartet werden, um alle relevanten Prüfungsinformationen zu erlangen und sicherzustellen, dass den Abschlussprüfern der Gesellschaft diese Informationen bekannt sind.

## Transaktionen mit verbundenen Personen

In Regulation 43(1) der Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (in der jeweils gültigen Fassung) (die „Central Bank UCITS Regulations“) heißt es, dass eine „verantwortliche Person sicherstellen muss, dass jede Transaktion zwischen einem OGAW und einer verbundenen Person (a) zu Marktbedingungen und (b) im besten Interesse der Anteilinhaber des OGAW durchgeführt wird“.

Wie gemäß Verordnung 81(4) der OGAW-Verordnungen der Zentralbank vorgeschrieben, ist der Verwaltungsrat davon überzeugt, dass (a) durch schriftliche Verfahren belegte Vorkehrungen getroffen wurden, um sicherzustellen, dass die in Verordnung 43(1) vorgeschriebenen Verpflichtungen auf alle Transaktionen mit verbundenen Personen angewendet werden; und (b) alle Transaktionen mit verbundenen Personen, die während des Geschäftsjahres abgeschlossen wurden, die in Verordnung 43(1) vorgeschriebenen Verpflichtungen erfüllten.

## Unabhängige Wirtschaftsprüfer

PricewaterhouseCoopers hat seine Bereitschaft erklärt, weiterhin in Übereinstimmung mit Section 383(2) des Companies Act von 2014 im Amt zu bleiben.

## Anlageziele und Anlagepolitik

Alle aktiven Fonds, mit Ausnahme des Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup>, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup>, Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup>, Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup> und Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup>, wurden von der Securities and Futures Commission in Hongkong zugelassen. Daher sind die vorgenannten Fonds in Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen. Eine Zulassung durch die Securities and Futures Commission in Hongkong ist nicht als Empfehlung für die Anlage in die Fonds zu verstehen.

Das Hauptanlageziel und die Anlagepolitik aller aktiven Fonds zum Ende des Geschäftsjahres sind unten und auf den nachfolgenden Seiten aufgeführt. Gleichwohl kann nicht garantiert werden, dass ein Fonds sein Anlageziel erreichen oder dass eine Anlagestrategie erfolgreich sein wird oder bestimmte Ergebnisse oder ein bestimmtes Rentabilitätsniveau erreicht werden (definierte Begriffe entsprechen ihrer Definition im Verkaufsprospekt des jeweiligen Fonds (der „Verkaufsprospekt“)).

## Regelmäßige Berichterstattung nur für Artikel 8 SFDR-Produkte

*Transparenz der Förderung ökologischer oder sozialer Merkmale und nachhaltiger Investitionen in periodischen Berichten*

Die Offenlegungsverordnung für nachhaltige Finanzen ((EU) 2019/2088) (die „SFDR“) verlangt von der Gesellschaft, in ihren regelmäßigen Berichten eine Beschreibung des Umfangs aufzunehmen, in dem ein gemäß Artikel 8 der SFDR (ein „Artikel 8-Fonds“) klassifizierter Fonds seine ökologischen oder sozialen Eigenschaften erfüllt hat.

Die SFDR ermächtigt auch die Europäische Bankenaufsichtsbehörde, die Europäische Behörde für Versicherungen und betriebliche Altersversorgung und die Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (gemeinsam „ESAs“) zur Entwicklung von Entwurfen aufsichtsrechtlicher technischer Standards („RTS“), das Informations- und Präsentationsformat in den periodischen Berichten festzulegen. Zum Zeitpunkt dieses Berichts haben die ESAs den RTS noch nicht abgeschlossen und die EU-Kommission hat angegeben, dass das Inkrafttreten des RTS bis zum 1. Januar 2023 verzögert wird.

Da die RTS noch nicht abgeschlossen oder in Kraft sind, wurden die folgenden Offenlegungen in Ermangelung eines gemeinsamen Satzes von Nachhaltigkeitsoffenlegungen oder Berichtsanforderungen erstellt, die in Kraft treten, wenn die RTS abgeschlossen und in Kraft ist.

## Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund

*Anlageziel* – Aufrechterhaltung des Kapitals des Fonds und Bereitstellung einer Rendite im Einklang mit den Geldmarktzinsen.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 99,5 % seines Nettoinventarwerts in: (i) berechnete Geldmarktinstrumente, die von der Europäischen Union separat ausgegeben oder garantiert werden, der Nationale, regionale und lokale Verwaltungen der Mitgliedstaaten oder deren Zentralbanken, die Europäische Zentralbank, die Europäische Investmentbank, der Europäische Investmentfonds, den europäischen Stabilitätsmechanismus, die europäische Finanzstabilitätsfazilität, eine zentrale Behörde oder Zentralbank eines Drittlandes (einschließlich der USA), der Internationale Währungsfonds, die Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung, der Rat der Europa Development Bank, die Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung, die Bank für internationale Vergleiche, und alle anderen relevanten internationalen Finanzinstitute oder Organisationen,

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund – (Fortsetzung)

zu denen ein oder mehrere Mitgliedstaaten gehören und zu denen Emittenten gehören können, ohne Einschränkung, Bundesvereinigung für nationale Hypotheken (Fannie Mae), Federal Home Loan Mortgage Corporation (Freddie Mac) Government National Mortgage Association (Ginnie Mae), Student Loan Marketing Association (Sallie Mae) und Federal Home Loan Bank („Geldmarktinstrumente für öffentliche Schulden“); (ii) berechnete umgekehrte Rückkaufvereinbarungen, die mit Geldmarktinstrumenten von öffentlichen Schuldtiteln gesichert sind; und (iii) Bareinlagen in US-Dollar.

Abweichend davon ist der Fonds von der Zentralbank ermächtigt, bis zu 100 % seines Nettovermögens in Geldmarktinstrumenten öffentlicher Schuldtitel anzulegen, vorausgesetzt, dass (i) er Geldmarktinstrumente öffentlicher Schuldtitel aus mindestens sechs verschiedenen Emissionen von Emittenten hält, (ii) und dass er die Anlage in Geldmarktinstrumenten öffentlicher Schuldtitel aus ein und derselben Emission auf höchstens 30 % seines Nettovermögens beschränkt. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in auf US-Dollar lautende Geldmarktinstrumente öffentlicher Schuldner, die von US-Emittenten ausgegeben werden. Der Fonds beabsichtigt nicht, derivative Finanzinstrumente für irgendeinen Zweck einzusetzen.

Der Fonds ist ein Geldmarktfonds mit kurzfristiger öffentlicher Verschuldung und konstantem Nettoinventarwert (Constant Net Asset Value, „CNAV“) in Übereinstimmung mit den Anforderungen der Central Bank Regulations.

### Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 75 Prozent seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel, die (i) an geregelten Märkten in Industrie- und Schwellenländern notiert sind oder gehandelt werden; (ii) auf US-Dollar lauten und (iii) zum Zeitpunkt des Kaufs mindestens von S&P oder einem gleichwertigen Unternehmen von einem anderen NRSRO bewertet wurden oder, falls sie nicht bewertet wurden, vom Anlageverwalter und Unteranlageverwalter des Fonds als von vergleichbarer Qualität eingestuft wurden. Der Fonds kann in folgende Arten von Wertpapieren investieren, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden: Schuldtitel, die von der US-Regierung, ihren Behörden, Institutionen und Gebietskörperschaften begeben oder garantiert werden (einschließlich inflationsgeschützter Wertpapiere), Unternehmensschuldtitel wie frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), wandelbare und nicht wandelbare Schuldscheine, Credit-Linked-Notes, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte, die von Industrie-, Versorgungs- oder Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften ausgegeben werden, hypothekarisch besicherte (MBS-) und forderungsbesicherte (ABS-) Wertpapiere, Vorzugsaktien und Anteile anderer offener Investmentfonds (open-ended collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68 (1) (e) der UCITS Regulations.

Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Mindestens zwei Drittel des Nettoinventarwerts des Fonds werden in Wertpapiere von Emittenten oder Unternehmen investiert, die ihren eingetragenen Sitz in den USA haben oder ihre Geschäftstätigkeit überwiegend in den USA ausüben.

Die Hebelwirkung durch den Einsatz von Derivaten darf bei dem Fonds bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts (berechnet anhand des Commitment-Ansatzes) betragen. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

### Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamrendite, bestehend aus Kapitalzuwachs und Erträgen.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel, die an geregelten Märkten in den Vereinigten Staaten notiert sind oder gehandelt werden, die in Anhang III des Verkaufsprospekts aufgeführt sind und die als Investment Grade eingestuft sind oder, wenn sie vom Anlageverwalter und Unteranlageverwalter nicht bewertet werden, von vergleichbarer Kreditqualität sind und von US-Emittenten ausgegeben werden. Bei den Wertpapieren, in die der Fonds investieren kann, handelt es sich unter anderem um Schuldtitel, die von der US-Regierung, ihren Behörden, Institutionen und Gebietskörperschaften begeben oder garantiert werden, Schuldtitel, die von anderen nationalen Regierungen, deren Behörden, Institutionen und Gebietskörperschaften begeben werden, von supranationalen Organisationen begebene Schuldtitel wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen, Unternehmensschuldtitel wie frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen und Anleihen, nichtwandelbare Schuldscheine, Credit-Linked-Notes, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte, die von Industrie-, Versorgungs- oder Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften ausgegeben werden, sowie hypothekarisch besicherte (MBS-) und forderungsbesicherte (ABS-) Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind.

Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Vorbehaltlich der in den Anlagerichtlinien festgelegten Grenzen kann der Fonds auch insgesamt bis zu 30 % seines Nettoinventarwerts in nicht öffentlich gehandelte Wertpapiere, Wertpapiere nach Regel 144A, Nullkupon-Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Schuldtitel von Nicht-US-Emittenten investieren. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen.

Die Strukturierung und Umstrukturierung des Fondsvermögens wird vom Anlageverwalter und Unteranlageverwalter auf der Grundlage seiner Analyse der Konjunktur- und Marktlage sowie der relativen Risiken und Chancen bestimmter Arten von festverzinslichen Wertpapieren vorgenommen. Die durchschnittliche Duration ändert sich je nach Zinsprognose des Unteranlageverwalters.

Der Fonds kann unverbriefte Beteiligungen an variabel verzinslichen Hypotheken oder sonstigen Geschäftskrediten oder Abtretungen solcher Darlehen kaufen, sofern diese liquide sind, die Zinsanpassung mindestens alle 397 Tage erfolgt und sie durch Immobilien oder andere Vermögenswerte besichert sind. Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und die Hebelwirkung durch den Einsatz von Derivaten darf bei dem Fonds bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts betragen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

### Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamrendite durch Kapitalzuwachs und Erträge.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 70 Prozent seines Nettoinventarwerts in auf Euro lautende Schuldtitel, die an geregelten Märkten in Industrie- und Schwellenländern notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt. Der Fonds investiert in die folgenden Arten von Wertpapieren, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden: Schuldtitel, die von nationalen Regierungen von Industrie- und Schwellenländern begeben oder garantiert werden, ihre Agenturen, Instrumentalitäten, und politische Unterabteilungen (einschließlich inflationsgeschützter Wertpapiere); Schuldtitel supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen; Unternehmensschuldtitel von Emittenten, die sich in Industrie- und Schwellenländern befinden oder deren Wertpapiere an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Handelspapier, Einlagenzertifikate, und Bankakzepten, die von Industrie-, Versorgungsunternehmen, Finanzen, Handelsbanken oder Bankholding-Unternehmen; hypothekarisch besicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere; Vorzugsaktien; und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Der Fonds investiert nicht in Aktienwerte, einschließlich Optionsscheine, außer (1) in Vorzugsaktien bis maximal 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds; und (2) in Aktienwerte, die über Umwandlungen von wandelbaren Schuldtiteln oder über Kapitalmaßnahmen von Emittenten (z. B. Ausgabe von Aktien, um zuvor ausgegebene Schuldtitel zu ersetzen) erworben werden. Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und die Hebelwirkung durch den Einsatz von Derivaten darf bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts (berechnet anhand des Commitment-Ansatzes) betragen. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts. Der Fonds kann unverbriefte Beteiligungen an variabel verzinslichen Hypotheken oder sonstigen Geschäftskrediten oder Abtretungen solcher Darlehen kaufen, sofern diese liquide sind, die Zinsanpassung mindestens alle 397 Tage erfolgt und sie durch Immobilien oder andere Vermögenswerte besichert sind.

# Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

## Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

*Anlageziel* – Um ein hohes Niveau an laufenden Erträgen zu erzielen.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 Prozent seines Nettoinventarwerts in hochverzinsliche Schuldverschreibungen und -instrumente, die (i) auf US-Dollar und Währungen einer Vielzahl anderer Industrieländer lauten und (ii) an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt. Zu diesen hochverzinslichen Schuldverschreibungen und -instrumenten gehören: (i) Unternehmensschuldtitel, einschließlich (a) frei übertragbarer Schuldscheine, (b) Schuldverschreibungen, (c) Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), (d) Wandelanleihen und nicht wandelbare Schuldverschreibungen, (e) Gutschriften, (f) Handelspapier, (g) Einlagenzertifikate, und (h) Bankerakzeptanzen, die von Industrieunternehmen erteilt werden, Versorgungsunternehmen, Finanzen, Handelsbanken oder Bankholding-Unternehmen; (ii) strukturierte Schuldverschreibungen, die übertragbare Wertpapiere sind, deren zugrunde liegendes Engagement festverzinsliche Wertpapiere sein kann; (iii) hypotheckenbesicherte Wertpapiere; (iv) forderungsbesicherte Wertpapiere; und (v) unbesicherte Beteiligungen an oder Abtretungen von variabel verzinslichen Hypotheken oder anderen gewerblichen Darlehen, die liquide sind und Zinsanpassungen mindestens alle 397 Tage vorsehen und die durch Immobilien oder andere Vermögenswerte gesichert werden können, vorausgesetzt, dass der Fonds mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in nicht wandelbare Schuldtitel investiert. Der Fonds kann in Schuldtitel investieren, die von S&P mit D oder von einer anderen anerkannten Ratingagentur mit einem vergleichbaren Rating bewertet sind. Diese Ratings weisen auf den hochspekulativen Charakter solcher Schuldtitel hin. Es ist durchaus möglich, dass die Emittenten in Bezug auf Tilgung und Zinszahlungen bereits in Verzug sind oder die Gefahr eines Zahlungsverzugs besteht.

Die übrigen Vermögenswerte des Fonds können in die folgenden Arten von Wertpapieren investiert werden, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden: Schuldtitel mit Investment Grade-Rating oder Wertpapiere ohne Rating, die vom Anlageverwalter und Unteranlageverwalter als gleichwertig angesehen werden; Vorzugsaktien und Anteile anderer offener Investmentfonds (open-ended collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations sowie Barmittel und Geldmarktinstrumente. Der Fonds kann maximal 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteilen anderer offener Investmentfonds im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations anlegen. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

## Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamttrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert hauptsächlich in Schuldtitel, die auf US-Dollar, japanische Yen, Pfund Sterling, Euro und eine Vielzahl anderer Währungen lauten und an einem der geregelten Märkte gehandelt oder notiert werden, die sich in Industrie- und Schwellenländern befinden, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt. Der Fonds kann in folgende Arten von Wertpapieren investieren, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden: Schuldtitel, die von nationalen Regierungen in Industrie- und Schwellenländern, ihren Behörden, Institutionen und Gebietskörperschaften begeben oder garantiert werden (einschließlich inflationsgeschützter Wertpapiere); Schuldtitel supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen; Schuldtitel von Unternehmen, die in Industrie- und Schwellenländern ansässig sind oder deren Wertpapiere an geregelten Märkten dieser Länder notiert sind oder gehandelt werden, darunter frei übertragbare Schuldtitel, Schuldverschreibungen, Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), Schuldtitel aus Schwellenländern (wie zum Beispiel Brady Bonds, Eurobonds und nach dem Recht eines Schwellenlands begebene Inlands- und Auslandsanleihen), wandelbare und nicht wandelbare Schuldscheine, Credit-Linked-Notes, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte, die von Industrie-, Versorgungs- oder Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften ausgegeben werden; hypotheckarisch besicherte (MBS-) und forderungsbesicherte (ABS-) Wertpapiere; Vorzugsaktien und Anteile anderer offener Investmentfonds (open-ended collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Der Fonds kann unverbriefte Beteiligungen an variabel verzinslichen Hypotheken oder sonstigen Geschäftskrediten oder Abtretungen solcher Darlehen kaufen, sofern diese liquide sind, die Zinsanpassung mindestens alle 397 Tage erfolgt und sie durch Immobilien oder andere Vermögenswerte besichert sind. Derartige Beteiligungen dürfen zusammen mit anderen Anlagen, die unter Ziffer 2.1 in Anhang II.A. des Prospekts fallen, nicht mehr als insgesamt 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds ausmachen.

Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

## Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

*Anlageziel* – Um ein hohes Niveau an laufenden Erträgen zu erzielen.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 70 Prozent seines Nettoinventarwerts in die folgenden Arten von hochverzinslichen Schuldverschreibungen von US-Emittenten, die auf US-Dollar lauten und an den in Anhang III des Verkaufsprospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden: Unternehmensanleihen, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Anleihen (einschließlich Nullkupon-Anleihen), nicht wandelbare Notizen, Handelspapier, Einlagenzertifikate, und Bankakzepten von Industrie, Versorgungsunternehmen, Finanzen, Handelsbanken oder Bankholding-Unternehmen; strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren sein kann; und hypotheckenbesicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldverschreibungen strukturiert sind; vorausgesetzt, dass mindestens zwei Drittel des Nettoinventarwerts des Fonds in nicht wandelbare Schuldverschreibungen investiert werden. Der Fonds kann in Schuldtitel investieren, die von S&P mit D oder von einer anderen anerkannten Ratingagentur mit einem vergleichbaren Rating bewertet sind. Diese Ratings weisen auf den hochspekulativen Charakter solcher Schuldtitel hin. Es ist durchaus möglich, dass die Emittenten in Bezug auf Tilgung und Zinszahlungen bereits in Verzug sind oder die Gefahr eines Zahlungsverzugs besteht.

Die verbleibenden Vermögenswerte des Fonds können in Schuldtiteln gehalten werden, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, die von S&P über BB+ oder einem anderen NRSRO oder einem gleichwertigen Wert bewertet werden, oder nicht bewertete Wertpapiere, die vom Anlageverwalter und Unteranlageverwalter als gleichwertig eingestuft werden; Vorzugsaktien und andere Aktien, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, wenn diese Anlagen mit dem Anlageziel des Fonds für hohe laufende Erträge übereinstimmen; sowie Barmittel oder kurzfristige Geldmarktinstrumente mit Restlaufzeiten von 13 Monaten oder weniger. Der Fonds kann bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in hochverzinslichen Unternehmensanleihen von Nicht-US-Emittenten aus Industrienationen und Schwellenländern anlegen, vorausgesetzt, diese Schuldtitel lauten auf US-Dollar und die Emittenten sind in OECD-Mitgliedsstaaten ansässig oder üben einen Großteil ihrer Geschäftstätigkeit dort aus. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Mindestens 95 % des Nettoinventarwerts des Fonds werden auf US-Dollar lauten. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

## Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamttrendite, bestehend aus Erträgen und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 Prozent seines Nettoinventarwerts in Schuldverschreibungen von Emittenten in Schwellenländern (nachfolgend „Schuldtitel aus Schwellenländern“), die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts aufgeführt, und (ii) Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen und solche Anlagen dienen dem Zweck, sich in den hierin beschriebenen Arten von Instrumenten zu engagieren oder anderweitig das Anlageziel und die Anlagepolitik des Fonds zu verfolgen. Der Fonds kann in die folgenden Arten von Wertpapieren investieren, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden: Schuldtitel, die von nationalen Regierungen in Industrie- und Schwellenländern, deren Behörden, Institutionen und Gebietskörperschaften begeben oder garantiert werden (einschließlich inflationsgeschützter Wertpapiere); Schuldtitel von in Industrie- und Schwellenländern ansässigen Unternehmen, deren Wertpapiere an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, darunter frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), wandelbare und nicht wandelbare Schuldscheine, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte, die von Industrie-, Versorgungs- oder Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften ausgegeben wurden; hypotheckenbesicherte (MBS-) Wertpapiere (einschließlich Collateralised Debt Obligations); verbrieft Beteiligungen an Darlehen in Form von frei übertragbaren Wertpapieren; strukturierte Schuldscheine, bei denen es sich um übertragbare

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

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

Wertpapiere handelt und denen festverzinsliche Wertpapiere zugrunde liegen können; forderungsbesicherte (ABS-) Wertpapiere; Vorzugsaktien und Anteile an anderen offenen Investmentfonds (open-ended collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations, wobei mindestens zwei Drittel des Nettoinventarwerts des Fonds in nicht wandelbare Schuldtitel investiert sein müssen.

Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Der Fonds kann unverbriefte Beteiligungen an variabel verzinslichen Hypotheken oder sonstigen Geschäftskrediten oder Abtretungen solcher Darlehen kaufen, sofern diese liquide sind, die Zinsanpassung mindestens alle 397 Tage erfolgt und sie durch Immobilien oder andere Vermögenswerte besichert sind. Derartige Beteiligungen dürfen zusammen mit anderen Anlagen, die unter Ziffer 2.1 in Anhang II.A. des Prospekts fallen, nicht mehr als insgesamt 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds ausmachen. Die Anlagen des Fonds können auf andere Währungen als die Basiswährung lauten. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

### Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamttrendite, bestehend aus Erträgen und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 70 Prozent seines Nettoinventarwerts in auf jede Währung lautende Unternehmensanleihen aus Schwellenländern, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, einschließlich (i) frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, festverzinsliche und variabel verzinsliche Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), umwandelbare und nicht umwandelbare Schuldverschreibungen, Handelspapier, Einlagenzertifikate, und Bankakzeptanzen, die von Industrie-, Versorgungsunternehmen, Finanzen, Handelsbanken oder Bankholding-Unternehmen; (ii) hypothekenbesicherte Wertpapiere (einschließlich besicherter Schuldverpflichtungen); (iii) verbrieftete Beteiligungen an Darlehen, die frei übertragbare Wertpapiere sind; (iv) strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrundeliegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann; und (v) forderungsbesicherte Wertpapiere.

Der Fonds kann bis zu 30 Prozent seines Nettoinventarwerts in die folgenden Arten von Wertpapieren anlegen, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden (die folgenden Wertpapiere können auf eine beliebige Währung lauten) und wenn es sich nicht um Unternehmensanleihen aus Schwellenländern handelt: (i) Schuldtitel, die von nationalen Regierungen in einem beliebigen Land ausgegeben oder garantiert werden, ihre Behörden oder Einrichtungen und politischen Unterabteilungen (einschließlich inflationsgeschützter Wertpapiere); (ii) Unternehmensschuldtitel von Emittenten, die in anderen Ländern als Schwellenländern ansässig sind, deren Wertpapiere an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, festverzinsliche und variabel verzinsliche Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), umwandelbare und nicht umwandelbare Schuldverschreibungen, Handelspapier, Einlagenzertifikate, und Bankakzeptanzen, die von Industrie-, Versorgungsunternehmen, Finanzen, Handelsbanken oder Bankholding-Unternehmen; (iii) hypothekenbesicherte Wertpapiere (einschließlich besicherter Schuldverpflichtungen); (iv) verbrieftete Beteiligungen an Darlehen, die frei übertragbare Wertpapiere sind; (v) strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrundeliegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann; (vi) forderungsbesicherte Wertpapiere; (vii) Vorzugsaktien; und (viii) andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen.

Der Fonds kann in Stammaktien, Vorzugsaktien, wandelbare Wertpapiere, Optionsscheine, Bezugsrechte und ihre Äquivalente investieren. Der Fonds investiert nicht mehr als 25 % seines Nettoinventarwerts in wandelbare Schuldtitel aus unabhängigen Angeboten und nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Vorzugsaktien aus unabhängigen Angeboten. Anlagen in Stammaktien, Vorzugswertpapiere, Optionen, Rechte und vergleichbare Anlagen (sowohl über unabhängige Angebote als auch anderweitig) dürfen insgesamt nicht mehr als 30 % des Nettoinventarwerts des Fonds ausmachen. Als Einschränkung des Vorstehenden darf der Fonds jeweils nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts für die folgenden Wertpapierarten anlegen: (i) hypothekarisch gesicherte Wertpapiere (einschließlich besicherter Schuldverschreibungen); (ii) strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann; und (iii) Asset-Backed Securities. Die hypothekarisch besicherten Wertpapiere, forderungsbesicherten Wertpapiere, strukturierten Schuldverschreibungen und Credit-Linked Notes, in die der Fonds investieren kann, können eingebettete Derivate und/oder eine Hebelung enthalten. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Die Hebelwirkung durch den Einsatz von Derivaten darf bei dem Fonds bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts (berechnet anhand des Commitment-Ansatzes) betragen. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

### Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

*Anlageziel* – Generierung einer Gesamttrendite. Sekundäres Anlageziel ist die Erzielung hoher laufender Erträge.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 70 Prozent seines Nettoinventarwerts in hochverzinsliche Schuldverschreibungen, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts aufgeführt. In der Regel werfen Wertpapiere, die von S&P mit BB+ oder niedriger oder von einer anderen anerkannten Ratingagentur mit einem vergleichbaren Rating bewertet sind, und gleichwertige Wertpapiere ohne Rating höhere Renditen ab. Schuldtitel, die schlechter als „Investment Grade“ bewertet sind, werden von den Ratingagenturen hinsichtlich der Fähigkeit des Emittenten zur Zahlung der Zinsen und zur Tilgung als überwiegend spekulativ angesehen und können unter schwierigen Bedingungen ein hohes Risiko darstellen. Der Fonds kann in Schuldtitel investieren, die von S&P mit D oder von einer anderen anerkannten Ratingagentur mit einem vergleichbaren Rating bewertet sind. Diese Ratings weisen auf den hochspekulativen Charakter solcher Schuldtitel hin. Es ist durchaus möglich, dass die Emittenten in Bezug auf Tilgung und Zinszahlungen bereits in Verzug sind oder die Gefahr eines Zahlungsverzugs besteht. Es wird nicht erwartet, dass der Fonds über 45 % seines Nettoinventarwerts in hochverzinslichen Wertpapieren anlegen wird, die in Schwellenländern, aufstrebenden europäischen Ländern oder aufstrebenden Ländern aus der Region Asien-Pazifik ausgegeben wurden. Der Fonds wird vermutlich in mindestens 10 verschiedenen Ländern investieren. Der Fonds ist jedoch global ausgerichtet und nicht auf Anlagen in bestimmten Ländern oder Regionen beschränkt. Der Fonds kann unverbriefte Beteiligungen an variabel verzinslichen Hypotheken oder sonstigen Geschäftskrediten oder Abtretungen solcher Darlehen kaufen, sofern diese liquide sind, die Zinsanpassung mindestens alle 397 Tage erfolgt und sie durch Immobilien oder andere Vermögenswerte besichert sind. Derartige Beteiligungen dürfen zusammen mit anderen Anlagen, die unter Ziffer 2.1 in Anhang II.A. des Prospekts fallen, nicht mehr als insgesamt 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds ausmachen. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Die Hebelwirkung durch den Einsatz von Derivaten darf bei dem Fonds bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts (berechnet anhand des Commitment-Ansatzes) betragen. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

### Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund

*Anlageziel* – Generierung einer Gesamttrendite. Sekundäres Anlageziel ist die Erzielung hoher laufender Erträge.

*Anlagepolitik* – Der Fonds ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er jederzeit mindestens 80 Prozent seines Nettoinventarwerts in inflationsgeschützte Wertpapiere oder andere Wertpapiere investiert, von denen der Anlageverwalter und der Unteranlageverwalter glauben, dass sie Schutz vor Inflation bieten, die von nationalen Regierungen von Ländern ausgegeben wird, die Mitglieder der OECD sind, ihre Agenturen, Instrumentalitäten und politische Unterabteilungen, supranationale Organisationen und Unternehmensemittenten wie frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen und Anleihen und werden an geregelten Märkten gemäß Anhang III des Verkaufsprospekts notiert oder gehandelt. Darüber hinaus kann der Fonds bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in anderen Arten von Schuldtiteln anlegen, die an einem in Anhang III des Verkaufsprospekts aufgeführten geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden und inflationsindiziert sind oder auch nicht. So unter anderem in Schuldtitel, die von Regierungen, deren Behörden, staatlichen Organisationen und Gebietskörperschaften ausgegeben werden oder besichert sind (einschließlich Strips), Schuldtiteln von Unternehmen wie z. B. frei übertragbare

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund – (Fortsetzung)

Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen, Step-up-Wertpapiere und Sachwerte), Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte, die von Industrie-, Versorgungs-, Finanz- und Geschäftsbankorganisationen oder Bankholdinggesellschaften ausgegeben werden; hypotheckenbesicherten Wertpapieren und Asset-Backed Securities, die als Schuldtitel strukturiert sind; umgekehrte Pensionsgeschäfte mit Schuldtiteln als Basiswerte (jedoch nur für die Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Central Bank of Ireland); strukturierten Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren Basiswerte festverzinsliche Wertpapiere enthalten können; verbrieften Darlehensbeteiligungen, bei denen es sich um frei übertragbare Wertpapiere handelt; Geldmarktinstrumenten; Wertpapieren anderer offener Investmentfonds im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der UCITS Regulations; und (mit der Maßgabe einer Höchstgrenze von 10 % des Gesamtvermögens des Fonds) Vorzugsaktien und anderen Aktien sowie aktienähnlichen Wertpapieren. Maximal 10 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68 (1)(e) der OGAW-Verordnungen investiert werden. Der Fonds investiert nicht in Wertpapiere ohne Investment Grade-Rating. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in Wertpapiere investiert werden, die an einem geregelten Markt in einem Schwellenland, europäischen Schwellenland oder Schwellenland im Asien-Pazifik-Raum notiert sind oder gehandelt werden. Die durchschnittliche Bonität des Fonds wird voraussichtlich zwischen A und AAA (S&P) bzw. A2 und Aaa (Moody's) liegen. Die durchschnittliche Portfolioduration des Fonds wird sich voraussichtlich zwischen einem und fünfzehn Jahren bewegen. Für die Einzeltitle im Fonds gelten jedoch keine Einschränkungen hinsichtlich der Duration.

Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und die Hebelwirkung durch den Einsatz von Derivaten darf bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts (berechnet anhand des Commitment-Ansatzes) betragen. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

### Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 70 Prozent seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel, die von asiatischen Emittenten ausgegeben werden, und in Derivate auf asiatische Zinssätze und Währungen, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt. Der Fonds investiert hauptsächlich in (i) Schuldverschreibungen, die von nationalen Regierungen in asiatischen Ländern ausgegeben oder garantiert werden, ihre Agenturen, Instrumentalitäten oder politische Unterabteilungen; (ii) Unternehmensschuldtitel, die von asiatischen Unternehmen ausgegeben werden, wie z. B. frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Anleihen (einschließlich Nullkupon-Anleihen), Handelspapier, Einlagenzertifikate und Bankakzepten von Industrieunternehmen, Versorgungsunternehmen, Finanzen, Handelsbanken oder Bankholding-Unternehmen; (iii) verbrieftete Beteiligungen an Darlehen, die frei übertragbare Wertpapiere sind; (iv) strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrundeliegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann; (v) hypotheckenbesicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind; (vi) Derivate auf asiatische Zinssätze und asiatische Anleihen, die mit hoch bewerteten asiatischen oder globalen Kreditinstituten abgeschlossen wurden; (vii) Asiatische Währungen und Derivate auf diese Währungen. Für die Zwecke dieses Fonds ist unter einem asiatischen Unternehmen ein Unternehmen zu verstehen, dessen Sitz sich in einem asiatischen Land befindet oder das seine Geschäftstätigkeit größtenteils in Asien ausübt.

Der Fonds darf höchstens 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer offener Investmentfonds (open-ended collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1) (e) der UCITS Regulations investieren. Höchstens 25 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in Wandelanleihen und bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in Vorzugsaktien, andere Aktienwerte und/oder Optionsscheine investiert werden. Maximal 5 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Optionsscheine investiert werden.

Die Hebelwirkung durch den Einsatz von Derivaten darf bei dem Fonds bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts (berechnet anhand des Commitment-Ansatzes) betragen. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

### Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

*Anlageziel* – Erreichen der Gesamrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert hauptsächlich in Schuldtitel, die (i) von S&P oder einem anderen NRSRO mit A- oder höher eingestuft werden, oder, wenn keine Bewertung als von vergleichbarer Qualität angesehen wird; (ii) (a) von Unternehmensemittenten mit Sitz in einer anderen Gerichtsbarkeit als einem Schwellenmarktland ausgegeben werden, die zum Zeitpunkt des Kaufs und nach Ansicht der Unteranlageverwalter, "Blue Chip"-Unternehmen, d. h. sie haben ein langfristiges Schuldenrating von A- oder höher durch S&P oder das Äquivalent durch einen anderen NRSRO, oder wenn nicht bewertete Werte als von vergleichbarer Qualität angesehen werden; und/oder (b) von supranationalen Organisationen ausgegeben werden, die ein langfristiges Schuldenrating von A- oder höher von S&P oder dem Äquivalent eines anderen NRSRO haben, oder wenn nicht bewertete Werte als von vergleichbarer Qualität angesehen werden; und (iii) an geregelten Märkten, die in Anhang III des Verkaufsprospekts aufgeführt sind oder gehandelt werden.

Der Fonds investiert nur in solche Unternehmensschuldtitel, die nach Auffassung des betreffenden Anlageverwalters und Unteranlageverwalters zumindest vorrangige ungesicherte Unternehmensschuldtitel des betreffenden Emittenten sind. Darüber hinaus der Fonds kann in Wertpapiere investieren, die von nationalen Regierungen ausgegeben oder garantiert werden (einschließlich STRIPS und inflationsindexgebundene Wertpapiere), ihre Agenturen, Instrumentalitäten und politische Unterabteilungen, Wertpapiere supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen; umgekehrte Rückkaufvereinbarungen mit Schuldverschreibungen als zugrunde liegende Instrumente (nur zu Zwecken der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Anforderungen der Zentralbank von Irland); und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1) (e) der OGAW-Verordnungen. Der Fonds darf höchstens 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere oder Anteile von anderen OGAW oder sonstigen Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren.

Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und die Hebelwirkung des Fonds aus Derivaten wird erwartungsgemäß 50 % seines Gesamt Nettoinventarwerts (berechnet anhand des Commitment-Ansatzes) nicht übersteigen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Die Wertpapiere, die das Anlageuniversum des Fonds umfassen, werden unter Verwendung eines proprietären Systems und des ESG-Rahmens von MSCI bewertet, um das ESG-Rating des gesamten Anlageuniversums und jedes einzelnen Emittenten und seiner Wertpapiere zu bestimmen, und danach wählt der Anlageverwalter Anlagen für den Fonds unter Berücksichtigung der Anlagepolitik des Fonds und der ESG-Ratings der Wertpapiere aus.

Der Fonds ist bestrebt, in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, die insgesamt eine gewichtete durchschnittliche CO<sub>2</sub>-Intensität des Portfolios erreichen, die mindestens 20 % niedriger ist als der ICE BofA Global Corporate 1 – 5 year AAA-A Global Large Cap Corporate 30 % Financial Constrained Index (der „Benchmark“). Der Anlageverwalter definiert den CO<sub>2</sub>-Fußabdruck als den gewichteten Durchschnitt der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität von Wertpapieren, die innerhalb des Portfolios gehalten werden. Die Intensität der CO<sub>2</sub>-Emissionen bezieht sich auf das Treibhausgas-Protokoll („GHG“) von Scope 1 und Scope 2, das von einem Emittenten emittiert wird.

Das Portfolio des Fonds wird ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von BBB oder besser beibehalten. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere von Emittenten mit MSCI ESG-Ratings von BB oder darunter zum Zeitpunkt des Kaufs anlegen. Aufgrund des integrierten ESG-Ansatzes wendet der Anlageverwalter ESG-Ratings auf mindestens 90 % der Wertpapiere an, in die der Fonds investiert. Der Fonds wird ein ESG-Rating des Portfolios aufrechterhalten, das höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds. Darüber hinaus wird der Fonds bestrebt sein, mindestens 20 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, deren Aktivitäten zu mindestens einem der acht ausgewählten Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (United Nations Sustainable Development Goals, UNSDGs) beitragen.

Der Fonds wird Anlagen in Wertpapieren der folgenden Emittenten ausschließen:

- Emittenten, die sich nicht an die vom Anlageverwalter festgelegten guten Governance-Praktiken halten;

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

## Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)

- Emittenten, die mehr als 5 % des Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder -verteilung erzielen;
- Emittenten erzielen über 10 % des Umsatzes aus:
  - zivile Schusswaffen (Herstellung/Lieferung),
  - jede Beteiligung an konventionellen Waffen,
  - thermischer Kohlebergbau (Produktion/Vertrieb),
- Emittenten, die über 5 % des Umsatzes aus der Produktion von Atomwaffen erzielen;
- Emittenten, die umstrittene Waffen (d. h. Antipersonen-Landminen, biochemische Waffen, Blindlasenwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht nachweisbare Fragmente) herstellen, ein umstrittenes Waffenunternehmen besitzen oder sich im Besitz eines umstrittenen Waffenunternehmens befinden;
- Emittenten, die gemäß dem UN Global Compact als „fehlgeschlagen“ bewertet werden; und
- Staats- und/oder Staatsemitenten, die gemäß dem Freedom House Index unzureichend abschneiden.

Der Anlageverwalter wird mit den Emittenten in Gesprächen mit der Geschäftsleitung über Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungspraktiken sprechen. Der Engagementprozess des Anlageverwalters zielt darauf ab, sich an den Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen auszurichten.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

## Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamtrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in die globalen Rentenmärkte. Der Fonds investiert hauptsächlich in Schuldverschreibungen (entweder direkt oder indirekt in andere Organismen für gemeinsame Anlagen, die hauptsächlich in solche Wertpapiere investieren, vorbehaltlich der hierin enthaltenen Beschränkungen), die auf US-Dollar lauten, Euro, Japanischer Yen, Pfund Sterling und eine Vielzahl anderer Währungen, die an geregelten Märkten in Industrie- und Schwellenländern notiert sind oder gehandelt werden, mit einem Schwerpunkt auf nicht-staatlichen Schuldtiteln, insbesondere Unternehmensanleihen und hypotheckenbesicherte Wertpapiere. Der Fonds kann in nicht auf den US-Dollar lautende Wertpapiere, Währungen und Derivate investieren, wobei das Gesamtengagement in anderen Währungen als dem US-Dollar (nach Absicherung) nicht mehr als 50 % des Nettoinventarwerts des Fonds ausmachen darf.

Der Fonds investiert in Wertpapiere, die von staatlichen Regierungen, ihren Behörden, Institutionen und Gebietskörperschaften begeben oder garantiert werden (darunter auch STRIPS und inflationsindexierte Wertpapiere); Wertpapiere supranationaler Organisationen, wie zum Beispiel frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen; Schuldtitel von Unternehmen, wie frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Brady Bonds, Anleihen mit variabel angepasster Verzinsung, variabel verzinsliche Anleihen (Floater), Planned Amortisation Bonds, Targeted Amortisation Bonds, Kapital-Strips, Eurobonds, Eurodollar- und Yankee-Dollar-Bonds, Payment-in-Kind-Anleihen, Nullkuponanleihen, nicht wandelbare Schuldscheine, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte, die von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften begeben werden; hypothekarisch besicherte (MBS-) und forderungsbesicherte (ABS-) Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind, sowie umgekehrte Pensionsgeschäfte, denen Schuldtitel zugrunde liegen (jedoch nur zum Zweck des effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank). Der Fonds darf höchstens 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere oder Anteile von anderen OGAW oder sonstigen Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren.

Der Fonds kann unverbriefte Beteiligungen an variabel verzinslichen Hypotheken oder sonstigen Geschäftskrediten oder Abtretungen solcher Darlehen kaufen, sofern diese liquide sind, die Zinsanpassung mindestens alle 397 Tage erfolgt und sie durch Immobilien oder andere Vermögenswerte besichert sind. Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und die Hebelwirkung durch den Einsatz von Derivaten darf bei dem Fonds bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts betragen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

## Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamtrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in Unternehmensanleihen und Schuldtitel, die von supranationalen Organisationen ausgegeben werden und (i) auf US-Dollar, japanische Yen, Euro, Pfund Sterling und eine Vielzahl anderer Währungen lauten und (ii) an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt. Zu den Unternehmensschuldtiteln, in die der Fonds investieren darf, gehören: frei übertragbare Schuldscheine, fest- und variabel verzinsliche Anleihen, Nullkuponanleihen, Schuldverschreibungen, nichtwandelbare Schuldtitel, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte, die von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften begeben werden. Darüber hinaus der Fonds kann in Wertpapiere investieren, die von nationalen Regierungen ausgegeben oder garantiert werden (einschließlich STRIPS und inflationsindexgebundene Wertpapiere), ihre Agenturen, Instrumentalitäten und politische Unterabteilungen, Wertpapiere supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen; verbrieft Beteiligungen an Darlehen, die frei übertragbare Wertpapiere sind; strukturierte Schuldverschreibungen, die frei übertragbare Wertpapiere sind; hypotheckenbesicherte Wertpapiere (einschließlich besicherter Hypothekenverpflichtungen); forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind; umgekehrte Pensionsgeschäfte mit Schuldtiteln als zugrunde liegende Instrumente (nur zu Zwecken der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Anforderungen der Zentralbank); und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen.

Der Fonds kauft keine Aktien oder materiellen Eigentumsansprüche an Aktien, mit Ausnahme von Vorzugsaktien oder Optionsscheinen, wobei höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Vorzugsaktien und/oder Optionsscheine investiert werden dürfen, und von Aktienwerten, die über Umwandlungen von wandelbaren Schuldtiteln oder über Kapitalmaßnahmen von Emittenten erworben werden. Der Fonds darf höchstens 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere oder Anteile von anderen OGAW oder sonstigen Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren.

Der Fonds kann Wertpapiere kaufen, die zum Kaufzeitpunkt ein Rating unter „Investment Grade“ besitzen oder, falls sie kein Rating aufweisen, nach Auffassung des Anlageverwalters und Unteranlageverwalters von vergleichbarer Qualität sind, solange solche Käufe nicht dazu führen, dass mehr als 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds aus Anlagen besteht, die ein Rating unter „Investment Grade“ besitzen oder, falls sie kein Rating aufweisen, nach Auffassung des Anlageverwalters und Unteranlageverwalters von vergleichbarer Qualität sind. Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und die Hebelwirkung durch den Einsatz von Derivaten darf bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts (berechnet anhand des Commitment-Ansatzes) betragen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

## Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund

*Anlageziel* – Um ein hohes Niveau an laufenden Erträgen zu erzielen.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in hochverzinsliche Schuldverschreibungen, die auf Euro lauten, an den in Anhang III des Verkaufsprospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, sowie von Emittenten, die weltweit ansässig sind.

Der Fonds strebt an, sein Anlageziel zu erreichen, indem er in Schuldtitel investiert, die von nationalen Regierungen ausgegeben oder garantiert werden, ihre Agenturen, Instrumentalitäten und politische Unterabteilungen; Unternehmensanleihen, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Brady Bonds, Anleihen mit anpassbarem Zinssatz, variabel verzinsliche Anleihen, geplante Amortisationsanleihen, gezielte Amortisationsanleihen, nur Kapitalanleihen, Eurobonds, Eurodollar-Anleihen und Yankee-Dollar-Instrumente, geldwerte Anleihen, Null-Kupon-Anleihen, nicht wandelbare Notizen, Handelspapier, Einlagenzertifikate, und Bankakzepten von Industrie, Versorgungsunternehmen, Finanzen, Handelsbanken oder Bankholding-Unternehmen; verbrieft Beteiligungen an Darlehen, die übertragbare Wertpapiere sind; strukturierte Schuldverschreibungen, die übertragbare Wertpapiere sind; hypotheckenbesicherte Wertpapiere; und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldverschreibungen strukturiert sind.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund – (Fortsetzung)

Vorbehaltlich der oben genannten Einschränkungen das verbleibende Vermögen des Fonds (das nicht mehr als ein Drittel seines Nettoinventarwerts beträgt) kann in (i) Schuldtiteln gehalten werden, die von S&P über BB+ oder einem anderen NRSRO entsprechend bewertet wurden, oder nicht bewertete Wertpapiere, die vom Anlageverwalter und den Unteranlageverwaltern als gleichwertig eingestuft werden; (ii) Vorzugsaktien und Optionsscheine, wenn solche Anlagen mit dem Anlageziel des Fonds für hohe laufende Erträge übereinstimmen; sowie (iii) Geld- oder kurzfristige Geldmarktinstrumente mit Restlaufzeiten von 13 Monaten oder weniger, Dies sind Instrumente, die normalerweise am Geldmarkt gehandelt werden und liquide sind (d. h. kann innerhalb von 7 Werktagen zu einem Preis, der seiner aktuellen Bewertung nahe kommt, in Bargeld umgewandelt werden und kann jede der folgenden Anlagen mit einer Laufzeit von 13 Monaten oder weniger umfassen: (a) Schuldtitel, die von den nationalen Regierungen ausgegeben oder garantiert werden, ihre Agenturen, Instrumentalitäten oder politische Unterabteilungen; (b) Unternehmensschuldtitel einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Anleihen (einschließlich Nullkupon-Anleihen), umwandelbare und nicht umwandelbare Schuldverschreibungen, Handelspapier, Einlagenzertifikate, und Bankakzepten von Industrie, Versorgungsunternehmen, Finanzen, Handelsbanken oder Bankholding-Unternehmen; (c) hypotheckenbesicherte Wertpapiere; (d) strukturierte Schuldverschreibungen, die übertragbare Wertpapiere sind; (e) verbrieftete Beteiligungen an Darlehen, die übertragbare Wertpapiere sind; (f) Gewährleistungen; (g) forderungsbesicherte Wertpapiere; und (h) umgekehrte Rückkaufvereinbarungen (nur zu Zwecken der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Anforderungen der Zentralbank). Der Fonds darf nicht mehr als 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen anlegen.

Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und die Hebelwirkung durch den Einsatz von Derivaten darf bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts (berechnet anhand des Commitment-Ansatzes) betragen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 25 % seines Nettoinventarwerts.

### Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamttrendite, bestehend aus Erträgen und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert in (i) Schuldverschreibungen, Wandelanleihen, Vorzugsaktien und Optionsscheine, die an geregelten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden, einschließlich Schwellenländer; (ii) Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen und solche Anlagen dienen dem Zweck, sich in den hierin beschriebenen Arten von Instrumenten zu engagieren oder anderweitig das Anlageziel und die Anlagepolitik des Fonds zu verfolgen, und (iii) Derivaten. Der Fonds kann maximal 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteilen anderer offener Investmentfonds im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations anlegen.

Der Fonds kann in Unternehmensschuldtitel wie frei übertragbare Schuldscheine investieren, Schuldverschreibungen, festverzinsliche und variabel verzinsliche Anleihen, Nullkupon-Anleihen, nicht wandelbare Notizen, Handelspapier, Einlagenzertifikate, und Bankakzepten von Industrie, Versorgungsunternehmen, Finanzen, Handelsbanken oder Bankholding-Unternehmen; strukturierte Schuldverschreibungen, die übertragbare Wertpapiere sind, deren zugrunde liegendes Engagement festverzinsliche Wertpapiere sein kann, vorausgesetzt, dass es dem Fonds gestattet wäre, direkt in solche zugrunde liegenden festverzinslichen Wertpapiere zu investieren; verbrieftete Beteiligungen an Darlehen, die übertragbare Wertpapiere sind; hypotheckenbesicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldverschreibungen strukturiert sind; und umgekehrte Rückkaufvereinbarungen mit Schuldverschreibungen als zugrunde liegende Instrumente (nur zu Zwecken der effizienten Portfolioverwaltung); Schuldtitel, die von nationalen Regierungen und ihren Behörden ausgegeben oder garantiert werden, Instrumentalitäten und politische Unterabteilungen; STRIPS und inflationsindexgebundene Wertpapiere; und Schuldverschreibungen supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen.

Der Fonds kann umfangreich in bestimmte Arten von Derivaten investieren (zu Anlagezwecken oder zum Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung). Der Fonds hat eine hohe Hebelgrenze. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

### Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Generierung von Gesamttrenditen durch Erträge und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert in ein weltweit diversifiziertes Portfolio von Schuldtiteln und Derivaten, die ein Engagement in Schuldtiteln, Zinssätzen, Währungen und Indizes bieten können. Der Fonds kann in Schuldtitel von Unternehmen, wie zum Beispiel frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen, fest und variabel verzinsliche Anleihen, Nullkuponanleihen, nichtwandelbare Schuldscheine, Credit-Linked-Notes, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte; Geldmarktinstrumente; verbrieftete Beteiligungen an Darlehen in Form von übertragbaren Wertpapieren; hypotheckarisch besicherte (MBS-) und forderungsbesicherte (ABS-) Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind; Wertpapierpensionsgeschäfte, denen Schuldtitel zugrunde liegen (nur zwecks effizienten Portfoliomanagements); Schuldtitel, die von nationalen Regierungen, ihren Behörden, Institutionen und Gebietskörperschaften begeben oder garantiert werden; STRIPS und inflationsindexierte Wertpapiere sowie Wertpapiere supranationaler Organisationen, wie zum Beispiel frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen, investieren. Verbrieftete Darlehensbeteiligungen sind börsennotierte Wertpapiere, und die Anlage in derartige Wertpapiere ist auf 50 % des Nettoinventarwerts des Fonds beschränkt.

Der Anlageverwalter und die Unteranlageverwalter gehen davon aus, dass die durchschnittliche Duration der Anlagen des Fonds je nach den Prognosen des Anlageverwalters und Unteranlageverwalters für Zinsen und Renditen zwischen null und zehn Jahren beträgt. Der Fonds darf bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere oder Anteile von anderen OGAW oder sonstigen Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations einschließlich offener börsengehandelter Fonds (einschließlich börsengehandelter Aktienfonds) investieren.

Der Fonds kann umfangreich in bestimmte Arten von Derivaten investieren. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

### Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamttrendite, bestehend aus Erträgen und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 65 Prozent seines Nettoinventarwerts in hypotheckenbesicherte Wertpapiere („MBS“) und forderungsbesicherte Wertpapiere („ABS“), die von nichtstaatlichen Emittenten ausgegeben werden und nicht von staatlich geförderten US-Unternehmen wie FNMA oder FHLMC und/oder von Behörden der US-Regierung wie GNMA garantiert werden. Diese Wertpapiere sind an geregelten Märkten auf der ganzen Welt, auch in Schwellenländern, notiert oder werden dort gehandelt.

Der Fonds kann insgesamt bis zu 35 Prozent seines Nettoinventarwerts anlegen in: hypotheckenbesicherte Wertpapiere, die von einer Agentur ausgegeben oder garantiert werden; forderungsbesicherte Wertpapiere, die von einer Agentur garantiert werden; Schulden, die von Unternehmen wie Schuldscheinen begeben oder garantiert werden, Anleihen (einschließlich Nullkupon-Anleihen), Wandelanleihen und nicht wandelbare Schuldverschreibungen, verbrieftete Beteiligungen an Darlehen, die übertragbare Wertpapiere sind, strukturierte Notizen, Vorzugsaktien, Handelspapier, Einlagenzertifikate, Zeiteinlagen, Rückkaufvereinbarungen und umgekehrte Rückkaufvereinbarungen (die für effiziente Portfoliomanagementzwecke verwendet werden können) und Dollarrollen; Banker-Akzeptanzen, einschließlich Schuldverschreibungen von Unternehmen, die sich im Besitz befinden, teilweise besessen, oder deren Verpflichtungen von einer Bundesregierung garantiert werden, seine Agenturen, oder andere Bundes-

Regierungsstellen; Schuldverschreibungen, die von Bundes-, Landes-, Kommunal- und Stadtregierungen und deren Behörden, Einrichtungen, Gemeinden und Unterabteilungen ausgegeben oder garantiert werden; Commercial Paper; Bargeld und Geldmarktinstrumente. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile eines anderen OGAW oder Organismus für gemeinsame Anlagen (einschließlich offener börsengehandelter Fonds) im Sinne von Regulations 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren.

Der Fonds kann umfangreich in bestimmte Arten von Derivaten investieren (zu Anlagezwecken oder zwecks effizienten Portfoliomanagements). Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs) und Total Return Swaps, basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % des Nettoinventarwerts des Fonds.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamrendite, bestehend aus Erträgen und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 Prozent seines Nettoinventarwerts in hypothekenbesicherte Wertpapiere (einschließlich besicherter Hypothekenverpflichtungen), die (i) auf US-Dollar lauten, (ii) von der US-Regierung, ihren Behörden, Einrichtungen und politischen Unterabteilungen und von von der US-Regierung gesponserten Unternehmen ausgegeben oder garantiert werden und (iii) an geregelten Märkten in den Vereinigten Staaten notiert sind oder gehandelt werden und in Anhang III des Verkaufsprospekts aufgeführt sind. Der Fonds kann bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in Schuldverschreibungen des US-Schatzamtes, von US-amerikanischen staatlichen Stellen begebenen oder garantierten Schuldverschreibungen und auf US-Dollar lautenden Zahlungsmitteläquivalenten einschließlich Geldmarktfonds und umgekehrte Pensionsgeschäfte (nur zwecks eines effizienten Portfoliomanagements) investieren oder halten. Der Fonds kauft nur Schuldtitel, die über ein Rating von mindestens B- von S&P oder ein vergleichbares Rating von einer anderen anerkannten Ratingagentur verfügen, oder die, wenn sie kein Rating haben, vom Anlageverwalter und Unteranlageverwalter als gleichwertig eingeschätzt werden. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Der Fonds wird nicht über 100 % seines Nettoinventarwerts hinaus gehebelt. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs) und Total Return Swaps, basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % des Nettoinventarwerts des Fonds.

### Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 70 Prozent seines Nettoinventarwerts in Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen von supranationalen Organisationen, die an geregelten Märkten im Vereinigten Königreich und anderen geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden und auf Pfund Sterling lauten.

Der Fonds darf in Unternehmensschuldtitel investieren, einschließlich frei übertragbare Schuldscheine, fest- und variabel verzinsliche Anleihen, Nullkuponanleihen, Schuldverschreibungen, nichtwandelbare Schuldtitel, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepten, die von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften begeben werden.

Darüber hinaus der Fonds in Wertpapiere investieren kann, die von nationalen Regierungen und ihren Behörden ausgegeben oder garantiert werden, Instrumentalitäten und politische Unterabteilungen; STRIPS und inflationsindexgebundene Wertpapiere; Wertpapiere supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen; verbrieftete Beteiligungen an Darlehen, die frei übertragbare Wertpapiere sind; strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um frei übertragbare Wertpapiere handelt, deren Basisrisiko festverzinsliche Wertpapiere sein können; hypothekenbesicherte Wertpapiere (einschließlich besicherter Hypothekenverpflichtungen) und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldverschreibungen strukturiert sind. Der Fonds darf höchstens 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere oder Anteile von anderen OGAW oder sonstigen Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

### Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert jederzeit mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in Unternehmensschuldtitel, die (i) auf US-Dollar lauten und (ii) an den in Anhang III des Verkaufsprospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden.

Zu den Arten von Unternehmensschuldtiteln, in die der Fonds investieren kann, gehören frei übertragbare Schuldscheine, festverzinsliche und variabel verzinsliche Anleihen, Nullkuponanleihen, Schuldverschreibungen, nicht wandelbare Schuldverschreibungen, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepten, die von Industrie-, Versorgungs-, Finanz-, Handelsbank- oder Bankholding-Unternehmen ausgegeben werden.

Darüber hinaus der Fonds kann in Wertpapiere investieren, die von nationalen Regierungen ausgegeben oder garantiert werden (einschließlich STRIPS und inflationsindexgebundene Wertpapiere), ihre Agenturen, Instrumentalitäten und politische Unterabteilungen, Wertpapiere supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen; verbrieftete Beteiligungen an Darlehen, die frei übertragbare Wertpapiere sind; strukturierte Schuldverschreibungen, die frei übertragbare Wertpapiere sind; hypothekenbesicherte Wertpapiere (einschließlich besicherter Hypothekenverpflichtungen); forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind; umgekehrte Pensionsgeschäfte mit Schuldtiteln als zugrunde liegende Instrumente (nur zu Zwecken der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Anforderungen der Zentralbank); und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen, und solche Anlagen dienen dem Zweck, ein Engagement in den hierin beschriebenen Arten von Instrumenten zu erlangen oder anderweitig das Anlageziel und die Anlagepolitik des Fonds zu verfolgen. Der Fonds darf höchstens 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere oder Anteile von anderen OGAW oder sonstigen Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren.

Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und kann aufgrund seiner Verwendung von derivativen Instrumenten bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts fremdfinanziert werden. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

### Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamrendite, bestehend aus Kapitalzuwachs und Erträgen.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel, die an geregelten Märkten in den Vereinigten Staaten notiert sind oder gehandelt werden, die in Anhang III des Verkaufsprospekts aufgeführt sind und von Emittenten weltweit ausgegeben werden. Zu den Arten von Schuldtiteln, in die der Fonds investieren kann, gehören: Schuldtitel, die von der Regierung der Vereinigten Staaten begeben oder garantiert werden, seine Agenturen, Instrumentalitäten und politische Unterabteilungen; Schuldtitel, die von anderen nationalen Regierungen ausgegeben werden, ihre Agenturen, Instrumentalitäten und politische Unterabteilungen; Schuldtitel supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen; Unternehmensanleihen, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, festverzinsliche oder variabel verzinsliche Anleihen; Wandelanleihen; nicht wandelbare Notizen; Credit-Linked Notes, Handelspapier, Einlagenzertifikate, und Bankakzepten, die von Industrie-, Versorgungsunternehmen, Finanzen, Handelsbanken oder Bankholding-Unternehmen; und hypothekenbesicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind.

Der Fonds kann ein Engagement von bis zu 75 % seines Nettoinventarwerts in hypothekenbesicherten und forderungsbesicherten Wertpapieren aufweisen. Die hypothekenbesicherten und forderungsbesicherten Wertpapiere und kreditgebundenen Anleihen, in die der Fonds investiert, können eingebettete Derivate und/oder Hebeleffekte enthalten, und der Fonds kann daher vorbehaltlich der unten dargelegten Gesamthebelgrenzwerte gehebelt werden.

Maximal 25 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Wandelanleihen investiert werden. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in Vorzugsaktien oder andere Aktienwerte, einschließlich Optionsscheine, investiert werden (maximal 5 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in Optionsscheine investiert werden). Maximal 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen investiert werden. Vorbehaltlich der oben genannten Beschränkungen darf der Fonds auch insgesamt nicht mehr als 30 % seines Nettoinventarwerts in nicht öffentlich gehandelte Wertpapiere, Wertpapiere nach Regel 144A, Wertpapiere mit Nullkupon (mit Ausnahme von Wertpapieren, die von der US-Regierung und ihren Behörden ausgegeben werden) und Geldmarktinstrumente investieren.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamterträge durch Erträge und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Unternehmensanleihen und Schuldtitel, die von supranationalen Organisationen ausgegeben werden und (i) auf US-Dollar, japanischen Yen, Euro, Pfund Sterling und eine Vielzahl anderer Währungen lauten und (ii) an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, die in Anhang III des Verkaufsprospekts aufgeführt sind. Darüber hinaus kann der Fonds in Wertpapieren anlegen, die von nationalen Regierungen (einschließlich STRIPS und inflationsindexierten Wertpapieren), ihren Behörden, Instrumenten und politischen Untergliederungen begeben oder garantiert werden, in Wertpapieren von supranationalen Organisationen wie frei übertragbaren Anleihen und Schuldverschreibungen, in umgekehrten Pensionsgeschäften mit Schuldtiteln als Basisinstrumenten (nur zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Anforderungen der Zentralbank) und in anderen offenen Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Vorschrift 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen.

Vorbehaltlich der oben genannten Beschränkung dürfen maximal 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds in wandelbare Schuldverschreibungen und/oder Schuldverschreibungen mit der Option zum Erwerb von Aktienwerten investiert werden. Der Fonds wird keine Aktien oder wirtschaftlichen Anteile an Aktien kaufen, mit Ausnahme von (1) Vorzugsaktien, vorausgesetzt, dass nicht mehr als 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Vorzugsaktien investiert werden dürfen; und (2) Aktien, die durch Umwandlungen von Wandelanleihen oder durch Kapitalmaßnahmen von Emittenten erworben wurden (wie z. B. die Ausgabe von Aktien, um zuvor ausgegebene Schuldtitel zu ersetzen). Nicht mehr als 5 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen anderen Währungen als dem US-Dollar ausgesetzt sein. Vorbehaltlich der oben genannten Beschränkungen darf der Fonds nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen anlegen.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Die Wertpapiere, aus denen sich das Anlageuniversum des Fonds zusammensetzt, werden sowohl mit einem proprietären System als auch mit dem ESG-Rahmen von MSCI bewertet, um das ESG-Rating des gesamten Anlageuniversums und jedes einzelnen Emittenten und seiner Wertpapiere zu bestimmen, und anschließend wählt der Anlageverwalter unter Berücksichtigung der Anlagepolitik des Fonds und der ESG-Ratings der Emittenten der betreffenden Wertpapiere Anlagen für den Fonds aus.

Der Fonds ist bestrebt, in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, die auf Jahresbasis einen absoluten Rückgang der CO<sub>2</sub>-Bilanz anstreben und insgesamt eine gewichtete durchschnittliche CO<sub>2</sub>-Intensität des Portfolios erreichen, die mindestens 20 % niedriger ist als der Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Hedged) USD (der „Benchmark“). Der Anlageverwalter definiert den CO<sub>2</sub>-Fußabdruck als den gewichteten Durchschnitt der CO<sub>2</sub>-Emissionsintensität von Wertpapieren, die innerhalb des Portfolios gehalten werden. Die Intensität der CO<sub>2</sub>-Emissionen bezieht sich auf das Treibhausgas-Protokoll („GHG“) von Scope 1 und Scope 2, das von einem Emittenten emittiert wird.

Wie in der Anlagepolitik dargelegt, wird das Portfolio des Fonds ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von BBB oder besser beibehalten. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere von Emittenten mit MSCI ESG-Ratings von BB oder darunter zum Zeitpunkt des Kaufs anlegen. Aufgrund des integrierten ESG-Ansatzes wendet der Anlageverwalter ESG-Ratings auf mindestens 90 % der Wertpapiere an, in die der Fonds investiert, mit Ausnahme von Hochzinsanleihen und Schwellenländeranleihen, bei denen die ESG-Ratings für mindestens 75 % dieser bestimmten Anlagen gelten. Der Fonds wird ein ESG-Rating des Portfolios aufrechterhalten, das höher ist als das Anlageuniversum des Fonds.

Darüber hinaus wird der Fonds bestrebt sein, mindestens 20 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, deren Aktivitäten zu mindestens einem der acht ausgewählten Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (United Nations Sustainable Development Goals, UNSDGs) beitragen.

Der Fonds wird Anlagen in Wertpapieren der folgenden Emittenten ausschließen:

- Emittenten, die keine guten Governance-Praktiken befolgen, wie vom Anlageverwalter unter Berücksichtigung der Governance-Faktoren im Abschnitt „Nachhaltigkeitsrisiko“ festgelegt;
- Emittenten, die mehr als 5 % des Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder -verteilung erzielen;
- Emittenten erzielen über 10 % des Umsatzes aus:
  - zivile Schusswaffen (Herstellung/Lieferung),
  - jede Beteiligung an konventionellen Waffen,
  - thermischer Kohlebergbau (Produktion/Vertrieb);
- Emittenten, die über 5 % des Umsatzes aus der Produktion von Atomwaffen erzielen;
- Emittenten, die umstrittene Waffen (Antipersonen-Landminen, biochemische Waffen, Blindlaserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht nachweisbare Fragmente) herstellen, ein umstrittenes Waffenunternehmen besitzen oder sich im Besitz eines umstrittene Waffenunternehmens befinden;
- Emittenten, die gemäß dem UN Global Compact als „fehlgeschlagen“ bewertet werden; und
- Staats- und/oder Staatsemittenten, die gemäß dem Freedom House Index unzureichend abschneiden.

Der Anlageverwalter wird mit den Emittenten in Gesprächen mit der Geschäftsleitung über Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungspraktiken sprechen. Der Engagementprozess des Anlageverwalters zielt darauf ab, sich an den Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen auszurichten.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamterträge, bestehend aus Erträgen und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert jederzeit mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel, die (i) an geregelten Märkten hauptsächlich in den folgenden Ländern notiert sind oder gehandelt werden; und (ii) auf Währungen von lauten, oder Emittenten mit Sitz in hauptsächlich die folgenden Länder: die Vereinigten Staaten, Kanada, Australien, Japan, Österreich, Belgien, Finnland, Frankreich, Deutschland, Griechenland, Irland, Italien, die Niederlande, Portugal, Spanien, Dänemark, Schweden, Schweiz, das Vereinigte Königreich, Neuseeland, Norwegen, Ungarn, Polen, und die Tschechische Republik. Der Fonds kann auch in Schuldtitel investieren, die an geregelten Märkten in anderen Industrieländern notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt.

Alle vom Fonds gekauften Schuldtitel werden zum Zeitpunkt des Kaufs mit Investment Grade bewertet. Wenn eine so erworbene Anlage nach dem Zeitpunkt des Kaufs anschließend auf unter Investment Grade herabgestuft wird, kann der Anlageverwalter nach eigenem Ermessen weiterhin die Schuldtitel halten, wenn er feststellt, dass dies im besten Interesse der Aktionäre ist. Der Fonds kann bis zu 20 Prozent seines Nettoinventarwerts in Schuldverschreibungen von Emittenten investieren, die sich in Ländern befinden, in denen beide der folgenden Kriterien zutreffen: (i) die auf Lokalwährung lautende langfristige Verschuldung des Landes wird von S&P unter A- oder der Gegenwert von allen NRSROs, die die Verschuldung bewerten, bewertet und (ii) das Land ist nicht im Citigroup World Government Bond Index vertreten. Maximal 25 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds können in wandelbare Schuldverschreibungen und bis zu 10 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds in Aktien und/oder Optionsscheine investiert werden. Nicht mehr als 5 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds werden in Optionsscheine investiert. Der Fonds darf nicht mehr als 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne der Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen anlegen. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 25 % seines Nettoinventarwerts. Der Fonds wird, einschließlich synthetischer Short-Positionen, nicht über 100 Prozent seines Nettoinventarwerts (berechnet anhand des Commitment-Ansatzes) gehebelt.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Der Anlageverwalter verwendet einen facettenreichen Ansatz, um die Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren („ESG“) über mindestens 90 % seiner aktuellen und zukünftigen Beteiligungen zu bewerten. Dieser Prozess beinhaltet die Verwendung eines proprietären Systems für die Bewertung und Klassifizierung von Emittenten zusammen mit der Verwendung von Rohdaten, Metriken und Analysen externer Anbieter. Die Ergebnisse dieser Analyse bilden die Grundlage für den Portfolioausschluss, wobei das durch die ökologischen und sozialen Faktoren für staatliche Emissionen definierte untere Dezil des investierbaren Universums durch das Screening ausgeschlossen und das zweitniedrigste Dezil automatisch zu Investitionskandidaten wird.

Der Fonds hat keinen spezifischen Sektorausschluss für staatliche Emittenten, die auf den Export fossiler Brennstoffe und/oder natürlicher Ressourcen angewiesen sind; jedoch können staatliche Emittenten, die auf diese Rohstoffsektoren angewiesen sind, ausgeschlossen werden, wenn ihre Umwelt- und Sozialwerte gemäß der verwendeten ESG-Methode in das unterste Dezil fallen.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Positive Renditen zu erzielen, die unabhängig von den Marktzyklen sind.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 70 Prozent seines Nettoinventarwerts in (i) Schuldtitel, Wandelbare Wertpapiere und Vorzugsaktien, die an geregelten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (ii) Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen; und (iii) Derivate, die ein Engagement in einem oder allen der folgenden Bereiche bieten: Schuldtitel, Zinssätze, Währungen und festverzinslichen Indizes, die die Zulassungsanforderungen der Zentralbank erfüllen. Der Fonds darf nicht mehr als 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteilen oder Anteilen anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen anlegen, und solche Anlagen dienen dem Zweck, sich in den in den Anlagerichtlinien *beschriebenen Arten von Instrumenten zu engagieren* oder anderweitig das Anlageziel und die Anlagepolitik des Fonds zu verfolgen.

Der Fonds kann ausgiebig in bestimmte Arten von Derivaten investieren, sei es zu Anlagezwecken oder zum Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung, wie im Abschnitt „Anlagetechniken und -instrumente und Finanzinstrumente“ des Prospekts beschrieben, einschließlich, aber nicht beschränkt auf Optionen, Futures und Optionen auf Futures, Devisenterminkontrakte und Optionsscheine. Reverse-Repurchase-Vereinbarungen, die Schuldtitel enthalten, da die zugrunde liegenden Instrumente für effiziente Portfoliomanagementzwecke verwendet werden können. Der Fonds kann auch Swaps einsetzen, einschließlich, aber nicht beschränkt auf Zins-, Total Return- und Inflationsswaps. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 25 % seines Nettoinventarwerts.

### Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Hohes Einkommen generieren. Die Generierung von Kapitalgewinnen ist ein sekundäres Ziel.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert jederzeit mindestens 80 Prozent seines Nettoinventarwerts in Unternehmensanleihen, die vom Anlageverwalter als hochverzinslich angesehen werden und an geregelten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden. Höhere Renditen sind im Allgemeinen von Wertpapieren verfügbar, die von S&P mit BB+ oder niedriger oder von Moody's mit Ba1 oder niedriger eingestuft wurden, oder von einem anderen NRSRO mit dem entsprechenden oder niedrigeren Rating oder wenn der Anlageverwalter kein Rating als von vergleichbarer Qualität erachtet. Schuldtitel, die unter Investment Grade eingestuft werden, werden von Ratingagenturen als überwiegend spekulativ in Bezug auf die Fähigkeit des Emittenten zur Zahlung von Zinsen und Rückzahlung des Kapitals angesehen und können ein erhebliches Risiko für ein Risiko negativer Bedingungen beinhalten. Der Fonds kann in Schuldtitel investieren, die von Moody's mit einem niedrigen Rating von C oder von S&P mit D bewertet werden, wobei die Ratings darauf hindeuten, dass die Verpflichtungen hochspekulativ sind und in Bezug auf Kapital und Zinsen in Verzug oder in Verzug geraten können. Der Anlageverwalter verlässt sich bei Anlageentscheidungen nicht ausschließlich auf die Ratings von bewerteten Wertpapieren, sondern setzt stattdessen einen quantitativen und qualitativen Prozess ein, um zu bestimmen, welche Wertpapiere einen Wert bieten. Zu den Faktoren, die bei der Bestimmung helfen, welchen Wert Unternehmensanleihen bieten, gehören die Stärke der Staatswirtschaft des Emittenten, der relative Wert der Währung der Wertpapiere, die Qualität des Geschäftsmodells des Emittenten, die Position der Wertpapiere in der Kapitalstruktur des Emittenten, die Qualität der Verpflichtungen in den Wertpapieren und die wahrscheinliche Rückforderungsrate der Wertpapiere im Stressfall. Der Anlageansatz des Anlageverwalters umfasst die Analyse wesentlicher Umwelt-, Sozial- und Governance-Probleme (ESG), die sich auf die Wertentwicklung einer Anlage auswirken können. Der Fonds wird in der Lage sein, bis zu 100 Prozent seines Nettoinventarwerts in Wertpapieren zu investieren, die in Schwellenländern ausgegeben werden. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts. In Bezug auf das Währungsrisiko darf der Anlageverwalter keine Netto-Short-Position in einer Währung oder einen Long-Wert von mehr als 105 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds aufweisen.

### Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamterträge, bestehend aus Erträgen und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel, die an geregelten Märkten an einem beliebigen Ort der Welt notiert sind oder gehandelt werden, einschließlich der Schwellenländer, und wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt.

Die Anlagen des Fonds können Folgendes umfassen: – (i) Schuldtitel, die von nationalen Regierungen ausgegeben oder garantiert werden, ihre Behörden oder Einrichtungen und politischen Unterabteilungen (einschließlich inflationsgeschützter Wertpapiere); (ii) Schuldtitel supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, festverzinsliche oder variabel verzinsliche Anleihen und Schuldverschreibungen; (iii) Unternehmensanleihen von Emittenten (diversifiziert über eine Vielzahl von Branchen, einschließlich, aber nicht beschränkt auf Kommunikation, Verbraucher, Energie, Finanzen, industriell, Technologie und Versorgungsunternehmen, usw.) in geregelten Märkten ansässig sind oder deren Wertpapiere an diesen notiert sind oder gehandelt werden, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, festverzinsliche oder variabel verzinsliche Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), umwandelbare und nicht umwandelbare Schuldverschreibungen, Handelspapier, Einlagenzertifikate, und Bankakzeptanzen, die von Industrie-, Versorgungsunternehmen, Finanzen, Handelsbanken oder Bankholding-Unternehmen; und (iv) hypothekenbesicherte Wertpapiere (einschließlich besicherter Schuldverpflichtungen) und forderungsbesicherte Wertpapiere; Vorzugsaktien und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne der Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen. Der Anlageansatz des Anlageverwalters umfasst die Analyse wesentlicher Umwelt-, Sozial- und Governance-Probleme (ESG), die sich auf die Wertentwicklung einer Anlage auswirken können. Der Fonds darf nicht mehr als 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne der Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen anlegen. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 25 % seines Nettoinventarwerts. Der Fonds wird, einschließlich synthetischer Short-Positionen, nicht über 100 Prozent seines Nettoinventarwerts gehebelt. Vorbehaltlich dieses Limits wird erwartet, dass der Fonds ein Netto-Long-Engagement aufweist. In Bezug auf das Währungsrisiko darf der Anlageverwalter keine Netto-Short-Position in einer Währung oder einen Long-Wert von mehr als 105 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds aufweisen.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

*Anlageziel* – Maximierung der Ertragsrendite unter allen Marktbedingungen bei gleichzeitigem Kapitalerhalt.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert in: (i) Schuldverschreibungen und wandelbare Wertpapiere, die an geregelten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden; (ii) Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen; und (iii) Derivate, die ein Engagement in einem oder allen der folgenden Bereiche bieten: Schuldtitel, Zinssätze, Währungen, Aktien und Indizes (einschließlich festverzinslicher Wertpapiere, Aktien- und Rohstoffindizes), die die Zulassungsanforderungen der Zentralbank erfüllen. Der Fonds investiert mindestens 70 Prozent seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel und Derivate, die ein Engagement in Schuldtiteln bieten. Der Fonds wird mindestens 85 % seines Nettoinventarwerts in US-Dollar anlegen. Wenn jedoch Möglichkeiten zur Verfügung stehen, kann dies von Zeit zu Zeit mindestens 80 % in US-Dollar betragen. Der Fonds darf nicht mehr als 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne der Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen anlegen. Reverse-Repurchase-Vereinbarungen, die Schuldtitel enthalten, da die zugrunde liegenden Instrumente für effiziente Portfoliomanagementzwecke verwendet werden können. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Der Anlageverwalter verwendet einen facettenreichen Ansatz, um die Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren („ESG“) über mindestens 90 % seiner aktuellen und zukünftigen Beteiligungen zu bewerten. Dieser Prozess beinhaltet die Verwendung eines proprietären Systems für die Bewertung und Klassifizierung von Emittenten zusammen mit der Verwendung von Rohdaten, Metriken und Analysen externer Anbieter. Die Ergebnisse dieser Analyse bilden die Grundlage für den Portfolioausschluss, bei dem das unterste Dezil, wie es durch die ökologischen und sozialen Faktoren für Staats- und Unternehmensanleihen definiert ist, des investierbaren Universums herausgefiltert wird und das zweitniedrigste Dezil zu automatischen Engagementkandidaten wird. Der Anlageverwalter überwacht auch aktuelle und zukünftige Bestände auf Verschlechterung und Verbesserung umweltbezogener und sozialer Faktoren.

Der Fonds hat keinen spezifischen Sektorausschluss für fossile Brennstoffe; Unternehmensemittenten im fossilen Brennstoffsektor sind jedoch ausgeschlossen, wenn ihre Umwelt- und Sozialwerte gemäß der verwendeten ESG-Methodik in das unterste Dezil fallen.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>A</sup>

*Anlageziel* – Maximierung der Gesamterrendite durch hohe Erträge und Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds strebt an, sein Anlageziel zu erreichen, hauptsächlich durch einen flexiblen Anlageansatz für Schuldtitel von Emittenten mit Sitz in einem beliebigen Land, sowohl durch Long- als auch Short-Engagement (über Derivate). Der Fonds investiert maximal 25 % seines Nettoinventarwerts in hypothekenbesicherte Wertpapiere innerhalb eines einzigen Nicht-US-Landes. Der Fonds investiert außerdem insgesamt maximal 40 % seines Nettoinventarwerts in hypothekenbesicherte Wertpapiere von Nicht-US-Ländern. Der Fonds investiert maximal 10 % seines Nettoinventarwerts in besicherte Schuldverpflichtungen und besicherte Darlehensverpflichtungen. Der Anlageansatz des Anlageverwalters umfasst die Analyse wesentlicher Umwelt-, Sozial- und Governance-Probleme (ESG), die sich auf die Wertentwicklung einer Anlage auswirken können. Zu den Arten von Schuldtiteln, in die der Fonds investieren kann, gehören: Hypothekenbesicherte Wertpapiere von Agenturen und Nicht-Agenturen, die als Schuldtitel strukturiert sind; vermögensbesicherte Wertpapiere; Unternehmensanleihen, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine; Wandelanleihen und nicht wandelbare Anleihen; Handelspapier, Einlagezertifikate, und Bankakzeptanzen, die von Industrie-, Versorgungsunternehmen, Finanzen, Handelsbanken oder Bankholding-Unternehmen; von nationalen Regierungen begebene oder garantierte Schuldtitel, ihre Agenturen, Instrumentalitäten und politische Unterabteilungen; Schuldtitel supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen; strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren sein kann; verbrieftete Beteiligungen an Darlehen, die übertragbare Wertpapiere sind; Euro-Dollar-Anleihen und Yankee-Dollar-Instrumente (einschließlich vorrangiger und nachrangiger Anleihen); und Rule 144A-Wertpapiere. Die strukturierten Schuldverschreibungen, in die der Fonds investiert, können eingebettete Derivate enthalten, und der Fonds kann infolgedessen fremdfinanziert werden. Die Hebelwirkung des Fonds, berechnet anhand der Summe der Nominalwerte der vom Fonds gehaltenen Derivate, wird weniger als 700 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds betragen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts. Der Fonds darf nicht mehr als 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen anlegen.

### Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>A</sup>

*Anlageziel* – Generierung von Erträgen sowie langfristigen Kapitalgewinnen.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert jederzeit mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Unternehmensanleihen, die vom Anlageverwalter als hochverzinslich angesehen werden und an geregelten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt, einschließlich direkter oder indirekter Investitionen durch Derivate auf solche Wertpapiere, vorausgesetzt, dass der Fonds mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts direkt in solche Wertpapiere investiert.

Der Fonds kann insgesamt bis zu 20 Prozent seines Nettoinventarwerts in Geldmarktinstrumente investieren, die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, sowie in Schuldtitel der im Verkaufsprospekt aufgeführten Arten, die nicht an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, vorausgesetzt jedoch, dass maximal 10 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds in Schuldtitel investiert werden können, die nicht an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden. Maximal 20 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds können in wandelbare Schuldverschreibungen investiert werden. Bis zu 20 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds können in Vorzugsaktien investiert werden. Es dürfen maximal 20 Prozent in Aktien investiert werden, einschließlich Optionsscheine (maximal 15 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds können in Optionsscheine investiert werden). Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Der Fonds kann für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Auflagen der Zentralbank ein Engagement in umgekehrten Pensionsgeschäften eingehen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts. In Bezug auf das Währungsrisiko darf der Anlageverwalter keine Netto-Short-Position in einer Währung oder einen Long-Wert von mehr als 105 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds aufweisen.

### Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>A</sup>

*Anlageziel* – Positive Renditen zu erzielen, die unabhängig von den Marktzyklen sind.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 Prozent seines Nettoinventarwerts in: (i) Schuldverschreibungen, wandelbare Wertpapiere und Vorzugsaktien, die an geregelten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Prospekts dargelegt; (ii) Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen; und (iii) Derivate, die ein Engagement in einem oder allen der folgenden Bereiche bieten: Schuldtitel, Zinssätze, Währungen und festverzinslichen Indizes, die die Zulassungsanforderungen der Zentralbank erfüllen. Der Fonds darf nicht mehr als 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen anlegen, und solche Anlagen dienen dem Zweck, sich in den hierin beschriebenen Arten von Instrumenten zu engagieren oder anderweitig das Anlageziel und die Anlagepolitik des Fonds zu verfolgen. Reverse-Repurchase-Vereinbarungen, die Schuldtitel enthalten, da die zugrunde liegenden Instrumente für effiziente Portfoliomanagementzwecke verwendet werden können.

Der Fonds kann ausgiebig in bestimmte Arten von Derivaten investieren, sei es zu Anlagezwecken oder zum Zweck einer effizienten Portfolioverwaltung, nämlich Optionen, Futures und Optionen auf Futures, Devisenterminkontrakte und Optionsscheine. Der Fonds kann auch Swaps einsetzen, einschließlich, aber nicht beschränkt auf Zinssatz-, Gesamterrendite-, Kreditausfall- und Inflationswaps.

<sup>A</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Bereitstellung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 Prozent seines Nettoinventarwerts in Aktien von Unternehmen mit großer Marktkapitalisierung, die (1) ihren Sitz oder Sitz in den Vereinigten Staaten haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Aktivitäten in den Vereinigten Staaten ausüben und (2) an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Prospekts dargelegt.

Der Fonds investiert in Stammaktien und Vorzugsaktien. Vorbehaltlich des oben genannten Anlagelimits in Aktien der Fonds kann auch in Schuldtitel investieren, die von in den USA ansässigen Emittenten begeben oder garantiert werden, einschließlich der US-Regierung, seine Agenturen, Instrumentalitäten, und politische Unterabteilungen; Unternehmensschuldtitel, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Handelspapier, Einlagenzertifikate, und Bankakzeptanzen, die von Industrie-, Versorgungsunternehmen, Finanzen, Handelsbanken oder Bankholding-Unternehmen; und Optionsscheine. Der Fonds kauft nur Schuldtitel, die zum Zeitpunkt des Kaufs mit Investment Grade bewertet sind. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

### Legg Mason ClearBridge Value Fund

*Anlageziel* – Erreichen eines langfristigen Kapitalzuwachses.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert hauptsächlich in Wertpapiere von US-Emittenten, die nach Ansicht des Anlageverwalters unterbewertet sind. Der Fonds kann auch bis zu 20 Prozent seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere von Nicht-US-Emittenten anlegen. Mindestens 50 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds werden in Aktien investiert. Der Fonds kann auch bis zu 5 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen anlegen.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Der Anlageverwalter verwendet einen etablierten proprietären Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens zu Umwelt-, Sozial- und Governance-Themen („ESG“) zu bestimmen. Dazu gehört die Erstellung eines ESG-Ratings durch sein ESG-Ratingsystem, indem sowohl quantitative als auch qualitative Aspekte bewertet werden. Dieses System hat vier Rating-Stufen: AAA, AA, A und B, die Unternehmen auf der Grundlage der Leistung bei wichtigen ESG-Themen zugewiesen werden. Unternehmen, die gemäß dem proprietären ESG-Ratingsystem ein „B“-Rating erhalten, können dem Fonds hinzugefügt werden, obwohl diese Unternehmen einen geringeren Prozentsatz des Fonds im Vergleich zu denjenigen mit „A“ und höher umfassen. Darüber hinaus wird der Anlageverwalter regelmäßig direkt mit den Unternehmen mit „B“-Rating in den Fonds eingebunden, um die wesentlichen ökologischen und/oder sozialen Eigenschaften dieser Unternehmen zu verbessern.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die mindestens 10 % ihres Umsatzes aus der Produktion und/oder dem Vertrieb von Waffen generieren, und Unternehmen, die einen Umsatz aus (a) verbotenen Waffen gemäß (i) dem Übereinkommen über das Verbot der Verwendung erzielen, Bevorratung, Produktion und Transfer von Antipersonenminen und deren Zerstörung und (ii) das Übereinkommen über das Verbot von Clustermunitionen und (b) Waffen, die gemäß dem Übereinkommen der Vereinten Nationen über biologische Waffen bzw. dem Übereinkommen über chemische Waffen der Vereinten Nationen als B- oder C-Waffen klassifiziert sind; und
- Unternehmen, die mindestens 5 % ihres Umsatzes aus Tabak erwirtschaften.

Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben dargelegt) auf 100 % des Portfolios des Fonds an, um ein Portfolio-ESG-Rating aufrechtzuerhalten, das höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund

*Anlageziel* – Erzeugung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 70 Prozent seines Nettoinventarwerts in Aktien von US-Unternehmen, die an geregelten Märkten in den

Vereinigten Staaten, die in Anhang III des Prospekts aufgeführt sind. Die Anlagen des Fonds umfassen Stammaktien, Vorzugsaktien und aktienbezogene Wertpapiere. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Der Fonds kann auch in bestimmte Arten von Derivaten investieren, jedoch nur zu Zwecken der effizienten Portfolioverwaltung. Der Anlageverwalter kann die Allokation des Fonds in Geldmarktinstrumente und zusätzliche liquide Vermögenswerte erhöhen, wenn nach Ansicht des Anlageverwalters die Marktbewertungsniveaus überhöht werden.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Der Anlageverwalter verwendet einen etablierten proprietären Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens zu Umwelt-, Sozial- und Governance-Themen („ESG“) zu bestimmen. Dazu gehört die Erstellung eines ESG-Ratings über sein ESG-Ratingsystem, indem sowohl quantitativ als auch qualitativ bewertet wird. Dieses System hat vier Rating-Stufen: AAA, AA, A und B, die Unternehmen auf der Grundlage der Leistung bei wichtigen ESG-Themen zugewiesen werden. Unternehmen, die gemäß dem proprietären ESG-Ratingsystem ein B-Rating erhalten, werden in diesem Fonds nicht für Anlagen berücksichtigt.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen mit erheblicher Beteiligung an der Gewinnung fossiler Brennstoffe und des Bergbaus, von denen Analysten glauben, dass sie keine eindeutig besseren ESG-Attribute aufweisen als andere ähnliche Unternehmen; und
- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes aus der Produktion und/oder dem Vertrieb von Waffen erzielen, und Unternehmen, die einen Umsatz aus (a) verbotenen Waffen gemäß (i) dem Übereinkommen über das Verbot der Verwendung erzielen, Bevorratung, Produktion und Transfer von Antipersonenminen und auf deren Zerstörung und (ii) das Übereinkommen über das Verbot von Clustermunitionen und (b) Waffen, die gemäß dem Übereinkommen der Vereinten Nationen über biologische Waffen bzw. dem Übereinkommen über chemische Waffen der Vereinten Nationen als B- oder C-Waffen klassifiziert sind.

Der Fonds hat kein Engagement in Unternehmen, die Tabakprodukte produzieren, kann aber in Unternehmen investieren, die indirekt 5 % oder weniger ihrer Einnahmen aus Tabak generieren. Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben dargelegt) auf 100 % des Portfolios des Fonds an, um ein Portfolio-ESG-Rating aufrechtzuerhalten, das höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund

*Anlageziel* – Erzeugung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 70 Prozent seines Nettoinventarwerts in Aktien einer konzentrierten Gruppe von US-Unternehmen mit hoher Marktkapitalisierung, die an den in Anhang III des Verkaufsprospekts aufgeführten geregelten Märkten in den Vereinigten Staaten notiert sind oder gehandelt werden. Die Kernbestände des Fonds werden US-Unternehmen mit großer Marktkapitalisierung sein, die in ihren jeweiligen Branchen dominant sind, globalen Umfang haben und eine langfristige Performance-Historie aufweisen. Die Anlagen des Fonds bestehen aus Stammaktien und in geringerem Umfang Vorzugsaktien und aktienbezogenen Wertpapieren, die von US-Unternehmen mit großer Marktkapitalisierung begeben werden oder damit in Verbindung stehen, von denen angenommen wird, dass sie attraktive Chancen für das Anlagewachstum bieten. Der Fonds

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

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

investiert nicht in Wertpapiere, die an geregelten Märkten in Schwellenländern, europäischen Schwellenländern oder asiatisch-pazifischen Schwellenländern notiert sind oder gehandelt werden. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1) (e) der UCITS Regulations investiert werden.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Der Anlageverwalter verwendet einen etablierten proprietären Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens zu Umwelt-, Sozial- und Governance-Themen („ESG“) zu bestimmen. Dazu gehört die Erstellung eines ESG-Ratings über sein ESG-Ratingsystem, indem sowohl quantitativ als auch qualitativ bewertet wird. Dieses System hat vier Rating-Stufen: AAA, AA, A und B, die Unternehmen auf der Grundlage der Leistung bei wichtigen ESG-Themen zugewiesen werden. Unternehmen, die gemäß dem proprietären ESG-Ratingsystem ein B-Rating erhalten, werden in diesem Fonds nicht für Anlagen berücksichtigt.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen mit erheblicher Beteiligung an der Gewinnung fossiler Brennstoffe und des Bergbaus, von denen Analysten glauben, dass sie keine eindeutig besseren ESG-Attribute aufweisen als andere ähnliche Unternehmen; und
- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes aus der Produktion und/oder dem Vertrieb von Waffen erzielen, und Unternehmen, die einen Umsatz aus (a) verbotenen Waffen gemäß (i) dem Übereinkommen über das Verbot der Verwendung erzielen, Bevorratung, Produktion und Transfer von Antipersonenminen und auf deren Zerstörung und (ii) das Übereinkommen über das Verbot von Clustermunitionen und (b) Waffen, die gemäß dem Übereinkommen der Vereinten Nationen über biologische Waffen bzw. dem Übereinkommen über chemische Waffen der Vereinten Nationen als B- oder C-Waffen klassifiziert sind.

Der Fonds hat kein Engagement in Unternehmen, die Tabakprodukte produzieren, kann aber in Unternehmen investieren, die indirekt 5 % oder weniger ihrer Einnahmen aus Tabak generieren. Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben dargelegt) auf 100 % des Portfolios des Fonds an, um ein Portfolio-ESG-Rating aufrechtzuerhalten, das höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund

*Anlageziel* – Erzeugung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Stammaktien von US-Unternehmen, die an den in Anhang III des Verkaufsprospekts aufgeführten geregelten Märkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden und von denen der Anlageverwalter glaubt, dass sie oder das Potenzial zu erleben, Wachstum des Gewinns und/oder Cashflows, das die durchschnittliche Gewinn- und/oder Cashflow-Wachstumsrate von Unternehmen übersteigt, deren Wertpapiere im Standard & Poor's Daily Price Index von 500 Stammaktien (der „S&P 500 Index“) enthalten sind. Der Anlageverwalter konzentriert seine Aktienauswahl für den Fonds auf die diversifizierte Gruppe von Wachstumsunternehmen aus Schwellenländern, die möglicherweise ihre „Start-up“-Phase durchlaufen haben und positive Gewinne und die Aussicht auf signifikante Gewinngewinne in den zwei bis drei Jahren nach dem Erwerb ihrer Aktien durch den Fonds aufweisen. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Der Anlageverwalter verwendet einen etablierten proprietären Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens zu Umwelt-, Sozial- und Governance-Themen („ESG“) zu bestimmen. Dazu gehört die Erstellung eines ESG-Ratings durch sein ESG-Ratingsystem, indem sowohl quantitative als auch qualitative Aspekte bewertet werden. Dieses System hat vier Rating-Stufen: AAA, AA, A und B, die Unternehmen auf der Grundlage der Leistung bei wichtigen ESG-Themen zugewiesen werden. Unternehmen, die gemäß dem proprietären ESG-Ratingsystem ein B-Rating erhalten, werden in diesem Fonds nicht für Anlagen berücksichtigt.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen mit erheblicher Beteiligung an der Gewinnung fossiler Brennstoffe und des Bergbaus, von denen Analysten glauben, dass sie keine eindeutig besseren ESG-Attribute aufweisen als andere ähnliche Unternehmen; und
- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes aus der Produktion und/oder dem Vertrieb von Waffen erzielen, und Unternehmen, die einen Umsatz aus (a) verbotenen Waffen gemäß (i) dem Übereinkommen über das Verbot der Verwendung erzielen, Bevorratung, Produktion und Transfer von Antipersonenminen und auf deren Zerstörung und (ii) das Übereinkommen über das Verbot von Clustermunitionen und (b) Waffen, die gemäß dem Übereinkommen der Vereinten Nationen über biologische Waffen bzw. dem Übereinkommen über chemische Waffen der Vereinten Nationen als B- oder C-Waffen klassifiziert sind.

Der Fonds hat kein Engagement in Unternehmen, die Tabakprodukte produzieren, kann aber in Unternehmen investieren, die indirekt 5 % oder weniger ihrer Einnahmen aus Tabak generieren. Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben dargelegt) auf 100 % des Portfolios des Fonds an, um ein Portfolio-ESG-Rating aufrechtzuerhalten, das höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

*Anlageziel* – Hohes Einkommen. Ein langfristiger Kapitalzuwachs ist ein sekundäres Ziel.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 Prozent seines Nettoinventarwerts in Aktien und aktienbezogene Wertpapiere, die voraussichtlich Anlageerträge, Dividendenzahlungen oder andere Ausschüttungen liefern, die an den in Anhang III des Verkaufsprospekts aufgeführten geregelten Märkten und von Emittenten weltweit notiert sind oder gehandelt werden. Der Fonds kann in Aktien und aktienbezogene Wertpapiere von Emittenten mit jeglicher Marktkapitalisierung investieren. Bei der Auswahl von Wertpapieren verwendet der Anlageverwalter einen kombinierten fundamentalen und makroökonomischen Ansatz, um Vermögenswerte mit attraktiven Dividenden und zukünftigen Gewinnaussichten zu identifizieren. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

### Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Bereitstellung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

*Anlagepolitik* – Der Anlageverwalter ist bestrebt, langfristig in Unternehmen zu investieren, die seiner Meinung nach von hoher Qualität sind und nachhaltige Wettbewerbsvorteile aufweisen, was sich durch hohe Kapitalrenditen, solide Bilanzen und kompetente Managementteams, die Kapital effizient zuteilen, auszeichnet. Der Fonds wird nicht in Unternehmen investieren, die erheblich direkt an der Gewinnung fossiler Brennstoffe und Bergbau beteiligt sind, sondern stattdessen nach anderen attraktiven nachhaltigen Möglichkeiten in den Sektoren Energie, Industrie und Rohstoffe suchen.

Obwohl das Vermögen des Fonds normalerweise hauptsächlich in Stammaktien von US-Unternehmen investiert wird, kann der Fonds auch insgesamt bis zu 15 % seines Nettoinventarwerts in wandelbare Wertpapiere (die eingebettete Derivate und/oder Hebeleffekte enthalten können), Vorzugsaktien, Optionsscheine, REITs, Rule 144A-Wertpapiere und Geldmarktinstrumente investieren, die an geregelten Märkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)

Der Fonds investiert zu jeder Zeit mindestens 85 % seines Nettoinventarwerts in US-Aktienpapiere (einschließlich Stammaktien und Vorzugsaktien), die an der regulierten Börse notiert sind oder gehandelt werden Märkte in den Vereinigten Staaten, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts der Gesellschaft dargelegt, die von Unternehmen ausgegeben werden, die die finanziellen Kriterien des Anlageverwalters und seine Kriterien für Nachhaltigkeit und Umwelt-, Sozial- und Governance-Richtlinien („ESG“) erfüllen („Nachhaltigkeitsführer“). Der Anlageverwalter wendet seine Kriterien des ESG Sustainability Leader auf 100 % des Portfolios des Fonds an. Der Portfolioaufbauprozess des Anlageverwalters beschränkt die Unternehmen im investierbaren Universum des Fonds um mindestens 20 %, um nur diejenigen Unternehmen aufzunehmen, die Nachhaltigkeitsführer sind.

Der Anlageverwalter verwendet einen etablierten proprietären Research- und Engagement-Prozess, um festzustellen, ob ein Unternehmen ein Nachhaltigkeitsführer ist. Dieser proprietäre Prozess des Anlageverwalters umfasst die Erstellung eines ESG-Ratingsystems, das auf der langjährigen Erfahrung des Anlageverwalters bei der Verwaltung von ESG-Anlagestrategien und der Identifizierung von ESG-Best Practices basiert. Die Nachhaltigkeitsführung kann sowohl quantitativ als auch qualitativ über das ESG-Ratingsystem des Anlageverwalters und seinen direkten Research- und Engagementprozess bewertet werden. Das ESG-Ratingsystem des Anlageverwalters besteht aus vier Ratingstufen: AAA, AA, A und B, die Unternehmen auf der Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der wichtigsten ESG-Aspekte zugewiesen werden.

Der Fonds ist nicht an Herstellern fossiler Brennstoffe, an Herstellern umstrittener Waffen (d. h. Antipersonenminen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Clustermunition) und an Unternehmen gebunden, die 5 % oder mehr ihrer Einnahmen aus Tabak oder mehr als 5 % der Einnahmen aus konventionellen Waffen oder 15 % der Einnahmen aus der Atomenergieerzeugung generieren.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Langfristiger Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 Prozent seines Nettoinventarwerts in Aktien, die an geregelten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt. Bis zu 25 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds können in Aktien von Emittenten in Schwellenländern investiert werden. Das Engagement des Fonds in russischen Wertpapieren wird 15 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds nicht übersteigen. Maximal 10 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds können in Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen investiert werden, und solche Anlagen dienen dem Zweck, sich in den hierin beschriebenen Arten von Instrumenten zu engagieren oder anderweitig das Anlageziel und die Anlagepolitik des Fonds zu verfolgen. Nicht mehr als 5 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds werden in Optionsscheine investiert. Um Kapitalflüsse zu verwalten, kann der Fonds Bargeld halten oder in Geldmarktinstrumente investieren.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Der Anlageverwalter verwendet einen etablierten proprietären Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens zu Umwelt-, Sozial- und Governance-Themen („ESG“) zu bestimmen. Dazu gehört die Erstellung eines ESG-Ratings durch sein ESG-Ratingsystem, indem sowohl quantitative als auch qualitative Aspekte bewertet werden. Dieses System hat vier Rating-Stufen: AAA, AA, A und B, die Unternehmen auf der Grundlage der Performance bei wichtigen ESG-Themen zugewiesen wurden. Unternehmen, die gemäß dem proprietären ESG-Ratingsystem ein B-Rating erhalten, werden in diesem Fonds nicht für Anlagen berücksichtigt.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen mit erheblicher Beteiligung an der Gewinnung und/oder Produktion fossiler Brennstoffe und Bergbau;
- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes aus der Produktion und/oder dem Vertrieb von Waffen erzielen, und Unternehmen, die einen Umsatz aus (a) verbotenen Waffen gemäß (i) dem Übereinkommen über das Verbot der Verwendung erzielten, Bevorratung, Produktion und Transfer von Antipersonenminen und deren Zerstörung und (ii) das Übereinkommen über das Verbot von Clustermunitionen und (b) Waffen, die gemäß dem Übereinkommen der Vereinten Nationen über biologische Waffen bzw. dem Übereinkommen über chemische Waffen der Vereinten Nationen als B- oder C-Waffen klassifiziert sind; und
- Unternehmen, die 15 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Atomenergieerzeugung generieren.

Der Fonds hat kein Engagement in Unternehmen, die Tabakprodukte produzieren, kann aber in Unternehmen investieren, die indirekt 5 % oder weniger ihrer Einnahmen aus Tabak generieren. Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben dargelegt) auf 100 % des Portfolios des Fonds an, um ein Portfolio-ESG-Rating aufrechtzuerhalten, das höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Um ein langfristiges stabiles Wachstum zu erreichen, das aus regelmäßigen und konsistenten Erträgen aus Dividenden und Zinsen plus Kapitalwachstum aus einem Portfolio globaler Infrastrukturtitel besteht.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 Prozent seines Nettoinventarwerts in Infrastrukturunternehmen über Aktien und aktienbezogene Wertpapiere, die an geregelten Märkten in den G7-Ländern der Vereinigten Staaten, des Vereinigten Königreichs, Japan, Deutschland, Frankreich, Italien und Kanada notiert sind oder gehandelt werden, und Aktien und aktienbezogene Wertpapiere, die an geregelten Märkten anderer Industrieländer und Schwellenländer, einschließlich Indien, notiert sind oder gehandelt werden. Zu den Aktien und aktienbezogenen Wertpapieren, in die der Fonds investieren kann, gehören Stammaktien, Vorzugsaktien, Hinterlegungsscheine, Rechte, Optionsscheine und Beteiligungsscheine von Infrastrukturunternehmen. Der Fonds kann in amerikanische und globale Hinterlegungsscheine (ADRs / GDRs) von Unternehmen investieren, die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt.

Der Fonds kann bis zu 20 Prozent seines Nettoinventarwerts in geschlossene Organismen für gemeinsame Anlagen wie REITs investieren. Alle REITs, in die der Fonds investiert, werden an einem geregelten Markt notiert oder gehandelt. Der Fonds kann bis zu 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile anderer offener OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen anlegen, vorausgesetzt, die Anlagepolitik und die Liquiditätsbestimmungen dieser Organismen für gemeinsame Anlagen stimmen mit denen des Fonds überein.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Für diesen Fonds werden, soweit möglich, Umwelt-, Sozial- und Governance-Risiken und -Chancen („ESG“) auf zwei wesentliche Weisen berücksichtigt. Erstens bei der Bewertung der Cashflows, die vom Anlageverwalter im Rahmen einer fundamentalen Wertpapierbewertung in Bezug auf geeignete Beteiligungsgesellschaften prognostiziert werden. Zweitens, wenn die ESG-Faktoren nicht in diesen prognostizierten Cashflows erfasst werden können, werden sie stattdessen durch eine Anpassung der erforderlichen Rendite oder Hurdle Rate der Anlage erfasst. Unter diesen Umständen werden die relevanten ESG-Faktoren und die Unternehmensführung dieser Faktoren durch eine proprietäre Scorecard des jeweiligen Analysten bewertet, was wiederum zu einer Anpassung der erforderlichen Rendite oder Hurdle Rate führt, die auf jede potenzielle Investition angewendet wird.

Aufgrund des integrierten ESG-Ansatzes wendet der Anlageverwalter seinen ESG-Prozess auf mindestens 90 % des Portfolios des Fonds an. Der Fonds wird ein ESG-Rating des Portfolios aufrechterhalten, das höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

In Übereinstimmung mit dem Bewertungsansatz des Fonds, der eine Haltedauer von fünf Jahren annimmt, wird Nachhaltigkeit anhand eines ESG-Scores bewertet, der sowohl derzeit auf aktuellen Prozessen, Richtlinien und Verhaltensweisen basiert, als auch in Bezug auf einen erwarteten ESG-Score in fünf Jahren, der auf Managementzielen und -richtlinien basiert. Dies ermöglicht es dem Team, Unternehmen zu identifizieren, deren Nachhaltigkeitspraktiken sich voraussichtlich verbessern werden.

Die ESG-Scores werden für die Unternehmen auf relativer Basis verglichen. Die Unternehmen im obersten Quartil von werden mit einer Reduzierung der erforderlichen Rendite oder Preishürde auf einer gleitenden Skala belohnt. Die unteren drei Quartile, basierend auf den ESG-Scores, werden durch eine Erhöhung der erforderlichen Rendite oder Hürdenrate auf einer Gleitskala bestraft.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)

Rund 600 Unternehmen werden nach Liquidität, Infrastrukturengagement und Infrastrukturqualität bewertet. Sobald die Liquiditätsanalyse dieses Universum um rund 50 % reduziert hat, werden etwa 10 % der verbleibenden Unternehmen aufgrund eines geringen Infrastrukturengagements ausgeschlossen, bei dem Unternehmen mit inakzeptablem Engagement in nicht-infrastrukturellen Aktivitäten ausgeschlossen sind. Weitere 20 % der Unternehmen sind aufgrund der schwachen Infrastrukturqualität ausgeschlossen.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die einen Großteil ihrer Bewertung aus der Gewinnung oder Produktion fossiler Brennstoffe ableiten;
- Gesellschaften, die mindestens 10 % ihres Umsatzes aus der Produktion und/oder dem Vertrieb von Waffen generieren, und Unternehmen, die einen Umsatz aus (a) verbotenen Waffen gemäß (i) dem Übereinkommen über das Verbot der Nutzung erzielen, Bevorratung, Produktion und Transfer von Antipersonenminen und deren Zerstörung und (ii) das Übereinkommen über das Verbot von Clustermunitionen und (b) Waffen, die gemäß dem Übereinkommen der Vereinten Nationen über biologische Waffen bzw. dem Übereinkommen über chemische Waffen der Vereinten Nationen als B- oder C-Waffen klassifiziert sind; und
- Unternehmen, die mindestens 5 % ihres Umsatzes aus Tabak erwirtschaften.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Um ein langfristiges stabiles Wachstum zu erzielen, das aus regelmäßigen und konsistenten Erträgen aus Dividenden und Zinsen plus Kapitalwachstum aus einem Portfolio von Infrastrukturwertpapieren aus Schwellenländern besteht.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 Prozent seines Nettoinventarwerts in Infrastrukturunternehmen über Aktien und aktienbezogene Wertpapiere, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, die von Unternehmen ausgegeben werden, die mindestens 50 Prozent ihres Gewinns vor Zinsen, Steuern, Abschreibungen und Abschreibungen aus Vermögenswerten in Schwellenländern, einschließlich Indien, ableiten. Es ist beabsichtigt, dass kein einzelnes Schwellenland mehr als 40 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds ausmachen darf. Die Aktien und aktienbezogenen Wertpapiere, in die der Fonds investieren kann, umfassen Stammaktien, Vorzugsaktien, Hinterlegungsscheine, Rechte, Optionsscheine und Beteiligungsscheine von Infrastrukturunternehmen.

Der Fonds kann bis zu 20 Prozent seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere investieren, die an russischen Märkten gehandelt werden, und Anlagen in Wertpapiere, die an russischen Märkten gehandelt werden, werden nur in Aktienwerten getätigt, die an der Moskauer Börse notiert sind und/oder gehandelt werden. Der Fonds kann in amerikanische, internationale und globale Hinterlegungsscheine (ADRS/DRS) von Unternehmen investieren, die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt. Der Fonds kann bis zu 20 Prozent seines Nettoinventarwerts in geschlossene Organismen für gemeinsame Anlagen wie REITs investieren, wenn die Anlagepolitik mit den Anlagepolitiken des Fonds übereinstimmt. Alle REITs, in die der Fonds investiert, werden an einem geregelten Markt notiert oder gehandelt. Der Fonds kann bis zu 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile anderer offener OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen anlegen, vorausgesetzt, die Anlagepolitik und die Liquiditätsbestimmungen dieser Organismen für gemeinsame Anlagen stimmen mit denen des Fonds überein.

### Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Bereitstellung von Erträgen aus Dividenden und Zinsen bei gleichzeitigem Erreichen eines langfristigen Kapitalwachstums.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Infrastrukturunternehmen über Aktien und aktienbezogene Wertpapiere, die an geregelten Märkten in den G7-Ländern der Vereinigten Staaten, des Vereinigten Königreichs, Japans, Deutschlands, Frankreichs, Italiens und Kanada notiert sind oder gehandelt werden, und Aktien und aktienbezogene Wertpapiere, die an geregelten Märkten anderer Industrieländer und Schwellenländer notiert sind oder gehandelt werden (letzteres bis zu 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds). Zu den Aktien und aktienbezogenen Wertpapieren, in die der Fonds investieren kann, gehören Stammaktien, Vorzugsaktien, Hinterlegungsscheine, Rechte, Optionsscheine und Beteiligungsscheine von Infrastrukturunternehmen. Beteiligungspapiere werden in der Regel nur verwendet, wenn der direkte Zugang zu Aktien in einem bestimmten Markt begrenzt oder verzögert ist, was beispielsweise Indien umfassen kann.

Der Fonds kann bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in REITs anlegen. Alle REITs, in die der Fonds investiert, werden an einem geregelten Markt notiert oder gehandelt. Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteilen oder Anteilen anderer offener OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen anlegen, sofern die Anlagepolitik und die Liquiditätsbestimmungen dieser Organismen für gemeinsame Anlagen mit denen des Fonds übereinstimmen.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Für diesen Fonds werden, soweit möglich, Umwelt-, Sozial- und Governance-Risiken und -Chancen („ESG“) auf zwei wesentliche Weisen berücksichtigt. Erstens bei der Bewertung der Cashflows, die vom Anlageverwalter im Rahmen einer fundamentalen Wertpapierbewertung in Bezug auf geeignete Beteiligungsgesellschaften prognostiziert werden. Zweitens, wenn die ESG-Faktoren nicht in diesen prognostizierten Cashflows erfasst werden können, werden sie stattdessen durch eine Anpassung der erforderlichen Rendite oder Hurdle Rate der Anlage erfasst. Unter diesen Umständen werden die relevanten ESG-Faktoren und die Unternehmensführung dieser Faktoren durch eine proprietäre Scorecard des jeweiligen Analysten bewertet, was wiederum zu einer Anpassung der erforderlichen Rendite oder Hurdle Rate führt, die auf jede potenzielle Investition angewendet wird.

Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess auf mindestens 90 % des Portfolios des Fonds an. Der Fonds wird ein ESG-Rating des Portfolios aufrechterhalten, das höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds. In Übereinstimmung mit dem Bewertungsansatz des Fonds, der eine Haltedauer von fünf Jahren annimmt, wird Nachhaltigkeit anhand eines ESG-Scores bewertet, der sowohl derzeit auf aktuellen Prozessen, Richtlinien und Verhaltensweisen basiert, als auch in Bezug auf einen erwarteten ESG-Score in fünf Jahren, der auf Managementzielen und -richtlinien basiert. Dies ermöglicht es dem Team, Unternehmen zu identifizieren, deren Nachhaltigkeitspraktiken sich voraussichtlich verbessern werden.

Die ESG-Scores werden für die Unternehmen auf relativer Basis verglichen. Die Unternehmen im obersten Quartil von werden mit einer Reduzierung der erforderlichen Rendite oder Preishürde auf einer gleitenden Skala belohnt. Die unteren drei Quartile, basierend auf den ESG-Scores, werden durch eine Erhöhung der erforderlichen Rendite oder Hürdenrate auf einer Gleitskala bestraft.

Rund 600 Unternehmen werden nach Liquidität, Infrastrukturengagement und Infrastrukturqualität bewertet. Sobald die Liquiditätsanalyse dieses Universum um rund 50 % reduziert hat, werden etwa 10 % der verbleibenden Unternehmen aufgrund eines geringen Infrastrukturengagements ausgeschlossen, bei dem Unternehmen mit inakzeptablem Engagement in Nicht-Infrastrukturaktivitäten ausgeschlossen sind. Weitere 20 % der Unternehmen sind aufgrund der schwachen Infrastrukturqualität ausgeschlossen.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die einen Großteil ihrer Bewertung aus der Gewinnung oder Produktion fossiler Brennstoffe ableiten;
- Gesellschaften, die mindestens 10 % ihres Umsatzes aus der Produktion und/oder dem Vertrieb von Waffen generieren, und Unternehmen, die einen Umsatz aus (a) verbotenen Waffen gemäß (i) dem Übereinkommen über das Verbot der Nutzung erzielen, Bevorratung, Produktion und Transfer von Antipersonenminen und deren Zerstörung und (ii) das Übereinkommen über das Verbot von Clustermunitionen und (b) Waffen, die gemäß dem Übereinkommen der Vereinten Nationen über biologische Waffen bzw. dem Übereinkommen über chemische Waffen der Vereinten Nationen als B- oder C-Waffen klassifiziert sind; und
- Unternehmen, die mindestens 5 % ihres Umsatzes aus Tabak erwirtschaften.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

*Anlageziel* – Erzielen eines langfristigen Kapitalzuwachses.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 70 Prozent seines Nettoinventarwerts in ein diversifiziertes Portfolio von Aktienwerten, die von US-amerikanischen Small-Cap-Unternehmen (d. h. US-Unternehmen mit einer Marktkapitalisierung von weniger als 3 Milliarden USD) ausgegeben werden, die an regulierten Märkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden. Der Anlageverwalter investiert das Vermögen des Fonds in diese Unternehmen, um von den seiner Meinung nach opportunistischen Situationen für unterbewertete Wertpapiere zu profitieren. Zu diesen opportunistischen Situationen können Turnarounds, Wachstumsunternehmen mit unterbrochenen Gewinnmustern, Unternehmen mit nicht anerkannten Anlagewerten oder unterbewertete Wachstumsunternehmen gehören. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Der Anlageverwalter verwendet bei der Verwaltung der Vermögenswerte des Fonds eine Wertmethode.

### Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund

*Anlageziel* – Erzielen eines langfristigen Kapitalzuwachses.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in Aktien, die von US-Unternehmen mit einer Börsenkapitalisierung von weniger als 5 Mrd. USD ausgegeben werden, gemessen zum Zeitpunkt der Anlage, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt. Bis zu einem Drittel des Nettoinventarwerts des Fonds kann in (i) Aktien (einschließlich Stammaktien, Vorzugsaktien und wandelbare Wertpapiere) von Unternehmen mit einer Börsenkapitalisierung über 5 Mrd. USD-Dollar, zum Zeitpunkt der Investition gemessen, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, (ii) Schuldverschreibungen, die von nationalen Regierungen und ihren Behörden ausgegeben oder garantiert werden, Instrumentalitäten und politische Unterabteilungen, (iii) Unternehmensschuldtitel von Emittenten, die sich in geregelten Märkten befinden oder deren Wertpapiere an diesen notiert sind oder gehandelt werden, und (iv) Bargeld für effiziente Portfoliomanagementzwecke. Nicht mehr als 10 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds, gemessen zum Zeitpunkt der Anlage, werden in Wertpapiere von Emittenten investiert, die an geregelten Märkten außerhalb der Vereinigten Staaten notiert sind oder gehandelt werden. Darüber hinaus dürfen zum Zeitpunkt des Kaufs nicht mehr als 5 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds in Schuldtitel investiert werden, die unter Investment Grade eingestuft sind. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

### Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Um einen langfristigen Kapitalzuwachs anzustreben.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Small-Cap-Unternehmen mit Hauptsitz in Ländern weltweit, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Der Anlageverwalter geht davon aus, dass es sich bei den Small-Cap-Unternehmen um solche handelt, deren Börsenkapitalisierung nicht größer ist als die des größten Unternehmens im MSCI ACWI Small-Cap Index (die „Benchmark“) zum Zeitpunkt seiner letzten Neuberechnung. Der Anlageverwalter wendet eine Anlagestrategie an, die sich auf Unternehmen konzentriert, die seiner Meinung nach Wettbewerbsvorteile und anhaltend hohe Renditen auf das investierte Kapital aufweisen, was seiner Meinung nach den Wert dieser Unternehmen im Laufe der Zeit steigern wird. Darüber hinaus sucht der Anlageverwalter nach Unternehmen, die seiner Ansicht nach ein attraktives Finanzprofil aufweisen, einschließlich Unternehmen mit: (i) konservativen Bilanzen, (ii) umsichtiger Kapitalallokation und (iii) attraktiven Reinvestitionsmöglichkeiten.

Der Fonds investiert maximal 60 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Unternehmen mit Hauptsitz in den Vereinigten Staaten. Unter normalen Marktbedingungen investiert der Fonds mindestens 40 % seines Nettoinventarwerts in Unternehmen mit Hauptsitz in mindestens drei verschiedenen Ländern außerhalb der Vereinigten Staaten. Der Fonds kann auch bis zu 30 % seines Nettoinventarwerts in Unternehmen mit Hauptsitz in Schwellenländern investieren.

### Franklin MV European Equity Growth and Income Fund (ehemals Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund)

*Anlageziel* – Langfristiger Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert jederzeit mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in Aktien von Unternehmen, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden und in Europa ansässig sind oder einen überwiegenden Teil ihrer wirtschaftlichen Aktivitäten in Europa ausüben, unter anderem Österreich, Belgien, Dänemark, Finnland, Frankreich, Deutschland, Griechenland, Ungarn, Irland, Italien, die Niederlande, Norwegen, Polen, Portugal, Spanien, Schweden, Schweiz, und Großbritannien, vorbehaltlich geltender Beschränkungen bei Anlagen durch Ausländer. Der Fonds ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er hauptsächlich in Wertpapiere von Unternehmen investiert, von denen angenommen wird, dass sie attraktive Chancen für einen langfristigen Kapitalzuwachs bieten. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

### 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)

*Anlageziel* – Langfristiger Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in Aktien, die an geregelten Märkten von Unternehmen notiert sind oder gehandelt werden, die in einem oder mehreren der folgenden asiatischen Schwellenländer ansässig sind oder einen überwiegenden Teil ihrer wirtschaftlichen Aktivitäten ausüben, vorbehaltlich der geltenden Beschränkungen, die von diesen Ländern für Investitionen ausländischer Anleger festgelegt wurden: China, Hongkong, Indonesien, Malaysia, die Philippinen, Singapur, Südkorea, Taiwan, Indien, Thailand, Australien und Neuseeland. Darüber hinaus kann der Fonds von Zeit zu Zeit auch in Aktien von Unternehmen mit Sitz in Pakistan und Sri Lanka investieren. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Maximal 10 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in aktiengebundene oder strukturierte Schuldverschreibungen investiert werden, die übertragbare Wertpapiere sind, deren zugrundeliegendes Engagement in Aktienwerten sein kann.

### Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup> (Handel eingestellt am 14. April 2021)

*Anlageziel* – Langfristiger Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert zu jeder Zeit mindestens 70 Prozent seines Nettoinventarwerts in Aktien (einschließlich Stammaktien und Vorzugsaktien) von Unternehmen, deren Sitz, eingetragener Sitz oder Haupttätigkeit sich in Schwellenländern befindet und die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, vorbehaltlich der geltenden Beschränkungen, die von diesen Ländern für Anlagen ausländischer Anleger festgelegt wurden. Bis zu 30 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds können in Aktien von Unternehmen investiert werden, die in Industrieländern ansässig sind oder ihren Hauptgeschäftssitz in diesen haben; von nationalen Regierungen begebene oder garantierte Schuldtitel, ihre Agenturen, Instrumentalitäten, und politische Unterabteilungen, die zum Zeitpunkt des Kaufs mit Investment Grade bewertet und an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden; Unternehmensschuldtitel, die zum Zeitpunkt des Kaufs mit Investment Grade bewertet sind und an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden; einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Handelspapier, Einlagenzertifikate, und Bankakzeptanzen, die von Industrie-, Versorgungsunternehmen, Finanzen, Handelsbanken oder Bankholding-Unternehmen; andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen und Optionsscheine. Nicht mehr als 10 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen investiert werden. Maximal 10 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in aktiengebundene oder strukturierte Schuldverschreibungen investiert werden, die übertragbare Wertpapiere sind, deren zugrundeliegendes Engagement in Aktienwerten sein kann.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund (früher Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund)

*Anlageziel* – Erzeugung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert jederzeit mindestens 70 Prozent seines Nettoinventarwerts in Aktien (einschließlich Stammaktien und Vorzugsaktien) von Unternehmen, die in einem beliebigen Land der Welt ansässig sind und an einem regulierten Markt notiert sind oder gehandelt werden. Um das Anlageziel des Fonds zu erreichen, wird der Anlageverwalter hauptsächlich in Unternehmen investieren, die in Industrieländern ansässig und notiert sind, und er wird versuchen, in Unternehmen zu investieren, die in Industrieländern und Schwellenländern ansässig sind, und zwar über eine Vielzahl von Branchen hinweg. Obwohl es keine Kapitalisierungsbeschränkungen gibt, wird der Fonds versuchen, hauptsächlich in Unternehmen mit großer Kapitalisierung zu investieren. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Investmentfonds (collective investment schemes) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Der Fonds kann aufgrund seiner Verwendung von Derivaten bis zu 100 Prozent seines Nettoinventarwerts (berechnet anhand des Commitment-Ansatzes) fremdfinanziert werden. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps, basierend auf dem Nominalwert solcher Instrumente, beträgt 20 Prozent seines Nettoinventarwerts.

Der Fonds kann über Shanghai-Hong Kong Stock Connect und/oder Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (die „Stock Connect-Programme“) in bestimmte zulässige chinesische A-Aktien investieren. Das Engagement in chinesischen A-Aktien über die Stock Connects wird nicht mehr als 10 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds betragen. Der Fonds kann auch indirekt an chinesischen A-Aktien beteiligt sein. Das Gesamtengagement in russischen Wertpapieren und chinesischen A-Aktien wird 15 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds nicht übersteigen.

### Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Erfassung des Wachstums des asiatischen Bruttoinlandsprodukts („BIP“) und Bereitstellung eines attraktiven Risiko-Rendite-Profils in einem historisch volatilen Markt unter Verwendung einer Long-Only-Aktienstrategie.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 Prozent seines Nettoinventarwerts in Aktien, ob direkt oder indirekt über aktienbezogene Wertpapiere oder Long-Positionen in derivativen Finanzinstrumenten auf Aktien und aktienbezogene Wertpapiere, die (i) an geregelten Märkten auf dem chinesischen Festland notiert sind oder gehandelt werden, Hongkong, Indien, Indonesien, Malaysia, Philippinen, Singapur, Südkorea, Taiwan und Thailand (zusammen die „Hauptländer“) oder (ii) an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, die sich in anderen Ländern als den Hauptländern befinden, aber von Unternehmen ausgegeben werden, deren Hauptaktivitäten durchgeführt werden, oder die den Großteil ihres Geschäftsgewinns daraus ableiten, die Hauptländer. Der Fonds kann in chinesische Aktien investieren (d. h. Aktien, die von Unternehmen ausgegeben werden, die in China ansässig sind oder den überwiegenden Teil ihres Umsatzes aus China erzielen), einschließlich bestimmter zugelassener chinesischer A-Aktien über den Shanghai-Hong Kong Stock Connect und/oder Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (die „Stock Connects“). Das maximale Gesamtengagement in chinesischen Aktien, auch über die Stock Connects, ist unbegrenzt.

Der Fonds kann insgesamt bis zu 20 Prozent seines Nettoinventarwerts anlegen in: Geldmarktinstrumente; Einlagen; Derivate und Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen, vorausgesetzt, dass der Fonds nicht mehr als 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile solcher anderen Organismen für gemeinsame Anlagen investieren darf. Der Fonds wird keine Short-Positionen eingehen.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Der Anlageverwalter bewertet Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren („ESG“), die sich auf die Fähigkeit eines Emittenten auswirken könnten, zukünftige nachhaltige Renditen zu generieren. Diese Merkmale werden sowohl quantitativ als auch qualitativ durch das proprietäre ESG-Ratingsystem des Anlageverwalters und seinen direkten Research- und Engagementprozess bewertet. Die proprietären ESG-Ratings erfassen zukunftsgerichtete Analysen mit Unternehmen, denen nach Berücksichtigung von Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungs-Nachhaltigkeitsfaktoren jeweils eine Risikobewertung für Governance und Nachhaltigkeit (umweltbezogen und sozial) von 1 (geringes Risiko) bis 5 (hohes Risiko) zugewiesen wurde. Unternehmen, die eine Nachhaltigkeitsrisikoeinstufung von 4 oder höher aufweisen, werden nicht in den Fonds aufgenommen. Unternehmen, die eine Nachhaltigkeitsrisikoeinstufung von 4 oder höher aufweisen, werden nicht in den Fonds aufgenommen.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus der Tabakproduktion generieren;
- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus der direkten Beteiligung an der Gewinnung fossiler Brennstoffe generieren;
- Unternehmen, die Einnahmen aus dem Abbau von Metallen und Mineralien im Sinne der GICS-Unterindustrien Diversifizierte Metalle und Bergbau, Kupfer, Gold und Edelmetalle und Mineralien generieren;
- Unternehmen, die an der Produktion, dem Verkauf oder dem Vertrieb von dedizierten und wichtigen Komponenten von Antipersonenminen und Clustermunition beteiligt sind; und
- Unternehmen, die im Rahmen des UN Global Compact als „fehlgeschlagen“ bewertet werden.

Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben dargelegt) auf 100 % des Portfolios des Fonds an. Der Fonds wird ein Portfolio ESG-Rating beibehalten, das höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Anlageverwalter geht davon aus, dass das Portfolio des Fonds typischerweise aus 20 bis 40 verschiedenen Emittenten bestehen wird, obwohl der Fonds unter bestimmten Umständen weniger als 20 Emittenten oder mehr als 40 Emittenten halten kann.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> (Handel eingestellt am 1. Juni 2021)

*Anlageziel* – Langfristige absolute Rendite durch Anwendung einer Long/Short-Aktienstrategie.

*Anlagepolitik* – Der Anlageverwalter konzentriert sich auf die grundlegende Analyse von Wertpapieren. Der Anlageverwalter ist bestrebt, Bewertungsanomalien zu identifizieren und diese gegebenenfalls durch Long- oder synthetische Short-Positionen zu nutzen. Der Anlageverwalter bewertet die Faktoren/Merkmale für Umwelt, Soziales und Governance („ESG“). Diese Faktoren/Merkmale werden sowohl quantitativ als auch qualitativ durch ihr eigenes ESG-Ratingsystem und ihren direkten Research- und Engagementprozess bewertet. Das Bruttoengagement (einschließlich Long- und Short-Positionen) in europäischen Aktien und aktienbezogenen Wertpapieren (einschließlich über Derivate) kann bis zu 200 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds betragen. Das Nettoengagement (Long-Engagement minus Short-Engagement) in europäischen Aktien und aktienbezogenen Wertpapieren (einschließlich über Derivate) wird voraussichtlich zwischen -30 Prozent und 100 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds liegen. Der Fonds kann bis zu 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1) der OGAW-Verordnungen anlegen, um sich in europäischen Aktien zu engagieren.

Der Fonds kann gemäß den Anforderungen der Zentralbank in Wertpapierfinanzierungstransaktionen (SFTs) investieren. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und SFTs, basierend auf dem Nominalwert solcher Instrumente, beträgt 200 Prozent seines Nettoinventarwerts.

### Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Langfristiger Kapitalzuwachs.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 Prozent seines Nettoinventarwerts in Aktien, sei es direkt oder indirekt über aktienbezogene Wertpapiere oder Long-Positionen in derivativen Finanzinstrumenten auf Aktien und aktienbezogene Wertpapiere, die an geregelten Märkten weltweit notiert sind oder gehandelt werden (einschließlich Schwellenländer), wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt. Der Anlageverwalter ist in erster Linie an Unternehmen interessiert: (1) von denen er glaubt, dass sie das Potenzial haben, eine hohe Rendite auf das investierte Kapital zu generieren und/oder aufrechtzuerhalten, die über ihre gewichteten durchschnittlichen Kapitalkosten hinausgeht;

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)

(2) wenn der Goodwill kein dominanter Vermögenswert in der Bilanz ist; und (3) wenn der Streubesitz über 3 Milliarden USD liegt.

Der Fonds kann insgesamt bis zu 20 Prozent seines Nettoinventarwerts anlegen in: Geldmarktinstrumente, Einlagen und Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen, vorausgesetzt, dass der Fonds nicht mehr als 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile solcher anderen Organismen für gemeinsame Anlagen investieren darf. Der Fonds kann in chinesische Aktien investieren (d. h. Aktien, die von Unternehmen ausgegeben werden, die in China ansässig sind oder den überwiegenden Teil ihrer Einnahmen aus China erzielen), einschließlich bestimmter zugelassener chinesischer A-Aktien über den Shanghai-Hong Kong Stock Connect und/oder Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (die „Stock Connects“). Die maximale indirekte Investition in chinesische A-Aktien wird auf 10 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds begrenzt. Das maximale Gesamtengagement in chinesischen Aktien, auch über die Stock Connects, ist unbegrenzt.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Der Anlageverwalter bewertet Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren („ESG“), die sich auf die Fähigkeit eines Emittenten auswirken könnten, zukünftige nachhaltige Renditen zu generieren. Diese Merkmale werden sowohl quantitativ als auch qualitativ durch das proprietäre ESG-Ratingsystem des Anlageverwalters und seinen direkten Research- und Engagementprozess bewertet. Die proprietären ESG-Ratings erfassen diese zukunftsgerichtete Analyse mit Unternehmen, denen nach Berücksichtigung der Nachhaltigkeitsfaktoren Umwelt, Soziales und Unternehmensführung jeweils eine Risikobewertung für Governance und Nachhaltigkeit (umweltbezogen und sozial) von 1 (geringes Risiko) bis 5 (hohes Risiko) zugewiesen wurde. Unternehmen, die ein Nachhaltigkeits- oder Governance-Risikoring von 4 oder höher aufweisen, werden nicht in den Fonds aufgenommen.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus Tabakproduktion, Vertrieb oder Großhandel generieren;
- Unternehmen, die Einnahmen aus der Produktion oder dem Vertrieb umstrittener Waffen generieren (d. h. Antipersonenminen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Clustermunition);
- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus der Produktion oder dem Vertrieb von konventionellen Waffen generieren.
- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus der Produktion fossiler Brennstoffe generieren;
- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus kohlebasierter Energieerzeugung oder dem Abbau oder Vertrieb von Wärmekohle generieren;
- Unternehmen, die Einnahmen aus dem Bergbau von Metallen und Mineralien im Sinne der GICS-Unterindustrien Diversifizierte Metalle und Bergbau, Kupfer, Gold und Edelmetalle und Mineralien generieren;
- Unternehmen, die 15 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Atomenergieerzeugung generieren; und
- Unternehmen, die im Rahmen des UN Global Compact als „fehlgeschlagen“ bewertet werden.

Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben dargelegt) auf 100 % des Portfolios des Fonds an. Der Fonds wird ein Portfolio ESG-Rating beibehalten, das höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund

*Anlageziel* – Zur Bereitstellung von Erträgen. Ein langfristiger Kapitalzuwachs ist ein sekundäres Ziel.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Aktien und aktienbezogene Wertpapiere (einschließlich Vorzugsaktien, Australische Trusts und festverzinsliche Wertpapiere, REITs, Depotscheine und Optionsscheine mit niedrigem Ausübungspreis auf Aktien), die (i) an geregelten Märkten (wie in Anhang III des Prospekts dargelegt) im asiatisch-pazifischen Raum (außer Japan) notiert sind oder gehandelt werden, Dazu gehören die Länder, die im MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index vertreten sind oder (ii) an geregelten Märkten (wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt) außerhalb des Asien-Pazifik-Raums (außer Japan) notiert sind oder gehandelt werden, aber von Unternehmen ausgegeben werden, deren Hauptaktivitäten in Ländern durchgeführt werden, die im MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index vertreten sind. Dieser Index besteht derzeit aus rund 1.200 Unternehmen mit hoher und mittlerer Kapitalisierung aus 13 Ländern der Region Asien-Pazifik (ohne Japan). Der Index umfasst derzeit vier Industrieländer und neun Schwellenländer, sodass der Fonds ein erhebliches Engagement in Wertpapieren aus Schwellenländern haben kann. Die Strategie des Anlageverwalters konzentriert sich auf Emittenten aus drei Hauptsektoren: (1) REITs, wie Einkaufszentren, Bürogebäude und Industriegebäude; (2) Infrastruktur, wie Mautstraßen, Versandhäfen, Flughäfen und Eisenbahnen; und (3) Versorgungsunternehmen, wie Gas- und Stromnetze und Generatoren. Der Fonds kann von Zeit zu Zeit in Vorzugsaktien investieren, wenn der Anlageverwalter der Ansicht ist, dass solche Wertpapiere eine überzeugende Renditemöglichkeit bieten und gleichzeitig das Anlageziel des Fonds einhalten. Der in solche Vermögenswerte investierte Gesamtbetrag wird 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds nicht überschreiten. Der Fonds darf maximal 50 % seines Nettoinventarwerts insgesamt in Aktien und aktienbezogene Wertpapiere (einschließlich Vorzugsaktien, Australische Trusts und festverzinsliche Wertpapiere, REITs und Optionsscheine mit niedrigem Ausübungspreis auf Aktien) (i) an geregelten Märkten (wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt) in Australien oder Neuseeland notiert oder gehandelt oder (ii) an geregelten Märkten (wie in Anhang III des Verkaufsprospekts dargelegt) außerhalb Australiens und Neuseelands notiert oder gehandelt werden, aber von Unternehmen ausgegeben werden, deren Hauptaktivitäten in Australien oder Neuseeland durchgeführt werden. Der Fonds kann insgesamt maximal 60 % seines Nettoinventarwerts in REITs und vermögensbezogene Wertpapiere (Aktien und aktienbezogene Wertpapiere (einschließlich Vorzugsaktien, australische Trusts und festverzinsliche Wertpapiere und Optionsscheine mit niedrigem Ausübungspreis auf Aktien) von Immobiliengesellschaften investieren, die in den MSCI Global Industry Classification Standard (GICS) Industry Group 6010 – Real Estate) aufgenommen sind. Der Fonds kann insgesamt bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts anlegen in: Geldmarktinstrumente, Einlagen, Derivate und Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen, sofern der Fonds nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile solcher anderen Organismen für gemeinsame Anlagen anlegen darf, und Anlagen in solche Programme dienen dem Zweck, Engagements in den hierin beschriebenen Arten von Instrumenten zu erlangen oder anderweitig das Anlageziel und die Anlagepolitik des Fonds zu verfolgen. Der Fonds kann in chinesische Aktien investieren (d. h. Aktien, die von Unternehmen ausgegeben werden, die in China ansässig sind oder den überwiegenden Teil ihrer Einnahmen aus China erzielen), einschließlich bestimmter zugelassener chinesischer A-Aktien über den Shanghai-Hong Kong Stock Connect und/oder Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (die „Stock Connects“). Das maximale Gesamtengagement des Fonds in chinesischen Aktien, einschließlich über die Stock Connects, beträgt 75 % des Nettoinventarwerts des Fonds.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Der Anlageverwalter bewertet die Faktoren/Merkmale für Umwelt, Soziales und Governance („ESG“). Diese Faktoren/Merkmale werden sowohl quantitativ als auch qualitativ durch ihr eigenes ESG-Ratingsystem und ihren direkten Research- und Engagementprozess bewertet. Der Anlageverwalter bewertet die ESG-Faktoren, die sich auf die Fähigkeit eines Emittenten auswirken könnten, zukünftige nachhaltige Renditen zu generieren. Die proprietären ESG-Ratings erfassen diese zukunftsgerichtete Analyse mit Unternehmen, denen nach Berücksichtigung von Umwelt-, Sozial-, Unternehmensführungs- und Nachhaltigkeitsfaktoren jeweils ein Risikoring für Governance und Nachhaltigkeit (umweltbezogen und sozial) von 1 (niedriges Risiko) bis 5 (hohes Risiko) zugewiesen wurde. Unternehmen mit einer Nachhaltigkeitsrisikoeinstufung von 5 werden nicht in den Fonds aufgenommen.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus der Tabakproduktion generieren;
- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus der Produktion von Waffen generieren;
- Unternehmen, die Teil der GICS-Branchenklassifizierung von Öl, Gas und Verbrauchsmaterialien sind;
- Unternehmen, die an der Produktion, dem Verkauf oder dem Vertrieb von dedizierten und wichtigen Komponenten von Antipersonenminen und Clustermunitionen beteiligt sind; und

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – (Fortsetzung)

- Unternehmen, die im Rahmen des UN Global Compact als „fehlgeschlagen“ bewertet werden.

Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben dargelegt) auf 100 % des Portfolios des Fonds an. Der Fonds wird ein Portfolio ESG-Rating beibehalten, das höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Langfristiges Kapitalwachstum.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Aktien (einschließlich Optionsscheine), die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, an dem der Emittent des Aktienkapitals seinen Sitz in einem Land hat oder den überwiegenden Teil seines Umsatzes aus einem Land ableitet, das im MSCI Emerging Markets Index enthalten ist, oder der geregelte Markt, an dem das Aktienkapital notiert ist oder gehandelt wird, sich in einem Land befindet, das im MSCI Emerging Markets Index enthalten ist. Der MSCI Emerging Markets Index umfasst Unternehmen mit großer und mittlerer Kapitalisierung in über 20 Schwellenländern und bilanziert halbjährlich neu. Die Anlagen des Fonds in Aktien können direkt oder indirekt über aktienbezogene Wertpapiere (einschließlich ADRs oder GDRs) oder Long-Positionen in Derivaten auf Aktien und aktienbezogene Wertpapiere getätigt werden. Anlagen in ADRs und GDRs werden 15 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds nicht übersteigen.

Der Fonds kann insgesamt bis zu 20 Prozent seines Nettoinventarwerts anlegen in: Geldmarktinstrumente, Einlagen und Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen, vorausgesetzt, dass der Fonds nicht mehr als 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile solcher anderen Organismen für gemeinsame Anlagen investieren darf.

Der Fonds kann in chinesische Aktien investieren (d. h. Aktien, die von Unternehmen ausgegeben werden, die in China ansässig sind oder den überwiegenden Teil ihres Umsatzes aus China erzielen), einschließlich bestimmter zugelassener chinesischer A-Aktien über den Shanghai-Hong Kong Stock Connect und/oder Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (die „Stock Connects“). Das maximale Engagement in chinesischen Aktien, auch über die Stock Connects, ist das Ausmaß der Repräsentation chinesischer Aktien im MSCI Emerging Markets Index plus weitere 10 Prozent.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Der Anlageverwalter bewertet die Faktoren/Merkmale für Umwelt, Soziales und Governance („ESG“). Diese Faktoren/Merkmale werden sowohl quantitativ als auch qualitativ durch ihr eigenes ESG-Ratingsystem und ihren direkten Research- und Engagementprozess bewertet. Der Anlageverwalter bewertet die ESG-Faktoren, die sich auf die Fähigkeit eines Emittenten auswirken könnten, zukünftige nachhaltige Renditen zu generieren. Diese Merkmale werden sowohl quantitativ als auch qualitativ durch das proprietäre ESG-Ratingsystem des Anlageverwalters und seinen direkten Research- und Engagementprozess bewertet. Die proprietären ESG-Ratings erfassen diese zukunftsgerichtete Analyse mit Unternehmen, denen nach Berücksichtigung von Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungs-Nachhaltigkeitsfaktoren jeweils eine Risikobewertung für Governance und Nachhaltigkeit (umwelt- und sozial) von 1 (niedriges Risiko) bis 5 (hohes Risiko) zugewiesen wurde. Unternehmen, die ein Nachhaltigkeits- oder Governance-Risikoring von 4 oder höher aufweisen, werden nicht in den Fonds aufgenommen.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus Tabakproduktion, Vertrieb oder Großhandel generieren;
- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus der Produktion oder dem Vertrieb von Waffen generieren;
- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus kohlebasierter Energieerzeugung oder dem Abbau oder Vertrieb von Wärmekohle generieren;
- Unternehmen, die an der Produktion, dem Verkauf oder dem Vertrieb von dedizierten und wichtigen Komponenten umstrittener Waffen beteiligt sind (d. h. Antipersonenminen, biologische und chemische Waffen und Clustermunition); und
- Unternehmen, die im Rahmen des UN Global Compact als „fehlgeschlagen“ bewertet werden.

Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben dargelegt) auf 100 % des Portfolios des Fonds an. Der Fonds wird ein Portfolio ESG-Rating beibehalten, das höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup>

*Anlageziel* – Langfristiger Kapitalzuwachs durch Investitionen in ein konzentriertes Portfolio, das hauptsächlich aus europäischen Aktien besteht.

*Anlagepolitik* – Der Fonds investiert mindestens 80 Prozent seines Nettoinventarwerts in Aktien von Unternehmen mit Sitz oder Börsennotierung in Europa oder die den überwiegenden Teil ihrer wirtschaftlichen Tätigkeit in Europa ausüben. Solche Anlagen können direkt oder indirekt über aktienbezogene Wertpapiere, Verwahrstellenbelege oder Organismen für gemeinsame Anlagen oder Long-Positionen über Derivate erfolgen. Der Fonds wird in Unternehmen investieren, die nach Ansicht des Anlageverwalters gemäß dem Anlageprozess des Anlageverwalters, (i) das Potenzial haben, eine hohe Rendite auf das investierte Kapital (ROIC) zu generieren oder aufrechtzuerhalten, die über ihre gewichteten durchschnittlichen Kapitalkosten hinausgeht; (ii) das Potenzial haben, langfristig ein attraktives Wachstumsprofil und/oder Cashflow-Generierung zu bieten; und (iii) von denen erwartet wird, dass sie unterstützende Buchhaltungspraktiken und Umweltpolitiken haben, Sozial- und Governance-Praktiken. Der Fonds kann in Futures auf europäische Aktienindizes investieren, um ein effizientes Portfoliomanagement zu ermöglichen und zu Anlagezwecken Optionsscheine mit niedrigem Ausübungspreis zu erhalten, z. B. wenn kein lokaler Marktzugang über ein lokales Wertpapierkonto verfügbar oder wünschenswert ist. Devisenterminkontrakte dürfen nur in Bezug auf die vom Fonds angebotenen abgesicherten Anteilsklassen verwendet werden. Der Fonds investiert nicht in andere Arten von Derivaten.

Der Fonds kann insgesamt bis zu 20 Prozent seines Nettoinventarwerts anlegen in: Geldmarktinstrumente; Einlagen; Derivate; Nicht-europäische Aktien; und Anteile oder Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der OGAW-Verordnungen, vorausgesetzt, dass der Fonds nicht mehr als 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Anteile oder Anteile solcher anderen Organismen für gemeinsame Anlagen investieren darf, und Anlagen in solche Programme dienen dem Zweck, Engagements in europäischen Aktien zu erlangen oder anderweitig das Anlageziel und die Anlagepolitik des Fonds zu verfolgen. Der Fonds kann bis zu 10 Prozent seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere anlegen, die von russischen Emittenten ausgegeben werden.

Der Fonds fördert Umwelteigenschaften und ist gemäß der Verordnung über die Offenlegung nachhaltiger Finanzen ((EU) 2019/2088) als Artikel 8-Fonds klassifiziert.

Der Anlageverwalter bewertet ESG-Faktoren/-Merkmale.

Diese Merkmale werden sowohl quantitativ als auch qualitativ durch das proprietäre ESG-Ratingsystem des Anlageverwalters und seinen direkten Research- und Engagementprozess bewertet.

Die zusätzliche Berücksichtigung ökologischer und sozialer Merkmale von Anlagen wird erreicht, indem die Anlagen auf Portfolioebene auf mögliche positive oder negative Risiken untersucht werden.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

### Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)

Die proprietären ESG-Ratings erfassen diese zukunftsgerichtete Analyse mit Unternehmen, denen nach Berücksichtigung von Umwelt-, Sozial- und Corporate-Governance-Nachhaltigkeitsfaktoren (wie im Abschnitt „Nachhaltigkeitsrisiko“ des Prospekts beschrieben) jeweils ein Risikoring für Governance und Nachhaltigkeit (umwelt- und sozial) von 1 (niedriges Risiko) bis 5 (hohes Risiko) zugewiesen wurde. Unternehmen, die ein Nachhaltigkeits- oder Governance-Risikoring von 4 oder höher aufweisen, werden nicht in den Fonds aufgenommen. Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus Tabakproduktion, Vertrieb oder Großhandel generieren;
- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus der Produktion oder dem Vertrieb von Waffen generieren;
- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus der Produktion oder dem Vertrieb fossiler Brennstoffe generieren;
- Unternehmen, die mehr als 5 % des Umsatzes aus kohlebasierter Energieerzeugung oder dem Abbau oder Vertrieb von Wärmekohle generieren;
- Unternehmen, die umstrittene Waffen produzieren oder vertreiben (d. h. Antipersonenminen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Clustermunition);
- Unternehmen, die mehr als 15 % des Umsatzes aus der Erzeugung von Kernenergie generieren; und
- Unternehmen, die Einnahmen aus dem Bergbau von Metallen und Mineralien im Sinne der GICS-Unterindustrien Diversifizierte Metalle und Bergbau, Kupfer, Gold und Edelmetalle und Mineralien generieren.

Der Fonds hat die ESG-Merkmale erfüllt, die er durch die Umsetzung der oben dargelegten Prozesse fördert.

### Taxonomie

#### Transparenz von umweltverträglichen Anlagen in Periodenberichten

Im Einklang mit seiner ESG-Anagemethodik kann ein Artikel-8-Fonds Anlagen halten, die zur Minderung des Klimawandels und zur Anpassung des Klimawandels beitragen. Aufgrund des Mangels an Zuverlässigkeit zeitnahe und nachprüfbar Daten, es ist, jedoch derzeit nicht feststellbar ist, wie und inwieweit die Tätigkeiten der zugrunde liegenden Anlagen in wirtschaftlichen Tätigkeiten erfolgen, die nach der Verordnung (EU) 2020/852 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 18. Juni 2020 über die Schaffung eines Rahmens zur Ermöglichung nachhaltiger Investitionen als umweltverträglich gelten, und zur Änderung der Verordnung (EU) 2019/2088, in der jeweils gültigen Fassung (die „Taxonomieverordnung“) und daher ist es nicht möglich, sich zu einem Mindestanteil der zugrunde liegenden Anlagen eines Artikel 8 Fonds zu verpflichten, der die EU-Kriterien für umweltverträgliche wirtschaftliche Aktivitäten berücksichtigt, einschließlich Aktivierungs- oder Übergangstätigkeiten, im Sinne der Taxonomieverordnung.

Die Gesellschaft überprüft diese Situation aktiv und wenn angemessene, ausreichende, zuverlässige, zeitnahe und überprüfbare Daten zu den Anlagen eines Artikel-8-Fonds und relevanten technischen Kriterien verfügbar werden, wird die Bewertung vorgenommen und der Verkaufsprospekt entsprechend aktualisiert. Anleger sollten beachten, dass das Prinzip „keinen erheblichen Schaden anrichten“ der Taxonomieverordnung nur für diejenigen Anlagen gilt, die dem Artikel 8 Fonds zugrunde liegen und die EU-Kriterien für umweltverträgliche wirtschaftliche Aktivitäten im Sinne der Taxonomieverordnung berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil eines Artikel 8 Fonds zugrunde liegenden Anlagen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für umweltverträgliche wirtschaftliche Aktivitäten gemäß der Taxonomieverordnung. Die obige Erklärung gilt in Bezug auf die folgenden Artikel-8-Fonds: Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund, Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser 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 US Equity Sustainability Leaders Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund, Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup> und Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup>.

Die den verbleibenden Fonds zugrunde liegenden Anlagen, die oben nicht aufgeführt sind, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für umweltverträgliche wirtschaftliche Aktivitäten.

Die Anlagepolitik der einzelnen Fonds wird im jeweiligen Verkaufsprospekt näher beschrieben.

Im Namen des Vorstands

\_\_\_\_\_  
Direktor

16. Juni 2022

\_\_\_\_\_  
Direktor

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer

## Bericht der unabhängigen Wirtschaftsprüfer an die Mitglieder der Legg Mason Global Funds Plc

### Bericht über die Prüfung des Jahresabschlusses

#### Meinung

Unserer Meinung nach ist der Jahresabschluss der Legg Mason Global Funds Plc:

- ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und Finanzlage der Gesellschaft und der Teilfonds zum 28. Februar 2022 sowie ihrer Ergebnisse für das zu diesem Zeitpunkt endende Geschäftsjahr vermitteln;
- gemäß der allgemein anerkannten Rechnungslegungspraxis in Irland ordnungsgemäß erstellt wurden (Buchhaltungsstandards, die vom Financial Reporting Council of the UK herausgegeben wurden, einschließlich des Financial Reporting Standard 102 „The Financial Reporting Standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ und irischem Recht); und
- gemäß den Anforderungen des Companies Act 2014 und der Verordnungen der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) ordnungsgemäß erstellt wurden.

Wir haben den Jahresabschluss, der in den Geschäftsbericht und den Jahresabschluss aufgenommen ist, geprüft, der Folgendes umfasst:

- die Bilanz zum 28. Februar 2022;
- die Gesamtergebnisrechnung für das zu diesem Zeitpunkt endende Geschäftsjahr;
- die Aufstellung oVeränderungen des den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens für das zu diesem Zeitpunkt endende Geschäftsjahr;
- das Anlageportfolio für jeden der Teilfonds zum 28. Februar 2022; und
- die Erläuterungen zum Jahresabschluss der Gesellschaft und für jeden ihrer Teilfonds, die eine Beschreibung der wesentlichen Rechnungslegungsgrundsätze enthalten.

#### Grundlage für die Meinung

Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit den International Standards on Auditing (Irland) („ISAs (Irland)“) und geltendem Recht durchgeführt.

Unsere Verantwortlichkeiten im Rahmen der ISAs (Irland) sind im Abschnitt Verantwortlichkeiten der Wirtschaftsprüfer für die Prüfung des Jahresabschlusses unseres Berichts näher beschrieben. Wir sind der Ansicht, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und angemessen sind, um eine Grundlage für unsere Bewertung zu bieten.

#### Unabhängigkeit

Wir blieben unabhängig vom Unternehmen in Übereinstimmung mit den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfung des Jahresabschlusses in Irland relevant sind, einschließlich des Ethikstandards der IAASA, und wir haben unsere sonstigen ethischen Verpflichtungen in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

#### Hervorhebung der Angelegenheit – Finanzberichte, die auf einer anderen Grundlage als der Unternehmensführung erstellt wurden

Bei der Erstellung unserer Stellungnahme zu den Jahresabschlüssen, die nicht geändert werden, machen wir auf Erläuterung 2 des Jahresabschlusses aufmerksam, in dem die Gründe beschrieben werden, warum die Jahresabschlüsse des Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund, des Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, des Franklin MV European Equity Growth and Income Fund und des Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund auf einer anderen Grundlage als der Unternehmensfortführung erstellt wurden.

#### Schlussfolgerungen in Bezug auf die Unternehmensfortführung

Basierend auf der von uns durchgeführten Arbeit haben wir keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen identifiziert, die einzeln oder zusammen erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft und der Teilfonds aufkommen lassen können, die Geschäftstätigkeit für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab dem Datum fortzusetzen, an dem der Jahresabschluss zur Ausgabe genehmigt wurde, wenn die Grundlage der Geschäftstätigkeit der Rechnungslegung übernommen wurde.

Bei der Prüfung des Jahresabschlusses sind wir zu dem Schluss gekommen, dass die Verwendung der Rechnungslegungsgrundlage der Unternehmensfortführung durch die Vorstandsmitglieder bei der Erstellung des Jahresabschlusses der Gesellschaft und der Teilfonds, bei denen die Rechnungslegungsgrundlage der Unternehmensfortführung übernommen wurde, angemessen ist.

Da jedoch nicht alle zukünftigen Ereignisse oder Bedingungen vorhergesagt werden können, ist diese Schlussfolgerung keine Garantie für die Fähigkeit der Gesellschaft und der Teilfonds, bei denen die Grundlage der Unternehmensfortführung der Rechnungslegung zur Fortführung der Unternehmensfortführung übernommen wurde.

Unsere Verantwortlichkeiten und die Verantwortlichkeiten der Direktoren in Bezug auf die Unternehmensfortführung sind in den entsprechenden Abschnitten dieses Berichts beschrieben.

#### Berichterstattung über andere Informationen

Die anderen Informationen umfassen alle Informationen im Geschäftsbericht und Jahresabschluss, mit Ausnahme des Jahresabschlusses und des Berichts unserer Abschlussprüfer. Die Direktoren sind für die anderen Informationen verantwortlich. Unsere Stellungnahme zum Jahresabschluss deckt die übrigen Angaben nicht ab und wir geben dementsprechend weder ein Bestätigungsvermerk noch, soweit in diesem Bericht nicht ausdrücklich etwas anderes angegeben ist, irgendeine Form der Zusicherung dazu ab. Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Jahresabschlusses ist es unsere Verantwortung, die anderen Informationen zu lesen und dabei zu prüfen, ob die anderen Informationen wesentlich mit dem Jahresabschluss oder unseren bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnissen unvereinbar sind oder anderweitig wesentlich falsch erscheinen. Wenn wir eine offensichtliche wesentliche Inkonsistenz oder wesentliche Falschdarstellung feststellen, sind wir verpflichtet, Verfahren durchzuführen, um zu schlussfolgern, ob eine wesentliche Falschdarstellung des Jahresabschlusses oder eine wesentliche Falschdarstellung der anderen Informationen vorliegt. Wenn wir aufgrund der von uns geleisteten Arbeit zu dem Schluss kommen, dass es eine wesentliche Falschdarstellung dieser anderen Informationen gibt, sind wir verpflichtet, diese Tatsache zu melden. Aufgrund dieser Verantwortlichkeiten haben wir nichts zu berichten.

In Bezug auf den Bericht der Directors haben wir auch geprüft, ob die vom Companies Act 2014 geforderten Offenlegungen einbezogen wurden.

Aufgrund der oben beschriebenen Verantwortlichkeiten und unserer im Rahmen der Prüfung durchgeführten Arbeit verlangen ISAs (Irland) und der Companies Act 2014 von uns, auch bestimmte Meinungen und Angelegenheiten wie unten beschrieben zu melden:

- Unserer Ansicht nach stimmen die im Bericht der Directors für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 enthaltenen Informationen auf der Grundlage der im Rahmen der Prüfung durchgeführten Arbeiten mit dem Jahresabschluss überein und wurden in Übereinstimmung mit den geltenden gesetzlichen Anforderungen erstellt.
- Basierend auf unseren Kenntnissen und unserem Verständnis der Gesellschaft und ihres Umfelds, die wir im Rahmen der Prüfung erhalten haben, haben wir keine wesentlichen Falschaussagen im Bericht der Verwaltungsratsmitglieder festgestellt.

#### Verantwortlichkeiten für den Jahresabschluss und die Prüfung

##### Verantwortlichkeiten der Geschäftsführer für den Jahresabschluss

Wie in der auf Seite 17 dargelegten Erklärung der Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats ausführlicher erläutert, sind die Verwaltungsratsmitglieder für die Erstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit dem geltenden Rahmenwerk verantwortlich und dafür, dass sie ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermitteln.

# Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer – (Fortsetzung)

## Verantwortlichkeiten für den Jahresabschluss und die Prüfung – (Fortsetzung)

### Verantwortlichkeiten der Geschäftsführer für den Jahresabschluss – (Fortsetzung)

Die Direktoren sind auch für die interne Kontrolle verantwortlich, die sie für notwendig halten, um die Erstellung von Abschlüssen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen Falschaussagen sind, sei es aufgrund von Betrug oder Fehlern.

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses sind die Vorstandsmitglieder dafür verantwortlich, die Fähigkeit der Gesellschaft und der Teilfonds zu beurteilen, die Geschäftstätigkeit fortzusetzen, gegebenenfalls Angelegenheiten im Zusammenhang mit der Unternehmensfortführung offenzulegen und die Grundlage der Unternehmensfortführung der Rechnungslegung zu verwenden, es sei denn, die Vorstandsmitglieder beabsichtigen entweder, die Gesellschaft zu liquidieren oder den Geschäftsbetrieb einzustellen, oder haben keine realistische Alternative, dies zu tun.

### Verantwortlichkeiten der Abschlussprüfer für die Prüfung des Jahresabschlusses

Unsere Ziele sind es, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Jahresabschluss als Ganzes frei von wesentlichen Falschaussagen ist, sei es aufgrund von Betrug oder Fehlern, und einen Bestätigungsvermerk zu erstellen, der unsere Meinung enthält. Eine angemessene Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, ist jedoch keine Garantie dafür, dass ein in Übereinstimmung mit den ISAs (Irland) durchgeführtes Audit immer eine wesentliche Fehldarstellung aufdeckt, wenn sie existiert. Fehldarstellungen können sich aus Betrug oder Fehlern ergeben und gelten als wesentlich, wenn sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Jahresabschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen der Nutzer beeinflussen könnten.

Unsere Prüfungstechniken können das Testen vollständiger Populationen bestimmter Transaktionen und Salden umfassen, möglicherweise unter Verwendung von Datenprüfungstechniken. In der Regel werden jedoch nur eine begrenzte Anzahl von Elementen für Tests ausgewählt, anstatt vollständige Populationen zu testen. Wir werden oft versuchen, bestimmte Punkte für Tests auf der Grundlage ihrer Größe oder Risikomerkmale anzusprechen. In anderen Fällen werden wir die Stichprobenprüfung verwenden, um eine Schlussfolgerung über die Population zu ziehen, aus der die Stichprobe ausgewählt wird.

Eine weitere Beschreibung unserer Verantwortlichkeiten für die Prüfung des Jahresabschlusses finden Sie auf der IAASA-Website unter:

[https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description\\_of\\_auditors\\_responsibilities\\_for\\_audit.pdf](https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf).

Diese Beschreibung ist Teil des Berichts unserer Wirtschaftsprüfer.

### Verwendung dieses Berichts

Dieser Bericht, einschließlich der Stellungnahmen, wurde für und nur für die Mitglieder des Unternehmens als Organ gemäß Abschnitt 391 des Companies Act 2014 und für keinen anderen Zweck erstellt. Wir übernehmen durch die Abgabe dieser Stellungnahmen keine Verantwortung für andere Zwecke oder gegenüber anderen Personen, denen dieser Bericht gezeigt wird oder in deren Hände er möglicherweise kommt, es sei denn, wir haben dies ausdrücklich schriftlich mit unserer vorherigen Zustimmung vereinbart.

### Sonstige erforderliche Berichterstattung

#### Stellungnahmen des Companies Act 2014 zu anderen Angelegenheiten

- Wir haben alle Informationen und Erklärungen erhalten, die wir für die Zwecke unserer Prüfung für notwendig halten.
- Unserer Ansicht nach waren die Buchführungsunterlagen der Gesellschaft ausreichend, um eine einfache und ordnungsgemäße Prüfung des Jahresabschlusses zu ermöglichen.
- Die Abschlüsse stimmen mit den Buchführungsunterlagen überein.

### Ausnahmemeldung gemäß Companies Act 2014

#### Vergütung und Transaktionen der Directors

Gemäß dem Companies Act von 2014 sind wir verpflichtet, Ihnen Bericht zu erstatten, wenn unserer Meinung nach die in den Abschnitten 305 bis 312 dieses Gesetzes festgelegten Angaben zur Vergütung und zu Transaktionen der Direktoren nicht gemacht wurden. Wir haben keine Ausnahmen zu melden, die sich aus dieser Verantwortung ergeben.

Pat Candon  
für und im Auftrag von PricewaterhouseCoopers  
Chartered Accountants and Statutory Audit Firm  
Dublin

16. Juni 2022

# Bericht der Verwahrstelle an die Anteilsinhaber

## Bericht der Verwahrstelle an die Anteilsinhaber vom 16. Juni 2022

Für den Zeitraum vom 1. März 2021 bis zum 28. Februar 2022 (der „Zeitraum“)

Die Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch (die „**Depotstelle**“ „**wir**“, „**wir**“ oder „**unser**“) hat sich mit dem Verhalten von Legg Mason Global Funds plc (die „Gesellschaft“) für den Zeitraum in ihrer Eigenschaft als Depotstelle der Gesellschaft befasst.

Dieser Bericht, einschließlich der Stellungnahme, wurde für und ausschließlich für die Aktionäre der Gesellschaft in Übereinstimmung mit unserer Rolle als Verwahrstelle der Gesellschaft und zu keinem anderen Zweck erstellt. Wir übernehmen durch die Abgabe dieser Stellungnahme keine Verantwortung für andere Zwecke oder gegenüber anderen Personen, denen dieser Bericht gezeigt wird.

### Verantwortlichkeiten der Verwahrstelle

Unsere Pflichten und Verantwortlichkeiten sind in Verordnung 34 der Verordnungen der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren) von 2011 (S.I. Nr. 352 von 2011) in der jeweils gültigen Fassung (die „Verordnungen“) dargelegt.

Unser Bericht legt dar, ob die Gesellschaft in diesem Zeitraum unserer Auffassung nach unter Einhaltung der Bestimmungen der Gründungsdokumente sowie der Regulations gelehrt wurde. Es liegt in der Gesamtverantwortung der Gesellschaft, diese Bestimmungen zu erfüllen. Falls die Gesellschaft nicht entsprechend geführt wurde, sind wir als Verwahrstelle verpflichtet, anzugeben, in welcher Hinsicht sie nicht entsprechend geführt wurde und welche Schritte wir diesbezüglich unternommen haben.

### Grundlage der Stellungnahme der Verwahrstelle

Die Verwahrstelle führt solche Überprüfungen durch, die sie nach ihrer vernünftigen Ansicht für notwendig hält, um ihren Pflichten nachzukommen und um sicherzustellen, dass die Gesellschaft in allen wesentlichen Belangen (i) in Übereinstimmung mit den Beschränkungen ihrer Anlage- und Kreditaufnahmebefugnisse durch die Bestimmungen ihrer Satzungsdokumentation und der entsprechenden Vorschriften und (ii) anderweitig in Übereinstimmung mit der Satzungsdokumentation der Gesellschaft und den entsprechenden Vorschriften verwaltet wurde.

### Meinung

Unserer Auffassung nach ist die Gesellschaft in diesem Berichtszeitraum in allen wesentlichen Aspekten unter Einhaltung folgender Vorschriften geführt worden:

- (i) in Übereinstimmung mit den Beschränkungen, die den Anlage- und Kreditaufnahmebefugnissen der Gesellschaft durch die Satzungsdokumentation und die Vorschriften auferlegt werden; und
- (ii) sonst in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Verfassungsdokumentation und der Verordnungen.

---

Für und im Auftrag der Bank of New York Mellon SA/NV,  
Niederlassung Dublin,  
Riverside Two  
Sir John Rogerson's Quay Dublin 2,  
D02 KV60,  
Irland

# Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 72,82 % (28. Februar 2021: 83,70 %)</b>					
<b>USA — 72,82 % (28. Februar 2021: 83,70 %)</b>					
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,120 %, fällig 13/04/2022	10.000	1,09	10.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 26/05/2022	9.991	1,08
7.500 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,140 %, fällig 22/04/2022	7.500	0,82	10.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 02/06/2022	9.991	1,09
40.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,050 %, fällig 09/06/2022 *	39.998	4,35	10.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 11/08/2022	9.996	1,09
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,135 %, fällig 25/07/2022 *	10.003	1,09	10.000 United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31/03/2022	10.002	1,09
8.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,195 %, fällig 28/07/2022 *	8.004	0,87	25.000 United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 31/03/2022	25.034	2,72
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,150 %, fällig 14/09/2022 *	10.004	1,09	10.000 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 31/05/2022	10.045	1,09
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,070 %, fällig 25/10/2022 *	9.999	1,09	10.000 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 31/07/2022	10.075	1,09
10.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 16/06/2022	9.998	1,09	5.000 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 31/07/2022	5.040	0,55
10.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 23/06/2022	9.998	1,09		669.444	72,82
5.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 06/07/2022	4.999	0,54	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen</b>	<b>669.444</b>	<b>72,82</b>
5.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 08/08/2022	4.997	0,54	<b>(Anschaffungskosten 669.444 USD)</b>		
4.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Null-Coupon, fällig 25/10/2022	3.994	0,43	<b>Rückkaufvereinbarungen — 29,37 % (28. Februar 2021: 19,49 %)</b>		
15.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 16/03/2022	15.000	1,63	<b>USA — 29,37 % (28. Februar 2021: 19,49 %)</b>		
10.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Null-Coupon, fällig 15/07/2022	9.997	1,09	60.000 Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement wird zu 60.000.083 USD zurückgekauft (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 61.200.144 USD), 0,050 %, fällig am 01/03/2022	60.000	6,53
15.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 0,050 %, fällig 01/06/2022 *	15.000	1,63	80.000 JP Morgan, Reverse Repurchase Agreement zu 80.000.111 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 81.600.179 USD), 0,050 %, fällig am 01/03/2022	80.000	8,70
5.000 Federal Home Loan Banks, 2,125 %, fällig 10/06/2022	5.028	0,54	50.000 Royal Bank of Canada, Reverse Repurchase Agreement zu 50.000.042 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 51.000.029 USD), 0,030 %, fällig am 01/03/2022	50.000	5,44
10.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 0,060 %, fällig 02/08/2022 *	10.000	1,09	80.000 TD Securities (USA) LLC, Reverse Repurchase Agreement zu 80.000.111 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 81.600.000 USD), 0,050 %, fällig am 01/03/2022	80.000	8,70
15.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 0,055 %, fällig 30/08/2022 *	15.000	1,63		270.000	29,37
10.729 Federal Home Loan Mortgage Corp, 0,125 %, fällig 25/07/2022	10.731	1,17	<b>Gesamtsumme der umgekehrten Rückkaufvereinbarungen</b>	<b>270.000</b>	<b>29,37</b>
15.000 Federal National Mortgage Association, 0,240 %, fällig 27/05/2022 *	15.007	1,63	<b>(Anschaffungskosten 270.000 USD)</b>		
10.000 United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 03/05/2022	9.998	1,09	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten</b>		
10.000 United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 10/05/2022	9.997	1,09	<b>finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>939.444</b>	<b>102,19</b>
10.000 United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 31/05/2022	9.993	1,09	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten</b>		
10.000 United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 07/06/2022	9.991	1,08	<b>finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>939.444</b>	<b>102,19</b>
20.000 United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 21/06/2022	19.969	2,17	<b>Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten</b>	<b>(20.120)</b>	<b>(2,19)</b>
10.000 United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 28/06/2022	9.981	1,09	<b>Gesamtvermögen</b>	<b>\$919.324</b>	<b>100,00</b>
30.230 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 01/03/2022	30.230	3,29			
25.231 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 03/03/2022	25.231	2,74			
10.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 08/03/2022	10.000	1,09			
50.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 10/03/2022	49.999	5,44			
15.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 15/03/2022	15.000	1,63			
15.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 17/03/2022	15.000	1,63			
20.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 22/03/2022	19.999	2,17			
33.640 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 24/03/2022	33.638	3,66			
10.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 29/03/2022	9.999	1,09			
15.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 31/03/2022	14.999	1,63			
10.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 07/04/2022	9.999	1,09			
10.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 14/04/2022	9.998	1,09			
10.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 19/04/2022	9.999	1,09			
10.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 21/04/2022	9.998	1,09			
10.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 26/04/2022	9.998	1,09			
10.000 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 28/04/2022	9.997	1,09			

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

\* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.

	% des Gesamt- vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	71,24
Geldmarktinstrumente	28,73
Sonstige Vermögenswerte	0,03
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

# Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Asset-Backed Securities – 9,40 % (28. Februar 2021: 8,11 %)</b>					
370	522	0,16	440	438	0,19
189	186	0,08	600	600	0,26
307	307	0,13	440	441	0,19
415	413	0,18	106	109	0,05
500	499	0,21	421	415	0,18
600	598	0,26	109	107	0,05
630	631	0,27	423	469	0,20
270	270	0,12	576	562	0,24
500	500	0,21	592	576	0,25
99	97	0,04	490	490	0,21
38	38	0,02	660	660	0,28
162	156	0,07	320	319	0,14
38	35	0,01	<b>Summe vermögensbesicherte Wertpapiere</b>		<b>9,40</b>
292	280	0,12	<b>(Anschaffungskosten 21.870 USD)</b>		
208	200	0,09	<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere — 25,49 % (28. Februar 2021: 35,39 %)</b>		
537	547	0,23	110	31	0,01
271	275	0,12	630	680	0,29
160	174	0,07	64	66	0,03
480	478	0,21	10.916	265	0,11
420	417	0,18	879	871	0,37
250	250	0,11	330	328	0,14
320	320	0,14	100	104	0,04
750	750	0,32	130	133	0,06
430	429	0,18	700	703	0,30
1.001	997	0,43	485	474	0,20
891	888	0,38	150	150	0,06
345	341	0,15	10	3	–
503	500	0,21	84	85	0,04
73	73	0,03	100	101	0,04
430	436	0,19	340	345	0,15
500	497	0,21	420	401	0,17
483	475	0,20	461	461	0,20
197	197	0,08	1.036	1.017	0,44
1.480	1.510	0,65	173	173	0,07
195	196	0,08	13	13	0,01
370	370	0,16	463	468	0,20
800	813	0,35	2	–	–
350	349	0,15	5	1	–
125	123	0,05	10	1	–
480	481	0,21	10	1	–
240	240	0,10	9	–	–
			700	691	0,30
			500	515	0,22
			2	2	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>					
40 Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, fällig 01/10/2044	44	0,02	394 Fannie Mae Pool 'BU0051', 2,500 %, fällig 01/09/2051	391	0,17
47 Fannie Mae Pool '890827', 3,500 %, fällig 01/12/2037	50	0,02	100 Fannie Mae Pool 'BU2599', 2,500 %, fällig 01/01/2052	99	0,04
27 Fannie Mae Pool 'AB9594', 4,000 %, fällig 01/06/2043	29	0,01	100 Fannie Mae Pool 'BV3089', 2,500 %, fällig 01/02/2052	99	0,04
291 Fannie Mae Pool 'AH4536', 4,000 %, fällig 01/02/2041	308	0,13	386 Fannie Mae Pool 'CA1692', 4,000 %, fällig 01/05/2048	408	0,18
11 Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, fällig 01/05/2040	12	0,01	95 Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500 %, fällig 01/07/2048	102	0,04
78 Fannie Mae Pool 'AL9397', 3,000 %, fällig 01/10/2046	80	0,03	263 Fannie Mae Pool 'CA4979', 3,000 %, fällig 01/01/2050	267	0,11
104 Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, fällig 01/11/2046	109	0,05	432 Fannie Mae Pool 'CA5164', 3,500 %, fällig 01/02/2050	448	0,19
46 Fannie Mae Pool 'AL9631', 3,000 %, fällig 01/12/2046	47	0,02	90 Fannie Mae Pool 'CA8377', 1,500 %, fällig 01/12/2035	87	0,04
20 Fannie Mae Pool 'AM8674', 2,810 %, fällig 01/04/2025	21	0,01	93 Fannie Mae Pool 'CB0114', 2,500 %, fällig 01/04/2041	93	0,04
46 Fannie Mae Pool 'AO7501', 4,000 %, fällig 01/06/2042	48	0,02	186 Fannie Mae Pool 'CB0470', 2,500 %, fällig 01/05/2041	187	0,08
28 Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, fällig 01/09/2042	29	0,01	100 Fannie Mae Pool 'CB2680', 3,500 %, fällig 01/01/2052	103	0,04
53 Fannie Mae Pool 'AS6328', 3,500 %, fällig 01/12/2045	55	0,02	199 Fannie Mae Pool 'CB2764', 2,000 %, fällig 01/02/2052	192	0,08
319 Fannie Mae Pool 'AS7313', 3,500 %, fällig 01/06/2046	333	0,14	399 Fannie Mae Pool 'CB2869', 2,500 %, fällig 01/02/2052	394	0,17
102 Fannie Mae Pool 'AS7738', 3,000 %, fällig 01/08/2046	105	0,05	200 Fannie Mae Pool 'CB3031', 2,500 %, fällig 01/03/2052	198	0,08
70 Fannie Mae Pool 'AS7844', 3,500 %, fällig 01/09/2046	72	0,03	100 Fannie Mae Pool 'CB3044', 2,500 %, fällig 01/03/2052	99	0,04
26 Fannie Mae Pool 'AS8740', 3,500 %, fällig 01/02/2047	27	0,01	60 Fannie Mae Pool 'CM0068', 3,500 %, fällig 01/02/2040	64	0,03
45 Fannie Mae Pool 'AS8745', 3,000 %, fällig 01/02/2047	47	0,02	53 Fannie Mae Pool 'FM0071', 3,500 %, fällig 01/02/2040	55	0,02
54 Fannie Mae Pool 'AS9588', 4,000 %, fällig 01/05/2047	57	0,02	281 Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, fällig 01/09/2049	308	0,13
24 Fannie Mae Pool 'AT4281', 4,000 %, fällig 01/06/2043	26	0,01	40 Fannie Mae Pool 'FM2158', 4,000 %, fällig 01/10/2049	42	0,02
71 Fannie Mae Pool 'AW9453', 3,500 %, fällig 01/08/2044	74	0,03	56 Fannie Mae Pool 'FM2201', 4,000 %, fällig 01/01/2048	59	0,03
47 Fannie Mae Pool 'BC0884', 3,000 %, fällig 01/05/2046	48	0,02	146 Fannie Mae Pool 'FM2761', 5,000 %, fällig 01/03/2050	158	0,07
78 Fannie Mae Pool 'BC1509', 3,000 %, fällig 01/08/2046	80	0,03	174 Fannie Mae Pool 'FM3141', 3,500 %, fällig 01/11/2048	181	0,08
111 Fannie Mae Pool 'BC2817', 3,000 %, fällig 01/09/2046	114	0,05	47 Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000 %, fällig 01/11/2048	50	0,02
28 Fannie Mae Pool 'BC9096', 3,500 %, fällig 01/12/2046	29	0,01	176 Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500 %, fällig 01/05/2047	183	0,08
43 Fannie Mae Pool 'BD2455', 3,000 %, fällig 01/01/2047	44	0,02	163 Fannie Mae Pool 'FM3572', 4,500 %, fällig 01/09/2049	174	0,07
47 Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000 %, fällig 01/10/2046	49	0,02	252 Fannie Mae Pool 'FM3773', 3,500 %, fällig 01/11/2048	263	0,11
118 Fannie Mae Pool 'BE2981', 3,000 %, fällig 01/02/2032	122	0,05	59 Fannie Mae Pool 'FM3904', 4,000 %, fällig 01/03/2049	62	0,03
36 Fannie Mae Pool 'BE3702', 4,000 %, fällig 01/06/2047	38	0,02	85 Fannie Mae Pool 'FM3978', 4,000 %, fällig 01/07/2050	89	0,04
226 Fannie Mae Pool 'BF0104', 4,000 %, fällig 01/02/2056	244	0,10	84 Fannie Mae Pool 'FM4577', 2,500 %, fällig 01/10/2050	83	0,04
262 Fannie Mae Pool 'BF0133', 4,000 %, fällig 01/08/2056	282	0,12	289 Fannie Mae Pool 'FM4595', 3,000 %, fällig 01/09/2050	294	0,13
59 Fannie Mae Pool 'BF0163', 5,000 %, fällig 01/11/2046	65	0,03	667 Fannie Mae Pool 'FM4650', 2,500 %, fällig 01/10/2040	671	0,29
102 Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000 %, fällig 01/01/2057	110	0,05	54 Fannie Mae Pool 'FM4737', 3,500 %, fällig 01/09/2050	55	0,02
224 Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, fällig 01/06/2057	241	0,10	64 Fannie Mae Pool 'FM4925', 3,000 %, fällig 01/11/2050	64	0,03
139 Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500 %, fällig 01/09/2057	152	0,07	46 Fannie Mae Pool 'FM5054', 4,000 %, fällig 01/11/2048	48	0,02
47 Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, fällig 01/08/2058	51	0,02	174 Fannie Mae Pool 'FM5423', 2,500 %, fällig 01/01/2051	172	0,07
197 Fannie Mae Pool 'BH2623', 4,000 %, fällig 01/08/2047	207	0,09	83 Fannie Mae Pool 'FM5713', 2,500 %, fällig 01/02/2051	82	0,03
22 Fannie Mae Pool 'BH4095', 4,000 %, fällig 01/10/2047	24	0,01	62 Fannie Mae Pool 'FM5783', 3,000 %, fällig 01/06/2038	64	0,03
93 Fannie Mae Pool 'BH9923', 3,500 %, fällig 01/09/2047	97	0,04	50 Fannie Mae Pool 'FM5828', 4,000 %, fällig 01/10/2048	52	0,02
44 Fannie Mae Pool 'BJ0685', 4,000 %, fällig 01/04/2048	46	0,02	77 Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, fällig 01/02/2051	76	0,03
39 Fannie Mae Pool 'BL2454', 3,160 %, fällig 01/05/2029	41	0,02	171 Fannie Mae Pool 'FM5931', 2,500 %, fällig 01/02/2051	170	0,07
193 Fannie Mae Pool 'BL5850', 2,260 %, fällig 01/04/2030	194	0,08	161 Fannie Mae Pool 'FM5944', 2,500 %, fällig 01/01/2051	159	0,07
76 Fannie Mae Pool 'BM1948', 6,000 %, fällig 01/07/2041	87	0,04	124 Fannie Mae Pool 'FM6134', 3,000 %, fällig 01/03/2040	128	0,05
19 Fannie Mae Pool 'BM2005', 4,000 %, fällig 01/12/2047	20	0,01	90 Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, fällig 01/03/2051	89	0,04
161 Fannie Mae Pool 'BM3473', 3,500 %, fällig 01/11/2047	168	0,07	94 Fannie Mae Pool 'FM6871', 2,500 %, fällig 01/04/2051	93	0,04
20 Fannie Mae Pool 'BM3904', 5,000 %, fällig 01/05/2048	22	0,01	381 Fannie Mae Pool 'FM7210', 2,000 %, fällig 01/04/2051	367	0,16
463 Fannie Mae Pool 'BM4579', 3,000 %, fällig 01/04/2047	474	0,20	94 Fannie Mae Pool 'FM7304', 2,500 %, fällig 01/05/2051	93	0,04
43 Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, fällig 01/03/2043	45	0,02	89 Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, fällig 01/06/2051	88	0,04
700 Fannie Mae Pool 'BM5526', 3,500 %, fällig 01/02/2048	730	0,31	88 Fannie Mae Pool 'FM7741', 2,500 %, fällig 01/05/2051	87	0,04
1.258 Fannie Mae Pool 'BN3898', 4,500 %, fällig 01/12/2048	1.352	0,58	70 Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000 %, fällig 01/01/2049	73	0,03
106 Fannie Mae Pool 'BO7625', 3,000 %, fällig 01/03/2050	108	0,05	78 Fannie Mae Pool 'FM7796', 4,000 %, fällig 01/06/2048	83	0,04
119 Fannie Mae Pool 'BP2319', 3,000 %, fällig 01/02/2050	120	0,05	95 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, fällig 01/07/2051	94	0,04
77 Fannie Mae Pool 'BP8713', 3,000 %, fällig 01/08/2050	78	0,03	96 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, fällig 01/07/2051	95	0,04
72 Fannie Mae Pool 'BP9421', 3,000 %, fällig 01/07/2050	73	0,03	77 Fannie Mae Pool 'FM7929', 3,500 %, fällig 01/08/2050	80	0,03
83 Fannie Mae Pool 'BQ1150', 2,500 %, fällig 01/10/2050	82	0,04	289 Fannie Mae Pool 'FM7960', 4,000 %, fällig 01/10/2048	305	0,13
90 Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500 %, fällig 01/11/2050	89	0,04	1.007 Fannie Mae Pool 'FM8210', 3,000 %, fällig 01/04/2050	1.023	0,44
92 Fannie Mae Pool 'BQ9224', 2,000 %, fällig 01/01/2051	89	0,04	148 Fannie Mae Pool 'FM8227', 3,500 %, fällig 01/06/2049	153	0,07
89 Fannie Mae Pool 'BQ9226', 2,000 %, fällig 01/01/2051	86	0,04	491 Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000 %, fällig 01/02/2050	503	0,22
84 Fannie Mae Pool 'BR0757', 2,500 %, fällig 01/01/2051	83	0,04	195 Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, fällig 01/10/2051	193	0,08
87 Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000 %, fällig 01/02/2051	84	0,04	98 Fannie Mae Pool 'FM9335', 2,500 %, fällig 01/10/2051	97	0,04
82 Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000 %, fällig 01/02/2051	79	0,03	100 Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000 %, fällig 01/01/2052	101	0,04
87 Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000 %, fällig 01/02/2051	84	0,04	99 Fannie Mae Pool 'FS0352', 2,000 %, fällig 01/01/2052	95	0,04
87 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, fällig 01/02/2051	84	0,04	299 Fannie Mae Pool 'FS0392', 2,500 %, fällig 01/01/2052	296	0,13
86 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, fällig 01/02/2051	83	0,04	199 Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, fällig 01/01/2052	198	0,09
88 Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000 %, fällig 01/03/2051	85	0,04	199 Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500 %, fällig 01/02/2052	198	0,08
183 Fannie Mae Pool 'BR3290', 2,000 %, fällig 01/03/2051	176	0,08	100 Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, fällig 01/02/2052	99	0,04
95 Fannie Mae Pool 'BR4035', 2,000 %, fällig 01/02/2051	91	0,04	100 Fannie Mae Pool 'FS0583', 2,500 %, fällig 01/02/2052	99	0,04
94 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, fällig 01/03/2051	90	0,04	100 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 01/02/2052	96	0,04
86 Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000 %, fällig 01/03/2051	83	0,04	400 Fannie Mae Pool 'FS0605', 2,500 %, fällig 01/02/2052	396	0,17
90 Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000 %, fällig 01/03/2051	87	0,04	38 Fannie Mae Pool 'MA1217', 4,000 %, fällig 01/10/2042	41	0,02
85 Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000 %, fällig 01/03/2051	82	0,04	19 Fannie Mae Pool 'MA1253', 4,000 %, fällig 01/11/2042	20	0,01
93 Fannie Mae Pool 'BR5458', 2,000 %, fällig 01/03/2051	89	0,04	27 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, fällig 01/09/2043	30	0,01
91 Fannie Mae Pool 'BR5577', 2,000 %, fällig 01/03/2051	87	0,04	52 Fannie Mae Pool 'MA2110', 3,500 %, fällig 01/12/2034	55	0,02
90 Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000 %, fällig 01/03/2051	87	0,04	37 Fannie Mae Pool 'MA2138', 3,500 %, fällig 01/01/2035	38	0,02
93 Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000 %, fällig 01/03/2051	90	0,04	70 Fannie Mae Pool 'MA2320', 3,000 %, fällig 01/07/2035	72	0,03
89 Fannie Mae Pool 'BR5634', 2,000 %, fällig 01/03/2051	86	0,04	114 Fannie Mae Pool 'MA2523', 3,000 %, fällig 01/02/2036	117	0,05
94 Fannie Mae Pool 'BR5649', 2,000 %, fällig 01/03/2051	91	0,04	84 Fannie Mae Pool 'MA2579', 3,000 %, fällig 01/04/2036	87	0,04
93 Fannie Mae Pool 'BR6462', 2,000 %, fällig 01/03/2051	89	0,04	198 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, fällig 01/07/2036	202	0,09
96 Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500 %, fällig 01/07/2051	95	0,04	284 Fannie Mae Pool 'MA2707', 3,000 %, fällig 01/08/2036	292	0,13
96 Fannie Mae Pool 'BT3244', 2,500 %, fällig 01/07/2051	95	0,04	422 Fannie Mae Pool 'MA2773', 3,000 %, fällig 01/10/2036	434	0,19
98 Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500 %, fällig 01/08/2051	97	0,04	264 Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, fällig 01/12/2036	271	0,12
98 Fannie Mae Pool 'BT3303', 2,500 %, fällig 01/08/2051	97	0,04	461 Fannie Mae Pool 'MA3058', 4,000 %, fällig 01/07/2047	486	0,21
	97	0,04	61 Fannie Mae Pool 'MA3149', 4,000 %, fällig 01/10/2047	64	0,03

# Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>					
43 Fannie Mae Pool 'MA3239', 4,000 %, fällig 01/01/2048	46	0,02	171 Freddie Mac Pool 'RA4414', 2,500 %, fällig 01/01/2051	170	0,07
12 Fannie Mae REMICS, Series 2001 81, Class GE, 6,000 %, fällig 25/01/2032	13	0,01	270 Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, fällig 01/02/2051	260	0,11
22 Fannie Mae REMICS, Series 2005 29, Class ZA, 5,500 %, fällig 25/04/2035	24	0,01	95 Freddie Mac Pool 'RA5040', 2,000 %, fällig 01/04/2051	91	0,04
9 Fannie Mae REMICS, Series 2011 87, Class SG, 6,363 %, fällig 25/04/2040 *	1	-	530 Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, fällig 01/05/2051	512	0,22
27 Fannie Mae REMICS, Series 2012 101, Class AI, 3,000 %, fällig 25/06/2027	1	-	384 Freddie Mac Pool 'RA5155', 2,000 %, fällig 01/05/2051	370	0,16
86 Fannie Mae REMICS, Series 2012 134, Class SK, 5,963 %, fällig 25/12/2042 *	15	0,01	96 Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000 %, fällig 01/06/2051	92	0,04
7 Fannie Mae REMICS, Series 2012 46, Class BA, 6,000 %, fällig 25/05/2042	8	-	382 Freddie Mac Pool 'RA5576', 2,500 %, fällig 01/07/2051	378	0,16
1 Fannie Mae REMICS, Series 2012 70, Class YS, 6,463 %, fällig 25/02/2041 *	-	-	1.086 Freddie Mac Pool 'RA6507', 2,000 %, fällig 01/12/2051	1.044	0,45
7 Fannie Mae REMICS, Series 2012 75, Class NS, 6,413 %, fällig 25/07/2042 *	1	-	95 Freddie Mac Pool 'RA6599', 3,500 %, fällig 01/01/2052	98	0,04
283 Fannie Mae REMICS, Series 2012 96, Class SB, 5,863 %, fällig 25/09/2042 *	38	0,02	386 Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, fällig 01/09/2041	377	0,16
11 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class BC, 6,500 %, fällig 25/07/2042	12	0,01	185 Freddie Mac Pool 'SD0552', 2,000 %, fällig 01/03/2051	178	0,08
15 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class CB, 5,500 %, fällig 25/04/2042	16	0,01	87 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig 01/04/2051	84	0,04
103 Fannie Mae REMICS, Series 2020 47, Class GZ, 2,000 %, fällig 25/07/2050	87	0,04	96 Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500 %, fällig 01/07/2051	95	0,04
172 Fannie Mae REMICS, Series 2020 56, Class DI, 2,500 %, fällig 25/08/2050	27	0,01	99 Freddie Mac Pool 'SD0809', 3,000 %, fällig 01/01/2052	100	0,04
85 Fannie Mae REMICS, Series 2020 74, Class EI, 2,500 %, fällig 25/10/2050	13	0,01	100 Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, fällig 01/01/2052	99	0,04
589 Fannie Mae REMICS, Series 2020 89, Class DI, 2,500 %, fällig 25/12/2050	84	0,04	596 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig 01/11/2051	592	0,25
469 Fannie Mae REMICS, Series 2020 97, Class AI, 2,000 %, fällig 25/01/2051	67	0,03	58 Freddie Mac Pool 'ZA2489', 3,500 %, fällig 01/01/2038	60	0,03
280 Fannie Mae REMICS, Series 2021 3, Class IB, 2,500 %, fällig 25/02/2051	48	0,02	27 Freddie Mac Pool 'ZA5318', 3,500 %, fällig 01/03/2048	28	0,01
799 Fannie Mae REMICS, Series 2021 3, Class QI, 2,500 %, fällig 25/02/2051	115	0,05	9 Freddie Mac Pool 'Z17269', 5,000 %, fällig 01/03/2038	10	-
55 Fannie Mae-Aces, Series 2013 M6, Class 1AC, 3,353 %, fällig 25/02/2043 *	58	0,02	30 Freddie Mac Pool 'ZN0538', 3,500 %, fällig 01/11/2042	31	0,01
400 Fannie Mae-Aces, Series 2018 M15, Class 1A2, 3,700 %, fällig 25/01/2036	442	0,19	22 Freddie Mac Pool 'ZN1436', 5,000 %, fällig 01/11/2048	24	0,01
195 Fannie Mae-Aces, Series 2018 M9, Class APT2, 3,121 %, fällig 25/04/2028 *	204	0,09	5 Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, fällig 01/12/2038	6	-
590 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M36, Class X1, 1,460 %, fällig 25/09/2034 *	56	0,02	9 Freddie Mac Pool 'ZS3569', 6,000 %, fällig 01/10/2036	10	-
29 Freddie Mac Gold Pool 'C91240', 4,500 %, fällig 01/01/2029	30	0,01	99 Freddie Mac Pool 'ZS4699', 4,000 %, fällig 01/01/2047	105	0,05
12 Freddie Mac Gold Pool 'G06409', 6,000 %, fällig 01/11/2039	14	0,01	21 Freddie Mac Pool 'ZS4751', 3,500 %, fällig 01/01/2048	22	0,01
5 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, fällig 01/09/2039	6	-	28 Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000 %, fällig 01/10/2032	29	0,01
181 Freddie Mac Gold Pool 'G61637', 3,000 %, fällig 01/09/2047	186	0,08	121 Freddie Mac Pool 'ZS9316', 3,500 %, fällig 01/01/2038	127	0,05
26 Freddie Mac Gold Pool 'Q17792', 3,500 %, fällig 01/05/2043	27	0,01	56 Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, fällig 01/01/2046	58	0,02
48 Freddie Mac Gold Pool 'Q29184', 4,000 %, fällig 01/10/2044	52	0,02	190 Freddie Mac Pool 'ZT1493', 3,000 %, fällig 01/09/2048	195	0,08
48 Freddie Mac Gold Pool 'Q45560', 3,000 %, fällig 01/01/2047	49	0,02	49 Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500 %, fällig 01/04/2033	51	0,02
94 Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000 %, fällig 01/01/2047	97	0,04	74 Freddie Mac Pool 'ZT2230', 4,000 %, fällig 01/07/2048	77	0,03
52 Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000 %, fällig 01/01/2047	53	0,02	5 Freddie Mac REMICS 3621, Class SB, 6,039 %, fällig 15/01/2040 *	1	-
20 Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, fällig 01/10/2042	21	0,01	20 Freddie Mac REMICS 3947, Class SG, 5,759 %, fällig 15/10/2041 *	3	-
62 Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500 %, fällig 01/03/2045	65	0,03	14 Freddie Mac REMICS 4194, Class BI, 3,500 %, fällig 15/04/2043	2	-
90 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates Q006, Class A2, 4,416 %, fällig 25/04/2028 *	90	0,04	4 Freddie Mac REMICS 4298, Class PI, 4,000 %, fällig 15/04/2043	-	-
88 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,100 %, fällig 01/03/2047 *	89	0,04	35 Freddie Mac REMICS 4813, Class CJ, 3,000 %, fällig 15/08/2048	36	0,02
479 Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,013 %, fällig 01/11/2048 *	490	0,21	74 Freddie Mac REMICS 5010, Class IK, 2,500 %, fällig 25/09/2050	10	-
155 Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 2,873 %, fällig 01/11/2047 *	159	0,07	262 Freddie Mac REMICS 5010, Class JI, 2,500 %, fällig 25/09/2050	42	0,02
157 Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,092 %, fällig 01/02/2050 *	160	0,07	91 Freddie Mac REMICS 5013, Class IN, 2,500 %, fällig 25/09/2050	15	0,01
88 Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, fällig 01/11/2050	87	0,04	182 Freddie Mac REMICS 5018, Class MI, 2,000 %, fällig 25/10/2050	25	0,01
85 Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, fällig 01/11/2050	84	0,04	82 Freddie Mac REMICS 5040, Class IB, 2,500 %, fällig 25/11/2050	11	-
86 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig 01/02/2051	82	0,04	374 Freddie Mac REMICS 5059, Class IB, 2,500 %, fällig 25/01/2051	62	0,03
361 Freddie Mac Pool 'QB9087', 2,000 %, fällig 01/02/2051	346	0,15	88 Freddie Mac REMICS 5069, Class MI, 2,500 %, fällig 25/02/2051	13	0,01
87 Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000 %, fällig 01/03/2051	83	0,04	195 Freddie Mac REMICS 5140, Class NI, 2,500 %, fällig 25/05/2049	29	0,01
98 Freddie Mac Pool 'QC0297', 2,000 %, fällig 01/04/2051	94	0,04	38 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, Series 2020DNA6, Class M1, 144A, 0,949 %, fällig 25/12/2050 *	38	0,02
97 Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, fällig 01/07/2051	96	0,04	78 Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates, Series T 56, Class 2AF, 0,587 %, fällig 25/05/2043 *	78	0,03
97 Freddie Mac Pool 'QC4446', 2,500 %, fällig 01/07/2051	96	0,04	19 Ginnie Mae I Pool '557522', 7,000 %, fällig 15/07/2031	21	0,01
96 Freddie Mac Pool 'QC4690', 2,500 %, fällig 01/08/2051	95	0,04	11 Ginnie Mae I Pool '565347', 7,000 %, fällig 15/08/2031	11	-
94 Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, fällig 01/08/2051	93	0,04	4 Ginnie Mae I Pool '584344', 7,000 %, fällig 15/04/2032	4	-
291 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, fällig 01/08/2051	289	0,12	79 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15/06/2048	83	0,04
100 Freddie Mac Pool 'QD5827', 2,000 %, fällig 01/02/2052	96	0,04	44 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15/09/2042	45	0,02
100 Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, fällig 01/02/2052	99	0,04	61 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15/09/2042	63	0,03
99 Freddie Mac Pool 'QD6093', 2,000 %, fällig 01/02/2052	95	0,04	140 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15/10/2042	145	0,06
113 Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000 %, fällig 01/09/2049	116	0,05	9 Ginnie Mae II Pool '4837', 6,000 %, fällig 20/10/2040	11	-
87 Freddie Mac Pool 'RA2114', 3,500 %, fällig 01/02/2050	90	0,04	8 Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500 %, fällig 20/01/2041	9	-
228 Freddie Mac Pool 'RA2313', 3,500 %, fällig 01/03/2050	237	0,10	6 Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, fällig 20/02/2041	6	-
34 Freddie Mac Pool 'RA2358', 4,000 %, fällig 01/03/2050	36	0,02	19 Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, fällig 20/03/2041	21	0,01
177 Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, fällig 01/11/2050	171	0,07	10 Ginnie Mae II Pool '5240', 6,000 %, fällig 20/11/2041	11	-
347 Freddie Mac Pool 'RA4175', 2,500 %, fällig 01/12/2050	343	0,15	17 Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, fällig 20/01/2046	18	0,01
			575 Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000 %, fällig 20/07/2047	608	0,26
			19 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, fällig 20/10/2049	19	0,01
			139 Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, fällig 20/01/2050	142	0,06
			32 Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500 %, fällig 20/09/2048	34	0,01
			65 Ginnie Mae II Pool '785359', 2,000 %, fällig 20/03/2051	63	0,03
			97 Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000 %, fällig 20/03/2051	95	0,04
			35 Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500 %, fällig 20/10/2047	36	0,02
			36 Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, fällig 20/02/2050	38	0,02
			107 Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000 %, fällig 20/11/2049	111	0,05
			49 Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, fällig 20/02/2050	52	0,02
			138 Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000 %, fällig 20/03/2050	140	0,06
			79 Ginnie Mae II Pool 'CG3836', 3,000 %, fällig 20/09/2047	80	0,03
			36 Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, fällig 20/06/2044	38	0,02

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>					
13			55		
Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500 %, fällig 20/03/2045	13	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2015 167, Class OI, 4,000 %, fällig 16/04/2045	9	–
136			38		
Ginnie Mae II Pool 'MA3521', 3,500 %, fällig 20/03/2046	142	0,06	Government National Mortgage Association, Series 2015 36, Class MI, 5,500 %, fällig 20/03/2045	8	–
72			647		
Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, fällig 20/04/2046	76	0,03	Government National Mortgage Association, Series 2015 5, Class IK, 0,357 %, fällig 16/11/2054 *	9	–
18			334		
Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, fällig 20/05/2046	19	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2016 128, Class IO, 0,754 %, fällig 16/09/2056 *	14	0,01
57			91		
Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, fällig 20/06/2046	59	0,03	Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class IL, 2,500 %, fällig 20/08/2050	12	0,01
19			177		
Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, fällig 20/07/2046	20	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class NI, 2,500 %, fällig 20/08/2050	24	0,01
107			88		
Ginnie Mae II Pool 'MA3873', 3,000 %, fällig 20/08/2046	110	0,05	Government National Mortgage Association, Series 2020 127, Class IN, 2,500 %, fällig 20/08/2050	12	0,01
21			91		
Ginnie Mae II Pool 'MA3937', 3,500 %, fällig 20/09/2046	22	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2020 129, Class IE, 2,500 %, fällig 20/09/2050	12	0,01
23			92		
Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000 %, fällig 20/11/2046	24	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class IH, 2,500 %, fällig 20/10/2050	13	0,01
26			90		
Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, fällig 20/02/2047	27	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class VI, 2,500 %, fällig 20/10/2050	12	–
199			365		
Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, fällig 20/06/2047	209	0,09	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class YI, 2,500 %, fällig 20/10/2050	47	0,02
167			4.520		
Ginnie Mae II Pool 'MA4719', 3,500 %, fällig 20/09/2047	175	0,07	Government National Mortgage Association, Series 2020 178, Class IO, 1,412 %, fällig 16/10/2060 *	461	0,20
117			3.417		
Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, fällig 20/11/2047	123	0,05	Government National Mortgage Association, Series 2020 179, Class IO, 0,998 %, fällig 16/09/2062 *	278	0,12
15			444		
Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000 %, fällig 20/12/2047	15	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2020 181, Class WI, 2,000 %, fällig 20/12/2050	47	0,02
76			1.849		
Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, fällig 20/12/2047	80	0,03	Government National Mortgage Association, Series 2020 195, Class IO, 0,958 %, fällig 16/12/2062 *	152	0,07
13			322		
Ginnie Mae II Pool 'MA5018', 3,000 %, fällig 20/02/2048	14	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class MI, 5,500 %, fällig 20/04/2050	46	0,02
132			85		
Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500 %, fällig 20/02/2048	138	0,06	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class NI, 3,500 %, fällig 20/04/2050	13	0,01
36			222		
Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, fällig 20/02/2048	38	0,02	Government National Mortgage Association, Series 2020 H04, Class FP, 0,601 %, fällig 20/06/2069 *	223	0,10
49			234		
Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, fällig 20/03/2048	51	0,02	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class FL, 1,312 %, fällig 20/05/2070 *	244	0,10
29			144		
Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000 %, fällig 20/04/2048	30	0,01	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class NF, 1,412 %, fällig 20/04/2070 *	147	0,06
112			76		
Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, fällig 20/06/2048	118	0,05	Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Class FA, 0,612 %, fällig 20/07/2070 *	76	0,03
54			6.191		
Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, fällig 20/07/2048	57	0,02	Government National Mortgage Association, Series 2021 10, Class IO, 1,002 %, fällig 16/05/2063 *	531	0,23
84			5.589		
Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, fällig 20/10/2048	89	0,04	Government National Mortgage Association, Series 2021 5, Class IO, 1,091 %, fällig 16/01/2061 *	488	0,21
37			492		
Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, fällig 20/12/2048	39	0,02	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Class A, 144A, 1,741 %, fällig 15/09/2031 *	444	0,19
375			851		
Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, fällig 20/01/2049	393	0,17	GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Class B, 144A, 2,941 %, fällig 15/09/2031 *	697	0,30
18			570		
Ginnie Mae II Pool 'MA5762', 3,500 %, fällig 20/02/2049	19	0,01	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, Series 2018 3PCK, Class B, 144A, 2,691 %, fällig 15/09/2031 *	559	0,24
126			10		
Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, fällig 20/03/2049	133	0,06	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16, Series 2013 GC16, Class B, 5,161 %, fällig 10/11/2046 *	10	–
66			86		
Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, fällig 20/04/2049	69	0,03	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-9, Series 2005 9, Class 2A1B, 0,911 %, fällig 20/06/2035 *	86	0,04
47			450		
Ginnie Mae II Pool 'MA6767', 3,500 %, fällig 20/07/2050	49	0,02	Independence Plaza Trust 2018-INDP, Series 2018 INDP, Class A, 144A, 3,763 %, fällig 10/07/2035	456	0,20
114			10		
Ginnie Mae II Pool 'MA6933', 3,500 %, fällig 20/10/2050	118	0,05	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, Series 2013 C17, Class B, 4,885 %, fällig 15/01/2047 *	10	–
28			120		
Ginnie Mae II Pool 'MA6997', 3,500 %, fällig 20/11/2050	29	0,01	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23, Series 2014 C23, Class AS, 4,202 %, fällig 15/09/2047 *	123	0,05
302			12.827		
Ginnie Mae II Pool 'MA7056', 4,500 %, fällig 20/12/2050	318	0,14	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2018-C8, Series 2018 C8, Class XA, 0,590 %, fällig 15/06/2051 *	325	0,14
165			100		
Ginnie Mae II Pool 'MA7473', 3,000 %, fällig 20/07/2051	168	0,07	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18, Series 2014 C18, Class AS, 4,110 %, fällig 15/10/2047 *	103	0,04
191			235		
Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, fällig 20/09/2051	194	0,08	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-ASHF, Series 2017 ASHF, Class A, 144A, 1,041 %, fällig 15/11/2034 *	233	0,10
300			550		
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ±	305	0,13	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class A, 144A, 3,047 %, fällig 15/08/2036	542	0,23
300			210		
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,500 % ±	310	0,13	New Residential Mortgage Loan Trust 2015-2, Series 2015 2A, Class A1, 144A, 3,750 %, fällig 25/08/2055 *	215	0,09
6			323		
Government National Mortgage Association, Series 2007 51, Class SG, 6,418 %, fällig 20/08/2037 *	1	–	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Class A1B, 144A, 3,250 %, fällig 25/09/2056 *	329	0,14
14			280		
Government National Mortgage Association, Series 2009 H01, Class FA, 1,312 %, fällig 20/11/2059 *	14	0,01	New Residential Mortgage Loan Trust 2017-2, Series 2017 2A, Class B1, 144A, 4,500 %, fällig 25/03/2057 *	291	0,12
2			320		
Government National Mortgage Association, Series 2010 85, Class HS, 6,488 %, fällig 20/01/2040 *	–	–	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Series 2021 NQ2R, Class A3, 144A, 1,353 %, fällig 25/10/2058 *	316	0,14
27			7		
Government National Mortgage Association, Series 2010 H26, Class LF, 0,451 %, fällig 20/08/2058 *	27	0,01	Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-4, Series 2007 4, Class 1A1, 2,174 %, fällig 25/09/2037 *	7	–
42			300		
Government National Mortgage Association, Series 2011 H01, Class AF, 0,551 %, fällig 20/11/2060 *	42	0,02	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C15, Series 2018 C15, Class C, 5,097 %, fällig 15/12/2051 *	308	0,13
53					
Government National Mortgage Association, Series 2011 H09, Class AF, 0,601 %, fällig 20/03/2061 *	53	0,02			
130					
Government National Mortgage Association, Series 2012 112, Class IO, 0,132 %, fällig 16/02/2053 *	1	–			
85					
Government National Mortgage Association, Series 2012 27, Class IO, 0,576 %, fällig 16/04/2053 *	1	–			
21					
Government National Mortgage Association, Series 2012 34, Class SA, 5,888 %, fällig 20/03/2042 *	4	–			
44					
Government National Mortgage Association, Series 2012 44, Class IO, 0,029 %, fällig 16/03/2049 *	–	–			
23					
Government National Mortgage Association, Series 2012 H18, Class NA, 0,621 %, fällig 20/08/2062 *	23	0,01			
51					
Government National Mortgage Association, Series 2012 H27, Class AI, 1,743 %, fällig 20/10/2062 *	2	–			
28					
Government National Mortgage Association, Series 2012 H30, Class GA, 0,451 %, fällig 20/12/2062 *	28	0,01			
94					
Government National Mortgage Association, Series 2013 107, Class AD, 2,766 %, fällig 16/11/2047 *	94	0,04			
–					
Government National Mortgage Association, Series 2013 145, Class XI, 0,001 %, fällig 16/09/2044	–	–			
25					
Government National Mortgage Association, Series 2013 163, Class IO, 1,023 %, fällig 16/02/2046 *	1	–			
95					
Government National Mortgage Association, Series 2013 H08, Class BF, 0,501 %, fällig 20/03/2063 *	95	0,04			
44					
Government National Mortgage Association, Series 2014 105, Class IO, 0,122 %, fällig 16/06/2054 *	1	–			
12					
Government National Mortgage Association, Series 2014 17, Class AM, 3,369 %, fällig 16/06/2048 *	12	0,01			
12					
Government National Mortgage Association, Series 2014 47, Class IA, 0,143 %, fällig 16/02/2048 *	–	–			
65					
Government National Mortgage Association, Series 2014 50, Class IO, 0,599 %, fällig 16/09/2055 *	2	–			
260					
Government National Mortgage Association, Series 2014 92, Class IX, 0,112 %, fällig 16/05/2054 *	2	–			
551					
Government National Mortgage Association, Series 2014 H20, Class FA, 0,531 %, fällig 20/10/2064 *	552	0,24			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>						
397	394	0,17	<b>Indien — 0,11 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			
397 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR6 Trust, Series 2005 AR6, Class 2A1A, 0,647 %, fällig 25/04/2045 *			270 Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 12/01/2052			
1.042	28	0,01	<b>Indonesien — 0,30 % (28. Februar 2021: 0,25 %)</b>			
1.042 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1, Series 2015 NX51, Class XA, 1,081 %, fällig 15/05/2048 *			700 Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 5,250 %, fällig 24/10/2042			
330	315	0,14	<b>Irland — 0,18 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			
330 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1, Series 2016 BNK1, Class B, 2,967 %, fällig 15/08/2049			230 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, fällig 29/10/2026			
1.566	69	0,03	210 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, fällig 29/10/2028			
1.566 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Series 2016 C36, Class XA, 1,234 %, fällig 15/11/2059 *			203 0,09			
460	461	0,20	425 0,18			
460 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41, Series 2017 C41, Class B, 4,188 %, fällig 15/11/2050 *			<b>Italien — 0,22 % (28. Februar 2021: 0,17 %)</b>			
1.625	20	0,01	500 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,125 %, fällig 14/07/2022			
1.625 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C23, Series 2014 C23, Class XA, 0,560 %, fällig 15/10/2057 *			<b>Kasachstan — 0,30 % (28. Februar 2021: 0,26 %)</b>			
38	38	0,02	650 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig 24/04/2030			
38 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Series 2014 LC14, Class ASB, 3,522 %, fällig 15/03/2047			<b>Kuwait — 0,31 % (28. Februar 2021: 0,15 %)</b>			
<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 60.660 USD)</b>		59.376	25,49	400 Equate Petrochemical BV, 4,250 %, fällig 03/11/2026		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 39,60 % (28. Februar 2021: 33,90 %)</b>			320 Equate Petrochemical BV, 144A, 2,625 %, fällig 28/04/2028			
<b>Australien — 0,30 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>						
140	169	0,07	400 Equate Petrochemical BV, 144A, 2,625 %, fällig 28/04/2028			
260	269	0,12	717 0,31			
260	269	0,11	<b>Macau — 0,08 % (28. Februar 2021: 0,07 %)</b>			
260 Glencore Funding LLC, 144A, 4,125 %, fällig 12/03/2024			200 Sands China Ltd, 5,125 %, fällig 08/08/2025			
260 Glencore Funding LLC, 144A, 3,875 %, fällig 27/10/2027			<b>Mexiko — 0,55 % (28. Februar 2021: 0,47 %)</b>			
		707	0,30	700 Comision Federal de Electricidad, 144A, 3,875 %, fällig 26/07/2033		
<b>Belgien — 0,61 % (28. Februar 2021: 0,55 %)</b>						
120	125	0,05	200 Orbia Advance Corp SAB de CV, 144A, 2,875 %, fällig 11/05/2031			
140	149	0,06	440 Petroleos Mexicanos, 6,625 %, fällig 15/06/2035			
480	534	0,23	20 Petroleos Mexicanos, 6,375 %, fällig 23/01/2045			
60	63	0,03	70 Petroleos Mexicanos, 5,625 %, fällig 23/01/2046			
180	192	0,08	1.275 0,55			
100	107	0,05	<b>Niederlande — 0,64 % (28. Februar 2021: 0,61 %)</b>			
230	254	0,11	250 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, fällig 04/08/2025			
230 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01/06/2050			300 Cooperatieve Rabobank UA, 3,750 %, fällig 21/07/2026			
		1.424	0,61	260 Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,375 %, fällig 21/05/2025		
<b>Brasilien — 0,81 % (28. Februar 2021: 0,69 %)</b>						
10	11	–	110 Shell International Finance BV, 2,875 %, fällig 10/05/2026			
50	46	0,02	120 Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06/04/2030			
690	757	0,33	10 Shell International Finance BV, 4,550 %, fällig 12/08/2043			
270	306	0,13	140 Shell International Finance BV, 4,000 %, fällig 10/05/2046			
20	25	0,01	270 Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06/04/2050			
600	743	0,32	1.494 0,64			
600 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 10/11/2039			<b>Peru — 0,58 % (28. Februar 2021: 0,51 %)</b>			
		1.888	0,81	400 Petroleos del Peru SA, 4,750 %, fällig 19/06/2032		
<b>Kanada — 0,63 % (28. Februar 2021: 0,42 %)</b>						
240	237	0,10	200 Petroleos del Peru SA, 144A, 5,625 %, fällig 19/06/2047			
30	31	0,01	680 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08/11/2042			
130	126	0,06	1.357 0,58			
40	50	0,02	<b>Katar — 0,34 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			
110	139	0,06	370 Qatar Energy, 144A, 2,250 %, fällig 12/07/2031			
130	129	0,06	230 Qatar Energy, 144A, 3,125 %, fällig 12/07/2041			
350	336	0,15	240 Qatar Energy, 144A, 3,300 %, fällig 12/07/2051			
80	74	0,03	792 0,34			
210	210	0,09	<b>Russland — 0,10 % (28. Februar 2021: 0,11 %)</b>			
130	125	0,05	200 Lukoil Capital DAC, 144A, 2,800 %, fällig 26/04/2027			
130 Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig 10/06/2025			300 Lukoil International Finance BV, 144A, 4,750 %, fällig 02/11/2026			
		1.457	0,63	132 0,06		
<b>Chile — 0,35 % (28. Februar 2021: 0,30 %)</b>						
800	820	0,35	223 0,10			
800 Corp Nacional del Cobre de Chile, 3,625 %, fällig 01/08/2027			<b>Südafrika — 0,13 % (28. Februar 2021: 0,11 %)</b>			
<b>China — 0,24 % (28. Februar 2021: 0,17 %)</b>						
80	80	0,04	290 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10/04/2027			
80 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144A, 2,700 %, fällig 01/05/2025			<b>Spanien — 0,42 % (28. Februar 2021: 0,34 %)</b>			
450	472	0,20	200 Banco Santander SA, 3,848 %, fällig 12/04/2023			
450 Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 4,375 %, fällig 10/04/2024			600 Banco Santander SA, 2,746 %, fällig 28/05/2025			
		552	0,24	150 Telefonica Emisiones SA, 5,213 %, fällig 08/03/2047		
<b>Kolumbien — 0,24 % (28. Februar 2021: 0,24 %)</b>						
650	567	0,24	968 0,42			
650 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28/05/2045			<b>Schweden — 0,08 % (28. Februar 2021: 0,15 %)</b>			
<b>Dänemark — 0,18 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>						
200	205	0,09	200 Swedbank AB, 144A, 1,300 %, fällig 02/06/2023			
200	211	0,09	<b>Schweiz — 0,84 % (28. Februar 2021: 0,61 %)</b>			
200 Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig 12/01/2024			310 Credit Suisse AG/New York NY, 1,000 %, fällig 05/05/2023			
		416	0,18	250 Credit Suisse AG/New York NY, 2,950 %, fällig 09/04/2025		
<b>Finnland — 0,11 % (28. Februar 2021: 0,08 %)</b>						
250	248	0,11	500 Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01/04/2031 *			
250 Nordea Bank Abp, 144A, 1,000 %, fällig 09/06/2023			250 Credit Suisse Group AG, 144A, 3,091 %, fällig 14/05/2032 *			
<b>Frankreich — 0,64 % (28. Februar 2021: 0,53 %)</b>						
200	208	0,09	230 UBS AG/London, 144A, 1,750 %, fällig 21/04/2022			
400	392	0,17	200 UBS Group AG, 144A, 2,859 %, fällig 15/08/2023 *			
200	213	0,09	200 UBS Group AG, 144A, 3,126 %, fällig 13/08/2030 *			
200	213	0,09	1.947 0,84			
200	222	0,10				
250	244	0,10				
200	202	0,09				
200 Danone SA, 2,589 %, fällig 02/11/2023						
		1.481	0,64			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



## Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>							
<b>USA – (Fortsetzung)</b>							
70	Chevron USA Inc, 3,850 %, fällig 15/01/2028	75	0,03	10	Dollar General Corp, 3,250 %, fällig 15/04/2023	10	–
10	Chubb INA Holdings Inc, 3,350 %, fällig 03/05/2026	10	–	50	Duke Energy Corp, 2,400 %, fällig 15/08/2022	50	0,02
93	Cigna Corp, 3,750 %, fällig 15/07/2023	95	0,04	50	Duke Energy Corp, 3,150 %, fällig 15/08/2027	51	0,02
150	Cigna Corp, 4,125 %, fällig 15/11/2025	158	0,07	150	Eaton Corp, 2,750 %, fällig 02/11/2022	152	0,07
300	Cigna Corp, 4,375 %, fällig 15/10/2028	326	0,14	50	Eaton Corp, 4,150 %, fällig 02/11/2042	54	0,02
20	Cintas Corp No 2, 2,900 %, fällig 01/04/2022	20	0,01	100	El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, fällig 15/06/2032	134	0,06
30	Cintas Corp No 2, 3,700 %, fällig 01/04/2027	32	0,01	120	Energy Transfer LP, 4,500 %, fällig 15/04/2024	125	0,05
80	Citigroup Inc, 3,500 %, fällig 15/05/2023	82	0,04	80	Energy Transfer LP, 5,500 %, fällig 01/06/2027	88	0,04
150	Citigroup Inc, 1,678 %, fällig 15/05/2024 *	150	0,06	40	Energy Transfer LP, 4,950 %, fällig 15/06/2028	43	0,02
180	Citigroup Inc, 3,300 %, fällig 27/04/2025	184	0,08	50	Energy Transfer LP, 5,250 %, fällig 15/04/2029	55	0,02
60	Citigroup Inc, 4,400 %, fällig 10/06/2025	63	0,03	490	Energy Transfer LP, 3,750 %, fällig 15/05/2030	498	0,21
120	Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13/09/2025	131	0,06	10	Energy Transfer LP, 5,300 %, fällig 01/04/2044	10	–
90	Citigroup Inc, 3,106 %, fällig 08/04/2026 *	91	0,04	60	Energy Transfer LP, 5,400 %, fällig 01/10/2047	64	0,03
60	Citigroup Inc, 4,300 %, fällig 20/11/2026	64	0,03	50	Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig 15/04/2049	58	0,02
260	Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29/09/2027	278	0,12	20	Enterprise Products Operating LLC, 3,900 %, fällig 15/02/2024	21	0,01
150	Citigroup Inc, 3,520 %, fällig 27/10/2028 *	154	0,07	210	Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig 16/10/2028	227	0,10
200	Citigroup Inc, 3,980 %, fällig 20/03/2030 *	211	0,09	350	Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig 31/01/2030	345	0,15
570	Citigroup Inc, 4,412 %, fällig 31/03/2031 *	618	0,27	20	Enterprise Products Operating LLC, 7,550 %, fällig 15/04/2038	27	0,01
280	Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03/06/2031 *	268	0,11	60	Enterprise Products Operating LLC, 5,700 %, fällig 15/02/2042	72	0,03
400	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15/07/2039	627	0,27	20	Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, fällig 15/03/2044	22	0,01
77	Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 30/07/2045	88	0,04	20	Enterprise Products Operating LLC, 4,800 %, fällig 01/02/2049	22	0,01
10	Citigroup Inc, 4,750 %, fällig 18/05/2046	11	–	170	Enterprise Products Operating LLC, 4,200 %, fällig 31/01/2050	171	0,07
90	Coca-Cola Co/The, 3,375 %, fällig 25/03/2027	95	0,04	20	Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, fällig 31/01/2051	19	0,01
140	Coca-Cola Co/The, 1,450 %, fällig 01/06/2027	134	0,06	10	Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31/01/2060	9	–
60	Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01/06/2040	55	0,02	140	EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15/04/2030	155	0,07
30	Coca-Cola Co/The, 2,600 %, fällig 01/06/2050	26	0,01	160	EOG Resources Inc, 3,900 %, fällig 01/04/2035	172	0,07
30	Comcast Corp, 3,950 %, fällig 15/10/2025	32	0,01	320	EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15/04/2050	390	0,17
70	Comcast Corp, 3,150 %, fällig 01/03/2026	72	0,03	10	Exxon Mobil Corp, 1,571 %, fällig 15/04/2023	10	–
120	Comcast Corp, 3,300 %, fällig 01/04/2027	125	0,05	90	Exxon Mobil Corp, 2,992 %, fällig 19/03/2025	92	0,04
140	Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15/10/2028	152	0,07	140	Exxon Mobil Corp, 3,043 %, fällig 01/03/2026	145	0,06
80	Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01/04/2030	83	0,04	130	Exxon Mobil Corp, 3,482 %, fällig 19/03/2030	137	0,06
100	Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15/10/2030	110	0,05	130	Exxon Mobil Corp, 4,114 %, fällig 01/03/2046	142	0,06
121	Comcast Corp, 7,050 %, fällig 15/03/2033	161	0,07	110	Exxon Mobil Corp, 4,327 %, fällig 19/03/2050	125	0,05
140	Comcast Corp, 3,900 %, fällig 01/03/2038	143	0,06	50	FirstEnergy Corp, Series A, 1,600 %, fällig 15/01/2026	47	0,02
10	Comcast Corp, 3,250 %, fällig 01/11/2039	10	–	180	FirstEnergy Corp, Series B, 4,400 %, fällig 15/07/2027	187	0,08
10	Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01/04/2040	10	–	650	FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, fällig 15/11/2031	815	0,35
20	Comcast Corp, 3,400 %, fällig 15/07/2046	19	0,01	200	FirstEnergy Corp, Series C, 5,350 %, fällig 15/07/2047	212	0,09
20	Comcast Corp, 4,000 %, fällig 01/03/2048	21	0,01	50	Fox Corp, 4,030 %, fällig 25/01/2024	52	0,02
70	Comcast Corp, 3,450 %, fällig 01/02/2050	65	0,03	280	Fox Corp, 5,476 %, fällig 25/01/2039	327	0,14
140	Comcast Corp, 2,800 %, fällig 15/01/2051	117	0,05	110	General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01/04/2050	127	0,05
141	Comcast Corp, 144A, 2,887 %, fällig 01/11/2051	123	0,05	22	General Electric Co, 6,750 %, fällig 15/03/2032	28	0,01
54	Comcast Corp, 144A, 2,937 %, fällig 01/11/2056	46	0,02	10	General Motors Co, 5,150 %, fällig 01/04/2038	11	–
40	ConocoPhillips, 144A, 3,750 %, fällig 01/10/2027	43	0,02	30	General Motors Co, 6,250 %, fällig 02/10/2043	37	0,02
350	ConocoPhillips, 144A, 4,300 %, fällig 15/08/2028	387	0,17	10	General Motors Co, 5,950 %, fällig 01/04/2049	12	0,01
20	ConocoPhillips Co, 6,950 %, fällig 15/04/2029	26	0,01	20	General Motors Financial Co Inc, 3,450 %, fällig 10/04/2022	20	0,01
50	Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig 01/04/2030	51	0,02	120	General Motors Financial Co Inc, 4,350 %, fällig 17/01/2027	126	0,05
30	Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20B, 3,950 %, fällig 01/04/2050	31	0,01	40	Gilead Sciences Inc, 3,700 %, fällig 01/04/2024	41	0,02
90	Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15/01/2028	93	0,04	100	Gilead Sciences Inc, 3,650 %, fällig 01/03/2026	104	0,04
170	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig 15/01/2031	190	0,08	100	Gilead Sciences Inc, 4,750 %, fällig 01/03/2046	114	0,05
230	Costco Wholesale Corp, 1,375 %, fällig 20/06/2027	221	0,10	3	Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, Perpetual *	3	–
100	Costco Wholesale Corp, 1,750 %, fällig 20/04/2032	92	0,04	50	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,625 %, fällig 22/01/2023	51	0,02
210	Coterra Energy Inc, 144A, 3,900 %, fällig 15/05/2027	219	0,09	70	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,200 %, fällig 23/02/2023	71	0,03
390	Coterra Energy Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15/03/2029	419	0,18	150	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01/04/2025	154	0,07
50	CVS Health Corp, 2,750 %, fällig 01/12/2022	50	0,02	140	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, fällig 21/10/2025	147	0,06
8	CVS Health Corp, 3,875 %, fällig 20/07/2025	8	–	90	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16/11/2026	92	0,04
40	CVS Health Corp, 3,625 %, fällig 01/04/2027	42	0,02	500	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, fällig 23/04/2029 *	519	0,22
230	CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25/03/2028	249	0,11	780	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, fällig 01/05/2029 *	828	0,36
110	CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01/04/2030	115	0,05	30	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01/02/2041	39	0,02
90	CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15/09/2031	83	0,04	440	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22/05/2045	529	0,23
100	CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25/03/2038	112	0,05	10	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig 21/10/2045	11	–
40	CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01/04/2040	41	0,02	50	Guardian Life Global Funding, 144A, 1,100 %, fällig 23/06/2025	48	0,02
40	CVS Health Corp, 5,125 %, fällig 20/07/2045	46	0,02	4	Halliburton Co, 3,800 %, fällig 15/11/2025	4	–
370	CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25/03/2048	433	0,19	40	Hershey Co/The, 0,900 %, fällig 01/06/2025	39	0,02
4	CVS Pass-Through Trust, 5,880 %, fällig 10/01/2028	4	–	90	Home Depot Inc/The, 2,500 %, fällig 15/04/2027	91	0,04
110	Deere & Co, 3,750 %, fällig 15/04/2050	117	0,05	10	Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 06/12/2028	11	–
240	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20/10/2025	247	0,11	80	Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15/04/2030	80	0,03
220	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20/10/2028	230	0,10	110	Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15/04/2040	110	0,05
160	Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15/12/2025	179	0,08	20	Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 15/06/2047	21	0,01
18	Devon Energy Corp, 5,250 %, fällig 15/10/2027	19	0,01	120	Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15/04/2050	118	0,05
30	Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15/01/2030	31	0,01	90	Honeywell International Inc, 1,350 %, fällig 01/06/2025	88	0,04
40	Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15/07/2041	47	0,02	30	Humana Inc, 3,150 %, fällig 01/12/2022	30	0,01
70	Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15/05/2042	75	0,03	20	Humana Inc, 4,500 %, fällig 01/04/2025	21	0,01
400	Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15/06/2045	447	0,19	130	Humana Inc, 3,950 %, fällig 15/03/2027	137	0,06
50	Diamondback Energy Inc, 2,875 %, fällig 01/12/2024	51	0,02	150	Humana Inc, 3,950 %, fällig 15/08/2049	153	0,07
50	Diamondback Energy Inc, 3,250 %, fällig 01/12/2026	51	0,02	10	Intel Corp, 3,700 %, fällig 29/07/2025	11	–
120	Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01/12/2029	122	0,05	60	Intel Corp, 1,600 %, fällig 12/08/2028	57	0,02
40	Diamondback Energy Inc, 3,125 %, fällig 24/03/2031	39	0,02	90	Intel Corp, 4,750 %, fällig 25/03/2050	105	0,05
				20	Intel Corp, 3,050 %, fällig 12/08/2051	18	0,01
				310	International Business Machines Corp, 3,000 %, fällig 15/05/2024	317	0,14
				80	Johnson & Johnson, 0,550 %, fällig 01/09/2025	76	0,03
				160	Johnson & Johnson, 0,950 %, fällig 01/09/2027	151	0,06
				130	Johnson & Johnson, 3,700 %, fällig 01/03/2046	140	0,06

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
50 JPMorgan Chase & Co, 3,625 %, fällig 13/05/2024	52	0,02	60 Otis Worldwide Corp, 2,056 %, fällig 05/04/2025	60	0,03
380 JPMorgan Chase & Co, 1,514 %, fällig 01/06/2024 *	379	0,16	200 Pacific Gas and Electric Co, 1,750 %, fällig 16/06/2022	200	0,09
230 JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, fällig 05/12/2024 *	237	0,10	50 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01/08/2027	47	0,02
220 JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, fällig 22/04/2026 *	217	0,09	70 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01/02/2031	62	0,03
70 JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, fällig 15/12/2026	75	0,03	20 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01/08/2040	17	0,01
270 JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, fällig 01/10/2027	289	0,12	30 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01/08/2050	25	0,01
110 JPMorgan Chase & Co, 3,625 %, fällig 01/12/2027	115	0,05	110 PayPal Holdings Inc, 1,350 %, fällig 01/06/2023	110	0,05
260 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23/07/2029 *	277	0,12	110 PayPal Holdings Inc, 1,650 %, fällig 01/06/2025	108	0,05
180 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05/12/2029 *	195	0,08	150 PepsiCo Inc, 0,750 %, fällig 01/05/2023	149	0,06
440 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22/04/2031 *	421	0,18	10 PepsiCo Inc, 2,250 %, fällig 19/03/2025	10	–
40 JPMorgan Chase & Co, 2,580 %, fällig 22/04/2032 *	38	0,02	10 PepsiCo Inc, 2,625 %, fällig 19/03/2027	10	–
195 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01/06/2045	234	0,10	40 PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig 01/05/2030	37	0,02
50 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22/04/2051 *	46	0,02	40 PepsiCo Inc, 2,875 %, fällig 15/10/2049	38	0,02
30 Kimberley-Clark Corp, 3,100 %, fällig 26/03/2030	31	0,01	110 Pfizer Inc, 2,625 %, fällig 01/04/2030	110	0,05
40 Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig 01/06/2025	42	0,02	110 Pfizer Inc, 1,700 %, fällig 28/05/2030	103	0,04
470 Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig 01/03/2028	501	0,22	230 Pfizer Inc, 2,550 %, fällig 28/05/2040	211	0,09
60 Kinder Morgan Inc, 5,550 %, fällig 01/06/2045	69	0,03	110 Pfizer Inc, 2,700 %, fällig 28/05/2050	100	0,04
120 LHarris Technologies Inc, 4,854 %, fällig 27/04/2035	137	0,06	20 Philip Morris International Inc, 2,500 %, fällig 22/08/2022	20	0,01
40 LHarris Technologies Inc, 5,054 %, fällig 27/04/2045	47	0,02	80 Philip Morris International Inc, 2,500 %, fällig 02/11/2022	81	0,03
240 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08/08/2024	237	0,10	80 Philip Morris International Inc, 1,125 %, fällig 01/05/2023	80	0,03
20 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25/06/2025	19	0,01	80 Philip Morris International Inc, 2,100 %, fällig 01/05/2030	75	0,03
127 Lehman Escrow Receipt, Null-Coupon, Perpetual †∞	1	–	40 Philip Morris International Inc, 6,375 %, fällig 16/05/2038	52	0,02
104 Lehman Swap Receipt, Null-Coupon, Perpetual †∞	1	–	10 Philip Morris International Inc, 4,500 %, fällig 20/03/2042	10	–
20 Lockheed Martin Corp, 3,100 %, fällig 15/01/2023	20	0,01	60 Philip Morris International Inc, 4,250 %, fällig 10/11/2044	62	0,03
50 Lockheed Martin Corp, 3,550 %, fällig 15/01/2026	53	0,02	30 Pioneer Natural Resources Co, 1,125 %, fällig 15/01/2026	29	0,01
100 Lockheed Martin Corp, 4,500 %, fällig 15/05/2036	114	0,05	100 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, fällig 15/08/2030	91	0,04
110 Lowe's Cos Inc, 1,700 %, fällig 15/09/2028	103	0,04	240 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig 15/01/2031	222	0,10
50 Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig 15/04/2030	55	0,02	50 Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, fällig 23/06/2025	48	0,02
60 Mars Inc, 144A, 2,700 %, fällig 01/04/2025	61	0,03	30 Procter & Gamble Co/The, 2,800 %, fällig 25/03/2027	31	0,01
260 Mars Inc, 144A, 3,200 %, fällig 01/04/2030	268	0,12	50 Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, fällig 25/03/2030	52	0,02
400 MassMutual Global Funding II, 144A, 0,850 %, fällig 09/06/2023	396	0,17	10 Progress Energy Inc, 3,150 %, fällig 01/04/2022	10	–
250 Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26/03/2050	272	0,12	60 Raytheon Technologies Corp, 3,150 %, fällig 15/12/2024	61	0,03
90 McDonald's Corp, 3,300 %, fällig 01/07/2025	93	0,04	120 Raytheon Technologies Corp, 2,250 %, fällig 01/07/2030	114	0,05
150 McDonald's Corp, 1,450 %, fällig 01/09/2025	146	0,06	100 Raytheon Technologies Corp, 4,500 %, fällig 01/06/2042	112	0,05
50 McDonald's Corp, 3,700 %, fällig 30/01/2026	53	0,02	230 Raytheon Technologies Corp, 3,125 %, fällig 01/07/2050	211	0,09
30 McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01/03/2027	31	0,01	160 Republic Services Inc, 2,500 %, fällig 15/08/2024	162	0,07
50 McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01/07/2027	52	0,02	50 salesforce.com Inc, 3,250 %, fällig 11/04/2023	51	0,02
30 McDonald's Corp, 3,800 %, fällig 01/04/2028	32	0,01	100 salesforce.com Inc, 3,700 %, fällig 11/04/2028	107	0,05
80 McDonald's Corp, 2,125 %, fällig 01/03/2030	76	0,03	100 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01/03/2032	133	0,06
80 McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01/07/2030	84	0,04	10 State Street Corp, 3,300 %, fällig 16/12/2024	10	–
180 McDonald's Corp, 4,875 %, fällig 09/12/2045	205	0,09	130 Target Corp, 2,250 %, fällig 15/04/2025	131	0,06
20 McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01/09/2049	20	0,01	2 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig 16/12/2039	3	–
40 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01/04/2050	43	0,02	60 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01/03/2030	58	0,02
31 Medtronic Inc, 3,500 %, fällig 15/03/2025	32	0,01	50 Texas Instruments Inc, 2,250 %, fällig 04/09/2029	49	0,02
15 Medtronic Inc, 4,625 %, fällig 15/03/2045	18	0,01	70 Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig 04/05/2030	66	0,03
150 Merck & Co Inc, 0,750 %, fällig 24/02/2026	143	0,06	100 Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15/03/2039	109	0,05
80 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24/06/2030	73	0,03	80 Texas Instruments Inc, 4,150 %, fällig 15/05/2048	91	0,04
215 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15/12/2036	242	0,10	170 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, fällig 22/08/2050 †∞	152	0,07
270 Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 0,900 %, fällig 08/06/2023	268	0,12	100 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, fällig 15/11/2040	112	0,05
300 Microsoft Corp, 2,400 %, fällig 08/08/2026	305	0,13	20 TJX Cos Inc/The, 2,250 %, fällig 15/09/2026	20	0,01
370 Microsoft Corp, 3,300 %, fällig 06/02/2027	395	0,17	130 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15/04/2025	134	0,06
60 Microsoft Corp, 2,525 %, fällig 01/06/2050	53	0,02	20 T-Mobile USA Inc, 3,750 %, fällig 15/04/2027	21	0,01
100 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17/03/2052	96	0,04	230 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15/04/2030	238	0,10
140 MidAmerican Energy Co, 3,650 %, fällig 15/04/2029	149	0,06	80 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15/02/2031	75	0,03
290 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig 04/05/2025	283	0,12	180 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15/11/2031	163	0,07
370 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28/04/2026 *	365	0,16	110 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15/02/2041	96	0,04
290 Morgan Stanley, 3,772 %, fällig 24/01/2029 *	301	0,13	30 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15/02/2051	26	0,01
400 Morgan Stanley, 2,699 %, fällig 22/01/2031 *	387	0,17	400 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01/02/2026	472	0,20
200 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01/04/2031 *	207	0,09	70 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 15/07/2025	74	0,03
100 MPLX LP, 4,000 %, fällig 15/03/2028	198	0,09	140 Union Pacific Corp, 2,150 %, fällig 05/02/2027	138	0,06
100 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15/04/2038	103	0,04	140 Union Pacific Corp, 2,400 %, fällig 05/02/2030	137	0,06
40 MPLX LP, 5,200 %, fällig 01/03/2047	44	0,02	130 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05/02/2070	130	0,06
60 MPLX LP, 5,200 %, fällig 01/12/2047	65	0,03	20 UnitedHealth Group Inc, 2,375 %, fällig 15/10/2022	20	0,01
180 MPLX LP, 4,700 %, fällig 15/04/2048	186	0,08	40 UnitedHealth Group Inc, 3,500 %, fällig 15/06/2023	41	0,02
100 New York Life Global Funding, 144A, 0,950 %, fällig 24/06/2025	97	0,04	50 UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, fällig 15/07/2025	52	0,02
100 Newell Brands Inc, 4,700 %, fällig 01/04/2026	104	0,04	60 UnitedHealth Group Inc, 1,250 %, fällig 15/01/2026	58	0,02
60 NIKE Inc, 2,400 %, fällig 27/03/2025	61	0,03	30 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15/12/2028	32	0,01
110 NIKE Inc, 2,750 %, fällig 27/03/2027	113	0,05	30 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15/05/2030	28	0,01
110 NIKE Inc, 2,850 %, fällig 27/03/2030	112	0,05	110 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15/05/2040	102	0,04
60 NIKE Inc, 3,250 %, fällig 27/03/2040	60	0,03	50 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15/03/2043	55	0,02
10 NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27/03/2050	10	–	40 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15/06/2048	45	0,02
200 Northrop Grumman Corp, 2,930 %, fällig 15/01/2025	204	0,09	20 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15/12/2048	23	0,01
20 Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig 15/01/2028	20	0,01	50 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15/08/2049	52	0,02
530 Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01/05/2050	668	0,29	110 UnitedHealth Group Inc, 2,900 %, fällig 15/05/2050	101	0,04
270 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01/04/2040	278	0,12	110 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15/08/2059	116	0,05
110 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01/04/2060	115	0,05	20 UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, fällig 15/05/2060	18	0,01
290 Oracle Corp, 1,650 %, fällig 25/03/2026	278	0,12	50 US Bancorp, 3,600 %, fällig 11/09/2024	52	0,02
310 Oracle Corp, 2,875 %, fällig 25/03/2031	296	0,13	290 US Bancorp, 1,450 %, fällig 12/05/2025	284	0,12
			150 USAA Capital Corp, 144A, 2,125 %, fällig 01/05/2030	145	0,06

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>			<b>Kasachstan — 0,09 % (28. Februar 2021: 0,08 %)</b>		
<b>USA – (Fortsetzung)</b>			200 Kazakhstan Government International Bond, 4,875 %, fällig 14/10/2044		
40 Verizon Communications Inc, 2,625 %, fällig 15/08/2026	40	0,02	202	0,09	
40 Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig 16/03/2027	43	0,02	<b>Kuwait — 0,21 % (28. Februar 2021: 0,17 %)</b>		
30 Verizon Communications Inc, 3,000 %, fällig 22/03/2027	30	0,01	460 Kuwait International Government Bond, 3,500 %, fällig 20/03/2027		
100 Verizon Communications Inc, 2,100 %, fällig 22/03/2028	97	0,04	<b>Mexiko – 0,65 % (28. Februar 2021: 0,40 %)</b>		
205 Verizon Communications Inc, 4,329 %, fällig 21/09/2028	224	0,10	1.140 Mexico Government International Bond, 4,750 %, fällig 08/03/2044		
30 Verizon Communications Inc, 3,875 %, fällig 08/02/2029	32	0,01	1.132	0,48	
100 Verizon Communications Inc, 3,150 %, fällig 22/03/2030	100	0,04	420 Mexico Government International Bond, 4,400 %, fällig 12/02/2052		
310 Verizon Communications Inc, 2,550 %, fällig 21/03/2031	298	0,13	388	0,17	
306 Verizon Communications Inc, 144A, 2,355 %, fällig 15/03/2032	286	0,12	1.520	0,65	
530 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10/08/2033	590	0,25	<b>Panama — 0,45 % (28. Februar 2021: 0,39 %)</b>		
60 Verizon Communications Inc, 4,400 %, fällig 01/11/2034	66	0,03	290 Panama Government International Bond, 2,252 %, fällig 29/09/2032		
20 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16/03/2037	24	0,01	257	0,11	
180 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig 20/11/2040	156	0,07	200 Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 15/05/2047		
200 Verizon Communications Inc, 3,850 %, fällig 01/11/2042	202	0,09	197	0,09	
70 Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig 15/08/2046	73	0,03	620 Panama Government International Bond, 4,300 %, fällig 29/04/2053		
70 Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21/08/2046	84	0,04	587	0,25	
130 Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22/03/2050	134	0,06	1.041	0,45	
70 Verizon Communications Inc, 2,875 %, fällig 20/11/2050	60	0,03	<b>Peru — 0,30 % (28. Februar 2021: 0,26 %)</b>		
180 Visa Inc, 3,150 %, fällig 14/12/2025	187	0,08	120 Peruvian Government International Bond, 6,550 %, fällig 14/03/2037		
30 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14/12/2045	35	0,02	153	0,06	
50 Visa Inc, 3,650 %, fällig 15/09/2047	53	0,02	80 Peruvian Government International Bond, 3,300 %, fällig 11/03/2041		
40 Walmart Inc, 1,500 %, fällig 22/09/2028	38	0,02	71	0,03	
10 Walmart Inc, 2,375 %, fällig 24/09/2029	10	–	180 Peruvian Government International Bond, 5,625 %, fällig 18/11/2050		
30 Walmart Inc, 1,800 %, fällig 22/09/2031	28	0,01	225	0,10	
20 Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig 20/11/2037	27	0,01	80 Peruvian Government International Bond, 3,550 %, fällig 10/03/2051		
60 Wells Fargo & Co, 4,125 %, fällig 15/08/2023	62	0,03	73	0,03	
61 Wells Fargo & Co, 4,480 %, fällig 16/01/2024	64	0,03	210 Peruvian Government International Bond, 3,600 %, fällig 15/01/2072		
40 Wells Fargo & Co, 3,750 %, fällig 24/01/2024	41	0,02	176	0,08	
300 Wells Fargo & Co, 1,654 %, fällig 02/06/2024 *	299	0,13	698	0,30	
240 Wells Fargo & Co, 2,188 %, fällig 30/04/2026 *	237	0,10	<b>Polen — 0,28 % (28. Februar 2021: 0,23 %)</b>		
200 Wells Fargo & Co, 4,100 %, fällig 03/06/2026	211	0,09	130 Republic of Poland Government International Bond, 5,000 %, fällig 23/03/2022		
180 Wells Fargo & Co, 3,000 %, fällig 23/10/2026	182	0,08	130	0,06	
260 Wells Fargo & Co, 4,300 %, fällig 22/07/2027	278	0,12	500 Republic of Poland Government International Bond, 4,000 %, fällig 22/01/2024		
420 Wells Fargo & Co, 2,393 %, fällig 02/06/2028 *	411	0,18	517	0,22	
150 Wells Fargo & Co, 4,150 %, fällig 24/01/2029	160	0,07	647	0,28	
200 Wells Fargo & Co, 2,879 %, fällig 30/10/2030 *	197	0,08	<b>Katar — 0,56 % (28. Februar 2021: 0,44 %)</b>		
280 Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04/04/2031 *	306	0,13	1.070 Qatar Government International Bond, 144A, 4,817 %, fällig 14/03/2049		
20 Wells Fargo & Co, 4,650 %, fällig 04/11/2044	22	0,01	1.302	0,56	
50 Wells Fargo & Co, 4,900 %, fällig 17/11/2045	57	0,02	<b>Russland — 0,07 % (28. Februar 2021: 0,34 %)</b>		
430 Wells Fargo & Co, 4,400 %, fällig 14/06/2046	462	0,20	400 Russian Foreign Bond – Eurobond, 5,625 %, fällig 04/04/2042		
350 Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig 07/12/2046	394	0,17	154	0,07	
880 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04/04/2051 *	1.086	0,47	<b>Saudi-Arabien — 0,17 % (28. Februar 2021: 0,14 %)</b>		
280 Williams Cos Inc/The, 3,750 %, fällig 15/06/2027	292	0,13	400 Saudi Government International Bond, 2,875 %, fällig 04/03/2023		
60 Williams Cos Inc/The, 4,900 %, fällig 15/01/2045	65	0,03	406	0,17	
90 Williams Cos Inc/The, 5,100 %, fällig 15/09/2045	99	0,04	<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,63 % (28. Februar 2021: 0,50 %)</b>		
60 Williams Cos Inc/The, 4,850 %, fällig 01/03/2048	65	0,03	1.450 Abu Dhabi Government International Bond, 2,500 %, fällig 11/10/2022		
30 Wyeth LLC, 5,950 %, fällig 01/04/2037	39	0,02	1.463	0,63	
65.206	28,00		<b>USA — 18,21 % (28. Februar 2021: 21,54 %)</b>		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen</b>			140 Tennessee Valley Authority, 1,875 %, fällig 15/08/2022		
<b>(Anschaffungskosten 92.762 USD)</b>			10 United States Treasury Note/Bond, 2,125 %, fällig 15/05/2022		
92.224	39,60		10	–	
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 24,00 % (28. Februar 2021: 26,13 %)</b>			40	0,02	
<b>Chile — 0,40 % (28. Februar 2021: 0,24 %)</b>			20	0,01	
370 Chile Government International Bond, 3,100 %, fällig 07/05/2041			110	0,05	
325	0,14		110	0,05	
760 Chile Government International Bond, 3,100 %, fällig 22/01/2061			1.710	0,70	
618	0,26		110	0,04	
943	0,40		70	0,03	
<b>China — 0,03 % (28. Februar 2021: 0,03 %)</b>			680	0,30	
CNY 500 China Government Bond, 3,310 %, fällig 30/11/2025			1.530	0,64	
82	0,03		4.480	1,90	
<b>Kolumbien — 0,47 % (28. Februar 2021: 0,23 %)</b>			1.150	0,48	
220 Colombia Government International Bond, 3,125 %, fällig 15/04/2031			2.650	1,10	
187	0,08		960	0,40	
660 Colombia Government International Bond, 3,250 %, fällig 22/04/2032			960	0,39	
554	0,24		720	0,30	
400 Colombia Government International Bond, 5,625 %, fällig 26/02/2044			110	0,05	
361	0,15		640	0,32	
1.102	0,47		5.390	2,22	
<b>Indien — 0,09 % (28. Februar 2021: 0,07 %)</b>			11.710	4,01	
200 Export-Import Bank of India, 3,375 %, fällig 05/08/2026			7.120	2,52	
202	0,09		3.330	1,25	
<b>Indonesien — 0,66 % (28. Februar 2021: 0,54 %)</b>			1.210	0,54	
1.500 Indonesia Government International Bond, 4,350 %, fällig 11/01/2048			800	0,33	
1.535	0,66		1.370	0,55	
<b>Israel — 0,35 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>			42.406	18,21	
800 Israel Government International Bond, 2,750 %, fällig 03/07/2030					
814	0,35				

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Uruguay — 0,38 % (28. Februar 2021: 0,24 %)</b>					
490 Uruguay Government International Bond, 4,375 %, fällig 23/01/2031	540	0,23		(9)	–
300 Uruguay Government International Bond, 5,100 %, fällig 18/06/2050	359	0,15		(44)	(0,02)
	899	0,38		(37)	(0,02)
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 60.791 USD)</b>	55.904	24,00		(39)	(0,02)
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,35 % (28. Februar 2021: 4,22 %)</b>					
5.470 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	5.470	2,35		(10)	–
	5.470	2,35		(18)	(0,01)
<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 5.470 USD)</b>	5.470	2,35		(14)	(0,01)
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 241.553 USD)</b>	234.866	100,84		(229)	(0,10)
<b>Verträge</b>					
	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts			
<b>Gekaufte Optionen – 0,03 % (28. Februar 2021: 0,04 %)</b>					
– U.S. 10 Year April 2022 Call 127,00, fällig 25/03/2022 – Goldman Sachs	22	0,01			
– U.S. 5 Year April 2022 Call 118,25, fällig 25/03/2022 – Goldman Sachs	10	–			
– U.S. Bond April 2022 Call 155,00, fällig 25/03/2022 – Goldman Sachs	14	0,01			
– U.S. Bond April 2022 Call 156,00, fällig 25/03/2022 – Goldman Sachs	12	0,01			
<b>Gekaufte Optionen gesamt (Anschaffungskosten 38 USD)</b>	58	0,03			
<b>Credit Default Swaps — 0,21 % (28. Februar 2021: 0,36 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	489	0,21			
<b>Inflation Swaps — 0,06 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	125	0,06			
<b>Zinsswaps – 0,12 % (28. Februar 2021: 0,99 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	288	0,12			
<b>Index-Swaps — 0,68 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.592	0,68			
<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	–	–			
<b>Futures – 0,31 % (28. Februar 2021: 0,09 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	726	0,31			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	238.144	102,25			
<b>Verträge</b>					
	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts			
<b>Schriftliche Optionen — (0,10 %) (28. Februar 2021: (0,12 %))</b>					
– U.S. 10 Year April 2022 Call 128,00, fällig 25/03/2022 – Goldman Sachs	(26)	(0,01)			
– U.S. 10 Year April 2022 Call 128,50, fällig 25/03/2022 – Goldman Sachs	(17)	(0,01)			
– U.S. 10 Year April 2022 Call 129,00, fällig 25/03/2022 – Goldman Sachs	(6)	–			
– U.S. 10 Year April 2022 Call 129,50, fällig 25/03/2022 – Goldman Sachs	(4)	–			
– U.S. 10 Year April 2022 Call 130,00, fällig 25/03/2022 – Goldman Sachs	(3)	–			
– U.S. 10 Year April 2022 Call 130,50, fällig 25/03/2022 – Goldman Sachs	(2)	–			
<b>Gesamtvermögen</b>	\$232.906	100,00			
<b>Geschriebene Optionen insgesamt (Kosten \$(174))</b>					
<b>Inflation Swaps — (0,04 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(92)	(0,04)			
<b>Zinsswaps – (0,14 %) (28. Februar 2021: (0,08 %))</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(329)	(0,14)			
<b>Devisenterminkontrakte – (0,02 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(50)	(0,02)			
<b>Futures – (0,65 %) (28. Februar 2021: (0,32 %))</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.522)	(0,65)			
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	(2.222)	(0,95)			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	235.922	101,30			
<b>Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten</b>	(3.016)	(1,30)			
<b>Gesamtvermögen</b>	\$232.906	100,00			
– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 39.208.000 USD oder 16,87 % des Nettovermögens.					
* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.					
† Illiquide.					
∞ Sicherheit wird nach Treu und Glauben vom Bewertungsausschuss oder nach dessen Ermessen zum beizulegenden Zeitwert bewertet.					
ε Die Sicherheit befindet sich zum 28. Februar 2022 in Verzug (entweder Kapital und/oder Zinsen).					
γ Sicherheiten fallen aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen nach Jahresende nicht mehr an.					
± Anzugebende Wertpapiere.					
<b>ABKÜRZUNGEN:</b>					
Unbefristet	– Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.				
REMIC	– Immobilienhypothekenanlage.				
TBA	– Wird bekannt gegeben.				
CNY	– Chinesischer Renminbi				
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					% des Gesamt vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					93,17
Organismen für gemeinsame Anlagen					2,22
Finanzderivate					1,33
Sonstige Vermögenswerte					3,28
<b>Gesamtvermögen</b>					100,00

### Zeitplan für Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20/12/2026	33.338	\$ 489
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.078 USD)				\$ 489
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)				\$ 489

### Zeitplan für Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,190 %	15/06/2022	11.149	\$ (13)
Goldman Sachs	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,820 %	04/06/2024	24.773	(316)
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,350 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15/02/2028	3.289	95
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,630 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15/02/2047	1.121	90

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Zinsswaps – (Fortsetzung)

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,200 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	07/10/2050	136	\$ 24
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,671 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	09/07/2051	1.072	79
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 2.982 USD)				\$ 288
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (247) USD)				(329)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 2.735 USD)				\$ (41)

## Zeitplan für Index-Swaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,560 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20/07/2045	2.880	\$ 666
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,710 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/05/2027	10.246	443
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,740 %, Receive Floating USD SOFR Compound	19/08/2045	1.170	230
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,130 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/08/2028	2.084	60
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,200 %, Receive Floating USD SOFR Compound	01/11/2028	1.527	39
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,220 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/08/2028	2.574	60
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20/11/2026	3.650	22
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/02/2047	636	29
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,630 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/05/2047	1.390	32
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,729 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/02/2047	1.315	5
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,733 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20/10/2031	2.350	6
Nicht realisierte Wertsteigerung von Index Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 1.592
Nicht realisierte Wertminderung von Index-Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				–
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 1.592

## Zeitplan der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	USD – CPI Urban Consumers	18/11/2023	3.220	\$ 50
Goldman Sachs	USD – CPI Urban Consumers	20/10/2026	2.360	75
Goldman Sachs	USD – CPI Urban Consumers	18/11/2026	3.220	(28)
Goldman Sachs	USD – CPI Urban Consumers	20/10/2031	2.360	(64)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 125
Nicht realisierte Wertminderung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(92)
Nettowertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 33

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Währung	Wert	Verkauf	Währung	Wert	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	26	Verkauf	EUR	23	\$ –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.307	Verkauf	USD	2.638	(50)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 12 USD)								\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)								(50)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 12 USD)								\$ (50)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nominaler Wert	Nominaler Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
90 Day Euro\$ December 2022	Goldman Sachs	434	\$ (668)
90 Day Euro\$ December 2023	Goldman Sachs	196	(485)
90 Day Euro\$ June 2023	Goldman Sachs	57	(190)
90 Day Euro\$ March 2022	Goldman Sachs	(312)	245
90 Day Euro\$ September 2023	Goldman Sachs	13	(40)
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Goldman Sachs	23	15
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Goldman Sachs	751	456
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Goldman Sachs	(76)	(139)
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Goldman Sachs	(10)	10
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 270 USD)			\$ 726
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (949) USD)			(1.522)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (679) USD)			\$ (796)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Asset-Backed Securities – 9,12 % (28. Februar 2021: 7,62 %)</b>					
2.810	522	0,19	3.000	536	0,04
162	159	0,01	3.300	2.738	0,18
847	847	0,06	2.000	1.959	0,13
3.060	3.048	0,20	2.500	2.491	0,17
1.250	1.245	0,08	2.000	1.993	0,13
2.059	2.062	0,14	4.390	4.396	0,30
3.900	3.833	0,26	1.280	1.282	0,09
2.390	178	0,01	4.390	4.375	0,29
2.500	2.498	0,17	2.500	2.494	0,17
1.630	1.631	0,11	1.335	1.293	0,09
735	736	0,05	395	378	0,03
2.000	1.994	0,13	1.550	1.549	0,10
3.564	3.540	0,24	250	249	0,02
1.740	1.738	0,12	2.360	2.363	0,16
22	24	–	3.600	3.508	0,24
2.925	2.843	0,19	4.540	4.440	0,30
1.960	1.896	0,13	2.231	2.192	0,15
93	93	0,01	2.010	1.845	0,12
3.540	3.334	0,22	149	154	0,01
681	688	0,05	3.341	3.708	0,25
550	549	0,04	746	751	0,05
3.437	2.729	0,18	2	688	0,05
2.672	2.674	0,18	508	496	0,03
179	185	0,01	2.852	2.789	0,19
8.581	8.374	0,56	1.403	1.391	0,09
2.815	2.701	0,18	2.950	2.949	0,20
2.060	2.238	0,15	465	466	0,03
200	202	0,01	2.690	2.686	0,18
500	500	0,03	<b>Summe der vermögensgesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 135.088 USD)</b>		
2.980	2.960	0,20	<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 19,60 % (28. Februar 2021: 28,98 %)</b>		
2.610	2.593	0,17	70	59	–
2.911	2.776	0,19	222	213	0,01
1.100	1.100	0,07	167	161	0,01
4.034	4.039	0,27	41	57	–
1.890	1.857	0,12	51	51	–
1.913	1.906	0,13	2.235	916	0,06
2.000	2.002	0,14	2.459	2.349	0,16
1.814	1.774	0,12	780	807	0,05
3.140	3.124	0,21	12.909	407	0,03
			1.500	1.593	0,11
			2.570	2.475	0,17
			291	279	0,02

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>					
497 BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND, Series 2018 IND, Class G, 144A, 2,241 %, fällig 15/11/2035 *	494	0,03	421 Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, fällig 01/10/2044	457	0,03
2.324 BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND, Series 2018 IND, Class H, 144A, 3,191 %, fällig 15/11/2035 *	2.300	0,15	142 Fannie Mae Pool '890827', 3,500 %, fällig 01/11/2037	150	0,01
3.100 BXP Trust 2017-CQHP, Series 2017 CQHP, Class A, 144A, 1,041 %, fällig 15/11/2034 *	3.052	0,21	8 Fannie Mae Pool '985626', 6,000 %, fällig 01/04/2033	9	–
64 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-3, Series 2005 3, Class 1A2, 0,767 %, fällig 25/04/2035 *	60	–	16 Fannie Mae Pool '995072', 5,500 %, fällig 01/08/2038	19	–
300 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27, Series 2015 GC27, Class AS, 3,571 %, fällig 10/02/2048	304	0,02	40 Fannie Mae Pool 'AB9683', 4,000 %, fällig 01/06/2043	43	–
8.968 Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Series 2006 AR6, Class 2A4, 0,627 %, fällig 25/09/2036 *	3.128	0,21	39 Fannie Mae Pool 'AE0758', 7,000 %, fällig 01/02/2039	46	–
3.023 COLT 2021-RPL1 Trust, Series 2021 RPL1, Class A1, 144A, 1,665 %, fällig 25/09/2061 *	2.958	0,20	28 Fannie Mae Pool 'AK8441', 4,000 %, fällig 01/04/2042	30	–
20 COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Series 2013 CR12, Class B, 4,762 %, fällig 10/10/2046 *	20	–	– Fannie Mae Pool 'AL2931', 6,000 %, fällig 01/06/2023	–	–
10 COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Series 2013 CR12, Class C, 5,070 %, fällig 10/10/2046 *	10	–	398 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, fällig 01/01/2043	419	0,03
726 COMM 2013-CCRE6 Mortgage Trust, Series 2013 CR6, Class B, 144A, 3,397 %, fällig 10/03/2046	726	0,05	38 Fannie Mae Pool 'AL3026', 3,500 %, fällig 01/12/2042	40	–
90 COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1, Class B, 4,035 %, fällig 10/02/2048 *	91	0,01	28 Fannie Mae Pool 'AL3508', 4,000 %, fällig 01/04/2043	29	–
70 COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1, Class C, 4,306 %, fällig 10/02/2048 *	69	–	22 Fannie Mae Pool 'AL4741', 4,500 %, fällig 01/01/2044	24	–
613 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1M2, 144A, 2,287 %, fällig 25/10/2039 *	615	0,04	78 Fannie Mae Pool 'AL9397', 3,000 %, fällig 01/10/2046	80	0,01
500 CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C1, Class AS, 3,791 %, fällig 15/04/2050 *	507	0,03	444 Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, fällig 01/11/2046	463	0,03
1.050 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class A2, 144A, 3,953 %, fällig 15/09/2037	1.066	0,07	367 Fannie Mae Pool 'AL9631', 3,000 %, fällig 01/12/2046	377	0,03
140 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class E, 144A, 4,373 %, fällig 15/09/2037	122	0,01	10 Fannie Mae Pool 'AM8674', 2,810 %, fällig 01/04/2025	10	–
5.170 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class F, 144A, 4,373 %, fällig 15/09/2037	3.951	0,27	10 Fannie Mae Pool 'AO2711', 4,000 %, fällig 01/05/2042	11	–
2.809 CSMC 2021-NQMB, Series 2021 NQMB, Class A1, 144A, 1,841 %, fällig 25/10/2066 *	2.754	0,19	22 Fannie Mae Pool 'AO6086', 4,000 %, fällig 01/06/2042	23	–
600 CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class G, 144A, 5,541 %, fällig 15/07/2032 *	532	0,04	9 Fannie Mae Pool 'AO9859', 4,000 %, fällig 01/07/2042	10	–
1.680 DBCG 2017-BBG Mortgage Trust, Series 2017 BBG, Class A, 144A, 0,891 %, fällig 15/06/2034 *	1.660	0,11	16 Fannie Mae Pool 'AP0692', 4,000 %, fällig 01/07/2042	17	–
173 Deutsche Mortgage Securities Inc Mortgage Loan Trust Series 2006-PR1, Series 2006 PR1, Class 3AF1, 144A, 0,471 %, fällig 15/04/2036 *	159	0,01	16 Fannie Mae Pool 'AP2530', 4,000 %, fällig 01/08/2042	17	–
412 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C03, Class 1M2, 3,187 %, fällig 25/07/2024 *	413	0,03	61 Fannie Mae Pool 'AP4710', 3,500 %, fällig 01/08/2042	64	–
2.554 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1B1, 3,937 %, fällig 25/10/2030 *	2.581	0,17	284 Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, fällig 01/09/2042	292	0,02
2.274 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1M2, 2,337 %, fällig 25/10/2030 *	2.306	0,16	27 Fannie Mae Pool 'AP4903', 4,000 %, fällig 01/09/2042	29	–
560 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05, Class 1B1, 4,437 %, fällig 25/01/2031 *	570	0,04	60 Fannie Mae Pool 'AP7399', 4,000 %, fällig 01/09/2042	65	–
15 Fannie Mae Interest Strip 390, Class C3, 6,000 %, fällig 25/07/2038	3	–	21 Fannie Mae Pool 'AP9229', 4,000 %, fällig 01/10/2042	22	–
7 Fannie Mae Interest Strip 407, Class 22, 5,000 %, fällig 25/01/2039	1	–	73 Fannie Mae Pool 'AP9766', 4,000 %, fällig 01/10/2042	78	0,01
4 Fannie Mae Interest Strip 407, Class 23, 5,000 %, fällig 25/01/2039 *	1	–	80 Fannie Mae Pool 'AP9862', 4,000 %, fällig 01/10/2042	85	0,01
8 Fannie Mae Interest Strip 407, Class 27, 5,500 %, fällig 25/01/2039 *	1	–	21 Fannie Mae Pool 'AQ0100', 4,000 %, fällig 01/10/2042	23	–
7 Fannie Mae Interest Strip 407, Class 34, 5,000 %, fällig 25/01/2038	1	–	95 Fannie Mae Pool 'AQ1641', 4,000 %, fällig 01/10/2042	102	0,01
20 Fannie Mae Interest Strip 407, Class 41, 6,000 %, fällig 25/01/2038	3	–	17 Fannie Mae Pool 'AQ3599', 4,000 %, fällig 01/11/2042	18	–
60 Fannie Mae Interest Strip 409, Class C13, 3,500 %, fällig 25/11/2041	6	–	30 Fannie Mae Pool 'AQ4078', 4,000 %, fällig 01/06/2043	32	–
68 Fannie Mae Interest Strip 409, Class C18, 4,000 %, fällig 25/04/2042	10	–	19 Fannie Mae Pool 'AQ4080', 4,000 %, fällig 01/06/2043	21	–
97 Fannie Mae Interest Strip 409, Class C2, 3,000 %, fällig 25/04/2027	5	–	31 Fannie Mae Pool 'AQ4555', 4,000 %, fällig 01/12/2042	33	–
69 Fannie Mae Interest Strip 409, Class C22, 4,500 %, fällig 25/11/2039	10	–	23 Fannie Mae Pool 'AQ5137', 4,000 %, fällig 01/11/2042	25	–
4.300 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	4.243	0,29	56 Fannie Mae Pool 'AQ7003', 4,000 %, fällig 01/12/2042	60	–
700 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ±	707	0,05	64 Fannie Mae Pool 'AQ7082', 4,000 %, fällig 01/01/2043	69	–
3.200 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500 % ±	3.296	0,22	25 Fannie Mae Pool 'AS0070', 4,000 %, fällig 01/08/2043	27	–
10 Fannie Mae Pool '254793', 5,000 %, fällig 01/07/2033	12	–	104 Fannie Mae Pool 'AS3253', 4,000 %, fällig 01/09/2044	112	0,01
13 Fannie Mae Pool '555743', 5,000 %, fällig 01/09/2033	14	–	28 Fannie Mae Pool 'AS4271', 4,500 %, fällig 01/01/2045	31	–
1 Fannie Mae Pool '725162', 6,000 %, fällig 01/02/2034	1	–	47 Fannie Mae Pool 'AS4347', 4,000 %, fällig 01/01/2045	51	–
7 Fannie Mae Pool '745000', 6,000 %, fällig 01/10/2035	7	–	508 Fannie Mae Pool 'AS6328', 3,500 %, fällig 01/12/2045	530	0,04
6 Fannie Mae Pool '843997', 1,876 %, fällig 01/11/2035 *	6	–	126 Fannie Mae Pool 'AS6340', 3,500 %, fällig 01/12/2045	132	0,01
5 Fannie Mae Pool '865915', 2,122 %, fällig 01/03/2036 *	5	–	105 Fannie Mae Pool 'AS6541', 3,500 %, fällig 01/01/2046	110	0,01
16 Fannie Mae Pool '888560', 6,000 %, fällig 01/11/2035	18	–	87 Fannie Mae Pool 'AS6562', 3,500 %, fällig 01/01/2046	91	0,01
36 Fannie Mae Pool '889117', 5,000 %, fällig 01/10/2035	40	–	665 Fannie Mae Pool 'AS7738', 3,000 %, fällig 01/08/2046	682	0,05
35 Fannie Mae Pool '890248', 6,000 %, fällig 01/08/2037	39	–	70 Fannie Mae Pool 'AS7844', 3,000 %, fällig 01/09/2046	72	–
			225 Fannie Mae Pool 'AS8623', 3,000 %, fällig 01/01/2047	231	0,02
			154 Fannie Mae Pool 'AS8740', 3,500 %, fällig 01/02/2037	161	0,01
			864 Fannie Mae Pool 'AS8745', 3,000 %, fällig 01/02/2047	886	0,06
			542 Fannie Mae Pool 'AS8951', 3,500 %, fällig 01/03/2047	565	0,04
			19 Fannie Mae Pool 'AT7208', 4,000 %, fällig 01/06/2043	20	–
			29 Fannie Mae Pool 'AT8394', 4,000 %, fällig 01/06/2043	31	–
			81 Fannie Mae Pool 'AT9637', 4,000 %, fällig 01/07/2043	88	0,01
			63 Fannie Mae Pool 'AT9653', 4,000 %, fällig 01/07/2043	68	–
			48 Fannie Mae Pool 'AT9657', 4,000 %, fällig 01/07/2043	51	–
			94 Fannie Mae Pool 'AW0318', 4,500 %, fällig 01/02/2044	100	0,01
			18 Fannie Mae Pool 'AW9453', 3,500 %, fällig 01/08/2044	19	–
			422 Fannie Mae Pool 'BC0884', 3,000 %, fällig 01/05/2046	433	0,03
			39 Fannie Mae Pool 'BC1509', 3,000 %, fällig 01/08/2046	40	–
			111 Fannie Mae Pool 'BC2817', 3,000 %, fällig 01/09/2046	114	0,01
			272 Fannie Mae Pool 'BC9077', 3,500 %, fällig 01/12/2046	284	0,02
			195 Fannie Mae Pool 'BC9096', 3,500 %, fällig 01/12/2046	204	0,01
			689 Fannie Mae Pool 'BD2455', 3,000 %, fällig 01/01/2047	706	0,05
			284 Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000 %, fällig 01/10/2046	292	0,02
			950 Fannie Mae Pool 'BF0104', 4,000 %, fällig 01/02/2056	1.025	0,07
			743 Fannie Mae Pool 'BF0163', 5,000 %, fällig 01/11/2046	810	0,05
			561 Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000 %, fällig 01/01/2057	605	0,04
			987 Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, fällig 01/06/2057	1.059	0,07
			880 Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500 %, fällig 01/09/2057	963	0,06
			47 Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, fällig 01/08/2058	51	–
			350 Fannie Mae Pool 'BF0338', 4,500 %, fällig 01/01/2059	382	0,03
			539 Fannie Mae Pool 'BH4101', 3,500 %, fällig 01/10/2047	560	0,04
			90 Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, fällig 01/12/2037	92	0,01
			923 Fannie Mae Pool 'BK7700', 4,500 %, fällig 01/10/2048	991	0,07
			183 Fannie Mae Pool 'BL2454', 3,160 %, fällig 01/05/2029	194	0,01
			963 Fannie Mae Pool 'BL5850', 2,260 %, fällig 01/04/2030	969	0,07
			825 Fannie Mae Pool 'BM1565', 3,000 %, fällig 01/04/2047	847	0,06
			265 Fannie Mae Pool 'BM1948', 6,000 %, fällig 01/07/2041	303	0,02
			161 Fannie Mae Pool 'BM3473', 3,500 %, fällig 01/11/2047	168	0,01
			47 Fannie Mae Pool 'BM3799', 3,000 %, fällig 01/08/2047	48	–
			264 Fannie Mae Pool 'BM4579', 3,000 %, fällig 01/04/2047	271	0,02
			45 Fannie Mae Pool 'BM4750', 3,500 %, fällig 01/02/2045	48	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>					
363 Fannie Mae REMICS, Series 2011 59, Class NZ, 5,500 %, fällig 25/07/2041	405	0,03	9 Freddie Mac Gold Pool 'Q27298', 4,000 %, fällig 01/07/2044	9	–
96 Fannie Mae REMICS, Series 2012 133, Class CS, 5,963 %, fällig 25/12/2042 *	17	–	384 Freddie Mac Gold Pool 'Q45560', 3,000 %, fällig 01/01/2047	393	0,03
12 Fannie Mae REMICS, Series 2012 28, Class B, 6,500 %, fällig 25/06/2039	13	–	944 Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000 %, fällig 01/01/2047	969	0,07
190 Fannie Mae REMICS, Series 2012 35, Class SC, 6,313 %, fällig 25/04/2042 *	33	–	258 Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000 %, fällig 01/01/2047	265	0,02
49 Fannie Mae REMICS, Series 2012 46, Class BA, 6,000 %, fällig 25/05/2042	55	–	229 Freddie Mac Gold Pool 'Q45827', 3,000 %, fällig 01/01/2047	235	0,02
75 Fannie Mae REMICS, Series 2012 51, Class B, 7,000 %, fällig 25/05/2042	89	0,01	100 Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, fällig 01/10/2042	107	0,01
1 Fannie Mae REMICS, Series 2012 70, Class YS, 6,463 %, fällig 25/02/2041 *	–	–	59 Freddie Mac Gold Pool 'U91254', 4,000 %, fällig 01/04/2043	63	–
66 Fannie Mae REMICS, Series 2012 74, Class SA, 6,463 %, fällig 25/03/2042 *	8	–	26 Freddie Mac Gold Pool 'U95137', 4,000 %, fällig 01/08/2043	28	–
193 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class BC, 6,500 %, fällig 25/07/2042	223	0,02	689 Freddie Mac Gold Pool 'U99054', 4,000 %, fällig 01/06/2043	742	0,05
238 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class CB, 5,500 %, fällig 25/04/2042	263	0,02	6.647 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K058, Class X1, 0,920 %, fällig 25/08/2026 *	238	0,02
1.298 Fannie Mae REMICS, Series 2016 23, Class ST, 5,813 %, fällig 25/11/2045 *	234	0,02	66 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,100 %, fällig 01/03/2047 *	67	–
208 Fannie Mae REMICS, Series 2016 61, Class BS, 5,913 %, fällig 25/09/2046 *	28	–	2.121 Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,013 %, fällig 01/11/2048 *	2.168	0,15
970 Fannie Mae REMICS, Series 2017 76, Class SB, 5,913 %, fällig 25/10/2057 *	183	0,01	737 Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 2,873 %, fällig 01/11/2047 *	756	0,05
268 Fannie Mae REMICS, Series 2017 85, Class SC, 6,013 %, fällig 25/11/2047 *	45	–	1.066 Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,092 %, fällig 01/02/2050 *	1.089	0,07
620 Fannie Mae REMICS, Series 2020 47, Class GZ, 2,000 %, fällig 25/07/2050	524	0,04	115 Freddie Mac Pool 'QA5768', 3,000 %, fällig 01/01/2050	117	0,01
772 Fannie Mae REMICS, Series 2020 56, Class DI, 2,500 %, fällig 25/08/2050	123	0,01	52 Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000 %, fällig 01/01/2050	53	–
794 Fannie Mae REMICS, Series 2020 57, Class NI, 2,500 %, fällig 25/08/2050	115	0,01	482 Freddie Mac Pool 'QA7256', 3,000 %, fällig 01/02/2050	489	0,03
425 Fannie Mae REMICS, Series 2020 74, Class EI, 2,500 %, fällig 25/10/2050	63	–	73 Freddie Mac Pool 'QB2667', 3,000 %, fällig 01/08/2050	74	0,01
2.355 Fannie Mae REMICS, Series 2020 89, Class DI, 2,500 %, fällig 25/12/2050	335	0,02	73 Freddie Mac Pool 'QB2927', 3,000 %, fällig 01/09/2050	74	0,01
1.408 Fannie Mae REMICS, Series 2020 97, Class AI, 2,000 %, fällig 25/01/2051	202	0,01	438 Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, fällig 01/11/2050	435	0,03
1.960 Fannie Mae REMICS, Series 2021 3, Class IB, 2,500 %, fällig 25/02/2051	333	0,02	255 Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, fällig 01/11/2050	253	0,02
2.309 Fannie Mae REMICS, Series 2021 3, Class QI, 2,500 %, fällig 25/02/2051	331	0,02	72 Freddie Mac Pool 'QB5799', 2,500 %, fällig 01/11/2050	72	–
2.173 Fannie Mae REMICS, Series 2021 69, Class II, 2,500 %, fällig 25/01/2049	288	0,02	258 Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000 %, fällig 01/02/2051	249	0,02
275 Fannie Mae-Aces, Series 2013 M6, Class 1AC, 3,353 %, fällig 25/02/2043 *	291	0,02	342 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig 01/02/2051	330	0,02
800 Fannie Mae-Aces, Series 2018 M15, Class 1A2, 3,700 %, fällig 25/01/2036	885	0,06	165 Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000 %, fällig 01/02/2051	159	0,01
878 Fannie Mae-Aces, Series 2018 M9, Class APT2, 3,121 %, fällig 25/04/2028 *	916	0,06	1.443 Freddie Mac Pool 'QB9087', 2,000 %, fällig 01/02/2051	1.386	0,09
510 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M19, Class A2, 2,560 %, fällig 25/09/2029	523	0,04	187 Freddie Mac Pool 'QB9090', 2,000 %, fällig 01/02/2051	180	0,01
1.867 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M36, Class X1, 1,460 %, fällig 25/09/2034 *	178	0,01	260 Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000 %, fällig 01/03/2051	250	0,02
126 Flagstar Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Class A4, 144A, 3,500 %, fällig 25/04/2048 *	126	0,01	173 Freddie Mac Pool 'QB9484', 2,000 %, fällig 01/03/2051	166	0,01
76 Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, fällig 01/04/2038	77	0,01	89 Freddie Mac Pool 'QB9485', 2,000 %, fällig 01/03/2051	86	0,01
147 Freddie Mac Gold Pool 'G06409', 6,000 %, fällig 01/11/2039	169	0,01	278 Freddie Mac Pool 'QB9961', 2,000 %, fällig 01/03/2051	268	0,02
16 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, fällig 01/09/2039	17	–	253 Freddie Mac Pool 'QC0160', 2,000 %, fällig 01/03/2051	244	0,02
400 Freddie Mac Gold Pool 'G08682', 4,000 %, fällig 01/12/2045	427	0,03	268 Freddie Mac Pool 'QC0161', 2,000 %, fällig 01/03/2051	258	0,02
5 Freddie Mac Gold Pool 'G13888', 5,000 %, fällig 01/06/2025	6	–	293 Freddie Mac Pool 'QC0297', 2,000 %, fällig 01/04/2051	282	0,02
1.512 Freddie Mac Gold Pool 'G60985', 3,000 %, fällig 01/05/2047	1.551	0,10	94 Freddie Mac Pool 'QC0885', 2,000 %, fällig 01/04/2051	91	0,01
1.087 Freddie Mac Gold Pool 'G61637', 3,000 %, fällig 01/09/2047	1.115	0,08	175 Freddie Mac Pool 'QC1164', 2,000 %, fällig 01/04/2051	169	0,01
960 Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000 %, fällig 01/10/2046	986	0,07	93 Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500 %, fällig 01/05/2051	93	0,01
3.453 Freddie Mac Gold Pool 'G67713', 4,000 %, fällig 01/06/2043	3.669	0,25	290 Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, fällig 01/07/2051	288	0,02
26 Freddie Mac Gold Pool 'Q19135', 4,000 %, fällig 01/06/2043	28	–	190 Freddie Mac Pool 'QC4818', 2,500 %, fällig 01/08/2051	188	0,01
32 Freddie Mac Gold Pool 'Q19254', 4,000 %, fällig 01/06/2043	34	–	94 Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, fällig 01/08/2051	93	0,01
31 Freddie Mac Gold Pool 'Q19611', 4,000 %, fällig 01/07/2043	34	–	1.549 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, fällig 01/08/2051	1.539	0,10
27 Freddie Mac Gold Pool 'Q19615', 4,000 %, fällig 01/07/2043	29	–	483 Freddie Mac Pool 'QC6551', 2,500 %, fällig 01/09/2051	478	0,03
			497 Freddie Mac Pool 'QD0350', 2,000 %, fällig 01/11/2051	478	0,03
			398 Freddie Mac Pool 'QD0652', 2,000 %, fällig 01/11/2051	382	0,03
			100 Freddie Mac Pool 'QD4146', 2,500 %, fällig 01/01/2052	99	0,01
			100 Freddie Mac Pool 'QD5620', 2,000 %, fällig 01/02/2052	96	0,01
			100 Freddie Mac Pool 'QD5628', 2,000 %, fällig 01/02/2052	96	0,01
			100 Freddie Mac Pool 'QD5960', 2,000 %, fällig 01/02/2052	96	0,01
			100 Freddie Mac Pool 'QD5961', 2,000 %, fällig 01/02/2052	96	0,01
			100 Freddie Mac Pool 'QD6009', 2,000 %, fällig 01/01/2052	96	0,01
			798 Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, fällig 01/02/2052	793	0,05
			198 Freddie Mac Pool 'QD6093', 2,000 %, fällig 01/02/2052	190	0,01
			199 Freddie Mac Pool 'QD6139', 2,000 %, fällig 01/02/2052	192	0,01
			100 Freddie Mac Pool 'QD6142', 2,500 %, fällig 01/02/2052	99	0,01
			88 Freddie Mac Pool 'QK0701', 2,500 %, fällig 01/04/2041	89	0,01
			794 Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000 %, fällig 01/09/2049	809	0,05
			137 Freddie Mac Pool 'RA2358', 4,000 %, fällig 01/03/2050	144	0,01
			194 Freddie Mac Pool 'RA3474', 3,000 %, fällig 01/09/2050	197	0,01
			798 Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, fällig 01/11/2050	769	0,05
			1.113 Freddie Mac Pool 'RA4414', 2,500 %, fällig 01/01/2051	1.103	0,07
			1.441 Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, fällig 01/02/2051	1.386	0,09
			475 Freddie Mac Pool 'RA5040', 2,000 %, fällig 01/04/2051	457	0,03
			3.257 Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, fällig 01/05/2051	3.141	0,21
			2.018 Freddie Mac Pool 'RA5155', 2,000 %, fällig 01/05/2051	1.941	0,13
			478 Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000 %, fällig 01/06/2051	459	0,03
			2.576 Freddie Mac Pool 'RA5576', 2,500 %, fällig 01/07/2051	2.551	0,17
			1.975 Freddie Mac Pool 'RA6507', 2,000 %, fällig 01/12/2051	1.898	0,13
			191 Freddie Mac Pool 'RA6599', 3,500 %, fällig 01/01/2052	197	0,01
			2.221 Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, fällig 01/09/2041	2.165	0,15
			132 Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000 %, fällig 01/07/2047	140	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>					
923 Freddie Mac Pool 'SD0552', 2,000 %, fällig 01/03/2051	888	0,06	976 Ginnie Mae II Pool 'AP6338', 4,000 %, fällig 20/10/2045	1.028	0,07
262 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig 01/04/2051	253	0,02	279 Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500 %, fällig 20/10/2047	290	0,02
575 Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500 %, fällig 01/07/2051	569	0,04	205 Ginnie Mae II Pool 'BD0384', 3,500 %, fällig 20/10/2047	216	0,01
789 Freddie Mac Pool 'SD0809', 3,000 %, fällig 01/01/2052	798	0,05	109 Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, fällig 20/02/2050	113	0,01
399 Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, fällig 01/01/2052	395	0,03	134 Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000 %, fällig 20/10/2049	141	0,01
4.269 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig 01/11/2051	4.241	0,29	107 Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000 %, fällig 20/11/2049	111	0,01
137 Freddie Mac Pool 'ZA5318', 3,500 %, fällig 01/03/2048	142	0,01	113 Ginnie Mae II Pool 'BS1728', 4,000 %, fällig 20/01/2050	121	0,01
1.333 Freddie Mac Pool 'ZA6342', 4,500 %, fällig 01/03/2049	1.430	0,10	98 Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, fällig 20/02/2050	104	0,01
888 Freddie Mac Pool 'ZA6680', 4,000 %, fällig 01/04/2049	941	0,06	414 Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000 %, fällig 20/03/2050	421	0,03
123 Freddie Mac Pool 'Z17269', 5,000 %, fällig 01/03/2038	138	0,01	190 Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, fällig 20/06/2044	201	0,01
210 Freddie Mac Pool 'ZM1278', 3,500 %, fällig 01/06/2046	221	0,01	51 Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500 %, fällig 20/03/2045	53	–
58 Freddie Mac Pool 'ZM5722', 3,500 %, fällig 01/02/2048	60	–	79 Ginnie Mae II Pool 'MA3375', 3,000 %, fällig 20/01/2046	81	0,01
59 Freddie Mac Pool 'ZN0480', 3,500 %, fällig 01/10/2042	62	–	68 Ginnie Mae II Pool 'MA3521', 3,500 %, fällig 20/03/2046	71	–
4 Freddie Mac Pool 'ZS0823', 5,000 %, fällig 01/12/2034	4	–	308 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, fällig 20/04/2046	322	0,02
6 Freddie Mac Pool 'ZS2059', 5,500 %, fällig 01/04/2038	7	–	165 Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, fällig 20/05/2046	173	0,01
23 Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, fällig 01/12/2038	26	–	283 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, fällig 20/06/2046	296	0,02
104 Freddie Mac Pool 'ZS3204', 5,000 %, fällig 01/06/2041	114	0,01	171 Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, fällig 20/07/2046	179	0,01
63 Freddie Mac Pool 'ZS3412', 5,500 %, fällig 01/12/2038	70	–	104 Ginnie Mae II Pool 'MA3937', 3,500 %, fällig 20/09/2046	109	0,01
8 Freddie Mac Pool 'ZS4748', 4,000 %, fällig 01/12/2047	9	–	140 Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000 %, fällig 20/11/2046	144	0,01
135 Freddie Mac Pool 'ZS8669', 3,000 %, fällig 01/09/2032	139	0,01	105 Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, fällig 20/02/2047	108	0,01
142 Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000 %, fällig 01/10/2032	146	0,01	26 Ginnie Mae II Pool 'MA4381', 3,000 %, fällig 20/04/2047	27	–
32 Freddie Mac Pool 'ZS8779', 5,000 %, fällig 01/07/2025	35	–	1.870 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, fällig 20/06/2047	1.968	0,13
683 Freddie Mac Pool 'ZS9316', 3,500 %, fällig 01/01/2038	719	0,05	336 Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500 %, fällig 20/08/2047	359	0,02
309 Freddie Mac Pool 'ZT1107', 3,500 %, fällig 01/03/2043	326	0,02	19 Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000 %, fällig 20/11/2047	19	–
28 Freddie Mac Pool 'ZT1159', 3,500 %, fällig 01/02/2044	29	–	759 Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, fällig 20/11/2047	801	0,05
392 Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, fällig 01/01/2046	404	0,03	202 Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000 %, fällig 20/12/2047	206	0,01
857 Freddie Mac Pool 'ZT1493', 3,000 %, fällig 01/09/2048	877	0,06	321 Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, fällig 20/12/2047	339	0,02
782 Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500 %, fällig 01/04/2033	816	0,05	618 Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500 %, fällig 20/02/2048	644	0,04
592 Freddie Mac Pool 'ZT2230', 4,000 %, fällig 01/07/2048	618	0,04	288 Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, fällig 20/02/2048	304	0,02
65 Freddie Mac Reference REMIC R007, Class ZA, 6,000 %, fällig 15/05/2036	73	0,01	212 Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, fällig 20/03/2048	223	0,02
44 Freddie Mac REMICS 3621, Class SB, 6,039 %, fällig 15/01/2040 *	7	–	275 Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000 %, fällig 20/04/2048	288	0,02
230 Freddie Mac REMICS 4813, Class CJ, 3,000 %, fällig 15/08/2048	232	0,02	520 Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500 %, fällig 20/04/2048	550	0,04
446 Freddie Mac REMICS 5010, Class IK, 2,500 %, fällig 25/09/2050	62	–	622 Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, fällig 20/05/2048	658	0,04
1.136 Freddie Mac REMICS 5010, Class JL, 2,500 %, fällig 25/09/2050	181	0,01	203 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, fällig 20/07/2048	215	0,01
457 Freddie Mac REMICS 5013, Class IN, 2,500 %, fällig 25/09/2050	74	0,01	394 Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, fällig 20/10/2048	414	0,03
912 Freddie Mac REMICS 5018, Class MI, 2,000 %, fällig 25/10/2050	122	0,01	236 Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000 %, fällig 20/11/2048	251	0,02
247 Freddie Mac REMICS 5040, Class IB, 2,500 %, fällig 25/11/2050	33	–	172 Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, fällig 20/12/2048	181	0,01
1.494 Freddie Mac REMICS 5059, Class IB, 2,500 %, fällig 25/01/2051	246	0,02	164 Ginnie Mae II Pool 'MA5762', 3,500 %, fällig 20/02/2049	171	0,01
529 Freddie Mac REMICS 5069, Class MI, 2,500 %, fällig 25/02/2051	77	0,01	281 Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, fällig 20/03/2049	296	0,02
1.368 Freddie Mac REMICS 5140, Class NI, 2,500 %, fällig 25/05/2049	200	0,01	262 Ginnie Mae II Pool 'MA5819', 5,000 %, fällig 20/03/2049	279	0,02
1.082 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Series 2020 DNA2, Class M2, 144A, 2,037 %, fällig 25/02/2050 *	1.086	0,07	132 Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, fällig 20/04/2049	139	0,01
1.730 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA6, Series 2020 DNA6, Class M2, 144A, 2,049 %, fällig 25/12/2050 *	1.731	0,12	445 Ginnie Mae II Pool 'MA6342', 5,000 %, fällig 20/12/2049	474	0,03
53 Freddie Mac Strips 334, Class S7, 5,909 %, fällig 15/08/2044 *	9	–	271 Ginnie Mae II Pool 'MA6413', 5,000 %, fällig 20/01/2050	287	0,02
412 Freddie Mac Strips 353, Class S1, 5,809 %, fällig 15/12/2046 *	65	–	242 Ginnie Mae II Pool 'MA6603', 5,000 %, fällig 20/04/2050	259	0,02
1.310 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2015 HQ2, Class B, 8,137 %, fällig 25/05/2025 *	1.332	0,09	636 Ginnie Mae II Pool 'MA6999', 4,500 %, fällig 20/11/2050	670	0,05
1.976 FREMF 2012-K20 Mortgage Trust, Series 2012 K20, Class X2A, 144A, 0,200 %, fällig 25/05/2045	–	–	121 Ginnie Mae II Pool 'MA7056', 4,500 %, fällig 20/12/2050	127	0,01
34 Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, fällig 15/04/2040	38	–	191 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, fällig 20/09/2051	194	0,01
60 Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, fällig 15/05/2040	68	–	5.700 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ±	5.795	0,39
62 Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000 %, fällig 15/09/2042	65	–	1.400 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,500 % ±	1.445	0,10
472 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15/06/2048	499	0,03	243 Government National Mortgage Association, Series 2009 H01, Class FA, 1,312 %, fällig 20/11/2059 *	246	0,02
88 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15/09/2042	91	0,01	5 Government National Mortgage Association, Series 2010 42, Class BS, 6,318 %, fällig 20/04/2040 *	1	–
196 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15/09/2042	203	0,01	3 Government National Mortgage Association, Series 2010 85, Class HS, 6,488 %, fällig 20/01/2040 *	–	–
439 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15/10/2042	453	0,03	404 Government National Mortgage Association, Series 2010 H11, Class FA, 1,108 %, fällig 20/06/2060 *	409	0,03
281 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, fällig 15/10/2042	290	0,02	396 Government National Mortgage Association, Series 2010 H20, Class AF, 0,431 %, fällig 20/10/2060 *	395	0,03
2 Ginnie Mae I Pool 'AB9205', 3,000 %, fällig 15/11/2042	2	–	4 Government National Mortgage Association, Series 2010 H22, Class FE, 0,451 %, fällig 20/05/2059 *	4	–
242 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, fällig 15/11/2042	250	0,02	646 Government National Mortgage Association, Series 2010 H24, Class FA, 0,451 %, fällig 20/10/2060 *	646	0,04
20 Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500 %, fällig 20/10/2037	23	–	27 Government National Mortgage Association, Series 2010 H26, Class LF, 0,451 %, fällig 20/08/2058 *	27	–
24 Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500 %, fällig 20/01/2040	26	–	229 Government National Mortgage Association, Series 2011 H01, Class AF, 0,551 %, fällig 20/11/2060 *	229	0,02
28 Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500 %, fällig 20/05/2040	30	–	53 Government National Mortgage Association, Series 2011 H09, Class AF, 0,601 %, fällig 20/03/2061 *	53	–
96 Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000 %, fällig 20/07/2040	107	0,01	377 Government National Mortgage Association, Series 2013 107, Class AD, 2,766 %, fällig 16/11/2047 *	377	0,03
18 Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000 %, fällig 20/08/2040	20	–	10.272 Government National Mortgage Association, Series 2013 50, Class IO, 0,108 %, fällig 16/10/2048 *	31	–
13 Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000 %, fällig 20/09/2040	14	–	926 Government National Mortgage Association, Series 2014 169, Class IO, 0,643 %, fällig 16/10/2056 *	26	–
8 Ginnie Mae II Pool '4871', 6,000 %, fällig 20/11/2040	9	–	53 Government National Mortgage Association, Series 2014 17, Class AM, 3,369 %, fällig 16/06/2048 *	55	–
24 Ginnie Mae II Pool '4905', 6,000 %, fällig 20/12/2040	27	–	261 Government National Mortgage Association, Series 2014 176, Class IA, 4,000 %, fällig 20/11/2044	42	–
4 Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000 %, fällig 20/01/2041	4	–	2.164 Government National Mortgage Association, Series 2014 H20, Class FA, 0,531 %, fällig 20/10/2064 *	2.167	0,15
17 Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, fällig 20/02/2041	20	–			
203 Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, fällig 20/03/2041	223	0,02			
5 Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000 %, fällig 20/07/2040	6	–			
62 Ginnie Mae II Pool '783368', 4,500 %, fällig 20/07/2041	68	–			
134 Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, fällig 20/01/2046	141	0,01			
1.463 Ginnie Mae II Pool '784674', 3,500 %, fällig 20/04/2048	1.550	0,10			
132 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, fällig 20/10/2049	135	0,01			
487 Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, fällig 20/01/2050	496	0,03			
96 Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500 %, fällig 20/09/2048	101	0,01			

# Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>					
576	95	0,01	4.070	3.724	0,25
Government National Mortgage Association, Series 2015 167, Class OI, 4,000 %, fällig 16/04/2045			JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Class F, 144A, 3,041 %, fällig 15/12/2036 *		
869	29	-	1.945	2.014	0,14
Government National Mortgage Association, Series 2015 183, Class IO, 0,559 %, fällig 16/09/2057 *			JP Morgan Mortgage Trust 2017-5, Series 2017 5, Class A2, 144A, 3,061 %, fällig 26/10/2048 *		
220	54	-	230	230	0,02
Government National Mortgage Association, Series 2016 135, Class SB, 5,974 %, fällig 16/10/2046 *			JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Series 2018 4, Class A1, 144A, 3,500 %, fällig 25/10/2048 *		
965	187	0,01	30	31	-
Government National Mortgage Association, Series 2016 21, Class ST, 5,988 %, fällig 20/02/2046 *			JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, Series 2013 C17, Class B, 4,885 %, fällig 15/01/2047 *		
444	82	0,01	31	166	0,01
Government National Mortgage Association, Series 2016 84, Class IG, 4,500 %, fällig 16/11/2045			JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C31, Series 2015 C31, Class B, 4,621 %, fällig 15/08/2048 *		
985	40	-	73	36	-
Government National Mortgage Association, Series 2017 111, Class IO, 0,536 %, fällig 16/02/2059 *			ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Series 2007 5, Class AJ, 5,450 %, fällig 12/08/2048 *		
1.107	53	-	20	20	-
Government National Mortgage Association, Series 2017 157, Class IO, 0,636 %, fällig 16/12/2059 *			ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-9, Series 2007 9, Class AJ, 6,193 %, fällig 12/09/2049 *		
1.002	43	-	20	7	-
Government National Mortgage Association, Series 2017 28, Class IO, 0,654 %, fällig 16/02/2057 *			Morgan Stanley Capital I Trust 2007-IQ16, Series 2007 IQ16, Class AJ, 6,282 %, fällig 12/12/2049 *		
900	33	-	1.859	1.590	0,11
Government National Mortgage Association, Series 2017 41, Class IO, 0,631 %, fällig 16/07/2058 *			Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-2AR, Series 2005 2AR, Class B1, 0,687 %, fällig 25/04/2035 *		
124	12	-	280	282	0,02
Government National Mortgage Association, Series 2017 H15, Class KI, 2,199 %, fällig 20/07/2067 *			MSCG Trust 2015-ALDR, Series 2015 ALDR, Class A2, 144A, 3,462 %, fällig 07/06/2035 *		
5.031	318	0,02	2.870	2.827	0,19
Government National Mortgage Association, Series 2017 H18, Class BI, 1,615 %, fällig 20/09/2067 *			Natisis Commercial Mortgage Securities Trust 2019- FAME, Series 2019 FAME, Class A, 144A, 3,047 %, fällig 15/08/2036		
66	5	-	461	469	0,03
Government National Mortgage Association, Series 2017 H20, Class IB, 2,036 %, fällig 20/10/2067 *			New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Class A1B, 144A, 3,250 %, fällig 25/09/2056 *		
452	451	0,03	870	896	0,06
Government National Mortgage Association, Series 2018 H06, Class PF, 0,401 %, fällig 20/02/2068 *			New Residential Mortgage Loan Trust 2017-6, Series 2017 6A, Class A1, 144A, 4,000 %, fällig 27/08/2057 *		
805	803	0,05	1.122	1.065	0,07
Government National Mortgage Association, Series 2018 H07, Class FD, 0,401 %, fällig 20/05/2068 *			Prime Mortgage Trust 2006-DR1, Series 2006 DR1, Class 2A1, 144A, 5,500 %, fällig 25/05/2035		
385	393	0,03	133	135	0,01
Government National Mortgage Association, Series 2019 90, Class AB, 3,000 %, fällig 20/07/2049			Residential Asset Securitization Trust 2005-A15, Series 2005 A15, Class 1A4, 5,750 %, fällig 25/02/2036		
363	50	-	6	6	-
Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class IL, 2,500 %, fällig 20/08/2050			Sequoia Mortgage Trust 2004-10, Series 2004 10, Class A1A, 0,782 %, fällig 20/11/2034 *		
1.061	143	0,01	690	713	0,05
Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class NI, 2,500 %, fällig 20/08/2050			UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2, Series 2017 C2, Class A4, 3,487 %, fällig 15/08/2050		
528	73	-	82.114	3.645	0,25
Government National Mortgage Association, Series 2020 127, Class IN, 2,500 %, fällig 20/08/2050			UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C9, Series 2018 C9, Class XA, 0,872 %, fällig 15/03/2051 *		
456	62	-	100	101	0,01
Government National Mortgage Association, Series 2020 129, Class IE, 2,500 %, fällig 20/09/2050			VNDO 2012-6AVE Mortgage Trust, Series 2012 6AVE, Class A, 144A, 2,996 %, fällig 15/11/2030		
16.967	1.288	0,09	1.930	1.911	0,13
Government National Mortgage Association, Series 2020 157, Class IO, 0,955 %, fällig 16/06/2062 *			WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR6 Trust, Series 2005 AR6, Class 2A1A, 0,647 %, fällig 25/04/2045 *		
277	39	-	193	189	0,01
Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class IH, 2,500 %, fällig 20/10/2050			WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA2 Trust, Series 2007 OA2, Class 2A, 1,473 %, fällig 25/03/2047 *		
361	47	-	125	124	0,01
Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class VI, 2,500 %, fällig 20/10/2050			Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Series 2015 SBC5, Class A, 144A, 4,104 %, fällig 14/09/2022 *		
1.549	201	0,01	20	20	-
Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class YI, 2,500 %, fällig 20/10/2050			Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2013-LC12, Series 2013 LC12, Class B, 4,305 %, fällig 15/07/2046 *		
12.597	1.284	0,09	250	253	0,02
Government National Mortgage Association, Series 2020 178, Class IO, 1,412 %, fällig 16/10/2060 *			Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC20, Series 2015 LC20, Class AS, 3,467 %, fällig 15/04/2050		
3.283	345	0,02	160	163	0,01
Government National Mortgage Association, Series 2020 181, Class VI, 2,000 %, fällig 20/12/2050			Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1, Series 2015 NX1, Class AS, 3,406 %, fällig 15/05/2048		
965	137	0,01	5.194	259	0,02
Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class MI, 3,500 %, fällig 20/04/2050			Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RB1, Series 2017 RB1, Class XA, 1,179 %, fällig 15/03/2050 *		
340	50	-	2.330	2.338	0,16
Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class NI, 3,500 %, fällig 20/04/2050			WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013-C14, Series 2013 C14, Class B, 3,841 %, fällig 15/06/2046 *		
1.016	1.057	0,07	2.010	2.021	0,14
Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class FL, 1,312 %, fällig 20/05/2070 *			WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21, Series 2014 C21, Class B, 4,213 %, fällig 15/08/2047 *		
216	221	0,01	<b>Gesamtsumme hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 301.837 USD)</b>		
Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class NF, 1,412 %, fällig 20/04/2070 *			291.661		
129	130	0,01	<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 32,53 % (28. Februar 2021: 34,30 %)</b>		
Government National Mortgage Association, Series 2020 H12, Class F, 0,662 %, fällig 20/07/2070 *			<b>Australien – 0,21 % (28. Februar 2021: 0,30 %)</b>		
228	229	0,02	300 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, fällig 30/09/2043		
Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Class FA, 0,612 %, fällig 20/07/2070 *			200 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 3,900 %, fällig 12/07/2047		
132	132	0,01	10 Glencore Funding LLC, 144A, 4,125 %, fällig 30/05/2023		
Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Class FC, 0,612 %, fällig 20/07/2070 *			1.970 Glencore Funding LLC, 144A, 4,125 %, fällig 12/03/2024		
28.564	2.495	0,17	430 Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, fällig 27/03/2027		
Government National Mortgage Association, Series 2021 5, Class IO, 1,091 %, fällig 16/01/2061 *			3.076		
3.006	2.715	0,18	<b>Belgien – 0,36 % (28. Februar 2021: 0,51 %)</b>		
GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Class A, 144A, 1,741 %, fällig 15/09/2031 *			1.990 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650 %, fällig 01/02/2026		
2.278	1.867	0,13	40 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, fällig 01/02/2046		
GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Class B, 144A, 2,941 %, fällig 15/09/2031 *			680 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000 %, fällig 13/04/2028		
80	82	0,01	280 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 01/06/2030		
GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16, Series 2013 GC16, Class B, 5,161 %, fällig 10/11/2046 *			840 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01/06/2040		
929	16	-	897		
GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20, Series 2014 GC20, Class XA, 0,987 %, fällig 10/04/2047 *					
19	20	-			
HarborView Mortgage Loan Trust 2007-7, Series 2007 7, Class 2A1A, 1,187 %, fällig 25/10/2037 *					
3.980	857	0,06			
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHH, Series 2018 PHH, Class F, 144A, 4,660 %, fällig 15/06/2035 *†					

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Belgien – (Fortsetzung)</b>					
100	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15/04/2048	110	0,01		
890	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, fällig 23/01/2049	1.105	0,07		
160	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01/06/2050	176	0,01		
		5.431	0,36		
<b>Brasilien — 0,73 % (28. Februar 2021: 0,56 %)</b>					
57	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17/03/2024	60	–		
6.440	Petrobras Global Finance BV, 5,299 %, fällig 27/01/2025	6.771	0,46		
390	Petrobras Global Finance BV, 7,375 %, fällig 17/01/2027	438	0,03		
480	Petrobras Global Finance BV, 5,500 %, fällig 10/06/2051	410	0,03		
840	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05/06/2115	781	0,05		
190	Suzano Austria GmbH, 3,750 %, fällig 15/01/2031	178	0,01		
2.050	Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15/01/2032	1.823	0,12		
60	Vale Canada Ltd, 7,200 %, fällig 15/09/2032	72	0,01		
210	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 21/11/2036	259	0,02		
		10.792	0,73		
<b>Kanada — 0,17 % (28. Februar 2021: 0,41 %)</b>					
120	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15/01/2028	117	0,01		
110	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15/02/2029	104	0,01		
160	Bank of Montreal, 3,803 %, fällig 15/12/2032 *	164	0,01		
290	Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30/05/2041	362	0,02		
500	Barrick North America Finance LLC, 5,750 %, fällig 01/05/2043	624	0,04		
650	Canadian Pacific Railway Co, 3,100 %, fällig 02/12/2051	590	0,04		
120	MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01/02/2029	121	0,01		
20	Teck Resources Ltd, 6,000 %, fällig 15/08/2040	24	–		
390	Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig 15/12/2027	409	0,03		
		2.515	0,17		
<b>China — 0,25 % (28. Februar 2021: 0,19 %)</b>					
370	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144A, 2,700 %, fällig 01/05/2025	373	0,03		
2.450	Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13/07/2031	2.056	0,14		
1.660	Prosus NV, 144A, 3,832 %, fällig 08/02/2051	1.257	0,08		
		3.686	0,25		
<b>Kolumbien — 0,13 % (28. Februar 2021: 0,06 %)</b>					
1.210	Ecopetrol SA, 4,625 %, fällig 02/11/2031	1.086	0,07		
960	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28/05/2045	838	0,06		
		1.924	0,13		
<b>Dänemark — 0,02 % (28. Februar 2021: 0,26 %)</b>					
280	Danske Bank A/S, 144A, 3,244 %, fällig 20/12/2025 *	283	0,02		
<b>Frankreich — 0,53 % (28. Februar 2021: 0,76 %)</b>					
280	BNP Paribas SA, 144A, 3,375 %, fällig 09/01/2025	286	0,02		
310	BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, fällig 10/01/2025 *	322	0,02		
1.660	BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09/06/2026 *	1.627	0,11		
620	BNP Paribas SA, 144A, 4,625 %, fällig 13/03/2027	654	0,04		
1.580	BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14/08/2028	1.684	0,11		
360	BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, fällig 10/01/2030 *	400	0,03		
550	BNP Paribas SA, 144A, 4,375 %, fällig 01/03/2033 *	567	0,04		
500	BPCE SA, 144A, 5,150 %, fällig 21/07/2024	525	0,04		
590	Credit Agricole SA, 144A, 4,000 %, fällig 10/01/2033 *	596	0,04		
240	Danone SA, 144A, 2,947 %, fällig 02/11/2026	245	0,02		
940	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 3,750 %, fällig 17/09/2024	964	0,06		
		7.870	0,53		
<b>Indien — 0,10 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
330	Reliance Industries Ltd, 144A, 2,875 %, fällig 12/01/2032	309	0,02		
1.270	Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 12/01/2052	1.171	0,08		
		1.480	0,10		
<b>Irland — 0,24 % (28. Februar 2021: 0,08 %)</b>					
850	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,150 %, fällig 15/02/2024	857	0,06		
1.170	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, fällig 29/10/2026	1.129	0,08		
1.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, fällig 29/10/2028	964	0,06		
480	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30/01/2032	456	0,03		
43	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,250 %, fällig 15/08/2022	44	–		
50	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 15/03/2023	51	–		
120	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 15/02/2024	126	0,01		
		3.627	0,24		
<b>Israel — 0,38 % (28. Februar 2021: 0,36 %)</b>					
1.240	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, fällig 18/12/2022	1.235	0,08		
1.200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21/07/2023	1.177	0,08		
210	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,000 %, fällig 15/04/2024	214	0,02		
590	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig 31/01/2025	620	0,04		
1.200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01/10/2026	1.096	0,08		
200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig 09/05/2027	193	0,01		
1.120	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09/05/2029	1.075	0,07		
		5.610	0,38		
<b>Italien — 0,20 % (28. Februar 2021: 0,37 %)</b>					
830	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,375 %, fällig 12/01/2023	839	0,06		
1.160	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, fällig 26/06/2024	1.195	0,08		
850	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig 15/01/2026	896	0,06		
		2.930	0,20		
<b>Japan — 0,18 % (28. Februar 2021: 0,33 %)</b>					
580	Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,043 %, fällig 15/09/2023	586	0,04		
1.810	Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,522 %, fällig 17/09/2025	1.833	0,12		
230	Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345 %, fällig 17/09/2027	237	0,02		
		2.656	0,18		
<b>Kasachstan — 0,05 % (28. Februar 2021: 0,04 %)</b>					
200	KazMunayGas National Co JSC, 144A, 5,750 %, fällig 19/04/2047	209	0,01		
520	KazMunayGas National Co JSC, 144A, 6,375 %, fällig 24/10/2048	579	0,04		
		788	0,05		
<b>Kuwait — 0,04 % (28. Februar 2021: 0,03 %)</b>					
520	Equate Petrochemical BV, 144A, 4,250 %, fällig 03/11/2026	538	0,04		
<b>Luxemburg — 0,01 % (28. Februar 2021: 0,05 %)</b>					
150	ArcelorMittal SA, 7,000 %, fällig 15/10/2039	183	0,01		
<b>Macau — 0,22 % (28. Februar 2021: 0,19 %)</b>					
540	Sands China Ltd, 5,125 %, fällig 08/08/2025	537	0,04		
710	Sands China Ltd, 144A, 2,300 %, fällig 08/03/2027	618	0,04		
580	Sands China Ltd, 5,400 %, fällig 08/08/2028	571	0,04		
730	Sands China Ltd, 144A, 2,850 %, fällig 08/03/2029	615	0,04		
1.090	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26/08/2028	951	0,06		
		3.292	0,22		
<b>Mexiko — 0,09 % (28. Februar 2021: 0,13 %)</b>					
20	America Movil SAB de CV, 6,375 %, fällig 01/03/2035	26	–		
20	America Movil SAB de CV, 6,125 %, fällig 15/11/2037	25	–		
590	Petroleos Mexicanos, 4,250 %, fällig 15/01/2025	590	0,04		
260	Petroleos Mexicanos, 6,875 %, fällig 04/08/2026	276	0,02		
25	Petroleos Mexicanos, 6,625 %, fällig 15/06/2035	23	–		
510	Petroleos Mexicanos, 5,500 %, fällig 27/06/2044	391	0,03		
		1.331	0,09		
<b>Marokko — 0,14 % (28. Februar 2021: 0,08 %)</b>					
1.030	OCF SA, 144A, 4,500 %, fällig 22/10/2025	1.040	0,07		
740	OCF SA, 144A, 3,750 %, fällig 23/06/2031	653	0,04		
480	OCF SA, 144A, 5,125 %, fällig 23/06/2051	389	0,03		
		2.082	0,14		
<b>Niederlande — 0,36 % (28. Februar 2021: 0,61 %)</b>					
200	ABN AMRO Bank NV, 144A, 4,750 %, fällig 28/07/2025	211	0,01		
1.840	Coöperatieve Rabobank UA, 4,375 %, fällig 04/08/2025	1.927	0,13		
250	Coöperatieve Rabobank UA, 144A, 1,339 %, fällig 24/06/2026 *	241	0,02		
160	Shell International Finance BV, 4,550 %, fällig 12/08/2043	183	0,01		

# Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Niederlande – (Fortsetzung)</b>					
770 Shell International Finance BV, 4,375 %, fällig 11/05/2045	855	0,06	872 Abbott Laboratories, 3,750 %, fällig 30/11/2026	931	0,06
270 Shell International Finance BV, 4,000 %, fällig 10/05/2046	287	0,02	230 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30/11/2036	273	0,02
1.770 Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06/04/2050	1.699	0,11	420 Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig 30/11/2046	519	0,03
	5.403	0,36	120 AbbVie Inc, 2,900 %, fällig 06/11/2022	121	0,01
<b>Peru — 0,18 % (28. Februar 2021: 0,18 %)</b>			2.460 AbbVie Inc, 2,300 %, fällig 21/11/2022	2.476	0,17
2.290 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08/11/2042	2.670	0,18	140 AbbVie Inc, 3,750 %, fällig 14/11/2023	144	0,01
<b>Katar — 0,22 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			2.150 AbbVie Inc, 2,600 %, fällig 21/11/2024	2.172	0,15
1.760 Qatar Energy, 144A, 2,250 %, fällig 12/07/2031	1.661	0,11	590 AbbVie Inc, 3,800 %, fällig 15/03/2025	614	0,04
870 Qatar Energy, 144A, 3,125 %, fällig 12/07/2041	820	0,05	250 AbbVie Inc, 3,600 %, fällig 14/05/2025	258	0,02
880 Qatar Energy, 144A, 3,300 %, fällig 12/07/2051	830	0,06	520 AbbVie Inc, 2,950 %, fällig 21/11/2026	530	0,04
	3.311	0,22	1.530 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21/11/2029	1.551	0,10
<b>Südafrika — 0,08 % (28. Februar 2021: 0,15 %)</b>			7 AbbVie Inc, 4,750 %, fällig 15/03/2045	8	–
670 Anglo American Capital Plc, 144A, 3,625 %, fällig 11/09/2024	688	0,05	110 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21/11/2049	117	0,01
200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10/04/2027	215	0,01	90 Aetna Inc, 2,800 %, fällig 15/06/2023	91	0,01
290 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,000 %, fällig 11/09/2027	305	0,02	450 Air Lease Corp, 3,375 %, fällig 01/07/2025	455	0,03
	1.208	0,08	160 Alphabet Inc, 0,450 %, fällig 15/08/2025	152	0,01
<b>Spanien — 0,15 % (28. Februar 2021: 0,18 %)</b>			310 Alphabet Inc, 0,800 %, fällig 15/08/2027	287	0,02
1.200 Banco Santander SA, 2,746 %, fällig 28/05/2025	1.202	0,08	370 Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15/08/2030	334	0,02
500 Telefonica Emisiones SA, 4,103 %, fällig 08/03/2027	529	0,04	600 Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15/08/2050	486	0,03
210 Telefonica Emisiones SA, 5,213 %, fällig 08/03/2047	229	0,01	170 Altria Group Inc, 2,350 %, fällig 06/05/2025	170	0,01
260 Telefonica Emisiones SA, 4,895 %, fällig 06/03/2048	273	0,02	846 Altria Group Inc, 4,400 %, fällig 14/02/2026	899	0,06
	2.233	0,15	17 Altria Group Inc, 4,800 %, fällig 14/02/2029	18	–
<b>Schweiz — 0,47 % (28. Februar 2021: 0,59 %)</b>			160 Altria Group Inc, 2,450 %, fällig 04/02/2032	143	0,01
710 Credit Suisse AG/New York NY, 2,950 %, fällig 09/04/2025	720	0,05	160 Altria Group Inc, 5,800 %, fällig 14/02/2039	176	0,01
700 Credit Suisse Group AG, 144A, 2,593 %, fällig 11/09/2025 *	697	0,05	330 Altria Group Inc, 3,875 %, fällig 16/09/2046	284	0,02
610 Credit Suisse Group AG, 144A, 2,193 %, fällig 05/06/2026 *	593	0,04	1.990 Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14/02/2049	2.215	0,15
670 Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01/04/2031 *	696	0,05	76 Altria Group Inc, 6,200 %, fällig 14/02/2059	85	0,01
720 Credit Suisse Group AG, 144A, 3,091 %, fällig 14/05/2032 *	683	0,04	790 Amazon.com Inc, 0,800 %, fällig 03/06/2025	762	0,05
210 Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 15/11/2041	257	0,02	970 Amazon.com Inc, 1,200 %, fällig 03/06/2027	923	0,06
200 UBS AG/London, 144A, 4,500 %, fällig 26/06/2048	226	0,01	660 Amazon.com Inc, 3,150 %, fällig 22/08/2027	690	0,05
820 UBS Group AG, 144A, 4,253 %, fällig 23/03/2028	872	0,06	510 Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03/06/2030	473	0,03
2.090 UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	2.177	0,15	260 Amazon.com Inc, 2,100 %, fällig 12/05/2031	251	0,02
	6.921	0,47	2.240 Amazon.com Inc, 3,875 %, fällig 22/08/2037	2.456	0,17
<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,07 % (28. Februar 2021: 0,08 %)</b>			340 Amazon.com Inc, 4,950 %, fällig 05/12/2044	423	0,03
200 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, fällig 25/09/2048	224	0,01	320 Amazon.com Inc, 4,050 %, fällig 22/08/2047	357	0,02
760 DP World Ltd/United Arab Emirates, 5,625 %, fällig 25/09/2048	850	0,06	790 Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03/06/2050	684	0,05
	1.074	0,07	140 Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22/08/2057	162	0,01
<b>Großbritannien — 0,73 % (28. Februar 2021: 1,18 %)</b>			5 Ambac Assurance Corp, 144A, 5,100 %, Perpetual	6	–
410 Barclays Plc, 4,972 %, fällig 16/05/2029 *	444	0,03	370 American International Group Inc, 2,500 %, fällig 30/06/2025	372	0,03
2.610 Barclays Plc, 5,088 %, fällig 20/06/2030 *	2.787	0,19	70 American International Group Inc, 3,750 %, fällig 10/07/2025	73	–
160 BAT Capital Corp, 3,557 %, fällig 15/08/2027	161	0,01	330 Amgen Inc, 3,625 %, fällig 22/05/2024	341	0,02
1.580 BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig 15/08/2047	1.462	0,10	34 Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15/06/2051	38	–
430 HSBC Holdings Plc, 4,250 %, fällig 18/08/2025	447	0,03	180 Anthem Inc, 3,125 %, fällig 15/05/2022	181	0,01
330 HSBC Holdings Plc, 4,300 %, fällig 08/03/2026	349	0,02	530 Anthem Inc, 2,950 %, fällig 01/12/2022	536	0,04
400 HSBC Holdings Plc, 4,041 %, fällig 13/03/2028 *	415	0,03	200 Anthem Inc, 3,350 %, fällig 01/12/2024	206	0,01
400 HSBC Holdings Plc, 4,583 %, fällig 19/06/2029 *	426	0,03	370 Anthem Inc, 3,650 %, fällig 01/12/2027	766	0,05
200 HSBC Holdings Plc, 4,950 %, fällig 31/03/2030	222	0,01	270 Apache Corp, 7,750 %, fällig 15/12/2029	315	0,02
340 HSBC Holdings Plc, 6,500 %, fällig 02/05/2036	430	0,03	17 Apache Corp, 6,000 %, fällig 15/01/2037	19	–
820 Lloyds Banking Group Plc, 4,650 %, fällig 24/03/2026	865	0,06	1.160 Apache Corp, 5,100 %, fällig 01/09/2040	1.162	0,08
780 Lloyds Banking Group Plc, 4,375 %, fällig 22/03/2028	833	0,05	60 Apache Corp, 5,250 %, fällig 01/02/2042	59	–
630 NatWest Group Plc, 4,269 %, fällig 22/03/2025 *	652	0,04	510 Apache Corp, 4,750 %, fällig 15/04/2043	487	0,03
230 NatWest Group Plc, 4,892 %, fällig 18/05/2029 *	251	0,02	180 Apache Corp, 4,250 %, fällig 15/01/2044	161	0,01
250 NatWest Group Plc, 5,076 %, fällig 27/01/2030 *	276	0,02	290 Apache Corp, 5,350 %, fällig 01/07/2049	289	0,02
290 Reynolds American Inc, 5,850 %, fällig 15/08/2045	314	0,02	1.190 Apple Inc, 1,125 %, fällig 11/05/2025	1.161	0,08
420 Standard Chartered Plc, 144A, 5,700 %, fällig 26/03/2044	472	0,03	720 Apple Inc, 2,450 %, fällig 04/08/2026	731	0,05
110 Vodafone Group Plc, 5,250 %, fällig 30/05/2048	126	0,01	400 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 15/02/2027	422	0,03
	10.932	0,73	1.300 AT&T Inc, 2,300 %, fällig 01/06/2027	1.284	0,09
<b>USA — 26,22 % (28. Februar 2021: 26,59 %)</b>			510 AT&T Inc, 1,650 %, fällig 01/02/2028	481	0,03
470 3M Co, 2,375 %, fällig 26/08/2029	460	0,03	60 AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01/02/2032	55	–
130 3M Co, 3,050 %, fällig 15/04/2030	133	0,01	180 AT&T Inc, 2,550 %, fällig 01/12/2033	167	0,01
920 3M Co, 3,700 %, fällig 15/04/2050	947	0,06	170 AT&T Inc, 5,350 %, fällig 01/09/2040	200	0,01
			190 AT&T Inc, 5,550 %, fällig 15/08/2041	227	0,02
			1.460 AT&T Inc, 3,100 %, fällig 01/02/2043	1.306	0,09
			161 AT&T Inc, 4,350 %, fällig 15/06/2045	167	0,01
			1.218 AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09/03/2048	1.307	0,09
			379 AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15/09/2053	347	0,02
			689 AT&T Inc, 3,550 %, fällig 15/09/2055	626	0,04
			70 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 01/12/2057	66	–
			465 AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15/09/2059	423	0,03
			400 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15/09/2031	368	0,02
			280 Bank of America Corp, 3,300 %, fällig 11/01/2023	285	0,02
			264 Bank of America Corp, 3,004 %, fällig 20/12/2023 *	266	0,02
			680 Bank of America Corp, 3,550 %, fällig 05/03/2024 *	691	0,05
			330 Bank of America Corp, 4,000 %, fällig 01/04/2024 *	343	0,02
			520 Bank of America Corp, 4,200 %, fällig 26/08/2024	542	0,04
			470 Bank of America Corp, 4,000 %, fällig 22/01/2025	488	0,03
			130 Bank of America Corp, 4,450 %, fällig 03/03/2026	139	0,01
			830 Bank of America Corp, 3,500 %, fällig 19/04/2026	860	0,06
			1.510 Bank of America Corp, 1,319 %, fällig 19/06/2026 *	1.444	0,10
			1.550 Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22/10/2026	1.658	0,11
			940 Bank of America Corp, 3,593 %, fällig 21/07/2028 *	972	0,07
			1.770 Bank of America Corp, 3,419 %, fällig 20/12/2028 *	1.811	0,12

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
			690		0,04
			700		0,05
			340		0,02
			240		0,02
			80		0,01
			950	1.024	0,07
			140		0,01
			232		0,02
			290		0,02
			2.980	3.234	0,22
			270		0,02
			270		0,02
			50		–
			250		0,02
			680		0,05
			330		0,02
			440		0,03
			220		0,02
			490		0,03
			110		0,01
			2.130	2.277	0,15
			60		–
			1.360	1.399	0,09
			1.750	1.843	0,12
			2.300	2.423	0,16
			1.590	1.724	0,12
			1.120	1.071	0,07
			880	830	0,06
			1.456	2.281	0,15
			255	301	0,02
			100	101	0,01
			390	405	0,03
			90	91	0,01
			720	759	0,05
			670	643	0,04
			20	18	–
			280	246	0,02
			130	137	0,01
			640	660	0,04
			280	291	0,02
			2.140	2.322	0,16
			390	403	0,03
			1.420	1.564	0,11
			60	66	–
			60	74	0,01
			13	17	–
			1.540	1.571	0,11
			80	76	0,01
			80	81	0,01
			80	75	0,01
			14	14	–
			110	113	0,01
			203	207	0,01
			240	201	0,01
			329	286	0,02
			66	69	–
			477	402	0,03
			74	62	–
			20	21	–
			350	374	0,03
			720	795	0,05
			85	109	0,01
			240	247	0,02
			190	196	0,01
			640	681	0,05
			47	47	–
			300	307	0,02
			130	133	0,01
			290	277	0,02
			1.160	1.200	0,08
			390	436	0,03
			100	101	0,01
			1.020	981	0,07
			340	316	0,02
			210	218	0,01
4.250	4.447	0,30			
1.800	1.887	0,13			
1.500	1.472	0,10			
2.290	2.170	0,15			
560	623	0,04			
2.260	2.430	0,16			
380	374	0,03			
	30	–			
435	446	0,03			
26	27	–			
555	621	0,04			
600	675	0,05			
1.330	1.486	0,10			
2.010	2.138	0,14			
680	664	0,04			
150	151	0,01			
320	316	0,02			
200	198	0,01			
690	683	0,05			
1.780	1.967	0,13			
2.220	2.081	0,14			
180	167	0,01			
810	945	0,06			
1.290	1.201	0,08			
1.870	2.225	0,15			
20	24	–			
330	342	0,02			
1.150	1.178	0,08			
440	459	0,03			
1.400	1.199	0,08			
43	43	–			
240	241	0,02			
120	121	0,01			
881	902	0,06			
194	205	0,01			
810	844	0,06			
2.280	2.403	0,16			
531	651	0,04			
2.120	1.966	0,13			
160	158	0,01			
850	837	0,06			
30	29	–			
50	48	–			
70	68	–			
1.840	1.751	0,12			
300	309	0,02			
290	279	0,02			
2.210	2.344	0,16			
1.550	1.618	0,11			
1.200	1.306	0,09			
500	524	0,04			
240	207	0,01			
260	311	0,02			
1.000	1.107	0,07			
210	206	0,01			
400	409	0,03			
130	128	0,01			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
1.790 Coterra Energy Inc, 144A, 3,900 %, fällig 15/05/2027	1.866	0,13	1.000 FirstEnergy Corp, Series C, 5,350 %, fällig 15/07/2047	1.058	0,07
560 Coterra Energy Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15/03/2029	602	0,04	760 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12/02/2032	718	0,05
300 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01/12/2030	270	0,02	150 Ford Motor Co, 4,750 %, fällig 15/01/2043	145	0,01
220 CVS Health Corp, 2,750 %, fällig 01/12/2022	222	0,01	400 Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, fällig 16/06/2025	419	0,03
761 CVS Health Corp, 3,875 %, fällig 20/07/2025	796	0,05	600 Ford Motor Credit Co LLC, 4,125 %, fällig 17/08/2027	605	0,04
220 CVS Health Corp, 3,625 %, fällig 01/04/2027	231	0,02	260 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig 16/02/2028	245	0,02
268 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25/03/2028	290	0,02	360 Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, fällig 03/05/2029	380	0,03
530 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01/04/2030	556	0,04	890 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13/11/2030	884	0,06
500 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15/04/2031	462	0,03	500 Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, fällig 17/06/2031	482	0,03
400 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25/03/2038	448	0,03	340 Fox Corp, 4,030 %, fällig 25/01/2024	352	0,02
220 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01/04/2040	227	0,02	2.040 Fox Corp, 5,476 %, fällig 25/01/2039	2.382	0,16
440 CVS Health Corp, 5,125 %, fällig 20/07/2045	510	0,03	10 Freeport-McMoRan Inc, 3,875 %, fällig 15/03/2023	10	–
3.700 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25/03/2048	4.327	0,29	30 Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, fällig 14/11/2024	31	–
70 CVS Health Corp, 4,250 %, fällig 01/04/2050	75	0,01	260 Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig 01/08/2030	269	0,02
16 CVS Pass-Through Trust, 144A, 5,298 %, fällig 11/01/2027	16	–	970 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15/03/2043	1.117	0,08
18 CVS Pass-Through Trust, 6,036 %, fällig 10/12/2028	20	–	746 GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418 %, fällig 15/11/2035	840	0,06
32 CVS Pass-Through Trust, 6,943 %, fällig 10/11/2030	37	–	230 General Dynamics Corp, 3,250 %, fällig 01/04/2025	237	0,02
150 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03/11/2036	182	0,01	90 General Dynamics Corp, 3,500 %, fällig 15/05/2025	93	0,01
140 Deere & Co, 3,100 %, fällig 15/04/2030	145	0,01	40 General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01/04/2040	45	–
740 Deere & Co, 3,750 %, fällig 15/04/2050	786	0,05	330 General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01/04/2050	380	0,03
190 Delta Air Lines Inc, 3,800 %, fällig 19/04/2023	192	0,01	124 General Electric Co, 6,750 %, fällig 15/03/2032	160	0,01
410 Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig 28/10/2024	405	0,03	240 General Motors Co, 5,400 %, fällig 02/10/2023	252	0,02
3.560 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01/05/2025	3.957	0,27	440 General Motors Co, 6,125 %, fällig 01/10/2025	487	0,03
810 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15/01/2026	910	0,06	50 General Motors Co, 5,150 %, fällig 01/04/2038	54	–
330 Devon Energy Corp, 8,250 %, fällig 01/08/2023	355	0,02	230 General Motors Co, 6,250 %, fällig 02/10/2043	280	0,02
530 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15/12/2025	591	0,04	330 General Motors Co, 5,950 %, fällig 01/04/2049	395	0,03
260 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15/01/2030	272	0,02	40 General Motors Financial Co Inc, 3,450 %, fällig 10/04/2022	40	–
40 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15/07/2041	47	–	10 General Motors Financial Co Inc, 4,250 %, fällig 15/05/2023	10	–
240 Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15/05/2042	259	0,02	50 General Motors Financial Co Inc, 4,350 %, fällig 17/01/2027	53	–
1.950 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15/06/2045	2.178	0,15	200 Gilead Sciences Inc, 3,500 %, fällig 01/02/2025	207	0,01
50 Diamondback Energy Inc, 3,250 %, fällig 01/12/2026	51	–	250 Gilead Sciences Inc, 4,750 %, fällig 01/03/2046	284	0,02
340 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01/12/2029	344	0,02	10 GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,250 %, fällig 01/06/2025	11	–
450 DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15/11/2024	450	0,03	80 GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,375 %, fällig 15/04/2026	86	0,01
410 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01/07/2026	416	0,03	3 Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, Perpetual *	3	–
230 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01/12/2026	226	0,02	440 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,200 %, fällig 23/02/2023	446	0,03
170 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01/06/2029	144	0,01	800 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,850 %, fällig 08/07/2024	828	0,06
60 Dollar General Corp, 3,250 %, fällig 15/04/2023	61	–	760 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01/04/2025	782	0,05
130 Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, fällig 15/02/2040	158	0,01	720 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, fällig 21/10/2025	757	0,05
640 Duke Energy Ohio Inc, 3,650 %, fällig 01/02/2029	672	0,05	1.970 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16/11/2026	2.019	0,14
660 Eaton Corp, 2,750 %, fällig 02/11/2022	667	0,04	4.750 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, fällig 23/04/2029 *	4.935	0,33
420 Eaton Corp, 4,150 %, fällig 02/11/2042	452	0,03	2.650 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, fällig 01/05/2029 *	2.812	0,19
36 El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, fällig 15/06/2032	48	–	3.090 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,650 %, fällig 21/10/2032 *	2.933	0,20
10 Energy Transfer LP, 7,600 %, fällig 01/02/2024	11	–	670 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01/02/2041	880	0,06
800 Energy Transfer LP, 4,500 %, fällig 15/04/2024	832	0,06	160 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,210 %, fällig 22/04/2042 *	149	0,01
210 Energy Transfer LP, 4,950 %, fällig 15/06/2028	226	0,02	380 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,908 %, fällig 21/07/2042 *	338	0,02
530 Energy Transfer LP, 5,250 %, fällig 15/04/2029	582	0,04	560 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22/05/2045	673	0,05
1.530 Energy Transfer LP, 3,750 %, fällig 15/05/2030	1.556	0,10	540 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig 21/10/2045	615	0,04
60 Energy Transfer LP, 5,300 %, fällig 01/04/2044	62	–	11 Halliburton Co, 3,800 %, fällig 15/11/2025	12	–
980 Energy Transfer LP, 5,400 %, fällig 01/10/2047	1.051	0,07	60 Halliburton Co, 4,850 %, fällig 15/11/2035	66	–
750 Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig 15/04/2049	868	0,06	320 Halliburton Co, 5,000 %, fällig 15/11/2045	357	0,02
590 Energy Transfer LP, Series F, 6,750 %, Perpetual *	566	0,04	50 Hanesbrands Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/05/2024	51	–
1.080 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig 16/10/2028	1.166	0,08	200 Hanesbrands Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15/05/2026	204	0,01
670 Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig 31/01/2030	660	0,04	150 HCA Inc, 4,750 %, fällig 01/05/2023	154	0,01
2.150 Enterprise Products Operating LLC, 4,200 %, fällig 31/01/2050	2.165	0,15	100 HCA Inc, 5,000 %, fällig 15/03/2024	105	0,01
420 Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, fällig 31/01/2051	392	0,03	270 HCA Inc, 5,375 %, fällig 01/02/2025	286	0,02
90 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31/01/2060	85	0,01	10 HCA Inc, 5,250 %, fällig 15/04/2025	11	–
240 EOG Resources Inc, 4,150 %, fällig 15/01/2026	256	0,02	170 HCA Inc, 5,250 %, fällig 15/06/2026	184	0,01
190 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15/04/2030	210	0,01	30 HCA Inc, 5,375 %, fällig 01/09/2026	32	–
690 EOG Resources Inc, 3,900 %, fällig 01/04/2035	742	0,05	90 HCA Inc, 5,625 %, fällig 01/09/2028	100	0,01
180 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15/04/2050	219	0,01	660 HCA Inc, 5,875 %, fällig 01/02/2029	739	0,05
500 EQT Corp, 3,000 %, fällig 01/10/2022	505	0,03	640 HCA Inc, 3,500 %, fällig 01/09/2030	635	0,04
50 EQT Corp, 6,625 %, fällig 01/02/2025	54	–	400 HCA Inc, 5,500 %, fällig 15/06/2047	469	0,03
20 EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15/05/2026	20	–	180 Hershey Co/The, 0,900 %, fällig 01/06/2025	174	0,01
850 EQT Corp, 3,900 %, fällig 01/10/2027	860	0,06	500 Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01/05/2025	517	0,03
200 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15/01/2029	211	0,01			
420 EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15/05/2031	409	0,03			
60 Exxon Mobil Corp, 1,571 %, fällig 15/04/2023	60	–			
1.700 Exxon Mobil Corp, 2,992 %, fällig 19/03/2025	1.746	0,12			
180 Exxon Mobil Corp, 3,043 %, fällig 01/03/2026	186	0,01			
650 Exxon Mobil Corp, 3,482 %, fällig 19/03/2030	687	0,05			
1.130 Exxon Mobil Corp, 4,114 %, fällig 01/03/2046	1.236	0,08			
80 Exxon Mobil Corp, 4,327 %, fällig 19/03/2050	91	0,01			
270 FirstEnergy Corp, Series A, 1,600 %, fällig 15/01/2026	254	0,02			
3.460 FirstEnergy Corp, Series B, 4,400 %, fällig 15/07/2027	3.589	0,24			
1.948 FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, fällig 15/11/2031	2.442	0,16			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
200 Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,750 %, fällig 01/05/2028	209	0,01	100 McDonald's Corp, 1,450 %, fällig 01/09/2025	98	0,01
330 Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875 %, fällig 01/04/2027	337	0,02	460 McDonald's Corp, 3,700 %, fällig 30/01/2026	485	0,03
380 Home Depot Inc/The, 2,500 %, fällig 15/04/2027	384	0,03	510 McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01/03/2027	533	0,04
70 Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 06/12/2028	76	0,01	360 McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01/07/2027	378	0,03
440 Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15/04/2030	439	0,03	260 McDonald's Corp, 3,800 %, fällig 01/04/2028	276	0,02
490 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15/04/2040	491	0,03	130 McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01/07/2030	137	0,01
90 Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 15/06/2047	96	0,01	80 McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01/09/2049	79	0,01
1.370 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15/04/2050	1.343	0,09	720 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01/04/2050	771	0,05
440 Honeywell International Inc, 1,350 %, fällig 01/06/2025	431	0,03	60 MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15/01/2043	65	–
430 Humana Inc, 3,950 %, fällig 15/03/2027	455	0,03	290 Medtronic Inc, 3,500 %, fällig 15/03/2025	302	0,02
1.700 Humana Inc, 3,125 %, fällig 15/08/2029	1.711	0,12	750 Merck & Co Inc, 0,750 %, fällig 24/02/2026	715	0,05
70 Humana Inc, 4,625 %, fällig 08/12/2042	78	0,01	450 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24/06/2030	412	0,03
20 Humana Inc, 4,800 %, fällig 15/03/2047	23	–	790 Merck & Co Inc, 2,750 %, fällig 10/12/2051	705	0,05
– 50ILFC E-Capital Trust II, 144A, 3,620 %, fällig 21/12/2065 *	43	–	300 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15/12/2036	338	0,02
80 Intel Corp, 3,700 %, fällig 29/07/2025	84	0,01	820 Microsoft Corp, 2,875 %, fällig 06/02/2024	840	0,06
410 Intel Corp, 1,600 %, fällig 12/08/2028	389	0,03	200 Microsoft Corp, 2,700 %, fällig 12/02/2025	206	0,01
130 Intel Corp, 3,734 %, fällig 08/12/2047	131	0,01	1.940 Microsoft Corp, 2,400 %, fällig 08/08/2026	1.971	0,13
380 Intel Corp, 4,750 %, fällig 25/03/2050	445	0,03	1.400 Microsoft Corp, 3,300 %, fällig 06/02/2027	1.496	0,10
200 Intel Corp, 3,050 %, fällig 12/08/2051	182	0,01	10 Microsoft Corp, 3,450 %, fällig 08/08/2036	11	–
1.940 International Business Machines Corp, 3,000 %, fällig 15/05/2024	1.986	0,13	390 Microsoft Corp, 2,525 %, fällig 01/06/2050	347	0,02
150 International Lease Finance Corp, 5,875 %, fällig 15/08/2022	153	0,01	10 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17/03/2052	10	–
930 Johnson & Johnson, 0,950 %, fällig 01/09/2027	879	0,06	43 Microsoft Corp, 2,675 %, fällig 01/06/2060	38	–
1.040 Johnson & Johnson, 3,625 %, fällig 03/03/2037	1.125	0,08	207 Microsoft Corp, 3,041 %, fällig 17/03/2062	198	0,01
1.420 JPMorgan Chase & Co, 1,514 %, fällig 01/06/2024 *	1.415	0,10	730 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20/06/2027	771	0,05
250 JPMorgan Chase & Co, 3,875 %, fällig 10/09/2024	259	0,02	30 Molson Coors Beverage Co, 3,500 %, fällig 01/05/2022	30	–
1.400 JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, fällig 05/12/2024 *	1.445	0,10	960 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig 04/05/2025	935	0,06
1.160 JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, fällig 22/04/2026 *	1.143	0,08	1.770 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28/04/2026 *	1.748	0,12
970 JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, fällig 01/10/2027	1.039	0,07	1.360 Morgan Stanley, 3,772 %, fällig 24/01/2029 *	1.413	0,09
1.000 JPMorgan Chase & Co, 3,509 %, fällig 23/01/2029 *	1.027	0,07	50 Morgan Stanley, 4,431 %, fällig 23/01/2030 *	54	–
770 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23/07/2029 *	820	0,06	960 Morgan Stanley, 2,699 %, fällig 22/01/2031 *	930	0,06
780 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05/12/2029 *	844	0,06	2.090 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01/04/2031 *	2.163	0,15
640 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22/04/2031 *	613	0,04	460 Morgan Stanley, 2,511 %, fällig 20/10/2032 *	435	0,03
640 JPMorgan Chase & Co, 2,545 %, fällig 08/11/2032 *	612	0,04	350 Morgan Stanley, 2,484 %, fällig 16/09/2036 *	318	0,02
1.730 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01/06/2045	2.077	0,14	380 MPLX LP, 4,875 %, fällig 01/12/2024	403	0,03
300 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22/04/2051 *	278	0,02	230 MPLX LP, 4,000 %, fällig 15/03/2028	249	0,02
380 Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,500 %, fällig 01/09/2023	387	0,03	1.750 MPLX LP, 4,800 %, fällig 15/02/2029	1.919	0,13
110 Kinder Morgan Energy Partners LP, 4,250 %, fällig 01/09/2024	114	0,01	410 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15/04/2038	423	0,03
300 Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig 01/06/2025	314	0,02	20 MPLX LP, 5,200 %, fällig 01/03/2047	22	–
680 Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig 01/03/2028	725	0,05	960 MPLX LP, 4,700 %, fällig 15/04/2048	994	0,07
270 Kinder Morgan Inc, 5,300 %, fällig 01/12/2034	303	0,02	320 MPLX LP, 5,500 %, fällig 15/02/2049	366	0,02
820 Kinder Morgan Inc, 5,550 %, fällig 01/06/2045	943	0,06	160 Newell Brands Inc, 4,700 %, fällig 01/04/2026	166	0,01
60 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01/03/2048	66	–	360 NIKE Inc, 2,400 %, fällig 27/03/2025	365	0,02
30 KKR Group Finance Co II LLC, 144A, 5,500 %, fällig 01/02/2043	35	–	580 NIKE Inc, 2,750 %, fällig 27/03/2027	596	0,04
130 Kraft Heinz Foods Co, 3,000 %, fällig 01/06/2026	130	0,01	290 NIKE Inc, 3,250 %, fällig 27/03/2040	291	0,02
150 Kraft Heinz Foods Co, 4,250 %, fällig 01/03/2031	159	0,01	790 NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27/03/2050	808	0,05
20 Kraft Heinz Foods Co, 6,750 %, fällig 15/03/2032	25	–	640 Northrop Grumman Corp, 2,930 %, fällig 15/01/2025	653	0,04
80 Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig 15/07/2035	90	0,01	1.140 Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig 15/01/2028	1.166	0,08
50 Kraft Heinz Foods Co, 6,875 %, fällig 26/01/2039	66	–	490 Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01/05/2050	617	0,04
10 Kraft Heinz Foods Co, 144A, 7,125 %, fällig 01/08/2039	14	–	320 NVIDIA Corp, 2,850 %, fällig 01/04/2030	324	0,02
10 Kraft Heinz Foods Co, 4,625 %, fällig 01/10/2039	11	–	870 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01/04/2040	895	0,06
170 Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig 04/06/2042	188	0,01	1.980 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01/04/2050	2.044	0,14
520 Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, fällig 15/07/2045	589	0,04	620 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01/04/2060	649	0,04
210 Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, fällig 01/06/2046	216	0,01	30 Occidental Petroleum Corp, 6,950 %, fällig 01/07/2024	33	–
370 Kraft Heinz Foods Co, 4,875 %, fällig 01/10/2049	410	0,03	130 Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, fällig 15/03/2026	140	0,01
300 Kraft Heinz Foods Co, 5,500 %, fällig 01/06/2050	361	0,02	410 Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, fällig 15/04/2026	411	0,03
770 LHarris Technologies Inc, 4,854 %, fällig 27/04/2035	880	0,06	610 Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, fällig 15/08/2026	611	0,04
110 LHarris Technologies Inc, 5,054 %, fällig 27/04/2045	130	0,01	260 Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, fällig 15/02/2027	254	0,02
1.880 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08/08/2024	1.855	0,12	600 Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig 15/08/2029	598	0,04
1.320 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25/06/2025	1.271	0,09	260 Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, fällig 15/09/2031	322	0,02
160 Lehman Brothers Escrow, Series DMTN, Null-Coupon, Perpetual <sup>†</sup> 000	–	–	730 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig 15/09/2036	861	0,06
207 Lehman Escrow Receipt, Null-Coupon, Perpetual <sup>†</sup> 00	1	–	200 Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, fällig 15/03/2040	223	0,02
79 Lehman Swap Receipt, Null-Coupon, Perpetual <sup>†</sup> 00	–	–	240 Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, fällig 15/06/2045	231	0,02
120 Lennar Corp, 4,500 %, fällig 30/04/2024	125	0,01	520 Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig 15/03/2046	622	0,04
50 Lennar Corp, 4,750 %, fällig 30/05/2025	53	–	100 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15/04/2046	95	0,01
460 Lennar Corp, 4,750 %, fällig 29/11/2027	501	0,03	520 Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, fällig 15/02/2047	482	0,03
90 Lockheed Martin Corp, 3,100 %, fällig 15/01/2023	91	0,01	260 Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig 15/03/2048	244	0,02
460 Lockheed Martin Corp, 3,550 %, fällig 15/01/2026	485	0,03	1.000 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15/08/2049	951	0,06
40 Lockheed Martin Corp, 4,500 %, fällig 15/05/2036	45	–	1.250 Oracle Corp, 1,650 %, fällig 25/03/2026	1.198	0,08
280 Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig 15/04/2030	309	0,02	1.690 Oracle Corp, 2,875 %, fällig 25/03/2031	1.614	0,11
540 Mars Inc, 144A, 3,200 %, fällig 01/04/2030	557	0,04	300 Otis Worldwide Corp, 2,056 %, fällig 05/04/2025	298	0,02
110 Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26/03/2050	120	0,01	990 Pacific Gas and Electric Co, 1,750 %, fällig 16/06/2022	989	0,07
290 McDonald's Corp, 3,375 %, fällig 26/05/2025	301	0,02	310 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01/08/2027	288	0,02
430 McDonald's Corp, 3,300 %, fällig 01/07/2025	443	0,03	390 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01/02/2031	348	0,02
			80 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01/08/2040	68	–
			190 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01/08/2050	158	0,01
			90 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15/02/2028	91	0,01
			540 PayPal Holdings Inc, 1,350 %, fällig 01/06/2023	538	0,04

# Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
560 PayPal Holdings Inc, 1,650 %, fällig 01/06/2025	549	0,04	340 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 15/07/2025	357	0,02
720 PepsiCo Inc, 0,750 %, fällig 01/05/2023	714	0,05	820 Union Pacific Corp, 2,891 %, fällig 06/04/2036	794	0,05
80 PepsiCo Inc, 2,250 %, fällig 19/03/2025	81	0,01	1.260 Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig 20/03/2060	1.298	0,09
70 PepsiCo Inc, 2,625 %, fällig 19/03/2027	72	–	470 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05/02/2070	469	0,03
580 PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig 01/05/2030	541	0,04	30 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15/04/2026	30	–
220 PepsiCo Inc, 2,875 %, fällig 15/10/2049	209	0,01	550 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/04/2029	538	0,04
940 Pfizer Inc, 0,800 %, fällig 28/05/2025	912	0,06	70 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15/11/2027	71	–
620 Pfizer Inc, 2,625 %, fällig 01/04/2030	621	0,04	160 United Rentals North America Inc, 4,875 %, fällig 15/01/2028	163	0,01
580 Pfizer Inc, 1,700 %, fällig 28/05/2030	542	0,04	210 United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15/01/2030	219	0,01
160 Philip Morris International Inc, 2,500 %, fällig 22/08/2022	161	0,01	1.230 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15/02/2031	1.190	0,08
540 Philip Morris International Inc, 2,500 %, fällig 02/11/2022	544	0,04	210 UnitedHealth Group Inc, 3,500 %, fällig 15/06/2023	215	0,01
360 Philip Morris International Inc, 1,125 %, fällig 01/05/2023	359	0,02	410 UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, fällig 15/07/2025	430	0,03
400 Philip Morris International Inc, 2,100 %, fällig 01/05/2030	376	0,03	210 UnitedHealth Group Inc, 1,250 %, fällig 15/01/2026	203	0,01
160 Philip Morris International Inc, 4,500 %, fällig 20/03/2042	167	0,01	660 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15/12/2028	711	0,05
170 Pioneer Natural Resources Co, 1,125 %, fällig 15/01/2026	162	0,01	200 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15/05/2030	189	0,01
710 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig 15/01/2031	656	0,04	160 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15/06/2048	179	0,01
250 PNC Bank NA, 3,875 %, fällig 10/04/2025	261	0,02	130 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15/12/2048	150	0,01
240 Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, fällig 23/06/2025	232	0,02	940 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15/08/2049	976	0,07
120 Procter & Gamble Co/The, 2,800 %, fällig 25/03/2027	124	0,01	300 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15/08/2059	317	0,02
340 Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, fällig 25/03/2030	355	0,02	80 UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, fällig 15/05/2060	72	–
19 Range Resources Corp, 5,875 %, fällig 01/07/2022	19	–	1.410 US Bancorp, 1,450 %, fällig 12/05/2025	1.379	0,09
314 Range Resources Corp, 5,000 %, fällig 15/03/2023	318	0,02	260 Verizon Communications Inc, 2,625 %, fällig 15/08/2026	260	0,02
200 Range Resources Corp, 4,875 %, fällig 15/05/2025	203	0,01	190 Verizon Communications Inc, 3,000 %, fällig 22/03/2027	192	0,01
280 Raytheon Technologies Corp, 3,150 %, fällig 15/12/2024	286	0,02	580 Verizon Communications Inc, 2,100 %, fällig 22/03/2028	561	0,04
650 Raytheon Technologies Corp, 3,950 %, fällig 16/08/2025	685	0,05	1.062 Verizon Communications Inc, 4,329 %, fällig 21/09/2028	1.158	0,08
630 Raytheon Technologies Corp, 4,125 %, fällig 16/11/2028	681	0,05	190 Verizon Communications Inc, 3,875 %, fällig 08/02/2029	202	0,01
280 Raytheon Technologies Corp, 2,250 %, fällig 01/07/2030	265	0,02	500 Verizon Communications Inc, 3,150 %, fällig 22/03/2030	502	0,03
130 Raytheon Technologies Corp, 4,500 %, fällig 01/06/2042	146	0,01	630 Verizon Communications Inc, 1,750 %, fällig 20/01/2031	568	0,04
370 Republic Services Inc, 2,500 %, fällig 15/08/2024	374	0,03	1.110 Verizon Communications Inc, 2,550 %, fällig 21/03/2031	1.066	0,07
430 salesforce.com Inc, 3,250 %, fällig 11/04/2023	439	0,03	1.897 Verizon Communications Inc, 144A, 2,355 %, fällig 15/03/2032	1.773	0,12
140 salesforce.com Inc, 3,700 %, fällig 11/04/2028	149	0,01	1.390 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10/08/2033	1.547	0,10
80 Santander Holdings USA Inc, 4,500 %, fällig 17/07/2025	84	0,01	580 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16/03/2037	692	0,05
322 Schlumberger Holdings Corp, 3,900 %, fällig 17/05/2028	335	0,02	1.480 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig 20/11/2040	1.286	0,09
430 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01/03/2032	571	0,04	510 Verizon Communications Inc, 3,850 %, fällig 01/11/2042	514	0,03
150 Southwestern Electric Power Co, 6,200 %, fällig 15/03/2040	191	0,01	430 Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig 15/08/2046	449	0,03
20 Southwestern Energy Co, 5,375 %, fällig 01/02/2029	21	–	550 Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21/08/2046	659	0,04
80 Southwestern Energy Co, 5,375 %, fällig 15/03/2030	83	0,01	50 Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig 16/03/2047	63	–
190 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01/02/2032	189	0,01	320 Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22/03/2050	329	0,02
552 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20/09/2025	601	0,04	2.200 Verizon Communications Inc, 2,875 %, fällig 20/11/2050	1.884	0,13
20 Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15/11/2028	24	–	830 Visa Inc, 3,150 %, fällig 14/12/2025	861	0,06
515 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15/03/2032	715	0,05	890 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14/12/2045	1.032	0,07
10 Sprint Corp, 7,875 %, fällig 15/09/2023	11	–	390 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15/02/2028	372	0,03
220 Sprint Corp, 7,625 %, fällig 15/02/2025	244	0,02	300 Walmart Inc, 1,500 %, fällig 22/09/2028	286	0,02
150 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,000 %, fällig 15/01/2028	155	0,01	150 Walmart Inc, 1,800 %, fällig 22/09/2031	141	0,01
290 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, fällig 01/03/2030	307	0,02	170 Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig 15/11/2037	232	0,02
360 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01/02/2031	371	0,02	410 Wells Fargo & Co, 4,480 %, fällig 16/01/2024	429	0,03
200 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig 15/01/2032	197	0,01	240 Wells Fargo & Co, 3,750 %, fällig 24/01/2024	248	0,02
640 Target Corp, 2,250 %, fällig 15/04/2025	644	0,04	1.500 Wells Fargo & Co, 1,654 %, fällig 02/06/2024 *	1.495	0,10
16 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig 16/12/2039	22	–	1.150 Wells Fargo & Co, 2,188 %, fällig 30/04/2026 *	1.135	0,08
300 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,900 %, fällig 15/09/2044	351	0,02	870 Wells Fargo & Co, 3,000 %, fällig 23/10/2026	882	0,06
380 Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig 04/05/2030	359	0,02	3.940 Wells Fargo & Co, 4,300 %, fällig 22/07/2027	4.209	0,28
980 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, fällig 22/08/2050	0,06	–	560 Wells Fargo & Co, 3,584 %, fällig 22/05/2028 *	579	0,04
420 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01/07/2038	526	0,04	750 Wells Fargo & Co, 2,393 %, fällig 02/06/2028 *	734	0,05
560 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, fällig 15/11/2040	628	0,04	960 Wells Fargo & Co, 4,150 %, fällig 24/01/2029	1.025	0,07
85 Time Warner Entertainment Co LP, 8,375 %, fällig 15/07/2033	116	0,01	1.330 Wells Fargo & Co, 2,879 %, fällig 30/10/2030 *	1.310	0,09
50 TJX Cos Inc/The, 2,250 %, fällig 15/09/2026	50	–	620 Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04/04/2031 *	677	0,05
2.640 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15/04/2025	2.715	0,18	580 Wells Fargo & Co, 4,900 %, fällig 17/11/2045	659	0,04
160 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15/02/2026	155	0,01	720 Wells Fargo & Co, 4,400 %, fällig 14/06/2046	773	0,05
120 T-Mobile USA Inc, 3,750 %, fällig 15/04/2027	125	0,01	1.890 Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig 07/12/2046	2.126	0,14
520 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15/02/2029	489	0,03	6.160 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04/04/2051 *	7.603	0,51
1.660 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15/04/2030	1.718	0,12	130 Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Perpetual *	137	0,01
450 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15/02/2031	422	0,03	170 Western Midstream Operating LP, 1,844 %, fällig 13/01/2023*	169	0,01
380 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15/02/2031	357	0,02	460 Western Midstream Operating LP, 3,600 %, fällig 01/02/2025	462	0,03
240 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15/04/2031	237	0,02	110 Western Midstream Operating LP, 4,500 %, fällig 01/03/2028	114	0,01
70 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15/11/2031	63	–	1.900 Western Midstream Operating LP, 4,550 %, fällig 01/02/2030	1.957	0,13
1.170 T-Mobile USA Inc, 144A, 2,700 %, fällig 15/03/2032	1.101	0,07	40 Western Midstream Operating LP, 5,300 %, fällig 01/03/2048	41	–
220 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15/02/2041	191	0,01	310 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15/08/2048	318	0,02
10 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15/02/2051	9	–	310 Western Midstream Operating LP, 5,750 %, fällig 01/02/2050	316	0,02
150 Toll Brothers Finance Corp, 4,375 %, fällig 15/04/2023	153	0,01	40 WestRock RKT LLC, 4,000 %, fällig 01/03/2023	41	–
1.350 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01/02/2026	1.592	0,11	100 Williams Cos Inc/The, 3,700 %, fällig 15/01/2023	101	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>			<b>Kuwait — 0,11 % (28. Februar 2021: 0,10 %)</b>		
<b>USA – (Fortsetzung)</b>			1.530 Kuwait International Government Bond, 144A, 3,500 %, fällig 20/03/2027		
350 Williams Cos Inc/The, Series A, 7,500 %, fällig 15/01/2031	451	0,03	1.622	0,11	
760 Williams Cos Inc/The, 7,750 %, fällig 15/06/2031	996	0,07	<b>Mexiko — 2,02 % (28. Februar 2021: 1,96 %)</b>		
1.038 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15/03/2032	1.457	0,10	MXN 6.990 Mexican Bonos, Series M 20, 10,000 %, fällig 05/12/2024	360	0,02
110 Wyeth LLC, 5,950 %, fällig 01/04/2037	144	0,01	MXN 131.480 Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31/05/2029	6.652	0,45
	390.234	26,22	MXN 165.417 Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	7.738	0,52
			MXN 256.970 Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07/11/2047	12.298	0,83
			3.010 Mexico Government International Bond, 4,600 %, fällig 10/02/2048	2.892	0,19
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 480.108 USD)</b>	<b>484.080</b>	<b>32,53</b>	190 Mexico Government International Bond, 5,750 %, fällig 12/10/2110	196	0,01
				30.136	2,02
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 30,21 % (28. Februar 2021: 26,81 %)</b>			<b>Nigeria — 0,02 % (28. Februar 2021: 0,02 %)</b>		
<b>Argentinien — 0,15 % (28. Februar 2021: 0,14 %)</b>			300 Nigeria Government International Bond, 144A, 6,500 %, fällig 28/11/2027		
212 Argentine Republic Government International Bond, 1,000 %, fällig 09/07/2029	70	0,01	287	0,02	
2.566 Argentine Republic Government International Bond, 0,500 %, fällig 09/07/2030	825	0,06	<b>Panama – 0,10 % (28. Februar 2021: 0,09 %)</b>		
1.062 Argentine Republic Government International Bond, 1,125 %, fällig 09/07/2035	316	0,02	670 Panama Government International Bond, 2,252 %, fällig 29/09/2032	593	0,04
1.850 Argentine Republic Government International Bond, 2,500 %, fällig 09/07/2041	633	0,04	950 Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 01/04/2056	921	0,06
757 Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 3,900 %, fällig 01/09/2037	323	0,02		1.514	0,10
	2.167	0,15	<b>Paraguay — 0,03 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
<b>Brasilien — 0,95 % (28. Februar 2021: 0,82 %)</b>			470 Paraguay Government International Bond, 144A, 3,849 %, fällig 28/06/2033		
BRL 2.241 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie B, Series NTN B, 6,000 %, fällig 15/05/2023	1.692	0,11	450	0,03	
BRL 11.136 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN F, 10,000 %, fällig 01/01/2023	2.122	0,14	<b>Peru — 0,19 % (28. Februar 2021: 0,18 %)</b>		
BRL 17.005 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN F, 10,000 %, fällig 01/01/2027	3.152	0,21	2.180 Peruvian Government International Bond, 2,783 %, fällig 23/01/2031	2.065	0,14
350 Brazilian Government International Bond, 2,625 %, fällig 05/01/2023	353	0,03	580 Peruvian Government International Bond, 5,625 %, fällig 18/11/2050	726	0,05
770 Brazilian Government International Bond, 4,625 %, fällig 13/01/2028	783	0,05		2.791	0,19
6.000 Brazilian Government International Bond, 5,000 %, fällig 27/01/2045	5.344	0,36	<b>Katar — 0,34 % (28. Februar 2021: 0,32 %)</b>		
880 Brazilian Government International Bond, 4,750 %, fällig 14/01/2050	738	0,05	620 Qatar Government International Bond, 144A, 4,000 %, fällig 14/03/2029	676	0,05
	14.184	0,95	2.380 Qatar Government International Bond, 144A, 4,817 %, fällig 14/03/2049	2.896	0,19
<b>Kolumbien — 0,16 % (28. Februar 2021: 0,09 %)</b>			1.290 Qatar Government International Bond, 144A, 4,400 %, fällig 16/04/2050	1.492	0,10
890 Colombia Government International Bond, 3,250 %, fällig 22/04/2032	746	0,05		5.064	0,34
900 Colombia Government International Bond, 4,125 %, fällig 22/02/2042	704	0,05	<b>Russland — 0,66 % (28. Februar 2021: 1,31 %)</b>		
990 Colombia Government International Bond, 5,625 %, fällig 26/02/2044	895	0,06	RUB 52.900 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6211, 7,000 %, fällig 25/01/2023 1y	391	0,03
	2.345	0,16	RUB 116.430 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6215, 7,000 %, fällig 16/08/2023 1y	920	0,06
<b>Ägypten — 0,08 % (28. Februar 2021: 0,07 %)</b>			RUB 16.270 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6219, 7,750 %, fällig 16/09/2026 1y	89	–
1.110 Egypt Government International Bond, 144A, 5,577 %, fällig 21/02/2023	1.123	0,08	RUB 89.250 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6207, 8,150 %, fällig 03/02/2027 1y	496	0,03
<b>Indonesien — 1,44 % (28. Februar 2021: 0,62 %)</b>			RUB 203.271 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19/01/2028 1y	1.007	0,07
650 Indonesia Government International Bond, 3,750 %, fällig 25/04/2022	652	0,04	RUB 689.514 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23/05/2029 1y	3.222	0,22
1.510 Indonesia Government International Bond, 144A, 5,875 %, fällig 15/01/2024	1.617	0,11	RUB 232.730 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10/04/2030 1y	1.132	0,08
200 Indonesia Government International Bond, 144A, 3,850 %, fällig 18/07/2027	211	0,02	RUB 22.030 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6225, 7,250 %, fällig 10/05/2034 1y	99	0,01
590 Indonesia Government International Bond, 3,500 %, fällig 11/01/2028	610	0,04	RUB 382.680 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6230, 7,700 %, fällig 16/03/2039 1y	2.469	0,16
1.610 Indonesia Government International Bond, 144A, 5,125 %, fällig 15/01/2045	1.803	0,12		9.825	0,66
280 Indonesia Government International Bond, 5,125 %, fällig 15/01/2045	314	0,02	<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,30 % (28. Februar 2021: 0,27 %)</b>		
200 Indonesia Government International Bond, 144A, 5,250 %, fällig 08/01/2047	230	0,02	1.270 Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 2,500 %, fällig 11/10/2022	1.282	0,08
430 Indonesia Government International Bond, 4,350 %, fällig 11/01/2048	440	0,03	3.010 Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 3,875 %, fällig 16/04/2050	3.232	0,22
3.970 Indonesia Government International Bond, 3,700 %, fällig 30/10/2049	3.759	0,25		4.514	0,30
IDR 171.202.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR91, 6,375 %, fällig 15/04/2032	11.786	0,79	<b>USA — 23,47 % (28. Februar 2021: 19,35 %)</b>		
	21.422	1,44	1.440 Federal National Mortgage Association, 6,625 %, fällig 15/11/2030	1.953	0,13
<b>Israel — 0,07 % (28. Februar 2021: 0,07 %)</b>			140 United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 15/11/2023	137	0,01
650 Israel Government International Bond, 2,750 %, fällig 03/07/2030	662	0,04	190 United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 30/09/2025	180	0,01
390 State of Israel, 3,375 %, fällig 15/01/2050	382	0,03	600 United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31/10/2025	569	0,04
	1.044	0,07	50 United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30/11/2025	48	–
<b>Kenia — 0,12 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
2.070 Republic of Kenya Government International Bond, 144A, 6,300 %, fällig 23/01/2034	1.747	0,12			

# Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>							
<b>USA – (Fortsetzung)</b>							
810	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31/01/2026	769	0,05	360	Brookfield WEC Holdings Inc., 3,250 %, fällig 01/08/2025 *	355	0,02
61.510	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31/05/2026	59.006	3,97	758	Brown Group Holding LLC, 3,000 %, fällig 07/06/2028 *	751	0,05
90	United States Treasury Note/Bond, 0,875 %, fällig 30/06/2026	87	0,01	879	Caesars Resort Collection LLC, 3,605 %, fällig 19/06/2025 *	876	0,06
13.860	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31/10/2026	13.469	0,91	1.491	Caesars Resort Collection LLC, 2,959 %, fällig 22/12/2024 *	1.478	0,10
150	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30/11/2026	147	0,01	519	Castlelake Aviation Ltd, 3,250 %, fällig 22/10/2026 *	513	0,03
4.590	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31/12/2026	4.485	0,30	1.741	Change Healthcare Holdings LLC, 3,500 %, fällig 01/03/2024 *	1.735	0,12
35.150	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31/01/2027	34.741	2,33	431	Charter Communications Operating LLC, 1,960 %, fällig 01/02/2027 *	425	0,03
18.330	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30/06/2028*	17.709	1,19	2.086	Charter Communications Operating LLC, 1,960 %, fällig 30/04/2025 *	2.081	0,14
350	United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, fällig 31/07/2028	333	0,02	1.261	Citadel Securities, 2,709 %, fällig 27/02/2028 *	1.251	0,08
2.250	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31/08/2028	2.154	0,14	676	Clarios Global LP, 3,459 %, fällig 30/04/2026 *	670	0,05
12.650	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30/09/2028	12.197	0,82	98	CSC Holdings LLC, 2,691 %, fällig 15/04/2027 *	95	0,01
1.570	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31/10/2028	1.525	0,10	258	CSC Holdings LLC, 2,441 %, fällig 15/01/2026 *	251	0,02
4.030	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15/05/2031	3.961	0,27	1.879	DCert Buyer, Inc., 4,209 %, fällig 16/10/2026 *	1.874	0,13
12.580	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/08/2031	11.948	0,80	1.330	Deerfield Dakota Holding LLC, 4,750 %, fällig 05/03/2027 *	1.326	0,09
4.140	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/11/2031	3.970	0,27	70	Delta 2 (Lux) S.a.r.l., 3,500 %, fällig 01/02/2024 *	69	-
2.050	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/11/2040	1.773	0,12	794	Delta Topco Inc, 4,500 %, fällig 07/10/2027 *	790	0,05
4.770	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2041	4.486	0,30	709	Edelman Financial Center LLC/The, 4,250 %, fällig 05/04/2028 *	704	0,05
3.460	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/05/2041	3.450	0,23	317	Energizer Holdings, Inc., 2,750 %, fällig 16/12/2027 *	315	0,02
7.920	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 15/08/2041	7.264	0,49	276	Entercom Media Corp, 2,609 %, fällig 17/11/2024 *	272	0,02
8.010	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15/08/2047	8.773	0,59	384	Eyecare Partners LLC, 3,974 %, fällig 20/02/2027 *	381	0,03
5.130	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/02/2048	5.903	0,40	179	FinCo I LLC, 2,709 %, fällig 27/06/2025 *	177	0,01
10.900	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/02/2050	10.441	0,70	236	First Eagle Holdings Inc, 2,724 %, fällig 17/02/2027 *	232	0,02
42.760	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/05/2050	34.125	2,29	791	Focus Financial Partners LLC, 2,105 %, fällig 03/07/2024 *	783	0,05
47.130	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/08/2050	38.814	2,61	904	Four Seasons Hotels Ltd, 2,209 %, fällig 30/11/2023 *	899	0,06
18.010	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15/11/2050	15.785	1,06	660	Froneri U.S. Inc, 2,459 %, fällig 30/01/2027 *	648	0,04
23.050	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2051	21.465	1,44	1.861	Gainwell Acquisition Corp, 4,750 %, fällig 01/10/2027 *	1.855	0,12
15.100	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15/05/2051	15.749	1,06	350	Garda World Security Corp, 4,430 %, fällig 30/10/2026 *	348	0,02
6.670	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/08/2051	6.400	0,43	2.128	Genesee & Wyoming Inc, 2,224 %, fällig 30/12/2026 *	2.101	0,14
5.820	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/11/2051	5.432	0,37	105	GFL Environmental Inc., 3,500 %, fällig 31/05/2025 *	105	0,01
		349.248	23,47	501	GoDaddy Operating Co, 1,959 %, fällig 15/02/2024 *	495	0,03
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 497.630 USD)</b>		<b>449.483</b>	<b>30,21</b>	1.948	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 2,209 %, fällig 15/11/2027 *	1.907	0,13
<b>Darlehensanleihen — 5,58 % (28. Februar 2021: 5,79 %)</b>				348	GVC Holdings Gibraltar Ltd, 3,000 %, fällig 16/03/2027 *	346	0,02
1.405	1011778 BC ULC, 1,959 %, fällig 14/11/2026 *	1.381	0,09	1.116	Harbor Freight Tools USA Inc, 3,250 %, fällig 19/10/2027 *	1.100	0,07
560	Air Canada, 4,250 %, fällig 27/07/2028 *	558	0,04	1.435	Hilton Worldwide Finance LLC, 1,937 %, fällig 21/06/2026 *	1.416	0,10
1.200	Ali Group S.R.L., 0,000 %, fällig 13/10/2028 *	1.185	0,08	1.038	ICON Luxembourg S.a.r.l., 2,750 %, fällig 01/07/2028 *	1.028	0,07
2.151	Allied Universal Holdco LLC, 4,250 %, fällig 14/05/2028 *	2.126	0,14	567	iHeartCommunications Inc, 3,209 %, fällig 01/05/2026 *	561	0,04
554	Alterra Mountain Co, 4,000 %, fällig 30/07/2028 *	550	0,04	990	ii-VI Inc, 0,000 %, fällig 08/12/2028 *	982	0,07
214	American Axle & Manufacturing Inc, 3,000 %, fällig 06/04/2024 *	213	0,01	259	Indigo Merger Sub, Inc., 2,750 %, fällig 01/07/2028 *	256	0,02
683	AmWINS Group, Inc., 3,000 %, fällig 17/02/2028 *	673	0,05	677	Ineos U.S. Petrochemical, 3,250 %, fällig 21/01/2026 *	670	0,04
1.214	API Group Inc, 2,709 %, fällig 01/10/2026 *	1.203	0,08	1.353	Jane Street Group, LLC, 2,959 %, fällig 21/01/2027 *	1.339	0,09
410	Aramark Services Inc, 1,959 %, fällig 11/03/2025 *	403	0,03	2.100	Level 3 Parent LLC, 1,959 %, fällig 01/03/2027 *	2.054	0,14
2.024	Asplundh Tree Expert LLC, 1,959 %, fällig 04/09/2027 *	2.001	0,13	457	Michaels Cos Inc./The, 5,000 %, fällig 08/04/2028 *	427	0,03
1.088	Asurion LLC, 3,209 %, fällig 03/11/2024 *	1.076	0,07	1.320	Mozart Borrower LP, 3,750 %, fällig 30/09/2028 *	1.309	0,09
1.002	Asurion LLC, 3,459 %, fällig 18/12/2026 *	987	0,07	2.189	Nexstar Broadcasting Inc, 2,606 %, fällig 19/09/2026 *	2.180	0,15
195	Asurion LLC, 3,334 %, fällig 03/11/2023 *	194	0,01	324	PCI Gaming Authority, 2,709 %, fällig 31/05/2026 *	321	0,02
356	Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 2,750 %, fällig 01/12/2027 *	355	0,02	629	Phoenix Guarantor Inc, 3,459 %, fällig 05/03/2026 *	621	0,04
1.053	Berry Global Inc, 1,876 %, fällig 01/07/2026 *	1.036	0,07	520	Phoenix Newco, Inc., 4,000 %, fällig 11/08/2028 *	517	0,03
261	Brightview Landscapes LLC, 2,750 %, fällig 15/08/2025 *	258	0,02	2.613	Pilot Travel Centers, 2,209 %, fällig 29/07/2028 *	2.577	0,17
				1.845	Prime Security Installations Ltd, 3,500 %, fällig 23/09/2026 *	1.828	0,12
				470	Project Sky Merger Sub, Inc., 4,250 %, fällig 10/08/2028 *	467	0,03
				620	Quikrete Holdings, Inc., 0,000 %, fällig 11/06/2028 *	615	0,04
				983	Rackspace Technology Global, Inc, 3,500 %, fällig 09/02/2028 *	956	0,06
				1.606	RealPage Inc, 3,750 %, fällig 18/02/2028 *	1.591	0,11
				910	RegionalCare Hospital Partners Holding, 3,959 %, fällig 16/11/2025 *	901	0,06
				1.881	Reynolds Consumer Products LLC, 1,959 %, fällig 04/02/2027 *	1.857	0,12
				2.329	Scientific Games International Inc, 2,959 %, fällig 14/08/2024 *	2.317	0,16
				1.420	Setanta Aircraft Leasing DAC, 2,140 %, fällig 05/11/2028 *	1.413	0,10
				1.480	SkyMiles IP Ltd, 4,750 %, fällig 16/09/2027 *	1.551	0,10
				1.870	Sotera Health, 3,250 %, fällig 13/12/2026 *	1.849	0,12
				1.389	Station Casinos LLC, 2,500 %, fällig 08/02/2027 *	1.373	0,09
				872	Terrier Media Buyer, Inc., 3,709 %, fällig 17/12/2026 *	862	0,06
				79	TransDigm Group Inc, 2,459 %, fällig 09/12/2025 *	78	0,01
				50	Triton Water Holdings, Inc., 4,000 %, fällig 16/03/2028 *	49	-
				1.358	UFC Holdings LLC, 3,500 %, fällig 29/04/2026 *	1.342	0,09
				1.102	United Airlines Inc, 4,500 %, fällig 14/04/2028 *	1.098	0,07
				828	Univision Communications Inc, 4,000 %, fällig 24/03/2026 *	823	0,06
				1.122	Verscend Holding Corp., 4,209 %, fällig 27/08/2025 *	1.120	0,08
				2.102	Virgin Media Bristol LLC, 2,691 %, fällig 04/01/2028 *	2.071	0,14

## Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Loan Notes – (Fortsetzung)</b>			<b>Inflation Swaps – (0,04 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
20 Whatabrands LLC, 3,750 %, fällig 21/07/2028 *	20	–	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(551)	(0,04)
690 Zayo Group Holdings Inc, 3,209 %, fällig 09/03/2027 *	676	0,05	<b>Zinsswaps – (0,20 %) (28. Februar 2021: (0,08 %))</b>		
590 Ziggo BV, 2,691 %, fällig 15/04/2028 *	579	0,04	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(2.957)	(0,20)
<b>Summe Darlehensanleihen (Anschaffungskosten 83.747 USD)</b>	<b>83.101</b>	<b>5,58</b>	<b>Swaptions – (0,02 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,29 % (28. Februar 2021: 1,67 %)</b>			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(258)	(0,02)
2.243 Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	34.088	2,29	<b>Devisenterminkontrakte – (0,49 %) (28. Februar 2021: (0,15 %))</b>		
<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 29.244 USD)</b>	<b>34.088</b>	<b>2,29</b>	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(7.304)	(0,49)
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 1.527.654 USD)</b>			<b>1.478.052</b>	<b>99,33</b>	
<b>Verträge (in Tsd.)</b>			<b>Futures – (0,60 %) (28. Februar 2021: (0,35 %))</b>		
<b>Gekaufte Optionen – 0,03 % (28. Februar 2021: 0,05 %)</b>			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
- U.S. 10 Year April 2022 Call 127,00, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	139	0,01	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
- U.S. 5 Year April 2022 Call 118,25, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	62	–	1.478.041		
- U.S. Bond April 2022 Call 155,00, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	102	0,01	<b>10.049</b>		
- U.S. Bond April 2022 Call 156,00, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	80	0,01	<b>Gesamtvermögen</b>		
<b>Gekaufte Optionen gesamt (Anschaffungskosten 250 USD)</b>	<b>383</b>	<b>0,03</b>	\$1.488.090		
<b>Credit Default Swaps – 0,33 % (28. Februar 2021: 0,59 %)</b>			100,00		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	4.882	0,33			
<b>Inflation Swaps – 0,05 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	750	0,05			
<b>Zinsswaps – 0,05 % (28. Februar 2021: 0,49 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	647	0,05			
<b>Index-Swaps – 0,37 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	5.476	0,37			
<b>Devisenterminkontrakte – 0,23 % (28. Februar 2021: 0,10 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	3.409	0,23			
<b>Futures – 0,40 % (28. Februar 2021: 0,18 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	5.952	0,40			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>			<b>1.499.551</b>		
<b>100,79</b>					
<b>Verträge (in Tsd.)</b>					
<b>Schriftliche Optionen – (0,10 %) (28. Februar 2021: (0,12 %))</b>					
- U.S. 10 Year April 2022 Call 128,00, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(161)	(0,01)			
- U.S. 10 Year April 2022 Call 128,50, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(105)	(0,01)			
- U.S. 10 Year April 2022 Call 129,00, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(37)	–			
- U.S. 10 Year April 2022 Call 129,50, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(27)	–			
- U.S. 10 Year April 2022 Call 130,00, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(21)	–			
- U.S. 10 Year April 2022 Call 130,50, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(11)	–			
- U.S. 10 Year June 2022 Call 130,00, fällig 20/05/2022 – Morgan Stanley	(56)	–			
- U.S. 5 Year April 2022 Call 117,75, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(282)	(0,02)			
- U.S. 5 Year April 2022 Call 118,00, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(235)	(0,02)			
(1) U.S. 5 Year April 2022 Call 118,75, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(249)	(0,02)			
- U.S. 5 Year April 2022 Put 117,25, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(65)	–			
- U.S. Bond April 2022 Call 157,00, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(129)	(0,01)			
- U.S. Bond April 2022 Call 158,00, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(98)	(0,01)			
<b>Geschriebene Optionen insgesamt (Kosten \$(1.118))</b>	<b>(1.476)</b>	<b>(0,10)</b>			

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 211.604.000 USD oder 14,27 % des Nettovermögens.

\* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.

† Illiquide.

∞ Sicherheit wird nach Treu und Glauben vom Bewertungsausschuss oder nach dessen Ermessen zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

ε Die Sicherheit befindet sich zum 28. Februar 2022 in Verzug (entweder Kapital und/oder Zinsen).

γ Sicherheiten fallen aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen nach Jahresende nicht mehr an.

≠ Sicherheit (ganz oder teilweise) als Sicherheit für den Handel mit Derivaten zum 28. Februar 2022 verpfändet.

± Anzugebende Wertpapiere.

β Der Zinssatz für diese Art von Wertpapier ist an den Verbraucherpreisindex (Consumer Price Index, CPI)/Einzelhandelspreisindex (Retail Price Index, RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Stand vom 28. Februar 2022.

**ABKÜRZUNGEN:**

Unbefristet	– Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.
REMIC	– Immobilienhypothekenanlage.
TBA	– Wird bekannt gegeben.
BRL	– Brasilianisch Real
IDR	– Indonesische Rupiah
MXN	– Mexikanischer Peso
RUB	– Russischer Rubel

	% des Gesamt- vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	87,09
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	5,32
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,18
Finanzderivate	1,38
Sonstige Vermögenswerte	4,03
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

# Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 % – Verkauf	20/12/2026	32.275	\$ 1.796
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20/12/2026	210.433	3.086
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 9.660 USD)				\$ 4.882
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)				\$ 4.882

## Zeitplan für Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	Pay Floating BRL CDI CETIP, Re-ceive Fixed 7,024 %	04/01/2027	15.900	\$ (238)
Citi	Pay Floating BRL CDI CETIP, Re-ceive Fixed 7,024 %	04/01/2027	16.899	(253)
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024 %	04/01/2027	13.400	(201)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,044 %	04/01/2027	11.000	(163)
Morgan Stanley	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,190 %	15/06/2022	56.215	(66)
Morgan Stanley	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,820 %	04/06/2024	134.778	(1.720)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,350 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15/02/2028	7.200	209
Morgan Stanley	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Re-ceive Fixed 7,450 %	18/07/2029	142.060	(151)
Morgan Stanley	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Re-ceive Fixed 7,440 %	20/07/2029	147.960	(162)
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,000 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	03/06/2051	735	(1)
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,050 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	07/06/2051	131	(2)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,671 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	09/07/2051	5.948	438
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 8.077 USD)				\$ 647
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.290) USD)				(2.957)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 6.787 USD)				\$ (2.310)

## Zeitplan für Index-Swaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Pay Fixed 0,710 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/05/2027	60.282	\$ 2.607
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,130 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/08/2028	28.059	813
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,200 %, Receive Floating USD SOFR Compound	01/11/2028	9.446	243
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,220 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/08/2028	20.467	479
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20/11/2026	22.420	132
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/02/2047	15.537	717
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,630 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/05/2047	16.950	388
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,729 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/02/2047	17.531	63
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,733 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20/10/2031	13.940	34
Nicht realisierte Wertsteigerung von Index Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 5.476
Nicht realisierte Wertminderung von Index-Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				–
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 5.476

## Zeitplan der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	USD – CPI Urban Consumers	18/11/2023	19.740	\$ 308
Morgan Stanley	USD – CPI Urban Consumers	20/10/2026	13.940	442
Morgan Stanley	USD – CPI Urban Consumers	18/11/2026	19.740	(175)
Morgan Stanley	USD – CPI Urban Consumers	20/10/2031	13.940	(376)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 750
Nicht realisierte Wertminderung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(551)
Nettowertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 199

## Zeitplan der Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Datum des Inkrafttretens	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	Swaption Payer Strike 0,01 %	02/05/2022	25.880	\$ (258)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ (258)
Nicht realisierte Wertminderung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				–
Nettowertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ (258)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
		Kauf		Verkauf		Verkauf		
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 1	Verkauf	AUD 1		\$ –	
11/03/2022	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD 3.175	Verkauf	RUB 239.520		961	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 113	Verkauf	AUD 158		(2)	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 14.981	Verkauf	EUR 13.181		190	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD –	Verkauf	GBP –		–	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 20	Verkauf	USD 27		–	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 37.546	Verkauf	USD 42.946		(818)	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD 8.429	Verkauf	USD 6.033		91	
15/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD 4.429	Verkauf	RUB 337.446		1.315	
19/04/2022	Citi	Kauf	USD 325	Verkauf	BRL 1.900		(39)	
19/04/2022	Citi	Kauf	USD 19.286	Verkauf	CNH 123.791		(238)	
19/04/2022	Citi	Kauf	USD 3.909	Verkauf	EUR 3.454		29	
19/04/2022	Citi	Kauf	EUR 285	Verkauf	USD 325		(5)	
19/04/2022	Citi	Kauf	MXN 177.617	Verkauf	USD 8.474		120	
19/04/2022	Citi	Kauf	INR 156.175	Verkauf	USD 2.072		(16)	
19/04/2022	Citi	Kauf	IDR 40.407.938	Verkauf	USD 2.787		15	
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	RUB 1.431.424	Verkauf	USD 18.574		(5.936)	
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	GBP 6.744	Verkauf	USD 9.144		(95)	
19/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD 21.711	Verkauf	CNH 138.647		(155)	
19/04/2022	JP Morgan	Kauf	AUD 27.283	Verkauf	USD 19.561		270	
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	ZAR 29.450	Verkauf	USD 1.850		52	
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	CAD 67.341	Verkauf	USD 52.914		223	
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	JPY 2.167.758	Verkauf	USD 18.735		143	
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.679 USD)							\$	3.409
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (2.446) USD)								(7.304)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (767) USD)							\$	(3.895)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nominaler Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)	
90 Day Euro\$ December 2022	Morgan Stanley	2.642	\$ 649.106	(3.954)	
90 Day Euro\$ December 2023	Morgan Stanley	1.017	248.796	(2.485)	
90 Day Euro\$ June 2023	Morgan Stanley	309	75.636	(1.029)	
90 Day Euro\$ March 2022	Morgan Stanley	(1.703)	(422.961)	1.235	
90 Day Euro\$ September 2023	Morgan Stanley	73	17.860	(223)	
Australia 10 Year Bond March 2022	Morgan Stanley	148	14.461	(523)	
Euro FX Currency March 2022	Morgan Stanley	5	702	(7)	
Euro-Bund March 2022	Morgan Stanley	(228)	(42.703)	1.745	
Euro-Buxl 30 Year Bond March 2022	Morgan Stanley	(25)	(5.544)	524	
Euro-OAT March 2022	Morgan Stanley	91	16.150	(743)	
Japan 10 Year Bond (OSE) March 2022	Morgan Stanley	(13)	(17.018)	167	
Mexican Peso Currency March 2022	Morgan Stanley	6	146	7	
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Morgan Stanley	347	44.221	222	
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Morgan Stanley	2.768	327.402	1.679	
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Morgan Stanley	78	12.222	163	
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Morgan Stanley	91	16.920	210	
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 2.931 USD)				\$	5.952
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (5.784) USD)					(8.964)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (2.853) USD)				\$	(3.012)

## Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 38,96 % (28. Februar 2021: 39,27 %)</b>					
<b>Australien — 0,67 % (28. Februar 2021: 0,92 %)</b>					
	970				
	970	0,67			
<b>Belgien — 1,32 % (28. Februar 2021: 1,79 %)</b>					
USD	140	0,10			
	90				
	86	0,06			
USD	140	0,09			
	138				
	1.100	0,74			
	1.102				
	500	0,33			
	500				
	1.974	1,32			
<b>Kanada — 0,04 % (28. Februar 2021: 0,10 %)</b>					
USD	60	0,03			
	51				
USD	10	0,01			
	9				
	60	0,04			
<b>China — 0,01 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
USD	10	0,01			
	9				
<b>Dänemark — 0,26 % (28. Februar 2021: 0,36 %)</b>					
	390	0,26			
	393				
<b>Frankreich — 1,82 % (28. Februar 2021: 2,58 %)</b>					
	310	0,19			
	600	0,39			
	200	0,14			
	660	0,49			
	200	0,14			
	212	0,14			
	699	0,47			
	2.712	1,82			
<b>Deutschland — 3,55 % (28. Februar 2021: 3,83 %)</b>					
	800	0,48			
	100	0,07			
	200	0,13			
	300	0,21			
	400	0,28			
	1.020	0,67			
	690	0,45			
	800	0,52			
	781				
	1.100	0,74			
	1.103				
	5.294	3,55			
<b>Israel — 0,23 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>					
USD	370	0,22			
	329				
USD	10	0,01			
	9				
USD	10	—			
	8				
	346	0,23			
<b>Italien — 1,78 % (28. Februar 2021: 0,56 %)</b>					
	1.100	0,73			
	950	0,64			
	620	0,41			
	607				
	2.663	1,78			
<b>Japan — 0,43 % (28. Februar 2021: 0,59 %)</b>					
	300	0,20			
	340	0,23			
	343				
	646	0,43			
<b>Luxemburg — 1,49 % (28. Februar 2021: 1,26 %)</b>					
	555	0,36			
	930	0,61			
	260	0,18			
	275				
	500	0,34			
	503				
	2.229	1,49			
<b>Macau — 0,20 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
USD	400	0,20			
	300				
<b>Niederlande — 1,92 % (28. Februar 2021: 2,09 %)</b>					
	850	0,58			
	250	0,17			
	320	0,21			
	940	0,64			
	300	0,20			
USD	40	0,02			
	36				
USD	170	0,10			
	146				
	2.871	1,92			
<b>Norwegen — 0,92 % (28. Februar 2021: 1,25 %)</b>					
	1.030	0,69			
	350	0,23			
	1.378	0,92			
<b>Singapur — 0,33 % (28. Februar 2021: 0,50 %)</b>					
	500	0,33			
	488				
<b>Südafrika — 0,21 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>					
	310	0,21			
	315				
<b>Spanien — 0,50 % (28. Februar 2021: 0,66 %)</b>					
	300	0,21			
	438	0,29			
	749	0,50			
<b>Supranational — 2,89 % (28. Februar 2021: 4,09 %)</b>					
	780	0,52			
	3.480	2,37			
	3.546				
	4.318	2,89			
<b>Schweden — 0,62 % (28. Februar 2021: 0,84 %)</b>					
	760	0,51			
	160	0,11			
	925	0,62			
<b>Schweiz — 1,55 % (28. Februar 2021: 1,20 %)</b>					
	920	0,65			
	160	0,11			
	320	0,20			
	330	0,22			
	550	0,37			
	2.318	1,55			
<b>Vereinigte Arabische Emirate — 0,46 % (28. Februar 2021: 0,20 %)</b>					
USD	200	0,11			
	162				
USD	250	0,15			
	221				
	320	0,20			
	306				
	689	0,46			
<b>Vereinigtes Königreich 5,32 % (28. Februar 2021: 4,29 %)</b>					
	1.070	0,72			
	100	0,07			
	1.050	0,74			
	1.260	0,89			
	270	0,18			
	1.110	0,75			
	1.190	0,82			
GBP	140	0,11			
	420	0,28			
USD	280	0,17			
	580	0,41			
GBP	140	0,11			
	100	0,07			
	7.946	5,32			
<b>USA — 12,44 % (28. Februar 2021: 10,85 %)</b>					
	320	0,21			
	940	0,64			
	300	0,20			
USD	40	0,02			
	36				
USD	170	0,10			
	146				
	1.390	0,95			
	250	0,17			
	420	0,28			
USD	290	0,19			
	150	0,11			
USD	60	0,04			
	13	0,01			
USD	70	0,04			
	58				
USD	200	0,14			
	167				

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
USD	20		<b>Frankreich — 12,75 % (28. Februar 2021: 9,40 %)</b>		
			1.510	1.580	1,06
			880	909	0,61
USD	30		6.260	5.999	4,01
USD	50		4.725	6.843	4,58
	1.440		880	955	0,64
USD	10		590	1.088	0,73
USD	10		1.600	1.667	1,12
USD	10			19.041	12,75
USD	80		<b>Deutschland — 15,99 % (28. Februar 2021: 9,93 %)</b>		
USD	290		3.250	3.273	2,19
USD	140		1.000	1.020	0,68
USD	140		780	801	0,54
USD	90		4.080	4.166	2,79
USD	170		3.620	3.606	2,41
USD	100		11.100	11.017	7,38
USD	90			23.883	15,99
USD	70		<b>Indonesien — 1,72 % (28. Februar 2021: 2,28 %)</b>		
USD	430		350	322	0,22
USD	60		2	2.240	1,50
USD	200			2.562	1,72
USD	200		<b>Italien — 8,01 % (28. Februar 2021: 10,10 %)</b>		
USD	20		3.050	3.323	2,22
USD	200		1.300	1.478	0,99
USD	200		6.065	7.163	4,80
USD	1.080			11.964	8,01
USD	520		<b>Mexiko — 1,59 % (28. Februar 2021: 1,94 %)</b>		
USD	540		850	760	0,51
USD	50		1.880	1.619	1,08
USD	1.320			2.379	1,59
USD	70		<b>Katar — 0,66 % (28. Februar 2021: 0,65 %)</b>		
USD	20		910	988	0,66
USD	210		<b>Rumänien — 0,48 % (28. Februar 2021: 0,71 %)</b>		
USD	580		802	621	0,41
USD	1.370		110	101	0,07
USD	60			722	0,48
USD	110		<b>Südafrika — 1,44 % (28. Februar 2021: 1,48 %)</b>		
USD	230		2.500	2.146	1,44
USD	320		<b>Südkorea — 0,77 % (28. Februar 2021: 1,05 %)</b>		
USD	180		1.150	1.157	0,77
USD	40		<b>Spanien — 7,08 % (28. Februar 2021: 7,79 %)</b>		
USD	90		1.350	1.359	0,91
USD	50		1.600	1.669	1,12
USD	50		790	828	0,55
USD	450		1.330	1.655	1,11
USD	700		4.200	5.062	3,39
USD	40			10.573	7,08
USD	10		<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,47 % (28. Februar 2021: 0,68 %)</b>		
USD	42		740	709	0,47
USD	8.000		<b>Großbritannien — 0,01 % (28. Februar 2021: 1,42 %)</b>		
USD	40		10	16	0,01
USD	10		<b>Belgien — 2,81 % (28. Februar 2021: 3,11 %)</b>		
USD	2.720		2.720	4.204	2,81
China			<b>China — 0,81 % (28. Februar 2021: 1,15 %)</b>		
	680		680	621	0,42
	590		590	590	0,39
			1.211		0,81
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 58.297 EUR)</b>		58.202	38,96		
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 58,64 % (28. Februar 2021: 53,84 %)</b>					
<b>Belgien — 2,81 % (28. Februar 2021: 3,11 %)</b>					
<b>China — 0,81 % (28. Februar 2021: 1,15 %)</b>					
<b>Frankreich — 12,75 % (28. Februar 2021: 9,40 %)</b>					
<b>Deutschland — 15,99 % (28. Februar 2021: 9,93 %)</b>					
<b>Indonesien — 1,72 % (28. Februar 2021: 2,28 %)</b>					
<b>Italien — 8,01 % (28. Februar 2021: 10,10 %)</b>					
<b>Mexiko — 1,59 % (28. Februar 2021: 1,94 %)</b>					
<b>Katar — 0,66 % (28. Februar 2021: 0,65 %)</b>					
<b>Rumänien — 0,48 % (28. Februar 2021: 0,71 %)</b>					
<b>Südafrika — 1,44 % (28. Februar 2021: 1,48 %)</b>					
<b>Südkorea — 0,77 % (28. Februar 2021: 1,05 %)</b>					
<b>Spanien — 7,08 % (28. Februar 2021: 7,79 %)</b>					
<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,47 % (28. Februar 2021: 0,68 %)</b>					
<b>Großbritannien — 0,01 % (28. Februar 2021: 1,42 %)</b>					

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts	Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA 4,05 % (28. Februar 2021: 0,56 %)</b>					
USD 4.870	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30/04/2025	4,171			2,79
USD 2.220	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31/01/2026	1,878			1,26
		6,049			4,05
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 88.683 EUR)</b>					
		87,604			58,64
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,54 % (28. Februar 2021: 1,28 %)</b>					
USD 905	Western Asset Liquidity Funds Plc—Western Asset US Dollar Liquidity Fund—Class WA (Distributing)	808			0,54
<b>Gesamte kollektive Kapitalanlagen (Kosten 801 EUR)</b>					
		808			0,54
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 147.781 EUR)</b>					
		146,614			98,14
<b>Zinsswaps – 0,05 % (28. Februar 2021: 0,19 %)</b>					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	72			0,05
<b>Devisenterminkontrakte – 0,04 % (28. Februar 2021: 0,04 %)</b>					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	59			0,04
<b>Futures – 0,38 % (28. Februar 2021 – 0,77 %)</b>					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	567			0,38
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					
		147,312			98,61
<b>Verträge (in Tsd.)</b>					
<b>Schriftliche Optionen – 0,00 % (28. Februar 2021: (0,03 %))</b>					
	(790) EUR Call/NOK Put 10,25, fällig 06/04/2022 – Citi	(3)			–
<b>Schriftliche Optionen gesamt (Anschaffungskosten (9 EUR))</b>					
		(3)			–
<b>Inflation Swaps – (0,24 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(358)			(0,24)
<b>Zinsswaps – (0,26 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(385)			(0,26)
<b>Devisenterminkontrakte – (0,38 %) (28. Februar 2021: (0,17 %))</b>					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(569)			(0,38)
<b>Verträge (in Tsd.)</b>					
<b>Futures – (0,40 %) (28. Februar 2021: (0,46 %))</b>					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(590)			(0,40)
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>					
		(1.905)			(1,28)
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>					
		145,407			97,33
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>					
		3,979			2,67
<b>Gesamtnettovermögen</b>					
		€ 149,386			100,00
– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A	Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 20.660.000 EUR bzw. 13,84 % des Nettovermögens.				
*	Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.				
β	Der Zinssatz für diese Art von Wertpapier ist an den Verbraucherpreisindex (Consumer Price Index, CPI)/Einzelhandelspreisindex (Retail Price Index, RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Stand vom 28. Februar 2022.				
<b>ABKÜRZUNGEN:</b>					
Unbefristet	– Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.				
GBP	– Britisches Pfund				
USD	– US-Dollar				
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					
Organismen für gemeinsame Anlagen					
Finanzderivate					
Sonstige Vermögenswerte					
<b>Gesamtvermögen</b>					
100,00					

### Zeitplan für Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating CAD 3M CAD CDOR, Receive Fixed 1,483 %	27/10/2023	8,140	€ (16)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating EUR 6M Euribor Reuters, Receive Fixed -0,250 %	30/06/2026	6,060	(172)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating EUR 6M Euribor Reuters, Receive Fixed -0,150 %	15/08/2026	7,280	(186)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating CZK 6MPribor PRBO, Receive Fixed 3,250 %	09/02/2032	80,800	(11)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,500 %, Receive Floating EUR 6M Euribor Reuters	30/06/2051	940	72
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 217 EUR)				€ 72
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – EUR)				(385)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 217 EUR)				€ (313)

### Zeitplan der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	USD – CPI Urban Consumers	28/04/2026	3,060	€ (223)
Bank of America Merrill Lynch	GBP – RPI All Items NSA	15/10/2026	2,010	(135)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – EUR)				€ –
Nicht realisierte Wertminderung von Inflationsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – EUR)				(358)
Nettowertminderung von Inflationsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – EUR)				€ (358)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
		Kauf			Verkauf			
18/05/2022	Citi	Kauf	HUF	401.628	Verkauf	EUR	1.120	€ (53)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	580	Verkauf	EUR	507	8
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	EUR	376	Verkauf	SEK	3.980	2
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	EUR	11.617	Verkauf	USD	13.348	(250)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	70	Verkauf	AUD	112	(2)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	220	Verkauf	CAD	320	(4)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	70	Verkauf	CZK	1.500	3
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	NOK	19.957	Verkauf	EUR	1.973	38
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	HUF	611.360	Verkauf	EUR	1.710	(85)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	GBP	15	Verkauf	EUR	18	–
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	GBP	195	Verkauf	EUR	232	1
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	680	Verkauf	GBP	573	(4)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	PLN	6.424	Verkauf	HUF	506.020	7
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	8.138	Verkauf	USD	9.292	(123)
18/05/2022	UBS	Kauf	SEK	3.981	Verkauf	EUR	382	(7)
18/05/2022	UBS	Kauf	EUR	2.121	Verkauf	USD	2.431	(41)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 42 EUR)							€	59
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (187) EUR)								(569)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (145) EUR)							€	(510)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nominaler Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
90 Day Euro\$ December 2022	Bank of America Merrill Lynch	47	€10.299	€ (52)
90 Day Euro\$ December 2023	Bank of America Merrill Lynch	84	18.327	(236)
Australia 3 Year Bond March 2022	Bank of America Merrill Lynch	54	3.950	(38)
Canadian 5 Year Bond June 2022	Bank of America Merrill Lynch	8	682	3
Euro-Bobl March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(16)	(2.110)	(19)
Euro-Bund March 2022	Bank of America Merrill Lynch	44	7.350	(27)
Euro-Buxl 30 Year Bond March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(30)	(5.933)	419
Long Gilt June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(147)	(1)
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(207)	(23.527)	(173)
U.S. 10 Year Ultra Note June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(13)	(1.639)	(19)
U.S. 2 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	13	2.495	5
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	246	25.951	135
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(16)	(2.236)	(25)
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(995)	5
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 855 EUR)				€ 567
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (509) EUR)				(590)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 346 EUR)				€ (23)

# Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Asset-Backed Securities – 5,45 % (28. Februar 2021: 0,75 %)</b>			<b>Frankreich — 0,75 % (28. Februar 2021: 1,56 %)</b>		
100	98	0,18	200	198	0,38
			200	198	0,37
250	244	0,46		396	0,75
100	96	0,18	<b>Hongkong — 0,44 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
320	321	0,61	250	233	0,44
150	146	0,28	<b>Indien — 0,40 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
43	43	0,08	210	211	0,40
100	97	0,19	<b>Irland — 0,27 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
100	92	0,17	150	145	0,27
150	150	0,28	<b>Israel — 1,40 % (28. Februar 2021: 1,25 %)</b>		
100	98	0,19	240	252	0,47
100	92	0,17	510	492	0,93
150	150	0,28		744	1,40
100	98	0,19	<b>Luxemburg — 0,36 % (28. Februar 2021: 1,58 %)</b>		
100	100	0,19	200	192	0,36
100	96	0,18	<b>Macau — 1,13 % (28. Februar 2021: 0,79 %)</b>		
38	38	0,07	250	233	0,44
250	248	0,47	400	364	0,69
67	66	0,12		597	1,13
100	97	0,18	<b>Südkorea — 0,12 % (28. Februar 2021: 0,32 %)</b>		
150	145	0,27	60	61	0,12
175	169	0,32	<b>Schweiz — 0,78 % (28. Februar 2021: 1,66 %)</b>		
250	249	0,47	200	204	0,39
300	297	0,56	200	208	0,39
				412	0,78
<b>Summe der vermögensbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 2.926 USD)</b>			<b>Großbritannien — 0,38 % (28. Februar 2021: 1,61 %)</b>		
	2.890	5,45	200	202	0,38
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere — 1,14 % (28. Februar 2021: 3,01 %)</b>			<b>USA — 71,22 % (28. Februar 2021: 64,91 %)</b>		
67	70	0,13	90	94	0,18
260	272	0,52	40	41	0,08
33	37	0,07	350	347	0,65
90	92	0,17	470	421	0,79
57	39	0,07	250	219	0,41
46	46	0,09	180	179	0,34
88	49	0,09	120	120	0,23
			80	82	0,15
<b>Gesamte hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 596 USD)</b>			150	154	0,29
	605	1,14	400	375	0,71
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 81,29 % (28. Februar 2021: 82,67 %)</b>			290	289	0,55
<b>Bermuda — 0,81 % (28. Februar 2021: 0,80 %)</b>			—	—	—
417	431	0,81	280	259	0,49
<b>Brasilien — 0,04 % (28. Februar 2021: 0,09 %)</b>			210	255	0,48
20	21	0,04	440	451	0,85
<b>Kanada — 1,71 % (28. Februar 2021: 2,46 %)</b>			100	102	0,19
CAD	171	0,32	250	256	0,48
60	60	0,11	221	255	0,48
200	194	0,37	120	123	0,23
21	21	0,04	110	110	0,21
340	355	0,67	200	188	0,36
100	104	0,20	200	190	0,36
	905	1,71	50	51	0,10
<b>Kaimaninseln — 0,64 % (28. Februar 2021: 1,17 %)</b>			180	211	0,40
171	163	0,31	340	354	0,67
183	174	0,33	300	311	0,59
	337	0,64	160	162	0,30
<b>Chile — 0,04 % (28. Februar 2021: 0,11 %)</b>			140	139	0,26
20	19	0,04	200	183	0,35
			510	503	0,95
			150	158	0,30
			250	258	0,49
			200	198	0,37
			450	467	0,88
			270	303	0,57
			150	169	0,32

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
230 Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig 01/06/2025	233	0,44	23 Vericast Corp, 8,750 %, fällig 31/08/2026 *	21	0,04
370 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,750 %, fällig 15/04/2025	387	0,73	39 Versend Holding Corp., 4,209 %, fällig 27/08/2025 *	39	0,07
			48 Zywave Inc, 5,250 %, fällig 30/10/2027 *	48	0,09
	37.742	71,22	<b>Summe Darlehensanleihen (Anschaffungskosten 3.893 USD)</b>	3.865	7,29
<b>Sambia — 0,80 % (28. Februar 2021: 1,60 %)</b>					
400 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15/10/2027	426	0,80	<b>Vorzugsaktien — 0,41 % (28. Februar 2021: 1,26 %)</b>		
			<b>USA — 0,41 % (28. Februar 2021: 1,26 %)</b>		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 44.290 USD)</b>	43.074	81,29	4 B Riley Financial Inc	96	0,18
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 0,13 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>			2 B Riley Financial Inc	55	0,11
<b>Argentinien — 0,13 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>			– Targa Resources Corp, Series A	65	0,12
7 Argentine Republic Government International Bond, 1,000 %, fällig 09/07/2029	2	0,01		216	0,41
204 Argentine Republic Government International Bond, 0,500 %, fällig 09/07/2030	66	0,12	<b>Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 217 USD)</b>	216	0,41
	68	0,13	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 52.031 USD)</b>	50.718	95,71
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 109 USD)</b>	68	0,13	<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,01 %)</b>		
<b>Darlehensanleihen — 7,29 % (28. Februar 2021: 9,94 %)</b>			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1	–
70 8Th Avenue Food & Provisions Inc, 7,959 %, fällig 01/10/2026 *	65	0,12	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	50.719	95,71
22 Academy Ltd, 4,500 %, fällig 06/11/2027 *	22	0,04	<b>Devisenterminkontrakte – (0,05 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
89 Baldwin Risk Partners, LLC, 4,000 %, fällig 14/10/2027 *	88	0,17	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(29)	(0,05)
139 Carnival Corp, 3,750 %, fällig 30/06/2025 *	138	0,26	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	(29)	(0,05)
19 CoreCivic Inc, 5,500 %, fällig 18/12/2024 *	19	0,04	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Verbindlichkeiten</b>	50.690	95,66
89 CP Atlas Buyer Inc, 4,250 %, fällig 27/12/2027 *	88	0,17	<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>	2.302	4,34
100 DS Parent, Inc., 6,500 %, fällig 10/12/2028 *	97	0,18	<b>Gesamtnettvermögen</b>	\$ 52.992	100,00
49 Equinox Holdings Inc, 10,000 %, fällig 08/03/2024 *	50	0,09			
98 Eyecare Partners LLC, 3,974 %, fällig 05/02/2027 *	98	0,18	– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
99 First Brands Group LLC, 6,000 %, fällig 24/03/2027 *	99	0,19	144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 32.805.000 USD oder 61,93 % des Nettovermögens.		
66 Global Medical Response, Inc, 5,250 %, fällig 24/09/2025 *	66	0,12	* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.		
50 Great Outdoors Group LLC, 4,500 %, fällig 05/03/2028 *	49	0,09	† Illiquide.		
390 Hornblower Sub LLC, 5,500 %, fällig 27/04/2025 *	359	0,68	∞ Sicherheit wird nach Treu und Glauben vom Bewertungsausschuss oder nach dessen Ermessen zum beizulegenden Zeitwert bewertet.		
99 Jane Street Group, LLC, 2,959 %, fällig 21/01/2027 *	98	0,19			
70 LRS Holdings LLC, 4,750 %, fällig 12/08/2028 *	70	0,13			
30 Madison IAQ LLC, 3,750 %, fällig 16/06/2028 *	30	0,06			
240 Magenta Buyer LLC, 9,000 %, fällig 03/05/2029 *	238	0,45			
299 One Call Corp, 6,250 %, fällig 07/04/2027 *	297	0,56			
1 Pacific Bells LLC, 0,000 %, fällig 20/10/2028 *	1	–			
79 Pacific Bells LLC, 5,000 %, fällig 20/10/2028 *	79	0,15			
56 Particle Investments S.a.r.l., 5,750 %, fällig 11/05/2027 *	56	0,11			
250 PECF USS Intermediate Holding Corp, 4,750 %, fällig 04/11/2028 *	249	0,47			
20 PetSmart Inc, 4,500 %, fällig 29/01/2028 *	20	0,04			
200 Project Sky Merger Sub, Inc., 4,250 %, fällig 10/08/2028 *	199	0,38			
40 Radiology Partners Inc, 4,412 %, fällig 09/07/2025 *	39	0,07			
30 Redstone Holdco 2 LP, 5,500 %, fällig 16/04/2028 *	28	0,05			
47 Reedy Industries Inc, 0,000 %, fällig 24/08/2028 *	47	0,09			
263 Reedy Industries Inc, 5,250 %, fällig 24/08/2028 *	261	0,49			
50 RVR Dealership Holdings LLC, 4,750 %, fällig 08/02/2028 *	49	0,09			
90 Southwestern Energy, 3,000 %, fällig 08/06/2027 *	90	0,17			
18 Spencer Spirit IH LLC, 6,209 %, fällig 14/06/2026 *†	18	0,03			
60 Symplr Software, Inc, 5,250 %, fällig 23/11/2027 *	59	0,11			
20 TruGreen LP, 9,250 %, fällig 30/10/2028 *	20	0,04			
99 U.S. Renal Care Inc, 5,209 %, fällig 26/06/2026 *	96	0,18			
99 United Airlines Inc, 4,500 %, fällig 21/04/2028 *	99	0,19			
380 UST Holdings Ltd, 4,250 %, fällig 29/10/2028 *	376	0,71			

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Währung verkaufen (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf USD	8 Verkauf HKD	61 \$ –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf USD	1 Verkauf AUD	– –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf USD	15 Verkauf EUR	13 –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf EUR	1.326 Verkauf USD	1.517 (29)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf AUD	41 Verkauf USD	29 1
18/05/2022	Citi	Kauf USD	175 Verkauf CAD	222 –
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 3 USD)				\$ 1
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(29)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 3 USD)				\$ (28)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Asset-Backed Securities – 0,80 % (28. Februar 2021: 0,59 %)</b>					
590 Home Equity Asset Trust 2005-6, Series 2005 6, Class M5, 1,132 %, fällig 25/12/2035 *	582	0,19	EUR 490 CAB SELAS, 3,375 %, fällig 01/02/2028	506	0,17
2.004 HSI Asset Securitization Corp Trust 2007-OPT1, Series 2007 OPT1, Class 1A, 0,327 %, fällig 25/12/2036 *	1.832	0,61		3.237	1,07
<b>Summe der vermögensbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 2.197 USD)</b>					
	2.414	0,80			
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere — 3,08 % (28. Februar 2021: 4,39 %)</b>					
580 BANK 2018-BNK15, Series 2018 BN15, Class B, 4,655 %, fällig 15/11/2061 *	616	0,20			
28 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2015 CO3, Class 2M2, 5,187 %, fällig 25/07/2025 *	28	0,01			
2.037 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 CO1, Class 1M2, 3,737 %, fällig 25/07/2029 *	2.091	0,69	<b>Deutschland — 1,60 % (28. Februar 2021: 0,72 %)</b>		
830 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 CO1, Class 1B1, 3,737 %, fällig 25/07/2030 *	832	0,28	3.000 Allianz SE, 3,200 %, Perpetual *	2.593	0,86
732 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 CO3, Class 1M2, 2,337 %, fällig 25/10/2030 *	742	0,25	120 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, fällig 15/01/2027	128	0,04
9 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Series 2020 DNA3, Class M2, 144A, 3,187 %, fällig 25/06/2050 *	9	–	EUR 800 Renk AG/Frankfurt am Main, 5,750 %, fällig 15/07/2025	904	0,30
730 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Series 2021DNA3, Class B1, 144A, 3,549 %, fällig 25/10/2033 *	698	0,23	EUR 558 TK Elevator Holdco GmbH, 6,625 %, fällig 15/07/2028	626	0,21
947 Hilton USA Trust 2016-HHV, Series 2016 HHV, Class D, 144A, 4,194 %, fällig 05/11/2038 *	946	0,31	EUR 540 TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig 15/05/2026	589	0,19
5.300 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Series 2018 PHMZ, Class M, 144A, 8,549 %, fällig 15/06/2035 **	265	0,09		4.840	1,60
14 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12, Series 2007 LD12, Class AJ, 6,644 %, fällig 15/02/2051 *	13	–	<b>Guatemala — 0,47 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
495 PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Series 2021 1R, Class A, 144A, 3,087 %, fällig 27/02/2024 *	503	0,17	1.400 Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, fällig 27/04/2029	1.419	0,47
1.487 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-1, Series 2017 1, Class M1, 144A, 4,000 %, fällig 25/01/2056 *	1.492	0,49		1.635	0,54
1.670 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR17 Trust, Series 2005 AR17, Class A1C3, 1,147 %, fällig 25/12/2045 *	1.104	0,36	<b>Irland — 0,91 % (28. Februar 2021: 0,71 %)</b>		
			440 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30/01/2032	418	0,14
<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 14.609 USD)</b>	9.339	3,08	96 Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,250 %, fällig 15/08/2022	97	0,03
			660 Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 15/03/2023	674	0,22
			1.490 Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 15/02/2024	1.562	0,52
				2.751	0,91
			<b>Israel — 0,76 % (28. Februar 2021: 0,77 %)</b>		
			1.170 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21/07/2023	1.147	0,38
			1.250 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01/10/2026	1.141	0,38
				2.288	0,76
			<b>Italien — 0,66 % (28. Februar 2021: 0,54 %)</b>		
			EUR 707 ASR Media and Sponsorship SpA, 5,125 %, fällig 01/08/2024	755	0,25
			EUR 620 Castor SpA, 6,000 %, fällig 15/02/2029	685	0,23
			EUR 500 International Design Group SPA, 4,250 %, fällig 15/05/2026 *	559	0,18
				1.999	0,66
			<b>Kasachstan — 0,86 % (28. Februar 2021: 0,68 %)</b>		
			460 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig 24/04/2030	489	0,16
			660 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, fällig 14/04/2033	602	0,20
			1.520 KazTransGas JSC, 4,375 %, fällig 26/09/2027	1.526	0,50
				2.617	0,86
			<b>Luxemburg — 0,42 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
			GBP 1.040 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01/04/2028	1.284	0,42
			<b>Macau — 0,15 % (28. Februar 2021: 0,15 %)</b>		
			530 Sands China Ltd, 144A, 2,850 %, fällig 08/03/2029	446	0,15
			<b>Mexiko — 1,56 % (28. Februar 2021: 1,58 %)</b>		
			1.310 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 6,875 %, Perpetual *	1.308	0,43
			1.360 BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125 %, fällig 18/01/2033 *	1.313	0,44
			1.980 Orbia Advance Corp SAB de CV, 5,875 %, fällig 17/09/2044	2.094	0,69
				4.715	1,56
			<b>Marokko — 0,53 % (28. Februar 2021: 0,58 %)</b>		
			1.600 OCP SA, 4,500 %, fällig 22/10/2025	1.615	0,53
			<b>Niederlande — 1,51 % (28. Februar 2021: 2,14 %)</b>		
			EUR 380 Promontoria Holding 264 BV, 6,375 %, fällig 01/03/2027	419	0,14
			1.510 Trivium Packaging Finance BV, 5,500 %, fällig 15/08/2026	1.526	0,50
			EUR 1.020 United Group BV, 5,250 %, fällig 01/02/2030	1.071	0,36
			1.150 VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, fällig 15/01/2032	1.091	0,36
			EUR 430 WP/AP Telecom Holdings IV BV, 3,750 %, fällig 15/01/2029	457	0,15
				4.564	1,51
			<b>Peru — 1,74 % (28. Februar 2021: 2,02 %)</b>		
			610 Petroleos del Peru SA, 5,625 %, fällig 19/06/2047	542	0,18
			2.140 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08/11/2042	2.495	0,82
			2.170 Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, fällig 30/04/2028	2.233	0,74
				5.270	1,74
			<b>Südafrika — 0,54 % (28. Februar 2021: 0,04 %)</b>		
			200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10/04/2027	215	0,07
			1.480 Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, fällig 18/03/2031	1.420	0,47
				1.635	0,54
			<b>Spanien — 1,05 % (28. Februar 2021: 0,42 %)</b>		
			EUR 590 Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, fällig 18/09/2027	635	0,21
			EUR 900 Telefonica Europe BV, 2,376 %, Perpetual *	874	0,29
			EUR 370 Tendam Brands SAU, 5,000 %, fällig 15/09/2024	413	0,13
			EUR 1.130 Tendam Brands SAU, 5,250 %, fällig 15/09/2024 *	1.263	0,42
				3.185	1,05

## Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Schweden — 0,36 % (28. Februar 2021: 0,83 %)</b>					
EUR	680	0,23	200	267	0,09
	Heimstaden Bostad AB, 3,625 %, Perpetual *		940	1.013	0,33
	400 Svenska Handelsbanken AB, 4,750 %, Perpetual *	0,13	830		
			Energy Transfer LP / Regency Energy Finance Corp, 4,500 %, fällig 01/11/2023	856	0,28
		0,36	860		
		0,69	Enterprise Products Operating LLC, 4,800 %, fällig 01/02/2049	939	0,31
		1,62	30	37	0,01
			EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15/04/2050	939	0,31
			970	982	0,32
			EQT Corp, 3,900 %, fällig 01/10/2027	982	0,32
			640	676	0,22
			EQT Corp, 5,000 %, fällig 15/01/2029	676	0,22
			210	238	0,08
			Exxon Mobil Corp, 4,327 %, fällig 19/03/2050	238	0,08
			50	50	0,02
			Exxon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15/04/2051	50	0,02
			1.650	2.068	0,68
			FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, fällig 15/11/2031	2.068	0,68
			1.330	1.257	0,41
			Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12/02/2032	1.257	0,41
			390	387	0,13
			Ford Motor Credit Co LLC, 3,815 %, fällig 02/11/2027	387	0,13
			1.515	1.417	0,47
			Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig 10/02/2029	1.417	0,47
			1.670	1.923	0,63
			Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15/03/2043	1.923	0,63
			1.156		
			GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418 %, fällig 15/11/2035	1.301	0,43
			50	56	0,02
			General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01/04/2040	56	0,02
			350	403	0,13
			General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01/04/2050	403	0,13
			390	410	0,14
			General Motors Co, 5,400 %, fällig 02/10/2023	410	0,14
			235	203	0,07
			Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, Perpetual *	203	0,07
			970	992	0,33
			Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875 %, fällig 01/04/2027	992	0,33
			30	28	0,01
			JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22/04/2051 *	28	0,01
			710	683	0,23
			JPMorgan Chase & Co, 3,328 %, fällig 22/04/2052 *	683	0,23
			47	47	0,02
			JPMorgan Chase & Co, Series I, 3,769 %, Perpetual *	47	0,02
			1.800	1.863	0,62
			JPMorgan Chase & Co, Series U, 6,125 %, Perpetual *	1.863	0,62
			550	707	0,23
			Kinder Morgan Inc, 8,050 %, fällig 15/10/2030	707	0,23
			865	1.136	0,38
			Kinder Morgan Inc, 7,800 %, fällig 01/08/2031	1.136	0,38
			135	179	0,06
			Kinder Morgan Inc, 7,750 %, fällig 15/01/2032	179	0,06
			370	419	0,14
			Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, fällig 15/07/2045	419	0,14
			440		
			Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 4,375 %, fällig 15/02/2027	417	0,14
			318	2	–
			Lehman Escrow Receipt, Null-Coupon, Perpetual *∞	2	–
			660	690	0,23
			Lumen Technologies Inc, Series W, 6,750 %, fällig 01/12/2023	690	0,23
			1.083	1.084	0,36
			Match Group Holdings II LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15/12/2027	1.084	0,36
			200	214	0,07
			McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01/04/2050	214	0,07
			160	214	0,07
			Morgan Stanley, 5,597 %, fällig 24/03/2051 *	214	0,07
			1.310	1.317	0,43
			MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 4,625 %, fällig 01/08/2029	1.317	0,43
			340	352	0,12
			Navient Corp, 5,875 %, fällig 25/10/2024	352	0,12
			1.500	1.638	0,54
			Netflix Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15/06/2030	1.638	0,54
			371	378	0,12
			Newell Brands Inc, 4,350 %, fällig 01/04/2023	378	0,12
			580	772	0,25
			NGPL PipeCo LLC, 144A, 7,768 %, fällig 15/12/2037	772	0,25
			690	688	0,23
			Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig 15/08/2029	688	0,23
			490	490	0,16
			Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01/02/2028	490	0,16
			2.400	2.352	0,78
			Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15/02/2030	2.352	0,78
			205	272	0,09
			Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01/03/2032	272	0,09
			610	608	0,20
			Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01/02/2032	608	0,20
			700	762	0,25
			Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20/09/2025	762	0,25
			2.640	3.667	1,21
			Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15/03/2032	3.667	1,21
			980	1.039	0,34
			Targa Resources Partners LP / Targa Resources PartnersFinance Corp, 5,500 %, fällig 01/03/2030	1.039	0,34
			870	901	0,30
			T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15/04/2030	901	0,30
			630	616	0,20
			United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/04/2029	616	0,20
			580	600	0,20
			United Rentals North America Inc, 5,500 %, fällig 15/05/2027	600	0,20
			500	484	0,16
			United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15/02/2031	484	0,16
			520	501	0,17
			Verizon Communications Inc, 3,400 %, fällig 22/03/2041	501	0,17
			150	146	0,05
			Verizon Communications Inc, 3,550 %, fällig 22/03/2051	146	0,05
			420	401	0,13
			Verizon Communications Inc, 3,700 %, fällig 22/03/2061	401	0,13
			460	429	0,14
			Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15/09/2027	429	0,14
			530	498	0,16
			Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 15/02/2029	498	0,16
			1.000	954	0,31
			VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15/02/2028	954	0,31
			560	691	0,23
			Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04/04/2051 *	691	0,23
			880	925	0,31
			Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Perpetual *	925	0,31
			330	335	0,11
			Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig 01/06/2025	335	0,11
			680	698	0,23
			Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15/08/2048	698	0,23
			900	917	0,30
			Western Midstream Operating LP, 5,750 %, fällig 01/02/2050	917	0,30
			452	582	0,19
			Williams Cos Inc/The, Series A, 7,500 %, fällig 15/01/2031	582	0,19
			1.235	1.454	0,48
			Williams Cos Inc/The, 5,750 %, fällig 24/06/2044	1.454	0,48
				78.653	25,96

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Sambia — 0,56 % (28. Februar 2021: 0,47 %)</b>					
560	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 01/04/2025	573	0,19		
1.090	First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 01/03/2026	1.121	0,37		
		1.694	0,56		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 163.547 USD)</b>					
		164.605	54,33		
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 21,55 % (28. Februar 2021: 24,57 %)</b>					
<b>Argentinien — 0,46 % (28. Februar 2021: 0,20 %)</b>					
3.264	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 3,900 %, fällig 01/09/2037	1.391	0,46		
<b>Brasilien — 2,59 % (28. Februar 2021: 1,06 %)</b>					
BRL 13.444	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000 %, fällig 01/01/2023	2.562	0,85		
BRL 16.570	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000 %, fällig 01/01/2025	3.117	1,03		
BRL 11.694	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000 %, fällig 01/01/2027	2.168	0,71		
		7.847	2,59		
<b>China — 3,10 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
CNY 5.500	China Government Bond, 2,500 %, fällig 27/09/2026	875	0,29		
CNY 36.000	China Government Bond, 4,290 %, fällig 22/05/2029	6.318	2,08		
CNY 10.000	China Government Bond, 3,950 %, fällig 29/06/2043	1.765	0,58		
CNY 2.500	China Government Bond, 4,100 %, fällig 21/05/2045	447	0,15		
		9.405	3,10		
<b>Kolumbien — 0,40 % (28. Februar 2021: 0,56 %)</b>					
1.350	Colombia Government International Bond, 5,625 %, fällig 26/02/2044	1.220	0,40		
<b>Elfenbeinküste (Elfenbeinküste) – 0,30 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>					
EUR 880	Ivory Coast Government International Bond, 5,250 %, fällig 22/03/2030	920	0,30		
<b>Dominikanische Republik — 0,20 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
670	Dominican Republic International Bond, 144A, 4,875 %, fällig 23/09/2032	611	0,20		
<b>Ägypten — 0,74 % (28. Februar 2021: 0,54 %)</b>					
1.360	Egypt Government International Bond, 3,875 %, fällig 16/02/2026	1.178	0,39		
EUR 1.180	Egypt Government International Bond, 6,375 %, fällig 11/04/2031	1.057	0,35		
		2.235	0,74		
<b>Gabun — 0,47 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
1.550	Gabon Government International Bond, 144A, 7,000 %, fällig 24/11/2031	1.429	0,47		
<b>Ghana — 0,23 % (28. Februar 2021: 0,27 %)</b>					
1.000	Ghana Government International Bond, 7,625 %, fällig 16/05/2029	683	0,23		
<b>Indonesien — 2,96 % (28. Februar 2021: 3,25 %)</b>					
1.390	Indonesia Government International Bond, 5,250 %, fällig 17/01/2042	1.564	0,52		
IDR 45.226.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR59, 7,000 %, fällig 15/05/2027	3.346	1,11		
IDR 52.396.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR78, 8,250 %, fällig 15/05/2029	4.042	1,33		
		8.952	2,96		
<b>Mexiko — 2,84 % (28. Februar 2021: 3,16 %)</b>					
MXN 45.164	Mexican Bonos, Series M 20, 7,500 %, fällig 03/06/2027	2.177	0,72		
MXN 137.587	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	6.436	2,12		
		8.613	2,84		
<b>Nigeria — 0,14 % (28. Februar 2021: 0,14 %)</b>					
520	Nigeria Government International Bond, 7,625 %, fällig 28/11/2047	421	0,14		
<b>Panama — 0,22 % (28. Februar 2021: 0,20 %)</b>					
680	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 01/04/2056	659	0,22		
<b>Peru — 0,37 % (28. Februar 2021: 0,22 %)</b>					
500	Peruvian Government International Bond, 2,392 %, fällig 23/01/2026	491	0,16		
690	Peruvian Government International Bond, 3,000 %, fällig 15/01/2034	638	0,21		
		1.129	0,37		
<b>Rumänien — 0,27 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
EUR 940	Romanian Government International Bond, 2,000 %, fällig 14/04/2033	817	0,27		
<b>Russland — 1,14 % (28. Februar 2021: 2,27 %)</b>					
RUB 288.495	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19/01/2028 †	1.429	0,47		
RUB 118.210	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23/05/2029 †	553	0,18		
RUB 329.535	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6225, 7,250 %, fällig 10/05/2034 †	1.476	0,49		
		3.458	1,14		
<b>Südafrika — 1,67 % (28. Februar 2021: 1,80 %)</b>					
ZAR 72.778	Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28/02/2041	3.160	1,04		
2.180	Republic of South Africa Government International Bond, 5,750 %, fällig 30/09/2049	1.890	0,63		
		5.050	1,67		
<b>USA — 3,45 % (28. Februar 2021: 8,29 %)</b>					
770	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/02/2027	788	0,26		
30	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15/08/2030	27	0,01		
1.030	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/08/2031	978	0,32		
1.400	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/11/2031	1.343	0,44		
120	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 15/08/2041	110	0,04		
140	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/11/2041	134	0,04		
1.650	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/05/2045	1.855	0,61		
15	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/11/2045	17	0,01		
500	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/08/2046	495	0,16		
360	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/02/2047	409	0,14		
120	United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 15/05/2048	142	0,05		
820	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/02/2049	952	0,31		
430	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2049	489	0,16		
40	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/05/2050	32	0,01		
1.700	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/08/2050#	1.400	0,46		
1.240	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15/05/2051	1.293	0,43		
		10.464	3,45		
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 81.601 USD)</b>					
		65.304	21,55		
<b>Darlehensanleihen — 4,09 % (28. Februar 2021: 6,99 %)</b>					
588	Alterra Mountain Co, 4,000 %, fällig 30/07/2028 *	583	0,19		
969	API Group Inc, 2,709 %, fällig 01/10/2026 *	961	0,32		
682	Asurion LLC, 3,209 %, fällig 03/11/2024 *	674	0,22		
704	Brightview Landscapes LLC, 2,750 %, fällig 15/08/2025 *	697	0,23		
831	Caesars Resort Collection LLC, 2,959 %, fällig 22/12/2024 *	824	0,27		
811	Clarios Global LP, 3,459 %, fällig 30/04/2026 *	805	0,27		
151	Entercom Media Corp, 2,609 %, fällig 17/11/2024 *	149	0,05		
635	Focus Financial Partners LLC, 2,105 %, fällig 03/07/2024 *	628	0,21		
463	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 2,209 %, fällig 15/11/2027 *	453	0,15		
1.246	Hilton Worldwide Finance LLC, 1,937 %, fällig 21/06/2026 *	1.230	0,41		
513	Level 3 Parent LLC, 1,959 %, fällig 01/03/2027 *	502	0,16		
233	Nexstar Broadcasting Inc, 2,606 %, fällig 19/09/2026 *	232	0,08		
593	Prime Security Installations Ltd, 3,500 %, fällig 23/09/2026 *	588	0,19		
1.407	Scientific Games International Inc, 2,959 %, fällig 14/08/2024 *	1.399	0,46		
938	Sedgwick Claims Management Services Inc, 3,459 %, fällig 31/12/2025 *	928	0,31		
600	Sotera Health, 3,250 %, fällig 13/12/2026 *	593	0,20		
902	Terrier Media Buyer, Inc., 3,709 %, fällig 17/12/2026 *	892	0,29		
253	UFC Holdings LLC, 3,500 %, fällig 29/04/2026 *	250	0,08		
<b>Gesamtdarlehensanleihen (Anschaffungskosten 12.555 USD)</b>					
		12.388	4,09		
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 9,56 % (28. Februar 2021: 9,89 %)</b>					
EUR 57	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	6.832	2,25		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – (Fortsetzung)</b>			
35 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc –Western Asset India Bond Fund – LM Class US\$ Accumulating	4.821	1,59	
75 Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason WesternAsset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US\$ Distributing (M)	6.804	2,25	
EUR 51 Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund – LM Class Euro Accumulating	10.500	3,47	
<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 26.265 USD)</b>	<b>28.957</b>	<b>9,56</b>	
<b>Stammaktien — 0,15 % (28. Februar 2021: 0,05 %)</b>			
<b>USA — 0,15 % (28. Februar 2021: 0,05 %)</b>			
44 Berry Corp	438	0,15	
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 491 USD)</b>	<b>438</b>	<b>0,15</b>	
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 301.265 USD)</b>			
<b>Devisenterminkontrakte – 1,52 % (28. Februar 2021: 1,46 %)</b>			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	4.595	1,52	
<b>Futures — 0,03 % (28. Februar 2021: 0,17 %)</b>			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	104	0,03	
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>			
	288.144	95,11	
<b>Credit Default Swaps — (0,13 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(394)	(0,13)	
<b>Inflationsswaps — (0,09 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(263)	(0,09)	
<b>Devisenterminkontrakte – (0,75 %) (28. Februar 2021: (0,32 %))</b>			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(2.265)	(0,75)	
<b>Futures – (0,42 %) (28. Februar 2021: (0,08 %))</b>			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.281)	(0,42)	
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>			
	(4.203)	(1,39)	
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>			
	283.941	93,72	
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>			
	19.028	6,28	
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>\$302.969</b>	<b>100,00</b>	

- Beträge, die als „-“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 42.934.000 USD oder 14,16 % des Nettovermögens.
- \* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.
- † Illiquide.
- ∞ Sicherheit wird nach Treu und Glauben vom Bewertungsausschuss oder nach dessen Ermessen zum beizulegenden Zeitwert bewertet.
- γ Sicherheiten, die nach Jahresende aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen nicht mehr ertragswirksam sind.
- ≠ Sicherheit (ganz oder teilweise) als Sicherheit für den Handel mit Derivaten zum 28. Februar 2022 verpfändet.

**ABKÜRZUNGEN:**

- Unbefristet – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.
- REMIC – Immobilienhypothekenanlage.
- BRL – Brasilianisch Real
- CNY – Chinesischer Renminbi
- EUR – Euro
- GBP – Britisches Pfund
- IDR – Indonesische Rupiah
- MXN – Mexikanischer Peso
- RUB – Russischer Rubel
- ZAR – Südafrika Rand

**Analyse des Gesamtvermögens**

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	78,03
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	3,99
Organismen für gemeinsame Anlagen	9,33
Finanzderivate	1,51
Sonstige Vermögenswerte	7,14
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

**Zeitplan für Credit Default Swaps**

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 5,000 % – Kauf	20/12/2026	5.320	\$ (394)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ (394)
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				–
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ (394)

**Zeitplan der Inflationsswaps**

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	USD – CPI Urban Consumers	28/04/2026	3.220	\$ (263)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(263)
Nettowertminderung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ (263)

**Aufstellung der Devisenterminkontrakte**

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Währung verkaufen (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf EUR 4	Verkauf USD 5	\$ –
10/03/2022	Citi	Kauf IDR 34.311.880	Verkauf USD 2.349	37
10/03/2022	Citi	Kauf INR 108.790	Verkauf USD 1.437	5
10/03/2022	JP Morgan	Kauf USD 5.974	Verkauf RUB 449.143	1.825
10/03/2022	JP Morgan	Kauf RUB 120.363	Verkauf USD 1.596	(484)
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf USD 905	Verkauf BRL 5.209	(103)
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf USD 3.603	Verkauf TWD 99.169	66
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf USD 2.077	Verkauf AUD 2.904	(33)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf USD 79	Verkauf CHF 73	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf USD 357	Verkauf EUR 315	2
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf USD 158	Verkauf EUR 139	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	644	Verkauf	GBP	481	\$	(1)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2.975	Verkauf	GBP	2.195		31
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	46	Verkauf	PLN	188		1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	33	Verkauf	SGD	44		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	42.548	Verkauf	USD	57.679		(593)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	ZAR	8.219	Verkauf	USD	532		1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	11.810	Verkauf	USD	13.509		(257)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	131.320	Verkauf	USD	93.989		1.415
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	15.742	Verkauf	USD	3.969		(223)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CHF	3.233	Verkauf	USD	3.500		27
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	ZAR	1.470	Verkauf	USD	98		(1)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.447	Verkauf	USD	1.077		(9)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	179	Verkauf	ZAR	2.741		3
18/05/2022	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	10.348	Verkauf	SGD	13.924		78
18/05/2022	BNP Paribas	Kauf	USD	740	Verkauf	GBP	547		6
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	5.061	Verkauf	CNH	32.355		(33)
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	1.933	Verkauf	EUR	1.682		41
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	9.466	Verkauf	GBP	6.972		112
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	3.316	Verkauf	HUF	1.099.626		28
18/05/2022	Citi	Kauf	MXN	36.560	Verkauf	USD	1.762		(3)
18/05/2022	Citi	Kauf	HUF	1.099.626	Verkauf	USD	3.519		(231)
18/05/2022	Citi	Kauf	EUR	600	Verkauf	USD	682		(8)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	361	Verkauf	AUD	500		(3)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	5.360	Verkauf	EUR	4.665		113
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.630	Verkauf	GBP	1.200		20
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	5.029	Verkauf	MXN	104.467		2
18/05/2022	HSBC	Kauf	USD	38.492	Verkauf	EUR	33.578		727
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	1.058	Verkauf	EUR	930		12
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	1.167	Verkauf	GBP	862		11
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	MXN	74.842	Verkauf	USD	3.586		16
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	3.902	Verkauf	USD	4.455		(66)
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	516	Verkauf	EUR	450		10
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	CAD	1.230	Verkauf	USD	969		1
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	SGD	4.804	Verkauf	USD	3.579		(36)
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	ZAR	3.000	Verkauf	USD	194		(1)
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	2.693	Verkauf	ZAR	41.862		(1)
18/05/2022	UBS	Kauf	USD	418	Verkauf	GBP	308		5
18/05/2022	UBS	Kauf	EUR	8.225	Verkauf	USD	9.429		(179)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 9.596 USD)								\$	4.595
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (2.105) USD)									(2.265)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 7.491 USD)								\$	2.330

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nominaler Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
90 Day Euro\$ December 2022	Bank of America Merrill Lynch	267	\$ 65.599	(484)
90 Day Euro\$ December 2023	Bank of America Merrill Lynch	152	37.185	(570)
Australia 3 Year Bond March 2022	Bank of America Merrill Lynch	147	12.056	(117)
Euro-Bobl March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(5)	(739)	13
Euro-Buxl 30 Year Bond March 2022	Morgan Stanley	(1)	(222)	17
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	38	4.843	47
U.S. 2 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	12	2.583	5
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(190)	(22.474)	(80)
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(17)	(2.664)	(30)
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(22)	(4.091)	22
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.115 USD)				\$ 104
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (501) USD)				(1.281)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 614 USD)				\$ (1.177)

# Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Asset-Backed Securities — 4,73 % (28. Februar 2021: 4,30 %)</b>					
310			850		
AGL CLO 6 Ltd, Series 2020 6A, Class ER, 144A, 6,754 %, fällig 20/07/2034 *					
	302	0,12	260		0,32
400			260		0,10
Ammc Clo 20 Ltd, Series 2017 20A, Class E, 144A, 6,051 %, fällig 17/04/2029 *					
	392	0,15	390		0,15
400			1.100		1,149
Apex Credit CLO 2019-II Ltd, Series 2019 2A, Class D, 144A, 4,308 %, fällig 25/10/2032 *					
	390	0,15	590		0,23
710			340		
Ares XLII Clo Ltd, Series 2017 42A, Class D, 144A, 3,709 %, fällig 22/01/2028 *					
	711	0,27	4.718		1,82
250			<b>Kaimaninseln — 1,03 % (28. Februar 2021: 1,04 %)</b>		
Ares XXXVR CLO Ltd, Series 2015 35RA, Class D, 144A, 3,241 %, fällig 15/07/2030 *					
	250	0,10	2.795		
500			Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15/09/2024		
ASSURANT CLO Ltd, Series 2018 3A, Class DR, 144A, 3,354 %, fällig 20/10/2031 *					
	500	0,19	2.660		1,03
460			<b>Chile — 0,03 % (28. Februar 2021: 0,10 %)</b>		
Avery Point VI CLO Ltd, Series 2015 6A, Class DR, 144A, 3,265 %, fällig 05/08/2027 *					
	461	0,18	80		0,03
440			<b>Frankreich — 1,24 % (28. Februar 2021: 1,11 %)</b>		
Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Class C, 144A, 3,404 %, fällig 20/04/2031 *					
	438	0,17	800		0,32
420			650		0,23
Canyon CLO 2020-1 Ltd, Series 2020 1A, Class ER, 144A, 6,591 %, fällig 15/07/2034 *					
	401	0,16	800		0,34
400			800		0,35
Catskill Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Class D, 144A, 6,254 %, fällig 20/04/2029 *					
	396	0,15	903		0,35
250			3.206		1,24
CIFC Funding 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Class D, 144A, 3,755 %, fällig 23/04/2029 *					
	250	0,10	<b>Hongkong — 0,15 % (28. Februar 2021: 0,22 %)</b>		
300			450		0,15
Goldentree Loan Management US Clo 10 Ltd, Series 2021 10A, Class E, 144A, 6,454 %, fällig 20/07/2034 *					
	293	0,11	<b>Indien — 0,29 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
300			740		0,29
GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd, Series 2014 9A, Class DR2, 144A, 3,299 %, fällig 29/10/2029 *					
	298	0,12	<b>Irland — 0,16 % (28. Februar 2021: 0,43 %)</b>		
250			440		
Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Class E, 144A, 5,191 %, fällig 15/04/2031 *					
	238	0,09	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30/01/2032		
510			418		0,16
Gripen Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Class E, 144A, 5,954 %, fällig 20/01/2030 *					
	503	0,19	<b>Israel — 0,96 % (28. Februar 2021: 0,40 %)</b>		
250			760		0,30
Harriman Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class ER, 144A, 6,654 %, fällig 20/04/2034 *					
	245	0,09	1.780		0,66
300			Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig 01/02/2036		
LCM 32 Ltd 32A, Class E, 144A, 6,644 %, fällig 20/07/2034 *					
	290	0,11	1.709		0,66
300			Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09/05/2029		
LCM XXII Ltd 22A, Class DR, 144A, 5,754 %, fällig 20/10/2028 *					
	287	0,11	2.478		0,96
443			<b>Italien — 0,43 % (28. Februar 2021: 0,61 %)</b>		
Magnetite XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144A, 5,921 %, fällig 15/10/2031 *					
	432	0,17	500		0,18
500			660		0,25
Marble Point CLO XIV Ltd, Series 2018 2A, Class D, 144A, 3,784 %, fällig 20/01/2032 *					
	485	0,19	1.111		0,43
280			<b>Luxemburg — 0,81 % (28. Februar 2021: 0,71 %)</b>		
Mountain View CLO IX Ltd, Series 2015 9A, Class CR, 144A, 3,361 %, fällig 15/07/2031 *					
	271	0,10	950		0,33
500			200		0,08
Nassau 2021-I Ltd, Series 2021 IA, Class D, 144A, 3,991 %, fällig 26/08/2034 *					
	481	0,19	1.070		0,40
250			ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30/06/2027		
Neuberger Berman CLO XVIII Ltd, Series 2014 18A, Class DR2, 144A, 6,175 %, fällig 21/10/2030 *					
	243	0,09	2.103		0,81
500			<b>Macau — 0,97 % (28. Februar 2021: 1,08 %)</b>		
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 Ltd, Series 2019 34A, Class ER, 144A, 6,741 %, fällig 20/01/2035 *					
	500	0,19	200		0,07
300			200		0,08
Ocean Trails CLO V, Series 2014 5A, Class DRR, 144A, 3,694 %, fällig 13/10/2031 *					
	284	0,11	450		0,14
350			250		0,18
Point Au Roche Park CLO Ltd, Series 2021 1A, Class E, 144A, 6,354 %, fällig 20/07/2034 *					
	339	0,13	1.560		0,53
580			460		0,15
Saranac CLO III Ltd, Series 2014 3A, Class DR, 144A, 3,464 %, fällig 22/06/2030 *					
	558	0,22	2.507		0,97
475			<b>Niederlande — 0,16 % (28. Februar 2021: 0,20 %)</b>		
Southwick Park CLO LLC, Series 2019 4A, Class ER, 144A, 6,504 %, fällig 20/07/2032 *					
	460	0,18	420		0,16
280			<b>Schweiz — 0,77 % (28. Februar 2021: 0,34 %)</b>		
Trinitas CLO X Ltd, Series 2019 10A, Class DR, 144A, 0,000 %, fällig 15/01/2035 *					
	280	0,11	200		0,08
320			920		0,36
Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Class DRR, 144A, 3,061 %, fällig 15/04/2027 *					
	316	0,12	910		0,33
100			Vistaljet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01/02/2030		
Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Class ERR, 144A, 5,981 %, fällig 15/04/2027 *					
	92	0,04	2.003		0,77
500			<b>Großbritannien — 1,44 % (28. Februar 2021: 1,02 %)</b>		
Vibrant CLO XI Ltd, Series 2019 11A, Class CR, 144A, 3,754 %, fällig 20/07/2032 *					
	495	0,19	252		0,10
370			299		0,12
Wellfleet CLO 2017-2A Ltd, Series 2017 2A, Class C, 144A, 3,654 %, fällig 20/10/2029 *					
	366	0,14	800		0,29
<b>Summe der vermögensbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 12.343 USD)</b>					
	12.247	4,73	500		0,19
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 86,26 % (28. Februar 2021: 82,68 %)</b>					
<b>Argentinien — 0,34 % (28. Februar 2021: 0,39 %)</b>					
200			470		0,17
Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750 %, fällig 02/05/2025					
	179	0,07	1.540		0,57
818			Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15/07/2031		
	697	0,27	3.734		1,44
	876	0,34	<b>USA — 74,05 % (28. Februar 2021: 68,04 %)</b>		
<b>Bermuda — 0,31 % (28. Februar 2021: 0,36 %)</b>					
771			760		0,31
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15/10/2025					
	798	0,31	280		0,11
<b>Brasilien — 0,22 % (28. Februar 2021: 0,28 %)</b>					
200			440		0,16
Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 144A, 6,125 %, Perpetual *					
	198	0,08	410		0,16
330			550		0,19
Petrobras Global Finance BV, 7,375 %, fällig 17/01/2027					
	371	0,14	360		0,13
	569	0,22	780		0,28
<b>Kanada — 1,82 % (28. Februar 2021: 2,83 %)</b>					
610			800		0,28
Air Canada, 144A, 3,875 %, fällig 15/08/2026					
	593	0,23	1.230		0,41
280			2.140		0,82
ATS Automation Tooling Systems Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15/12/2028					
	270	0,10	Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01/03/2028		
300			717		0,28
Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15/01/2028					
	301	0,12	1.075		0,41
			2.130		0,82
			Akumin Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01/11/2025		
			Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15/02/2028		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
430 Alliance Data Systems Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15/12/2024	429	0,17	1.820 Colgate Energy Partners III LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01/07/2029	1.875	0,72
550 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15/07/2026	564	0,22	1.470 CommScope Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01/03/2027	1.465	0,57
500 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01/06/2029	466	0,18	960 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01/09/2029	897	0,35
650 Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/ Atlas Luxco			90 CommScope Technologies LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15/03/2027	80	0,03
4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig 01/06/2028	609	0,23	580 Compass Group Diversified Holdings LLC, 144A, 5,250 %, fällig 15/04/2029	561	0,22
720 Alta Equipment Group Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15/04/2026	717	0,28	117 Comstock Resources Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15/05/2025	120	0,05
1.390 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 10,000 %, fällig 15/06/2026	1.286	0,50	740 Comstock Resources Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15/01/2030	717	0,28
420 American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 20/04/2026	430	0,17	110 CoreCivic Inc, 4,625 %, fällig 01/05/2023	110	0,04
1.180 American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20/04/2029	1.208	0,47	900 CoreCivic Inc, 8,250 %, fällig 15/04/2026	1.932	0,75
920 American Axle & Manufacturing Inc, 6,500 %, fällig 01/04/2027	942	0,36	510 Cornerstone Building Brands Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15/01/2029	489	0,19
1.310 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01/10/2029	1.244	0,48	710 Covanta Holding Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01/12/2029	680	0,26
823 American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig 01/09/2026	953	0,37	560 CP Atlas Buyer Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01/12/2028	506	0,20
1.110 AmWINS Group Inc, 144A, 4,875 %, fällig 30/06/2029	1.059	0,41	750 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01/02/2029	761	0,29
82 Anagram International Inc / Anagram Holdings LLC, 144A, 10,000 %, fällig 15/08/2026	86	0,03	320 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15/01/2030	284	0,11
470 Antero Resources Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01/03/2030	480	0,19	450 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01/12/2030	405	0,16
390 Apache Corp, 7,750 %, fällig 15/12/2029	455	0,18	250 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03/11/2036	303	0,12
1.340 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/06/2029	1.212	0,47	600 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, fällig 15/09/2037	734	0,28
330 Arches Buyer Inc, 144A, 4,250 %, fällig 01/06/2028	313	0,12	500 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15/01/2026	562	0,22
870 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, fällig 01/09/2029	817	0,32	400 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20/10/2028	418	0,16
300 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15/08/2027	285	0,11	1.190 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15/08/2027	1.191	0,46
310 Bath & Body Works Inc, 144A, 9,375 %, fällig 01/07/2025	363	0,14	1.700 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01/07/2026	1.724	0,67
250 Bath & Body Works Inc, 7,500 %, fällig 15/06/2029	274	0,11	2.350 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01/12/2028	2.252	0,87
830 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01/10/2030	900	0,35	2.420 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01/06/2029	2.046	0,79
650 Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01/04/2026	673	0,26	300 DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15/08/2026	273	0,11
480 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01/02/2027	485	0,19	860 Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig 15/06/2025	910	0,35
640 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15/02/2029	547	0,21	630 Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, fällig 15/02/2028	571	0,22
640 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,250 %, fällig 30/01/2030	517	0,20	290 Diversified Healthcare Trust, 4,375 %, fällig 01/03/2031	250	0,10
860 Bed Bath & Beyond Inc, 5,165 %, fällig 01/08/2044	631	0,24	510 Dornoch Debt Merger Sub Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15/10/2029	474	0,18
1.570 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15/02/2026	1.548	0,60	940 DraftKings Inc, 144A, Null-Coupon, fällig 15/03/2028	713	0,28
250 Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01/09/2028	237	0,09	300 Edgewell Personal Care Co, 144A, 4,125 %, fällig 01/04/2029	282	0,11
300 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15/12/2025	316	0,12	650 Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig 15/07/2029	597	0,23
1.020 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15/07/2026	1.054	0,41	290 Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15/07/2025	303	0,12
810 Boyne USA Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15/05/2029	797	0,31	80 Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig 30/01/2028	83	0,03
800 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01/02/2026	792	0,31	570 Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc, 144A, 9,500 %, fällig 31/07/2027	557	0,21
690 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15/04/2028	716	0,28	620 Endo Luxembourg Finance Co I Sarl / Endo US Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01/04/2029	584	0,23
540 Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01/07/2025	561	0,22	180 Energy Transfer LP, Series H, 6,500 %, Perpetual *	178	0,07
750 Caesars Entertainment Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/10/2029	713	0,27	210 EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000 %, fällig 01/07/2025	214	0,08
600 Calpine Corp, 144A, 5,000 %, fällig 01/02/2031	556	0,21	200 EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, fällig 01/07/2027	209	0,08
520 Cano Health LLC, 144A, 6,250 %, fällig 01/10/2028	462	0,18	640 EQM Midstream Partners LP, 5,500 %, fällig 15/07/2028	629	0,24
770 Carnival Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01/03/2027	751	0,29	500 EQM Midstream Partners LP, 6,500 %, fällig 15/07/2048	488	0,19
570 Carnival Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01/05/2029	554	0,21	500 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15/01/2029	528	0,20
890 Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15/10/2029	848	0,33	500 EQT Corp, 7,500 %, fällig 01/02/2030	597	0,23
1.210 Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15/05/2029	1.143	0,44	730 EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15/05/2031	711	0,27
380 Carrols Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01/07/2029	328	0,13	260 Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/01/2029	249	0,10
1.000 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01/02/2031	939	0,36	340 Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15/01/2030	324	0,12
740 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig 01/02/2032	721	0,28	510 FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, fällig 01/09/2028	482	0,19
910 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01/05/2032	866	0,33	590 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01/01/2030	587	0,23
200 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01/06/2033	188	0,07	1.060 Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, fällig 15/11/2025	1.083	0,42
970 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15/01/2034	893	0,34	830 Ford Motor Co, 9,000 %, fällig 22/04/2025	963	0,37
470 Centene Corp, 4,625 %, fällig 15/12/2029	485	0,19	1.730 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12/02/2032	1.635	0,63
190 Chegg Inc, Null-Coupon, fällig 01/09/2026	156	0,06	700 Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, fällig 03/05/2029	739	0,29
520 Cheniere Energy Partners LP, 4,000 %, fällig 01/03/2031	513	0,20	1.700 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13/11/2030	1.689	0,65
100 Chesapeake Energy Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01/02/2026	103	0,04	600 Forestar Group Inc, 144A, 3,850 %, fällig 15/05/2026	569	0,22
770 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15/04/2029	748	0,29	370 Forestar Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01/03/2028	358	0,14
1.300 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01/04/2030	1.211	0,47	360 Foundation Building Materials Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01/03/2029	335	0,13
670 Cinemark USA Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15/03/2026	661	0,25	1.360 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15/03/2043	1.566	0,60
490 Clarivate Science Holdings Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01/07/2029	462	0,18	220 Frontier Communications Holdings LLC, 144A, 5,000 %, fällig 01/05/2028	214	0,08
840 Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01/06/2029	874	0,34	200 Frontier Communications Holdings LLC, 144A, 6,750 %, fällig 01/05/2029	194	0,07
920 CNX Midstream Partners LP, 144A, 4,750 %, fällig 15/04/2030	891	0,34	960 Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15/02/2028	964	0,37
660 Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, fällig 01/10/2031	582	0,22	790 Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000 %, fällig 01/11/2026	787	0,30
			730 Gap Inc/The, 144A, 3,875 %, fällig 01/10/2031	655	0,25
			620 GEO Group Inc/The, 5,875 %, fällig 15/10/2024	548	0,21
			1.390 GEO Group Inc/The, 6,000 %, fällig 15/04/2026	1.149	0,44
			730 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15/12/2028	684	0,26
			770 Halozyne Therapeutics Inc, 144A, 0,250 %, fällig 01/03/2027	672	0,26
			750 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20/01/2026	760	0,29
			720 HCA Inc, 5,625 %, fällig 01/09/2028	799	0,31
			207 HCA Inc, 7,500 %, fällig 15/11/2095	260	0,10

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
			1.470		
			144A, 6,250 %, fällig 15/01/2028	1.420	0,55
			750 Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15/02/2028	681	0,26
			700 Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01/02/2028	699	0,27
			600 Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15/01/2029	658	0,25
			620 Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15/02/2030	608	0,23
			760 Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 5,750 %, fällig 15/01/2029	752	0,29
			290 RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc, 144A, 9,750 %, fällig 01/12/2026	304	0,12
			800 Rent-A-Center Inc/TX, 144A, 6,375 %, fällig 15/02/2029	767	0,30
			750 Resideo Funding Inc, 144A, 4,000 %, fällig 01/09/2029	676	0,26
			520 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 3,875 %, fällig 01/03/2031	488	0,19
			1.150 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15/10/2033	1.072	0,41
			520 Rocket Software Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15/02/2029	483	0,19
			900 Roller Bearing Co of America Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15/10/2029	870	0,34
			600 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 01/07/2026	569	0,22
			680 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 31/08/2026	678	0,26
			1.660 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01/04/2028	1.629	0,63
			690 Ryan Specialty Group LLC, 144A, 4,375 %, fällig 01/02/2030	665	0,26
			222 Service Corp International/US, 7,500 %, fällig 01/04/2027	257	0,10
			600 Service Properties Trust, 5,500 %, fällig 15/12/2027	588	0,23
			660 Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet FoodInc/Simmons Feed, 144A, 4,625 %, fällig 01/03/2029	612	0,24
			550 Sizzling Platter LLC / Sizzling Platter Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig 28/11/2025	529	0,20
			670 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01/02/2032	667	0,26
			810 Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144A, 4,875 %, fällig 01/11/2027	795	0,31
			1.160 Spirit Airlines Inc, 1,000 %, fällig 15/05/2026	1.080	0,42
			648 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20/09/2025	705	0,27
			700 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15/03/2032	972	0,38
			920 Sprint Corp, 7,625 %, fällig 15/02/2025	1.020	0,39
			1.000 SRM Escrow Issuer LLC, 144A, 6,000 %, fällig 01/11/2028	1.001	0,39
			970 StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15/05/2029	979	0,38
			240 StoneX Group Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15/06/2025	252	0,10
			380 Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 144A, 5,000 %, fällig 01/06/2031	361	0,14
			230 Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP / Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp, 144A, 5,875 %, fällig 15/05/2025	227	0,09
			600 Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp, 144A, 5,250 %, fällig 15/01/2029	603	0,23
			400 Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig 15/10/2026	397	0,15
			1.660 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01/09/2026	1.522	0,59
			340 Switch Ltd, 144A, 3,750 %, fällig 15/09/2028	323	0,12
			130 Talen Energy Supply LLC, 144A, 7,250 %, fällig 15/05/2027	116	0,04
			350 Talen Energy Supply LLC, 144A, 6,625 %, fällig 15/01/2028	304	0,12
			70 Talen Energy Supply LLC, 144A, 7,625 %, fällig 01/06/2028	63	0,02
			870 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 31/12/2030	839	0,32
			400 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01/02/2031	412	0,16
			450 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig 15/01/2032	444	0,17
			1.050 Tenet Healthcare Corp, 144A, 4,625 %, fällig 15/06/2028	1.030	0,40
			355 Terminix Co LLC/The, 7,450 %, fällig 15/08/2027	417	0,16
			270 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01/07/2038	338	0,13
			780 Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30/04/2028	807	0,31
			820 T-Mobile USA Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15/04/2031	808	0,31
			640 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15/04/2031	631	0,24
			960 TopBuild Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15/03/2029	902	0,35
			700 TransDigm Inc, 4,625 %, fällig 15/01/2029	661	0,26
			680 Triton Water Holdings Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01/04/2029	628	0,24
			250 Twitter Inc, 144A, Null-Coupon, fällig 15/03/2026	217	0,08
			320 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, – 4,875 %, fällig 15/01/2026	327	0,13
			150 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15/04/2026	150	0,06
			1.550 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/04/2029	1.515	0,58
			1.050 United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15/01/2030	1.094	0,42
			630 Univision Communications Inc, 144A, 9,500 %, fällig 01/05/2025	665	0,26
			530 Urban One Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01/02/2028	528	0,20
			1.310 US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig 15/07/2027	1.306	0,50
			150 Vector Group Ltd, 144A, 10,500 %, fällig 01/11/2026	154	0,06
			740 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 01/11/2033	714	0,28
			780 Vericast Corp, 144A, 11,000 %, fällig 15/09/2026	799	0,31
			930 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15/11/2028	855	0,33
			340 Viavi Solutions Inc, 144A, 3,750 %, fällig 01/10/2029	323	0,12
			1.210 Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15/05/2025	1.346	0,52
			400 Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15/09/2027	373	0,14
			2.270 Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15/02/2029	2.149	0,83
			2.340 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15/02/2028	2.232	0,86

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>			<b>Vorzugsaktien — 0,93 % (28. Februar 2021: 1,21 %)</b>		
<b>USA – (Fortsetzung)</b>			<b>USA — 0,93 % (28. Februar 2021: 1,21 %)</b>		
200 Western Midstream Operating LP, 3,600 %, fällig 01/02/2025	201	0,08	18 B Riley Financial Inc	437	0,17
910 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15/08/2048	935	0,36	12 B Riley Financial Inc	286	0,11
700 Western Midstream Operating LP, 5,750 %, fällig 01/02/2050	713	0,28	19 B Riley Financial Inc	457	0,18
1.000 WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15/04/2029	841	0,32	20 MPLX LP, Series A <sup>∞</sup>	662	0,25
490 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,750 %, fällig 15/04/2025	512	0,20	1 Targa Resources Corp, Series A	576	0,22
690 XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig 01/05/2034	754	0,29		2.418	0,93
460 ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15/01/2030	454	0,17			
920 ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01/02/2029	874	0,34			
	191.879	74,05			
<b>Sambia — 1,08 % (28. Februar 2021: 1,20 %)</b>			<b>Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 2.413 USD)</b>	2.418	0,93
350 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 01/04/2025	358	0,14	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 263.430 USD)</b>	255.876	98,76
300 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 01/03/2026	309	0,12	<b>Credit Default Swaps – 0,05 % (28. Februar 2021: 0,02 %)</b>		
2.010 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15/10/2027	2.138	0,82	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	112	0,05
	2.805	1,08	<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,01 %)</b>		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 230.641 USD)</b>	223.491	86,26	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	–	–
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 0,26 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>			<b>Futures – 0,02 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
<b>Argentinien — 0,26 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	47	0,02
55 Argentine Republic Government International Bond, 1,000 %, fällig 09/07/2029	18	–	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	256.035	98,83
650 Argentine Republic Government International Bond, 0,500 %, fällig 09/07/2030	209	0,08	<b>Credit Default Swaps — (0,01 %) (28. Februar 2021: (0,01 %))</b>		
514 Argentine Republic Government International Bond, 1,125 %, fällig 09/07/2035	153	0,06	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(19)	(0,01)
712 Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 3,900 %, fällig 01/09/2037	304	0,12	<b>Devisenterminkontrakte – (0,02 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
	684	0,26	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(41)	(0,02)
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.307 USD)</b>	684	0,26	<b>Futures – (0,03 %) (28. Februar 2021: (0,04 %))</b>		
<b>Darlehensanleihen — 5,58 % (28. Februar 2021: 9,85 %)</b>			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(72)	(0,03)
364 Acrisure LLC, 3,724 %, fällig 15/02/2027 *	359	0,14	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	(132)	(0,06)
930 Adtalem Global Education Inc, 5,250 %, fällig 12/02/2028 *	922	0,36	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	255.903	98,77
399 Allied Universal Holdco LLC, 4,250 %, fällig 14/05/2028 *	394	0,15	<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>	3.197	1,23
118 Amerilife Holdings LLC, 4,106 %, fällig 06/02/2027 *	117	0,05	<b>Gesamtnettvermögen</b>	\$259.100	100,00
478 Caesars Resort Collection LLC, 2,959 %, fällig 22/12/2024 *	473	0,18			
675 CNT Holdings I Corp, 4,250 %, fällig 16/10/2027 *	673	0,26			
130 CoreCivic Inc, 5,500 %, fällig 18/12/2024 *	130	0,05			
987 DCert Buyer, Inc., 4,209 %, fällig 16/10/2026 *	985	0,38			
570 DCert Buyer, Inc., 7,209 %, fällig 16/02/2029 *	570	0,22			
190 Deerfield Dakota Holding LLC, 7,500 %, fällig 14/04/2028 *	192	0,07			
345 Equinox Holdings Inc, 10,000 %, fällig 08/03/2024 *	350	0,13			
394 Eyecare Partners LLC, 3,974 %, fällig 05/02/2027 *	390	0,15			
498 Focus Financial Partners LLC, 3,000 %, fällig 24/06/2028 *	493	0,19			
506 Global Tel'Link Corp, 4,459 %, fällig 29/11/2025 *	493	0,19			
356 Great Outdoors Group LLC, 4,500 %, fällig 05/03/2028 *	355	0,14			
399 Magenta Buyer LLC, 5,750 %, fällig 03/05/2028 *	396	0,15			
304 Mister Car Wash, 3,209 %, fällig 14/05/2026 *	300	0,12			
617 PetSmart Inc, 4,500 %, fällig 29/01/2028 *	615	0,24			
468 Phoenix Guarantor Inc, 3,459 %, fällig 05/03/2026 *	462	0,18			
299 Redstone Holdco 2 LP, 5,500 %, fällig 27/04/2028 *	281	0,11			
705 Rent-A-Center Inc/TX, 3,813 %, fällig 17/02/2028 *	694	0,27			
425 Spencer Spirit IH LLC, 6,209 %, fällig 14/06/2026 *†	424	0,16			
903 Symplr Software, Inc, 5,250 %, fällig 23/11/2027 *	900	0,35			
68 Terrier Media Buyer, Inc., 3,709 %, fällig 17/12/2026 *	67	0,03			
140 TruGreen LP, 9,250 %, fällig 30/10/2028 *	141	0,05			
397 U.S. Renal Care Inc, 5,209 %, fällig 26/06/2026 *	382	0,15			
400 United Airlines Inc, 6,250 %, fällig 25/06/2027 *	419	0,16			
164 Vericast Corp, 8,750 %, fällig 31/08/2026 *	148	0,06			
398 Verscend Holding Corp., 4,209 %, fällig 27/08/2025 *	397	0,15			
399 Virgin Pulse Inc, 4,750 %, fällig 30/03/2028 *	394	0,15			
1.110 Whatabrands LLC, 3,750 %, fällig 21/07/2028 *	1.099	0,42			
435 Zywave Inc, 5,250 %, fällig 30/10/2027 *	434	0,17			
<b>Gesamtdarlehensanleihen (Anschaffungskosten 14.465 USD)</b>	14.449	5,58			
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen — 0,35 % (28. Februar 2021: 2,37 %)</b>					
914 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	914	0,35			
<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 914 USD)</b>	914	0,35			
<b>Stammaktien — 0,65 % (28. Februar 2021: 0,72 %)</b>					
<b>USA — 0,65 % (28. Februar 2021: 0,72 %)</b>					
90 Berry Corp	903	0,35			
5 Oasis Petroleum Inc	710	0,28			
14 Party City Holdings Inc	60	0,02			
	1.673	0,65			
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 1.347 USD)</b>	1.673	0,65			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Ford Motor Credit Co LLC, 5,000 % – Verkauf	20/12/2026	900	\$ 112
Goldman Sachs	Occidental Petroleum Corporation, 1,000 % – Verkauf	20/06/2026	920	(19)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 39 USD)				\$ 112
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (26) USD)				(19)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 13 USD)				\$ 93

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	35	Verkauf	EUR	31	\$ –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	1	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	19	Verkauf	SGD	24	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	721	Verkauf	USD	537	(5)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	39	Verkauf	USD	53	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.645	Verkauf	USD	1.882	(36)
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	7	Verkauf	CAD	8	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 28 USD)								\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1) USD)								(41)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 27 USD)								\$ (41)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nominaler Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Goldman Sachs	(77)	\$ (9.813)	\$ (72)
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Goldman Sachs	76	8.990	47
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 47
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (85) USD)				(72)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (85) USD)				\$ (25)

# Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 62,78 % (28. Februar 2021: 60,10 %)</b>			<b>Kasachstan — 2,37 % (28. Februar 2021: 2,11 %)</b>		
<b>Brasilien — 4,17 % (28. Februar 2021: 3,48 %)</b>			460 KazMunayGas National Co JSC, 6,375 %, fällig 24/10/2048		
300	B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 4,125 %, fällig 20/09/2031	270	0,66	462	1,12
460	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 6,125 %, Perpetual *	456	1,11	974	2,37
360	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05/06/2115	335	0,82		
200	Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15/01/2032	178	0,43		
460	Ultrapar International SA, 5,250 %, fällig 06/10/2026	474	1,15		
		1.713	4,17		
<b>Chile — 3,70 % (28. Februar 2021: 0,94 %)</b>			<b>Kuwait — 2,66 % (28. Februar 2021: 1,94 %)</b>		
580	ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners ColombiaSAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27/04/2026	539	1,31		
200	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA, 3,693 %, fällig 13/09/2061	171	0,41		
200	Inversiones CMPC SA, 3,000 %, fällig 06/04/2031	184	0,45		
200	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 3,500 %, fällig 10/09/2051	171	0,42		
460	VTR Comunicaciones SpA, 5,125 %, fällig 15/01/2028	456	1,11		
		1.521	3,70		
<b>China — 4,05 % (28. Februar 2021: 8,36 %)</b>			<b>Macau — 0,41 % (28. Februar 2021: 0,92 %)</b>		
450	China Aoyuan Group Ltd, 7,950 %, fällig 19/02/2023	85	0,21		
200	China SCE Group Holdings Ltd, 7,375 %, fällig 09/04/2024	135	0,33		
200	CMB International Leasing Management Ltd, 2,750 %, fällig 12/08/2030	188	0,46		
200	Coastal Emerald Ltd, 4,300 %, Perpetual *	195	0,47		
460	Huarong Finance 2019 Co Ltd, 2,125 %, fällig 30/09/2023	443	1,08		
200	Logan Group Co Ltd, 6,500 %, fällig 16/07/2023	71	0,17		
200	Ping'an Real Estate Capital Ltd, 3,450 %, fällig 29/07/2026	182	0,44		
200	Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13/07/2031	168	0,41		
200	Shimao Group Holdings Ltd, 3,975 %, fällig 16/09/2023	66	0,16		
200	Shimao Group Holdings Ltd, 6,125 %, fällig 21/02/2024	64	0,15		
200	Times China Holdings Ltd, 6,750 %, fällig 08/07/2025	70	0,17		
		1.667	4,05		
<b>Kolumbien — 4,30 % (28. Februar 2021: 4,81 %)</b>			<b>Mexiko — 4,24 % (28. Februar 2021: 4,71 %)</b>		
500	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA, 4,875 %, fällig 21/04/2025	501	1,22		
460	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28/05/2045	402	0,98		
414	Millicom International Cellular SA, 6,250 %, fällig 25/03/2029	429	1,04		
460	Oleoducto Central SA, 4,000 %, fällig 14/07/2027	434	1,06		
		1.766	4,30		
<b>Costa Rica — 0,49 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			<b>Marokko — 1,15 % (28. Februar 2021: 0,95 %)</b>		
200	Instituto Costarricense de Electricidad, 6,750 %, fällig 07/10/2031	202	0,49		
<b>Guatemala — 0,49 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			<b>Niederlande — 0,56 % (28. Februar 2021: 1,03 %)</b>		
200	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 5,250 %, fällig 27/04/2029	203	0,49		
<b>Hongkong — 3,04 % (28. Februar 2021: 3,53 %)</b>			<b>Nigeria — 0,48 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
460	AIA Group Ltd, 3,200 %, fällig 16/09/2040	431	1,05		
200	Elect Global Investments Ltd, 4,850 %, Perpetual	193	0,47		
260	Melco Resorts Finance Ltd, 5,375 %, fällig 04/12/2029	226	0,55		
460	Panther Ventures Ltd, 3,500 %, Perpetual	400	0,97		
		1.250	3,04		
<b>Indien — 1,63 % (28. Februar 2021: 0,87 %)</b>			<b>Oman — 1,12 % (28. Februar 2021: 0,91 %)</b>		
460	REC Ltd, 2,250 %, fällig 01/09/2026	435	1,06		
250	Reliance Industries Ltd, 2,875 %, fällig 12/01/2032	234	0,57		
		669	1,63		
<b>Indonesien — 4,29 % (28. Februar 2021: 4,26 %)</b>			<b>Panama — 2,69 % (28. Februar 2021: 1,79 %)</b>		
400	Hutama Karya Persero PT, 3,750 %, fällig 11/05/2030	407	0,99		
460	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, 6,530 %, fällig 15/11/2028	520	1,26		
460	Minejasa Capital BV, 5,625 %, fällig 10/08/2037	435	1,06		
460	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4,000 %, fällig 30/06/2050	403	0,98		
		1.765	4,29		
<b>Irland — 0,46 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			<b>Peru — 1,50 % (28. Februar 2021: 2,10 %)</b>		
200	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30/01/2032	190	0,46		
<b>Israel — 2,70 % (28. Februar 2021: 1,82 %)</b>			<b>Russland — 0,66 % (28. Februar 2021: 3,00 %)</b>		
460	Bank Leumi Le-Israel BM, 144A, 3,275 %, fällig 29/01/2031 *	442	1,08		
200	Israel Electric Corp Ltd, 144A, 3,750 %, fällig 22/02/2032	199	0,48		
460	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,000 %, fällig 15/04/2024	469	1,14		
		1.110	2,70		
			<b>Singapur — 4,52 % (28. Februar 2021: 3,72 %)</b>		
			200 BOC Aviation Ltd, 2,625 %, fällig 17/01/2025		
			250 BOC Aviation Ltd, 3,250 %, fällig 29/04/2025		
			460 DBS Group Holdings Ltd, 3,300 %, Perpetual *		
			460 Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, fällig 19/06/2024		
			460 United Overseas Bank Ltd, 3,750 %, fällig 15/04/2029 *		
			1.860		
			4,52		
			<b>Südafrika — 2,50 % (28. Februar 2021: 0,95 %)</b>		
			460 Eskom Holdings SOC Ltd, 6,350 %, fällig 10/08/2028		
			570 Sasol Financing USA LLC, 4,375 %, fällig 18/09/2026		
			1.028		
			2,50		
			<b>Südkorea — 1,89 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
			200 Hyundai Capital Services Inc, 2,500 %, fällig 24/01/2027		
			200 Kookmin Bank, 2,375 %, fällig 15/02/2027		
			200 NH Investment & Securities Co Ltd, 1,875 %, fällig 07/10/2026		
			200 Shinhan Financial Group Co Ltd, 2,875 %, Perpetual *		
			778		
			1,89		
			<b>Supranational — 2,92 % (28. Februar 2021: 2,45 %)</b>		
			200 African Export-Import Bank/The, 3,994 %, fällig 21/09/2029		
			INR 22.000 Asian Development Bank, 5,900 %, fällig 20/12/2022		
			IDR 741.300 European Bank for Reconstruction & Development, 6,450 %, fällig 13/12/2022		
			53		
			0,13		
			IDR 5.820.000 Inter-American Development Bank, 7,875 %, fällig 14/03/2023		
			419		
			1,02		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>				<b>Republik Ruanda — 0,55 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
<b>Supranational – (Fortsetzung)</b>				240 Rwanda International Government Bond, 5,500 %, fällig 09/08/2031					
INR	17.600	International Finance Corp, 5,850 %, fällig 25/11/2022	234	0,57		226	0,55		
			1.199	2,92	<b>Senegal — 0,41 % (28. Februar 2021: 0,94 %)</b>				
<b>Türkei — 1,20 % (28. Februar 2021: 1,01 %)</b>				200 Senegal Government International Bond, 6,750 %, fällig 13/03/2048					
	510	Türk Telekomunikasyon AS, 4,875 %, fällig 19/06/2024	494	1,20	<b>Türkei — 0,91 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>				
<b>USA — 1,22 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>				400 Türkiye İhracat Kredi Bankası AS, 5,750 %, fällig 06/07/2026					
	10	Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26/03/2050	11	0,03	<b>Ukraine — 0,20 % (28. Februar 2021: 1,45 %)</b>				
	30	New York Life Insurance Co, 3,750 %, fällig 15/05/2050	31	0,07	230 Ukraine Government International Bond, 7,750 %, fällig 01/09/2025				
	460	Sagicor Financial Co Ltd, 5,300 %, fällig 13/05/2028	459	1,12	<b>Vereinigte Arabische Emirate — 0,92 % (28. Februar 2021: 0,81 %)</b>				
			501	1,22	460 Finance Department Government of Sharjah, 4,000 %, fällig 28/07/2050				
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 28.647 USD)</b>				25.815	62,78	<b>Usbekistan — 0,41 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 18,03 % (28. Februar 2021: 28,65 %)</b>				200 Republic of Uzbekistan International Bond, 3,900 %, fällig 19/10/2031					
<b>Bahamas — 0,92 % (28. Februar 2021: 1,76 %)</b>				200 Vietnam Government International Bond, 144A, 4,800 %, fällig 19/11/2024					
	400	Bahamas Government International Bond, 5,750 %, fällig 16/01/2024	379	0,92	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 8.293 USD)</b>				
<b>Bahrain — 1,15 % (28. Februar 2021: 0,98 %)</b>				7.414				18,03	
	460	Bahrain Government International Bond, 6,750 %, fällig 20/09/2029	475	1,15	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 9,85 % (28. Februar 2021: 9,15 %)</b>				
<b>Elfenbeinküste (Elfenbeinküste) – 1,14 % (28. Februar 2021: 1,90 %)</b>				45 Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US\$					
	480	Ivory Coast Government International Bond, 5,750 %, fällig 31/12/2032	471	1,14	<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 4.483 USD)</b>				
<b>Dominikanische Republik — 1,03 % (28. Februar 2021: 0,98 %)</b>				4.048				9,85	
	150	Dominican Republic International Bond, 5,500 %, fällig 22/02/2029	149	0,36	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 41.423 USD)</b>				
	300	Dominican Republic International Bond, 144A, 4,875 %, fällig 23/09/2032	274	0,67	37.277				
			423	1,03	90,66				
<b>Ecuador — 0,48 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>				<b>Verträge (in Tsd.)</b>				<b>Wert (in Tsd.) \$</b>	<b>% des Nettoinventarwerts</b>
	280	Ecuador Government International Bond, 1,000 %, fällig 31/07/2035	198	0,48	<b>Gekaufte Optionen – 0,02 % (28. Februar 2021: 0,03 %)</b>				
<b>Ägypten — 1,43 % (28. Februar 2021: 0,94 %)</b>				235 USD Put/CNY Call 6,45, fällig 17/03/2022 – JP Morgan				5	0,01
EGP	3.980	Egypt Government Bond, Series 2YR, 14,138 %, fällig 20/10/2022	255	0,62	425 USD Put/MXN Call 20,00, fällig 20/08/2022 – Goldman Sachs				
	200	Egypt Government International Bond, 7,625 %, fällig 29/05/2032	168	0,41	<b>Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 7 USD)</b>				
	200	Egypt Government International Bond, 7,300 %, fällig 30/09/2033	164	0,40	9				
			587	1,43	<b>Devisenterminkontrakte – 0,37 % (28. Februar 2021: 0,28 %)</b>				
<b>Ghana — 0,48 % (28. Februar 2021: 1,15 %)</b>				Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				155	0,37
	200	Ghana Government International Bond, 10,750 %, fällig 14/10/2030	196	0,48	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>				
<b>Guatemala — 0,45 % (28. Februar 2021: 1,04 %)</b>				37.441				91,05	
	200	Guatemala Government Bond, 4,650 %, fällig 07/10/2041	184	0,45	<b>Schriftliche Optionen — (0,01 %) (28. Februar 2021: (0,06 %))</b>				
<b>Indonesien — 0,51 % (28. Februar 2021: 0,80 %)</b>				(235) USD Call/CNH Put 7,00, fällig 17/03/2022 – JP Morgan				–	–
IDR	2.664.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR68, 8,375 %, fällig 15/03/2034	209	0,51	(425) USD Call/MXN Put 22,70, fällig 20/08/2022 – Goldman Sachs				
					<b>Geschriebene Optionen insgesamt (Kosten \$(7))</b>				
<b>Jamaika — 1,24 % (28. Februar 2021: 1,03 %)</b>				(6)				(0,01)	
	460	Jamaica Government International Bond, 6,750 %, fällig 28/04/2028	511	1,24	<b>Credit Default Swaps — (0,02 %) (28. Februar 2021: (0,05 %))</b>				
<b>Jordanien — 0,46 % (28. Februar 2021: 0,94 %)</b>				Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				(8)	(0,02)
	200	Jordan Government International Bond, 5,850 %, fällig 07/07/2030	188	0,46	<b>Devisenterminkontrakte – (0,42 %) (28. Februar 2021: (0,06 %))</b>				
<b>Kenia — 0,82 % (28. Februar 2021: 0,97 %)</b>				Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				(174)	(0,42)
	400	Republic of Kenya Government International Bond, 6,300 %, fällig 23/01/2034	338	0,82	<b>Futures – (0,22 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>				
<b>Mexiko – 0,45 % (28. Februar 2021: 1,24 %)</b>				Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				(89)	(0,22)
MXN	3.920	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	183	0,45	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>				
<b>Marokko — 0,89 % (28. Februar 2021: 0,82 %)</b>				(277)				(0,67)	
	460	Morocco Government International Bond, 4,000 %, fällig 15/12/2050	364	0,89	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>				
<b>Nigeria — 1,07 % (28. Februar 2021: 0,94 %)</b>				37.164				90,38	
	460	Nigeria Government International Bond, 6,500 %, fällig 28/11/2027	440	1,07	<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>				
<b>Oman — 1,13 % (28. Februar 2021: 0,90 %)</b>				3.954				9,62	
	460	Oman Government International Bond, 4,125 %, fällig 17/01/2023	465	1,13	<b>Gesamtvermögen</b>				
<b>Panama — 0,47 % (28. Februar 2021: 1,26 %)</b>				\$41.118				100,00	
	200	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 01/04/2056	194	0,47					

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.292.000 USD oder 3,15 % des Nettovermögens.

\* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## ABKÜRZUNGEN:

Unbefristet	– Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.
EGP	– Ägyptisches Pfund
IDR	– Indonesische Rupiah
INR	– Indische Rupie
MXN	– Mexikanischer Peso

## Analyse des Gesamtvermögens

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	79,85
Organismen für gemeinsame Anlagen	9,73
Finanzderivate	0,39
Sonstige Vermögenswerte	10,03
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

## Zeitplan für Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Chile Government Bond, 1,000 % – Kauf	20/12/2024	250	\$ (4)
Goldman Sachs	tate of Qatar, 1,000 % – Kauf	20/12/2024	250	(4)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (12) USD)				(8)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (12) USD)				\$ (8)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Verkaufswährung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
15/03/2022	Bank of America Merrill Lynch	Kauf USD 489	Verkauf RUB 37.046	\$ 148
15/03/2022	Bank of America Merrill Lynch	Kauf RUB 33.457	Verkauf USD 417	(109)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf USD 95	Verkauf EUR 82	1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf USD 51	Verkauf EUR 46	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf USD 2	Verkauf GBP 2	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf USD 2	Verkauf GBP 2	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf USD –	Verkauf SGD –	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf GBP 107	Verkauf USD 145	(2)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf EUR 2.504	Verkauf USD 2.863	(54)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf SGD 12	Verkauf USD 9	–
15/03/2022	JP Morgan	Kauf CNH 763	Verkauf USD 119	2
13/04/2022	Citi	Kauf USD 19	Verkauf BRL 110	(2)
13/04/2022	JP Morgan	Kauf USD 221	Verkauf MXN 4.597	(2)
19/04/2022	Citi	Kauf USD 706	Verkauf IDR 10.248.864	(5)
19/04/2022	Citi	Kauf USD 550	Verkauf INR 41.436	4
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 62 USD)				\$ 155
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (13) USD)				(174)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 49 USD)				\$ (19)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nominaler Wert	Nominaler Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Goldman Sachs (53)	\$ (6.754)	(50)
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Goldman Sachs (22)	(3.447)	(39)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 77 USD)			\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)			(89)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 77 USD)			\$ (89)

# Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 89,29 % (28. Februar 2021: 89,01 %)</b>					
<b>Argentinien — 0,78 % (28. Februar 2021: 0,49 %)</b>					
200 Pan American Energy LLC/Argentina, 9,125 %, fällig 30/04/2027	218	0,78			
<b>Brasilien — 8,53 % (28. Februar 2021: 9,01 %)</b>					
400 B3 SA – Brasil Bolsa Balcão, 4,125 %, fällig 20/09/2031	360	1,29			
200 Braskem Finance Ltd, 6,450 %, fällig 03/02/2024	213	0,76			
200 CSN Inova Ventures, 6,750 %, fällig 28/01/2028	208	0,75			
300 Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 6,125 %, Perpetual *	297	1,07			
200 Nexa Resources SA, 6,500 %, fällig 18/01/2028	210	0,76			
200 Petrobras Global Finance BV, 5,600 %, fällig 03/01/2031	200	0,72			
360 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05/06/2115	335	1,20			
200 Suzano Austria GmbH, 5,000 %, fällig 15/01/2030	205	0,74			
280 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 10/11/2039	347	1,24			
	2.375	8,53			
<b>Chile — 6,67 % (28. Februar 2021: 4,81 %)</b>					
390 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27/04/2026	362	1,30			
200 Enel Chile SA, 4,875 %, fällig 12/06/2028	213	0,76			
200 Engie Energia Chile SA, 3,400 %, fällig 28/01/2030	187	0,67			
176 GNL Quintero SA, 4,634 %, fällig 31/07/2029	179	0,64			
200 Inversiones CMPC SA, 3,000 %, fällig 06/04/2031	185	0,66			
350 Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 4,250 %, fällig 07/05/2029	364	1,31			
200 Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 3,500 %, fällig 10/09/2051	171	0,62			
200 VTR Comunicaciones SpA, 5,125 %, fällig 15/01/2028	198	0,71			
	1.859	6,67			
<b>China — 6,87 % (28. Februar 2021: 6,35 %)</b>					
200 China Aoyuan Group Ltd, 7,950 %, fällig 19/02/2023	38	0,14			
200 China SCE Group Holdings Ltd, 7,250 %, fällig 19/04/2023	144	0,51			
200 Country Garden Holdings Co Ltd, 5,400 %, fällig 27/05/2025	155	0,56			
200 Fuqing Investment Management Ltd, 3,250 %, fällig 23/06/2025	185	0,66			
400 Huarong Finance 2019 Co Ltd, 2,125 %, fällig 30/09/2023	385	1,38			
200 Logan Group Co Ltd, 6,500 %, fällig 16/07/2023	71	0,25			
200 Logan Group Co Ltd, 4,250 %, fällig 12/07/2025	60	0,22			
200 Longfor Group Holdings Ltd, 3,900 %, fällig 16/04/2023	200	0,72			
190 Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, fällig 12/11/2023	197	0,71			
200 Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13/07/2031	168	0,60			
200 Shimao Group Holdings Ltd, 3,975 %, fällig 16/09/2023	66	0,24			
200 Sunac China Holdings Ltd, 6,500 %, fällig 09/07/2023	85	0,31			
200 Times China Holdings Ltd, 6,750 %, fällig 16/07/2023	88	0,32			
400 Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6,000 %, fällig 25/10/2023	71	0,25			
	1.913	6,87			
<b>Kolumbien — 8,74 % (28. Februar 2021: 6,29 %)</b>					
200 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA, 4,875 %, fällig 21/04/2025	200	0,72			
200 Ecopetrol SA, 6,875 %, fällig 29/04/2030	209	0,75			
230 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28/05/2045	201	0,72			
200 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 02/11/2051	168	0,60			
200 Grupo de Inversiones Suramericana SA, 5,500 %, fällig 29/04/2026	202	0,72			
200 Grupo Energia Bogota SA ESP, 4,875 %, fällig 15/05/2030	203	0,73			
270 Millicom International Cellular SA, 6,250 %, fällig 25/03/2029	280	1,00			
400 Oleoducto Central SA, 4,000 %, fällig 14/07/2027	378	1,36			
200 Promigas SA ESP / Gases del Pacifico SAC, 3,750 %, fällig 16/10/2029	180	0,65			
200 SURA Asset Management SA, 4,375 %, fällig 11/04/2027	205	0,74			
200 Transportadora de Gas Internacional SA ESP, 5,550 %, fällig 01/11/2028	209	0,75			
	2.435	8,74			
<b>Costa Rica — 0,73 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
200 Instituto Costarricense de Electricidad, 6,750 %, fällig 07/10/2031	202	0,73			
<b>Guatemala — 0,73 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
200 Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 5,250 %, fällig 27/04/2029	203	0,73			
<b>Hongkong — 1,39 % (28. Februar 2021: 2,90 %)</b>					
200 AIA Group Ltd, 2,700 %, Perpetual *	197	0,71			
200 Melco Resorts Finance Ltd, 4,875 %, fällig 06/06/2025	191	0,68			
	388	1,39			
<b>Indien — 5,32 % (28. Februar 2021: 4,34 %)</b>					
200 Adani Ports & Special Economic Zone Ltd, 3,100 %, fällig 02/02/2031	174	0,62			
400 Bharti Airtel Ltd, 4,375 %, fällig 10/06/2025	414	1,49			
200 Oil India Ltd, 5,375 %, fällig 17/04/2024	211	0,76			
200 REC Ltd, 2,250 %, fällig 01/09/2026	189	0,68			
250 Reliance Industries Ltd, 3,667 %, fällig 30/11/2027	259	0,93			
250 Reliance Industries Ltd, 2,875 %, fällig 12/01/2032	234	0,84			
	1.481	5,32			
<b>Indonesien — 1,50 % (28. Februar 2021: 1,65 %)</b>					
200 Cikarang Litrindo Tbk PT, 4,950 %, fällig 14/09/2026	201	0,72			
230 Minejasa Capital BV, 5,625 %, fällig 10/08/2037	217	0,78			
	418	1,50			
<b>Israel — 4,58 % (28. Februar 2021: 2,97 %)</b>					
200 Israel Electric Corp Ltd, 144A, 3,750 %, fällig 22/02/2032	198	0,71			
300 Mizrahi Tefahot Bank Ltd, 144A, 3,077 %, fällig 07/04/2031 *	288	1,04			
750 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig 31/01/2025	789	2,83			
	1.275	4,58			
<b>Kasachstan — 1,49 % (28. Februar 2021: 1,70 %)</b>					
200 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig 24/04/2030	213	0,77			
200 KazTransGas JSC, 4,375 %, fällig 26/09/2027	201	0,72			
	414	1,49			
<b>Kuwait — 2,97 % (28. Februar 2021: 2,67 %)</b>					
200 Equate Petrochemical BV, 4,250 %, fällig 03/11/2026	207	0,74			
200 MEGlobal Canada ULC, 5,875 %, fällig 18/05/2030	227	0,82			
410 NBK Tier 1 Ltd, 3,625 %, Perpetual *	394	1,41			
	828	2,97			
<b>Macau — 2,42 % (28. Februar 2021: 2,44 %)</b>					
400 Sands China Ltd, 5,400 %, fällig 08/08/2028	394	1,41			
330 Wynn Macau Ltd, 5,125 %, fällig 15/12/2029	280	1,01			
	674	2,42			
<b>Malaysia — 1,64 % (28. Februar 2021: 1,69 %)</b>					
300 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig 19/08/2050	262	0,94			
200 Goh Capital Ltd, 4,250 %, fällig 24/01/2027	196	0,70			
	458	1,64			
<b>Mexiko — 6,88 % (28. Februar 2021: 6,63 %)</b>					
200 Alpek SAB de CV, 4,250 %, fällig 18/09/2029	199	0,71			
200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 7,500 %, Perpetual *	196	0,70			
200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 6,875 %, Perpetual *	200	0,72			
250 BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125 %, fällig 18/01/2033 *	241	0,87			
200 Cemex SAB de CV, 3,875 %, fällig 11/07/2031	178	0,64			
280 Comision Federal de Electricidad, 3,875 %, fällig 26/07/2033	250	0,90			
300 Fresnillo Plc, 4,250 %, fällig 02/10/2050	273	0,98			
200 Orbia Advance Corp SAB de CV, 2,875 %, fällig 11/05/2031	181	0,65			
200 Trust Fibra Uno, 4,869 %, fällig 15/01/2030	198	0,71			
	1.916	6,88			
<b>Marokko — 1,51 % (28. Februar 2021: 1,22 %)</b>					
520 OCP SA, 5,125 %, fällig 23/06/2051	421	1,51			
<b>Niederlande — 1,01 % (28. Februar 2021: 1,64 %)</b>					
200 VEON Holdings BV, 4,000 %, fällig 09/04/2025	87	0,31			
440 VEON Holdings BV, 3,375 %, fällig 25/11/2027	194	0,70			
	281	1,01			
<b>Nigeria — 0,71 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
200 IHS Holding Ltd, 5,625 %, fällig 29/11/2026	197	0,71			
<b>Panama — 2,82 % (28. Februar 2021: 2,59 %)</b>					
400 Banco General SA, 5,250 %, Perpetual *	399	1,43			
200 Banco Nacional de Panama, 2,500 %, fällig 11/08/2030	177	0,64			
220 Cable Onda SA, 4,500 %, fällig 30/01/2030	209	0,75			
	785	2,82			
<b>Peru — 5,83 % (28. Februar 2021: 5,92 %)</b>					
200 Banco BBVA Peru SA, 5,250 %, fällig 22/09/2029 *	206	0,74			
190 Banco de Credito del Peru, 3,125 %, fällig 01/07/2030 *	181	0,65			
200 Consorcio Transmataro SA, 4,700 %, fällig 16/04/2034	206	0,74			
200 Kallpa Generacion SA, 4,125 %, fällig 16/08/2027	199	0,72			
105 Southern Copper Corp, 7,500 %, fällig 27/07/2035	139	0,50			
300 Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, fällig 30/04/2028	309	1,11			
400 Volcan Cia Minera SAA, 4,375 %, fällig 11/02/2026	383	1,37			
	1.623	5,83			
<b>Katar — 1,58 % (28. Februar 2021: 2,52 %)</b>					
200 Ooredoo International Finance Ltd, 2,625 %, fällig 08/04/2031	192	0,69			
229 Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3, 5,838 %, fällig 30/09/2027	248	0,89			
	440	1,58			
<b>Russland — 0,64 % (28. Februar 2021: 3,72 %)</b>					
200 Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA, 4,950 %, fällig 06/02/2028	89	0,32			
200 Lukoil International Finance BV, 4,750 %, fällig 02/11/2026	88	0,32			
	177	0,64			
<b>Singapur — 0,69 % (28. Februar 2021: 3,81 %)</b>					
200 BOC Aviation Ltd, 1,750 %, fällig 21/01/2026	192	0,69			
<b>Südafrika — 4,36 % (28. Februar 2021: 1,74 %)</b>					
200 Eskom Holdings SOC Ltd, 6,350 %, fällig 10/08/2028	204	0,73			
470 Liquid Telecommunications Financing Plc, 5,500 %, fällig 04/09/2026	460	1,65			
350 Sasol Financing USA LLC, 4,375 %, fällig 18/09/2026	343	1,23			
200 Sasol Financing USA LLC, 6,500 %, fällig 27/09/2028	208	0,75			
	1.215	4,36			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>		
<b>Südkorea — 1,35 % (28. Februar 2021: 3,76 %)</b>		
360 Shinhan Bank Co Ltd, 3,875 %, fällig 24/03/2026	376	1,35
<b>Türkei — 3,01 % (28. Februar 2021: 2,61 %)</b>		
250 Coca-Cola Icecek AS, 4,500 %, fällig 20/01/2029	246	0,88
200 Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS, 5,375 %, fällig 15/11/2024	200	0,72
200 TC Ziraat Bankası AS, 5,125 %, fällig 29/09/2023	197	0,71
200 Turk Telekomunikasyon AS, 4,875 %, fällig 19/06/2024	194	0,70
	837	3,01
<b>Vereinigte Arabische Emirate — 1,58 % (28. Februar 2021: 3,08 %)</b>		
400 Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC, 4,600 %, fällig 02/11/2047	439	1,58
<b>USA — 1,43 % (28. Februar 2021: 0,84 %)</b>		
400 Sajicor Financial Co Ltd, 5,300 %, fällig 13/05/2028	400	1,43
<b>Sambia — 1,53 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
400 First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 15/10/2027	426	1,53
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 27.362 USD)</b>	<b>24.866</b>	<b>89,29</b>
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 7,99 % (28. Februar 2021: 9,01 %)</b>		
<b>Bahamas — 0,68 % (28. Februar 2021: 0,50 %)</b>		
200 Bahamas Government International Bond, 5,750 %, fällig 16/01/2024	190	0,68
<b>Elfenbeinküste (Elfenbeinküste) – 0,69 % (28. Februar 2021: 0,84 %)</b>		
200 Ivory Coast Government International Bond, 6,125 %, fällig 15/06/2033	193	0,69
<b>Dominikanische Republik — 0,54 % (28. Februar 2021: 0,76 %)</b>		
150 Dominican Republic International Bond, 5,500 %, fällig 22/02/2029	150	0,54
<b>Ägypten – 0,59 % (28. Februar 2021: 0,53 %)</b>		
200 Egypt Government International Bond, 7,300 %, fällig 30/09/2033	164	0,59
<b>Ghana — 0,52 % (28. Februar 2021: 0,54 %)</b>		
200 Ghana Government International Bond, 7,875 %, fällig 26/03/2027	145	0,52
<b>Indien — 0,73 % (28. Februar 2021: 0,53 %)</b>		
200 Export-Import Bank of India, 3,375 %, fällig 05/08/2026	202	0,73
<b>Kenia — 0,61 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
200 Republic of Kenya Government International Bond, 144A, 6,300 %, fällig 23/01/2034	169	0,61
<b>Nigeria — 0,66 % (28. Februar 2021: 0,54 %)</b>		
200 Nigeria Government International Bond, 7,875 %, fällig 16/02/2032	185	0,66
<b>Oman — 0,73 % (28. Februar 2021: 1,02 %)</b>		
200 Oman Government International Bond, 5,625 %, fällig 17/01/2028	204	0,73
<b>Paraguay — 0,63 % (28. Februar 2021: 0,48 %)</b>		
200 Paraguay Government International Bond, 2,739 %, fällig 29/01/2033	175	0,63
<b>Republik Ruanda — 0,75 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
220 Rwanda International Government Bond, 5,500 %, fällig 09/08/2031	207	0,75
<b>Senegal — 0,61 % (28. Februar 2021: 0,53 %)</b>		
200 Senegal Government International Bond, 6,750 %, fällig 13/03/2048	169	0,61

Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Ukraine — 0,25 % (28. Februar 2021: 1,30 %)</b>		
200 Ukraine Government International Bond, 7,750 %, fällig 01/09/2025	71	0,25
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 2.603 USD)</b>	<b>2.224</b>	<b>7,99</b>
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 29.965 USD)</b>	<b>27.090</b>	<b>97,28</b>
<b>Gekaufte Optionen – 0,03 % (28. Februar 2021: 0,02 %)</b>		
400 USD Put/CNY Call 6,45, fällig 17/03/2022 – JP Morgan	9	0,03
<b>Gekaufte Optionen gesamt (Anschaffungskosten 3 USD)</b>	<b>9</b>	<b>0,03</b>
<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,01 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	–	–
<b>Futures — 0,01 % (28. Februar 2021: 0,16 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1	0,01
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>27.100</b>	<b>97,32</b>

Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Schriftliche Optionen – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
(400) USD Call/CNH Put 7,00, fällig 17/03/2022 – JP Morgan	–	–
<b>Geschriebene Optionen insgesamt (Kosten \$(3))</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Devisenterminkontrakte – (0,14 %) (28. Februar 2021: (0,01 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(39)	(0,14)
<b>Futures – (0,10 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(27)	(0,10)
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(66)</b>	<b>(0,24)</b>
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>27.034</b>	<b>97,08</b>
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>	<b>814</b>	<b>2,92</b>
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>\$27.848</b>	<b>100,00</b>

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 823.000 USD oder 2,96 % des Nettovermögens.

\* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.

**ABKÜRZUNGEN:**

Unbefristet – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,77
Finanzderivate	0,04
Sonstige Vermögenswerte	3,19
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

**Aufstellung der Devisenterminkontrakte**

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Währung	Wert	Verkaufswährung (in Tsd.)	Währung	Wert	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	47	Verkauf	EUR	42	\$ –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	24	Verkauf	EUR	20	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.812	Verkauf	USD	2.073	(39)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 6 USD)								\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (5) USD)								(39)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1 USD)								\$ (39)

**Aufstellung der Futures-Kontrakte**

Gegenpartei	Nominaler Wert	Nominaler Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	UBS	(29)	\$ (27)
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	UBS	(1)	1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 65 USD)			\$ 1
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)			(27)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 65 USD)			\$ (26)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Asset-Backed Securities – 0,30 % (28. Februar 2021: 0,24 %)</b>			<b>Mexiko — 2,81 % (28. Februar 2021: 3,64 %)</b>		
250 Magnetite XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144A, 5,921 %, fällig 15/10/2031 *	244	0,30	800 BBVA Bancomer SA/Texas, 144A, 5,125 %, fällig 18/01/2033 *	772	0,94
<b>Summe der vermögensbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 246 USD)</b>	244	0,30	1.110 Petroleos Mexicanos, 6,625 %, fällig 15/06/2035	1.007	1,23
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 66,19 % (28. Februar 2021: 71,80 %)</b>			600 Petroleos Mexicanos, 6,625 %, fällig 15/06/2038	521	0,64
<b>Argentinien — 1,32 % (28. Februar 2021: 2,22 %)</b>				2.300	2,81
210 Pampa Energia SA, 144A, 7,500 %, fällig 24/01/2027	182	0,22	<b>Niederlande – 1,16 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
610 Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750 %, fällig 02/05/2025	546	0,67	EUR 200 United Group BV, 5,250 %, fällig 01/02/2030	210	0,26
280 YPF SA, 144A, 8,500 %, fällig 28/07/2025	224	0,27	780 VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, fällig 15/01/2032	740	0,90
150 YPF SA, 144A, 4,000 %, fällig 12/02/2026	127	0,16		950	1,16
	1.079	1,32	<b>Peru — 0,88 % (28. Februar 2021: 0,08 %)</b>		
<b>Belgien — 0,25 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			750 Petroleos del Peru SA, 144A, 4,750 %, fällig 19/06/2032	725	0,88
EUR 210 Ideal Standard International SA, 6,375 %, fällig 30/07/2026	201	0,25	<b>Südafrika — 0,56 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
<b>Brasilien — 4,15 % (28. Februar 2021: 2,75 %)</b>			480 Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, fällig 18/03/2031	461	0,56
500 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig 20/09/2031	451	0,55	<b>Schweiz — 0,37 % (28. Februar 2021: 1,03 %)</b>		
1.300 MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14/01/2031	1.147	1,40	300 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, Perpetual *	306	0,37
1.470 Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01/02/2029	1.527	1,86	<b>Türkei — 0,86 % (28. Februar 2021: 1,28 %)</b>		
270 Ultrapar International SA, 144A, 5,250 %, fällig 06/10/2026	278	0,34	300 TC Ziraat Bankasi AS, 144A, 5,125 %, fällig 29/09/2023	296	0,36
	3.403	4,15	410 Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 6,875 %, fällig 28/02/2025	409	0,50
<b>Kanada — 0,91 % (28. Februar 2021: 2,89 %)</b>				705	0,86
340 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15/02/2029	321	0,39	<b>Großbritannien — 5,63 % (28. Februar 2021: 4,80 %)</b>		
440 ATS Automation Tooling Systems Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15/12/2028	425	0,52	GBP 220 Bellis Acquisition Co Plc, 4,500 %, fällig 16/02/2026	281	0,34
	746	0,91	EUR 110 INEOS Quattro Finance 1 Plc, 144A, 3,750 %, fällig 15/07/2026	116	0,14
<b>Kaimaninseln — 1,04 % (28. Februar 2021: 0,79 %)</b>			EUR 510 INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750 %, fällig 15/07/2026	540	0,66
899 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15/09/2024	855	1,04	GBP 250 Marks & Spencer Plc, 3,750 %, fällig 19/05/2026	335	0,41
<b>China — 0,45 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			510 Marston's Issuer Plc, Series B1, 3,049 %, fällig 16/07/2035 *	542	0,66
400 China Aoyuan Group Ltd, 0,000 %, fällig 23/01/2023	77	0,09	GBP 1.530 Saga Plc, 5,500 %, fällig 15/07/2026	1.969	2,40
400 China Aoyuan Group Ltd, 6,350 %, fällig 08/02/2024	74	0,09	310 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15/07/2031	298	0,37
200 China SCE Group Holdings Ltd, 6,000 %, fällig 04/02/2026	115	0,14	GBP 240 Wheel Bidco Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 15/07/2026	305	0,37
600 Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6,000 %, fällig 25/10/2023	107	0,13	GBP 180 Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, fällig 15/07/2026	228	0,28
	373	0,45		4.614	5,63
<b>Frankreich — 0,97 % (28. Februar 2021: 0,51 %)</b>			<b>USA — 34,87 % (28. Februar 2021: 41,90 %)</b>		
720 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, fällig 15/10/2029	661	0,81	200 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, fällig 01/05/2028	186	0,23
EUR 120 Burger King France SAS, 4,750 %, fällig 01/11/2026 *	134	0,16	540 Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/ Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig 01/06/2028	506	0,62
	795	0,97	660 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01/10/2029	627	0,76
<b>Deutschland — 1,46 % (28. Februar 2021: 0,58 %)</b>			170 Apache Corp, 5,100 %, fällig 01/09/2040	170	0,21
EUR 550 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, fällig 15/01/2027	588	0,72	200 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15/08/2027	190	0,23
EUR 310 TK Elevator Midco GmbH, 4,375 %, fällig 15/07/2027	347	0,42	390 Ball Corp, 2,875 %, fällig 15/08/2030	357	0,44
EUR 240 TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig 15/05/2026	262	0,32	240 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15/09/2031	221	0,27
	1.197	1,46	150 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01/02/2027	151	0,18
<b>Guatemala — 0,48 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			340 Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig 01/07/2030	342	0,42
390 Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, fällig 27/04/2029	395	0,48	330 BVX Technologies Inc, 144A, 4,125 %, fällig 30/06/2028	321	0,39
<b>Hongkong — 0,28 % (28. Februar 2021: 0,27 %)</b>			350 Carnival Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01/03/2027	341	0,42
260 Melco Resorts Finance Ltd, 5,375 %, fällig 04/12/2029	226	0,28	640 Carnival Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01/05/2029	622	0,76
<b>Israel — 3,16 % (28. Februar 2021: 3,72 %)</b>			500 Carnival Plc, 1,000 %, fällig 28/10/2029	419	0,51
2.560 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01/10/2026	2.337	2,85	500 Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15/05/2029	472	0,58
260 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig 09/05/2027	251	0,31	290 Carrolls Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01/07/2029	250	0,30
	2.588	3,16	2.310 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01/05/2032	2.198	2,68
<b>Italien — 0,24 % (28. Februar 2021: 1,26 %)</b>			240 Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, fällig 01/10/2031	212	0,26
220 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01/06/2032 *	199	0,24	540 CoreCivic Inc, 8,250 %, fällig 15/04/2026	549	0,67
<b>Luxemburg — 1,90 % (28. Februar 2021: 0,69 %)</b>			100 CoreCivic Inc, 4,750 %, fällig 15/10/2027	89	0,11
300 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15/08/2029	274	0,33	290 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01/02/2029	294	0,36
720 Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, fällig 15/02/2028	639	0,78	220 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15/11/2031	201	0,24
390 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30/06/2027	374	0,46	420 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15/01/2026	472	0,58
GBP 220 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01/04/2028	271	0,33	290 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15/08/2027	290	0,35
	1.558	1,90	230 DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15/11/2024	230	0,28
<b>Macau — 2,44 % (28. Februar 2021: 1,56 %)</b>			360 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01/07/2026	365	0,45
480 MGM China Holdings Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 01/02/2027	437	0,53	360 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01/12/2028	345	0,42
610 Sands China Ltd, 144A, 3,250 %, fällig 08/08/2031	497	0,61	280 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01/06/2029	237	0,29
400 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01/10/2027	352	0,43	800 DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15/08/2026	728	0,89
840 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 15/12/2029	714	0,87	100 Diversified Healthcare Trust, 4,375 %, fällig 01/03/2031	86	0,10
	2.000	2,44	650 Energy Transfer LP, Series F, 6,750 %, Perpetual *	623	0,76
			480 Energy Transfer LP, Series G, 7,125 %, Perpetual *	472	0,58
			80 Energy Transfer LP, Series H, 6,500 %, Perpetual *	79	0,10
			90 EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, fällig 01/07/2027	94	0,11
			90 EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15/05/2026	89	0,11
			940 EQT Corp, 3,900 %, fällig 01/10/2027	952	1,16

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
290	EQT Corp, 5,000 %, fällig 15/01/2029	306	0,37		
90	EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15/05/2031	88	0,11		
1.110	Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12/02/2032	1.049	1,28		
1.100	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig 16/02/2028	1.036	1,26		
200	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13/11/2030	199	0,24		
510	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15/12/2028	478	0,58		
810	JB Poindexter & Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15/04/2026	842	1,03		
320	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 7,125 %, fällig 01/08/2039	436	0,53		
250	Las Vegas Sands Corp, 3,900 %, fällig 08/08/2029	240	0,29		
750	Level 3 Financing Inc, 144A, 3,625 %, fällig 15/01/2029	658	0,80		
290	Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01/10/2031	271	0,33		
220	Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig 01/05/2028	206	0,25		
160	Minerva Merger Sub Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15/02/2030	154	0,19		
370	Oasis Petroleum Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01/06/2026	377	0,46		
380	Occidental Petroleum Corp, 6,125 %, fällig 01/01/2031	433	0,53		
200	Party City Holdings Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15/02/2026	201	0,24		
340	Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15/02/2028	309	0,38		
180	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15/02/2030	176	0,22		
340	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 01/07/2026	323	0,39		
290	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 31/08/2026	289	0,35		
410	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01/04/2028	402	0,49		
100	Sensata Technologies Inc, 4,375 %, fällig 15/02/2030	97	0,12		
390	Sirius XM Radio Inc, 144A, 4,125 %, fällig 01/07/2030	369	0,45		
220	Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01/02/2032	219	0,27		
530	Spirit Airlines Inc, 1,000 %, fällig 15/05/2026	493	0,60		
360	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20/09/2025	392	0,48		
270	StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15/05/2029	273	0,33		
220	Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01/09/2026	202	0,25		
110	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 6,500 %, fällig 15/07/2027	117	0,14		
500	T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15/02/2029	470	0,57		
1.355	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/04/2029	1.324	1,62		
780	Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15/02/2029	738	0,90		
220	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 15/02/2029	207	0,25		
465	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15/02/2028	443	0,54		
360	Western Midstream Operating LP, 4,650 %, fällig 01/07/2026	373	0,46		
250	Western Midstream Operating LP, 4,750 %, fällig 15/08/2028	259	0,32		
20	Western Midstream Operating LP, 4,550 %, fällig 01/02/2030	21	0,02		
400	WV International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15/04/2029	337	0,41		
		28.587	34,87		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen insgesamt (Anschaffungskosten 57.724 USD)</b>					
		54.263	66,19		
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 14,64 % (28. Februar 2021: 15,65 %)</b>					
<b>Angola — 0,31 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
250	Angolan Government International Bond, 144A, 8,250 %, fällig 09/05/2028	250	0,31		
<b>Argentinien — 1,65 % (28. Februar 2021: 1,22 %)</b>					
161	Argentine Republic Government International Bond, 1,000 %, fällig 09/07/2029	54	0,07		
467	Argentine Republic Government International Bond, 0,500 %, fällig 09/07/2030	150	0,18		
1.631	Argentine Republic Government International Bond, 1,125 %, fällig 09/07/2035	485	0,59		
1.041	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 3,900 %, fällig 01/09/2037	443	0,54		
340	Provincia de Cordoba, 144A, 5,000 %, fällig 01/06/2027	220	0,27		
		1.352	1,65		
<b>Bahamas — 0,23 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
200	Bahamas Government International Bond, 144A, 5,750 %, fällig 16/01/2024	190	0,23		
<b>Bahrain — 0,32 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
310	Bahrain Government International Bond, 144A, 6,000 %, fällig 19/09/2044	261	0,32		
<b>Brasilien — 0,43 % (28. Februar 2021: 1,39 %)</b>					
350	Brazilian Government International Bond, 4,625 %, fällig 13/01/2028	356	0,43		
<b>Kolumbien — 0,35 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
340	Colombia Government International Bond, 3,125 %, fällig 15/04/2031	289	0,35		
<b>Costa Rica — 0,24 % (28. Februar 2021: 0,20 %)</b>					
200	Costa Rica Government International Bond, 6,125 %, fällig 19/02/2031	200	0,24		
<b>Dominikanische Republik — 0,73 % (28. Februar 2021: 0,53 %)</b>					
250	Dominican Republic International Bond, 144A, 5,500 %, fällig 22/02/2029	249	0,30		
380	Dominican Republic International Bond, 144A, 4,500 %, fällig 30/01/2030	353	0,43		
		602	0,73		
<b>Ecuador — 0,48 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
550	Ecuador Government International Bond, 144A, 1,000 %, fällig 31/07/2035	389	0,48		
<b>Ägypten — 0,71 % (28. Februar 2021: 0,36 %)</b>					
300	Egypt Government International Bond, 6,588 %, fällig 21/02/2028	268	0,33		
350	Egypt Government International Bond, 144A, 7,600 %, fällig 01/03/2029	315	0,38		
		583	0,71		
<b>El Salvador — 0,14 % (28. Februar 2021: 0,19 %)</b>					
200	El Salvador Government International Bond, 144A, 6,375 %, fällig 18/01/2027	111	0,14		
<b>Ghana — 0,60 % (28. Februar 2021: 0,66 %)</b>					
360	Ghana Government International Bond, 144A, 10,750 %, fällig 14/10/2030	353	0,43		
200	Ghana Government International Bond, 144A, 8,125 %, fällig 26/03/2032	135	0,17		
		488	0,60		
<b>Indonesien — 0,86 % (28. Februar 2021: 1,79 %)</b>					
IDR 10.034.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR61, 7,000 %, fällig 15/05/2022	705	0,86		
<b>Kenia — 0,23 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
200	Republic of Kenya Government International Bond, 144A, 7,250 %, fällig 28/02/2028	191	0,23		
<b>Mexiko — 1,92 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
MXN 13.660	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 23/11/2034	655	0,80		
MXN 4.680	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	219	0,27		
210	Mexico Government International Bond, 2,659 %, fällig 24/05/2031	194	0,23		
540	Mexico Government International Bond, 3,500 %, fällig 12/02/2034	509	0,62		
		1.577	1,92		
<b>Nigeria — 0,34 % (28. Februar 2021: 0,32 %)</b>					
300	Nigeria Government International Bond, 144A, 7,875 %, fällig 16/02/2032	277	0,34		
<b>Oman — 0,62 % (28. Februar 2021: 0,50 %)</b>					
500	Oman Government International Bond, 144A, 5,625 %, fällig 17/01/2028	511	0,62		
<b>Paraguay — 0,69 % (28. Februar 2021: 0,84 %)</b>					
640	Paraguay Government International Bond, 144A, 2,739 %, fällig 29/01/2033	561	0,69		
<b>Peru — 0,63 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
600	Peruvian Government International Bond, 1,862 %, fällig 01/12/2032	514	0,63		
<b>Russland — 0,77 % (28. Februar 2021: 0,94 %)</b>					
RUB 69.969	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19/01/2028 †	347	0,42		
RUB 61.500	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23/05/2029 †	287	0,35		
		634	0,77		
<b>Senegal — 0,24 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
230	Senegal Government International Bond, 144A, 6,750 %, fällig 13/03/2048	194	0,24		
<b>Südafrika — 0,26 % (28. Februar 2021: 0,64 %)</b>					
250	Republic of South Africa Government International Bond, 5,650 %, fällig 27/09/2047	215	0,26		
<b>Türkei — 1,70 % (28. Februar 2021: 1,68 %)</b>					
1.560	Turkey Government International Bond, 4,250 %, fällig 14/04/2026	1.393	1,70		
<b>Ukraine — 0,19 % (28. Februar 2021: 0,74 %)</b>					
450	Ukraine Government International Bond, 144A,				
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 14.491 USD)</b>					
		12.001	14,64		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts		
<b>Darlehensanleihen — 3,22 % (28. Februar 2021: 3,03 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – (0,17 %) (28. Februar 2021: (0,07 %))</b>				
400	AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5,500 %, fällig 20/04/2028 *	409	0,50	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			
874	DIRECTV Financing LLC, 5,750 %, fällig 22/07/2027 *	873	1,06	(139)	(0,17)		
250	SkyMiles IP Ltd, 4,750 %, fällig 16/09/2027 *	262	0,32	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>			
744	United Airlines Inc, 4,500 %, fällig 14/04/2028 *	742	0,91	(139)	(0,17)		
340	United Airlines Inc, 6,250 %, fällig 25/06/2027 *	356	0,43	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>			
<b>Summe Darlehensanleihen (Anschaffungskosten 2.620 USD)</b>			2.642	3,22	75.888	92,57	
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen — 7,76 % (28. Februar 2021: 8,85 %)</b>			<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>				
EUR	6 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	762	0,93	<b>Gesamtvermögen</b>			
20	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US\$ Distributing (M)	1.855	2,26	\$81.978	100,00		
EUR	18 Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund – LM Class Euro (Accumulating)	3.743	4,57	– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.			
<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 5.820 USD)</b>			6.360	7,76	144A	Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 31.724.000 USD oder 38,70 % des Nettovermögens.	
<b>Vorzugsaktien — 0,33 % (28. Februar 2021: 0,26 %)</b>			* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.				
<b>USA — 0,33 % (28. Februar 2021: 0,26 %)</b>			† Illiquide.				
–	Targa Resources Corp, Series A	272	0,33	‡ Sicherheiten, die nach Jahresende aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen nicht mehr ertragswirksam sind.			
<b>Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 263 USD)</b>			272	0,33	<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
<b>Garantie — 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			Unbefristet – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.				
<b>USA — 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			EUR – Euro				
4	EG Acquisition Corp	1	–	GBP – Britisches Pfund			
<b>Gesamtgarantie (Anschaffungskosten 4 USD)</b>			1	–	IDR – Indonesische Rupiah		
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 81.168 USD)</b>			75.783	92,44	MXN – Mexican Peso		
<b>Devisenterminkontrakte – 0,24 % (28. Februar 2021: 0,15 %)</b>			RUB – Russischer Rubel				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			193	0,24	<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
<b>Futures – 0,06 % (28. Februar 2021: 0,05 %)</b>			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden			79,93	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			51	0,06	Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden		
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>			76.027	92,74	Organismen für gemeinsame Anlagen		
						3,16	
						7,61	
						0,29	
						9,01	
						100,00	

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Währung verkaufen (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD – Verkauf	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD 5 Verkauf	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 238 Verkauf	(4)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 22 Verkauf	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 27 Verkauf	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 65 Verkauf	1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 60 Verkauf	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 74 Verkauf	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD 32 Verkauf	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 1.695 Verkauf	(35)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 18 Verkauf	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD 11.007 Verkauf	119
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 3.397 Verkauf	(50)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD 3.048 Verkauf	(20)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 38 Verkauf	–
19/04/2022	Citi	Kauf	USD 1.790 Verkauf	14
19/04/2022	Citi	Kauf	EUR 880 Verkauf	(17)
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD 3.965 Verkauf	41
18/05/2022	Citi	Kauf	EUR 549 Verkauf	(13)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD 847 Verkauf	18
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 158 USD)				\$ 193
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (76) USD)				(139)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 82 USD)				\$ 54

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nominaler Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
Euro FX Currency March 2022	UBS	(47)	\$ (6.596)	\$ 51
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 52 USD)				\$ 51
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				–
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 52 USD)				\$ 51

# Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 0,36 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,36 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
EUR	200 MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, fällig 10/03/2034	0,36
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 237 USD)</b>		
	214	0,36
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 91,86 % (28. Februar 2021: 95,06 %)</b>		
<b>Australien — 0,59 % (28. Februar 2021: 1,52 %)</b>		
AUD	310 Australia Government Bond, Series 30CI, 2,500 %, fällig 20/09/2030 β	0,59
<b>Kanada — 0,62 % (28. Februar 2021: 0,91 %)</b>		
CAD	90 Canadian Government Real Return Bond, Series CPI, 4,000 %, fällig 01/12/2031 β	0,27
CAD	170 Canadian Government Real Return Bond, Series CPI, 1,500 %, fällig 01/12/2044 β	0,35
	207	0,62
	366	0,62
<b>Frankreich — 9,24 % (28. Februar 2021: 5,20 %)</b>		
EUR	280 French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,100 %, fällig 25/07/2022 β	0,65
EUR	2.300 French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 0,250 %, fällig 25/07/2024 β	5,27
EUR	1.210 French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,850 %, fällig 25/07/2027 β	3,32
	1.972	9,24
	5.498	9,24
<b>Deutschland — 6,79 % (28. Februar 2021: 3,09 %)</b>		
EUR	1.500 Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Series I/L, 0,100 %, fällig 15/04/2023 β	3,37
EUR	1.330 Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Series I/L, 0,500 %, fällig 15/04/2030 β	3,42
	2.035	6,79
	4.043	6,79
<b>Indonesien — 1,32 % (28. Februar 2021: 1,43 %)</b>		
	640 Indonesia Government International Bond, 4,200 %, fällig 15/10/2050	1,11
IDR	1.581.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR79, 8,375 %, fällig 15/04/2039	0,21
	125	1,32
	784	1,32
<b>Italien — 6,24 % (28. Februar 2021: 6,49 %)</b>		
EUR	2.220 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 3,100 %, fällig 15/09/2026 β	5,94
EUR	140 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 0,400 %, fällig 15/05/2030 β	0,30
	178	6,24
	3.715	6,24
<b>Japan — 8,51 % (28. Februar 2021: 9,61 %)</b>		
JPY	14.400 Japanese Government CPI Linked Bond, Series 21, 0,100 %, fällig 10/03/2026 β	0,22
JPY	342.000 Japanese Government CPI Linked Bond, Series 22, 0,100 %, fällig 10/03/2027 β	5,35
JPY	189.900 Japanese Government CPI Linked Bond, Series 23, 0,100 %, fällig 10/03/2028 β	2,94
	1.746	8,51
	5.064	8,51
<b>Mexiko – 2,64 % (28. Februar 2021: 3,51 %)</b>		
MXN	2.310 Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	0,18
MXN	17.002 Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07/11/2047	1,37
EUR	650 Mexico Government International Bond, 2,875 %, fällig 08/04/2039	1,09
	652	2,64
	1.574	2,64
<b>Neuseeland — 0,30 % (28. Februar 2021: 0,40 %)</b>		
NZD	190 New Zealand Government Inflation Linked Bond, Series 0930, 3,000 %, fällig 20/09/2030 β	0,30
	177	0,30
<b>Katar — 0,41 % (28. Februar 2021: 0,51 %)</b>		
	200 Qatar Government International Bond, 4,817 %, fällig 14/03/2049	0,41
	243	0,41
<b>Rumänien — 0,44 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
EUR	220 Romanian Government International Bond, 2,000 %, fällig 14/04/2033	0,32
EUR	70 Romanian Government International Bond, 3,750 %, fällig 07/02/2034	0,12
	72	0,44
	263	0,44
<b>Südafrika — 1,37 % (28. Februar 2021: 1,67 %)</b>		
ZAR	18.820 Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28/02/2041	1,37
	817	1,37
<b>Spanien — 1,25 % (28. Februar 2021: 3,83 %)</b>		
EUR	530 Spain Government Inflation Linked Bond, 144A, 0,700 %, fällig 30/11/2033 β	1,25
	746	1,25
<b>USA — 52,14 % (28. Februar 2021: 55,37 %)</b>		
	9.900 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15/04/2023 β	19,60
	1.790 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15/07/2025 β	3,81
	2.269	3,81

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
1.670 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15/01/2026 β	2.131	3,58
4.230 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15/01/2027 β	5.304	8,91
1.340 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500 %, fällig 15/01/2028 β	1.665	2,80
1.760 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 3,875 %, fällig 15/04/2029 β	4.068	6,83
2.640 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15/01/2030 β	3.112	5,23
850 United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31/05/2026	815	1,37
10 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/08/2050	8	0,01
	31.036	52,14
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 53.539 USD)</b>		
	54.679	91,86
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 5,06 % (28. Februar 2021: 1,93 %)</b>		
3.010 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	3.010	5,06
<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 3.010 USD)</b>		
	3.010	5,06
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 56.786 USD)</b>		
	57.903	97,28
<b>Zinsswaps – 0,04 % (28. Februar 2021: 0,12 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	26	0,04
<b>Devisenterminkontrakte – 0,59 % (28. Februar 2021: 0,36 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	353	0,59
<b>Futures – 0,53 % (28. Februar 2021: 0,57 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	315	0,53
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	58.597	98,44

Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Schriftliche Optionen – 0,00 % (28. Februar 2021: (0,03 %))</b>		
EUR (410) EUR Call/NOK Put 10,25, fällig 06/04/2022 – Citi	(2)	–
<b>Geschriebene Optionen gesamt (Kosten \$5)</b>		
	(2)	–
<b>Inflation Swaps — (0,24 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(142)	(0,24)
<b>Zinsswaps – (0,24 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(144)	(0,24)
<b>Devisenterminkontrakte – (0,50 %) (28. Februar 2021: (0,25 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(298)	(0,50)
<b>Futures – (0,40 %) (28. Februar 2021: (0,21 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(236)	(0,40)
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
	(822)	(1,38)
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
	57,775	97,06
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		
	1.750	2,94
<b>Gesamtvermögen</b>		
	\$59.525	100,00

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 4.461.000 USD oder 7,49 % des Nettovermögens.

β Der Zinssatz für diese Art von Wertpapieren ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Stand vom 28. Februar 2022.

**ABKÜRZUNGEN:**

- VPI – Verbraucherpreisindex.
- AUD – Australischer Dollar
- CAD – Kanadischer Dollar
- EUR – Euro
- IDR – Indonesische Rupiah
- JPY – Japanischer Yen
- MXN – Mexikanischer Peso
- NZD – Neuseeländischer Dollar
- ZAR – Südafrika Rand

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

	% des Gesamt vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	90,61
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,97
Finanzderivate	1,15
Sonstige Vermögenswerte	3,27
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Zeitplan für Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	Pay Floating CAD 3M CAD CDOR, Receive Fixed 1,483 %	27/10/2023	4.790	\$ (10)
Citi	Pay Floating EUR 6M Euribor Reuters, Receive Fixed -0,250 %	30/06/2026	1.910	(61)
Citi	Pay Floating EUR 6M Euribor Reuters, Receive Fixed -0,150 %	15/08/2026	2.380	(68)
Citi	Pay Floating CZK 6MPrior PRBO, Receive Fixed 3,250 %	09/02/2032	30.320	(5)
Citi	Pay Fixed 0,500 %, Receive Floating EUR 6M Euribor Reuters	30/06/2051	300	26
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 56 USD)				\$ 26
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(144)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 56 USD)				\$ (118)

### Zeitplan der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	USD – CPI Urban Consumers	28/04/2026	1.100	\$ (90)
Citi	GBP – RPI All Items NSA	15/10/2026	690	(52)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(142)
Nettowertminderung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ (142)

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
10/03/2022	JP Morgan	Kauf	USD	465	Verkauf	KRW	555.440	\$ 3
10/03/2022	JP Morgan	Kauf	KRW	551.960	Verkauf	USD	469	(10)
10/03/2022	JP Morgan	Kauf	RUB	1.060	Verkauf	USD	14	(4)
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	419	Verkauf	BRL	2.140	5
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	477	Verkauf	TWD	13.140	9
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	BRL	2.140	Verkauf	USD	372	42
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	TWD	13.130	Verkauf	USD	472	(3)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	6.244	Verkauf	USD	7.137	(132)
18/05/2022	BNP Paribas	Kauf	USD	338	Verkauf	EUR	295	6
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	2.128	Verkauf	EUR	1.853	45
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	773	Verkauf	JPY	89.571	(7)
18/05/2022	Citi	Kauf	HUF	145.619	Verkauf	USD	466	(31)
18/05/2022	Citi	Kauf	AUD	475	Verkauf	USD	342	3
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	454	Verkauf	CAD	575	–
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.126	Verkauf	EUR	1.850	45
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.691	Verkauf	JPY	311.300	(22)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	51	Verkauf	NZD	76	(1)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	AUD	360	Verkauf	USD	260	2
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	NOK	3.246	Verkauf	USD	368	–
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	846	Verkauf	ZAR	12.870	17
18/05/2022	HSBC	Kauf	USD	533	Verkauf	EUR	465	10
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	1.019	Verkauf	AUD	1.429	(20)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	585	Verkauf	CAD	745	(2)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	23	Verkauf	CZK	500	1
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	5.037	Verkauf	EUR	4.412	75
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	47	Verkauf	GBP	35	1
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	PLN	2.247	Verkauf	HUF	177.000	3
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	999	Verkauf	JPY	115.721	(10)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	169	Verkauf	USD	194	(4)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	MXN	1.511	Verkauf	USD	72	–
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	ZAR	605	Verkauf	USD	40	(1)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	HUF	208.620	Verkauf	USD	666	(42)
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	518	Verkauf	AUD	720	(6)
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	682	Verkauf	JPY	78.670	(3)

# Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)		
18/05/2022	UBS	Kauf	USD	4.531	Verkauf	EUR	3.952	86
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 175 USD)							\$	353
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (119) USD)								(298)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 56 USD)							\$	55

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nominaler Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)	
90 Day Euro\$ December 2022	Citi	34	\$ 8.354	\$ (39)	
90 Day Euro\$ December 2023	Citi	30	7.339	(98)	
Australia 3 Year Bond March 2022	Citi	32	2.624	(26)	
Canadian 5 Year Bond June 2022	Citi	2	191	1	
Euro-Bobl March 2022	Citi	11	1.626	(10)	
Euro-Bund March 2022	Citi	(14)	(2.622)	85	
Euro-Buxl 30 Year Bond March 2022	Citi	(8)	(1.774)	141	
Euro-OAT March 2022	Citi	9	1.597	3	
Japan 10 Year Bond (OSE) March 2022	Citi	(2)	(2.618)	28	
Long Gilt June 2022	Citi	6	990	1	
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Citi	(3)	(382)	(3)	
U.S. 10 Year Ultra Note June 2022	Citi	(37)	(5.229)	(60)	
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Citi	48	5.677	30	
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Citi	7	1.097	15	
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Citi	5	930	11	
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 281 USD)				\$	315
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (104) USD)					(236)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 177 USD)				\$	79

# Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 14,64 % (28. Februar 2021: 21,02 %)</b>					
<b>China — 2,45 % (28. Februar 2021: 6,40 %)</b>					
1.150	China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd, 3,080 %, Perpetual *	1.144	0,22		
2.650	China Minmetals Corp, 3,750 %, Perpetual *	2.685	0,53		
CNY 30.000	CNI Capital Ltd, 3,970 %, fällig 01/11/2022	4.729	0,93		
2.500	Coastal Emerald Ltd, 4,300 %, Perpetual *	2.435	0,48		
2.100	Country Garden Holdings Co Ltd, 3,125 %, fällig 22/10/2025	1.506	0,29		
		12.499	2,45		
<b>Frankreich — 1,49 % (28. Februar 2021: 1,30 %)</b>					
SGD 10.000	Credit Agricole SA, 3,800 %, fällig 30/04/2031 *	7.600	1,49		
<b>Hongkong — 1,02 % (28. Februar 2021: 2,27 %)</b>					
6.000	Panther Ventures Ltd, 3,500 %, Perpetual	5.219	1,02		
<b>Indien — 1,92 % (28. Februar 2021: 1,62 %)</b>					
INR 450.000	NTPC Ltd, 7,250 %, fällig 03/05/2022	5.997	1,18		
4.000	REC Ltd, 2,250 %, fällig 01/09/2026	3.778	0,74		
		9.775	1,92		
<b>Indonesien — 2,25 % (28. Februar 2021: 2,15 %)</b>					
3.000	Minejasa Capital BV, 5,625 %, fällig 10/08/2037	2.836	0,56		
4.150	Pelabuhan Indonesia II PT, 5,375 %, fällig 05/05/2045	4.529	0,89		
4.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4,125 %, fällig 15/05/2027	4.102	0,80		
		11.467	2,25		
<b>Katar — 1,94 % (28. Februar 2021: 1,28 %)</b>					
IDR 140.000.000	QNB Finance Ltd, 6,900 %, fällig 23/01/2025	9.909	1,94		
<b>Singapur — 1,72 % (28. Februar 2021: 2,18 %)</b>					
SGD 11.500	Temasek Financial I Ltd, 2,800 %, fällig 17/08/2071	8.765	1,72		
<b>Supranational — 1,38 % (28. Februar 2021: 3,20 %)</b>					
IDR 20.000.000	International Bank for Reconstruction & Development, 4,300 %, fällig 13/09/2023	1.376	0,27		
IDR 77.000.000	International Finance Corp, 8,000 %, fällig 09/10/2023	5.640	1,11		
		7.016	1,38		
<b>Thailand — 0,47 % (28. Februar 2021: 0,43 %)</b>					
3.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd, 3,500 %, fällig 17/10/2049	2.396	0,47		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 75.365 USD)</b>					
		74.646	14,64		
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 79,61 % (28. Februar 2021: 73,06 %)</b>					
<b>China — 23,15 % (28. Februar 2021: 16,02 %)</b>					
CNY 110.000	Agricultural Development Bank of China, Series 1806, 4,650 %, fällig 11/05/2028	19.022	3,73		
CNY 40.000	China Development Bank, Series 2008, 2,890 %, fällig 22/06/2025	6.385	1,25		
CNY 80.000	China Development Bank, Series 2103, 3,300 %, fällig 03/03/2026	12.943	2,54		
HKD 7.500	China Development Bank/Hong Kong, 0,851 %, fällig 24/01/2024 *	960	0,19		
CNY 33.000	China Government Bond, 3,380 %, fällig 21/11/2024	5.368	1,05		
CNY 50.000	China Government Bond, Series INBK, 2,680 %, fällig 21/05/2030	7.802	1,53		
CNY 96.500	China Government Bond, 3,600 %, fällig 21/05/2030	16.191	3,18		
CNY 130.000	China Government Bond, Series INBK, 3,390 %, fällig 16/03/2050	20.488	4,02		
CNY 60.000	China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14/09/2050	10.206	2,00		
CNY 5.000	Export-Import Bank of China/The, 4,400 %, fällig 14/05/2024	822	0,16		
CNY 40.000	Export-Import Bank of China/The, Series 2007, 3,260 %, fällig 24/02/2027	6.466	1,27		
CNY 30.000	Export-Import Bank of China/The, Series 1910, 3,860 %, fällig 20/05/2029	4.982	0,98		
CNY 40.000	Export-Import Bank of China/The, Series 2010, 3,230 %, fällig 23/03/2030	6.371	1,25		
		118.006	23,15		
<b>Indien — 8,34 % (28. Februar 2021: 7,05 %)</b>					
INR 280.000	India Government Bond, 8,150 %, fällig 24/11/2026	4.010	0,79		
INR 980.000	India Government Bond, Series SPB, 8,240 %, fällig 15/02/2027	14.099	2,77		
INR 450.000	India Government Bond, 7,170 %, fällig 08/01/2028	6.183	1,21		
INR 700.000	India Government Bond, 7,610 %, fällig 09/05/2030	9.784	1,92		
INR 190.000	India Government Bond, 6,570 %, fällig 05/12/2033	2.432	0,48		
INR 450.000	National Highways Authority of India, 7,300 %, fällig 18/05/2022	5.989	1,17		
		5.989	1,17		
<b>Indonesien — 8,21 % (28. Februar 2021: 6,74 %)</b>					
IDR 51.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR77, 8,125 %, fällig 15/05/2024	3.837	0,75		
IDR 96.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR56, 8,375 %, fällig 15/09/2026	7.459	1,46		
IDR 108.875.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR59, 7,000 %, fällig 15/05/2027	8.056	1,58		
IDR 20.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR47, 10,000 %, fällig 15/02/2028	1.679	0,33		
IDR 27.500.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR64, 6,125 %, fällig 15/05/2028	1.928	0,38		
IDR 114.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR54, 9,500 %, fällig 15/07/2031	9.524	1,87		
IDR 25.000.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR58, 8,250 %, fällig 15/06/2032	1.936	0,38		
IDR 100.000.000	Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Series OB, 8,250 %, fällig 15/08/2024	7.424	1,46		
		41.843	8,21		
<b>Malaysia — 10,60 % (28. Februar 2021: 9,31 %)</b>					
MYR 20.490	Malaysia Government Bond, Series 0118, 3,882 %, fällig 14/03/2025	5.013	0,98		
MYR 52.380	Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955 %, fällig 15/09/2025	12.856	2,52		
MYR 1.200	Malaysia Government Bond, Series 0308, 5,248 %, fällig 15/09/2028	313	0,06		
MYR 26.850	Malaysia Government Bond, Series 0219, 3,885 %, fällig 15/08/2029	6.484	1,27		
MYR 78.000	Malaysia Government Bond, Series 0411, 4,232 %, fällig 30/06/2031	19.262	3,78		
MYR 22.510	Malaysia Government Bond, Series 0413, 3,844 %, fällig 15/04/2033	5.339	1,05		
MYR 20.360	Malaysia Government Bond, Series 0419, 3,828 %, fällig 05/07/2034	4.764	0,94		
		54.031	10,60		
<b>Philippinen — 9,17 % (28. Februar 2021: 9,34 %)</b>					
PHP 1.016.000	Philippine Government International Bond, 3,900 %, fällig 26/11/2022	19.767	3,88		
PHP 1.256.000	Philippine Government International Bond, 6,250 %, fällig 14/01/2036	26.981	5,29		
		46.748	9,17		
<b>Singapur — 1,14 % (28. Februar 2021: 1,88 %)</b>					
SGD 8.250	National Environment Agency, 2,500 %, fällig 15/09/2051	5.806	1,14		
<b>Südkorea — 13,87 % (28. Februar 2021: 17,77 %)</b>					
IDR 50.000.000	Export-Import Bank of Korea, 144A, 6,700 %, fällig 02/12/2024	3.590	0,70		
KRW 31.600.000	Korea Treasury Bond, Series 2912, 1,375 %, fällig 10/12/2029	23.897	4,69		
KRW 46.300.000	Korea Treasury Bond, Series 3006, 1,375 %, fällig 10/06/2030	34.761	6,82		
KRW 13.000.000	Korea Treasury Bond, Series 3909, 1,125 %, fällig 10/09/2039	8.454	1,66		
		70.702	13,87		
<b>Thailand — 5,13 % (28. Februar 2021: 4,89 %)</b>					
THB 801.030	Thailand Government Bond, 3,300 %, fällig 17/06/2038	26.180	5,13		
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 417.852 USD)</b>					
		405.813	79,61		
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,41 % (28. Februar 2021: 3,67 %)</b>					
12.311	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	12.311	2,41		
<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 12.311 USD)</b>					
		12.311	2,41		
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 505.528 USD)</b>					
		492.770	96,66		
<b>Total Return Swaps — 1,52 % (28. Februar 2021: 1,26 %)</b>					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	7.755	1,52		
<b>Devisenterminkontrakte – 0,08 % (28. Februar 2021: 0,05 %)</b>					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	378	0,08		
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					
		500.903	98,26		
<b>Devisenterminkontrakte – (0,12 %) (28. Februar 2021: (0,15 %))</b>					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(594)	(0,12)		
<b>Futures – (0,22 %) (28. Februar 2021: (0,19 %))</b>					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.113)	(0,22)		
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>					
		(1.707)	(0,34)		
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>					
		499.196	97,92		
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>					
		10.598	2,08		
<b>Gesamtvermögen</b>					
		\$509.794	100,00		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 3.590.000 USD oder 0,70 % des Nettovermögens.

\* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.

	% des Gesamt vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,51
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,40
Finanzderivate	1,58
Sonstige Vermögenswerte	2,51
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### ABKÜRZUNGEN:

Unbefristete – A-Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.

CNY – Chinesischer Renminbi

HKD – Hongkong-Dollar

IDR – Indonesische Rupiah

INR – Indische Rupie

KRW – Südkoreanischer Won

MYR – Malaysischer Ringgit

PHP – Philippin Peso

SGD – Singapur Dollar

THB – Thai Baht

### Zeitplan für Total Return Swaps

Gegenpartei	Referenzinheit	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	Indonesia Treasury Bond ∞	15/07/2023	10.000.000	\$ 751
Citi	Indonesia Treasury Bond ∞	15/07/2031	37.000.000	3.091
JP Morgan	Indonesia Treasury Bond ∞	15/08/2030	45.000.000	3.913
Nicht realisierte Wertsteigerung von Total Return Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 7.891 USD)				\$ 7.755
Nicht realisierte Wertminderung von Total Return Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				–
Nettowertsteigerung von Total Return Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 7.891 USD)				\$ 7.755

∞ Das Wertpapier wird nach Treu und Glauben vom Bewertungsausschuss oder nach dessen Ermessen zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)	
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	AUD 2	\$ –
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	SGD 1	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	7	Verkauf	USD 8	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	USD –	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD –	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	27	Verkauf	USD 4	–
02/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	57	Verkauf	USD 41	1
02/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	472	Verkauf	USD 75	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	409	Verkauf	AUD 569	(5)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	137	Verkauf	CNH 865	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	6	Verkauf	EUR 5	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	82	Verkauf	SGD 109	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	10.514	Verkauf	USD 12.025	(229)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CHF	303	Verkauf	USD 328	3
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	5.100	Verkauf	USD 3.796	(32)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	30.563	Verkauf	USD 21.876	329
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	34.452	Verkauf	USD 5.402	45
28/03/2022	Citi	Kauf	KRW	8.500.000	Verkauf	USD 7.083	(17)
18/04/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	13.800	Verkauf	USD 10.273	(95)
18/04/2022	Citi	Kauf	SGD	22.810	Verkauf	USD 16.959	(136)
18/04/2022	JP Morgan	Kauf	SGD	13.451	Verkauf	USD 10.000	(80)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 310 USD)						\$ 378	
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (948) USD)						(594)	
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (638) USD)						\$ (216)	

### Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nominaler Wert	Nominaler Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
Korea 10 Year Bond March 2022	UBS	260	\$ 25.949
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)			\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.195) USD)			(1.113)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.195) USD)			\$ (1.113)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 86,23 % (28. Februar 2021: 76,86 %)</b>			<b>Italien – 0,49 % (28. Februar 2021: 0,46 %)</b>		
<b>Australien – 1,67 % (28. Februar 2021: 2,15 %)</b>			<b>Japan – 2,17 % (28. Februar 2021: 1,96 %)</b>		
EUR	720	0,18	EUR	1.960	0,49
EUR	287	0,07	EUR	120	0,03
EUR	1.670	0,42	EUR	750	0,19
GBP	550	0,17	EUR	550	0,14
GBP	230	0,07	EUR	1.790	0,43
EUR	3.000	0,76	EUR	3.370	0,84
	7.408	1,67	EUR	270	0,07
			EUR	2.000	0,47
<b>Belgien – 0,10 % (28. Februar 2021: 0,35 %)</b>			<b>Luxemburg – 0,59 % (28. Februar 2021: 0,58 %)</b>		
EUR	400	0,10	EUR	2.275	0,59
<b>Kanada – 2,64 % (28. Februar 2021: 2,54 %)</b>			<b>Niederlande – 4,36 % (28. Februar 2021: 3,21 %)</b>		
GBP	2.970	0,89	EUR	3.000	0,77
EUR	2.200	0,56	EUR	220	0,06
EUR	1.300	0,30	EUR	200	0,05
GBP	1.230	0,36	GBP	2.500	0,73
EUR	2.110	0,53	EUR	2.300	0,56
	11.734	2,64	EUR	270	0,06
<b>Dänemark – 1,91 % (28. Februar 2021: 1,79 %)</b>			EUR	2.010	0,49
EUR	550	0,14	EUR	200	0,05
EUR	1.580	0,38	EUR	300	0,08
EUR	5.700	1,39	EUR	1.300	0,31
	8.458	1,91	EUR	1.780	0,41
<b>Finnland – 0,24 % (28. Februar 2021: 0,23 %)</b>			EUR	1.700	0,38
EUR	950	0,24	EUR	220	0,05
<b>Frankreich – 9,16 % (28. Februar 2021: 8,91 %)</b>			EUR	300	0,08
EUR	300	0,08	EUR	1.800	0,41
EUR	1.000	0,25	EUR	1.700	0,38
EUR	2.300	0,54	EUR	2.200	0,56
EUR	800	0,21	EUR	1.500	0,35
GBP	2.600	0,76	EUR	1.500	0,35
	3.391	0,76		19.376	4,36
EUR	670	0,15	<b>Norwegen – 0,80 % (28. Februar 2021: 0,77 %)</b>		
EUR	230	0,05	EUR	940	0,23
EUR	2.700	0,65	EUR	1.000	0,25
EUR	1.100	0,28	EUR	540	0,14
EUR	1.000	0,25	EUR	390	0,10
GBP	2.600	0,76	EUR	330	0,08
EUR	300	0,08		3.555	0,80
EUR	6.350	1,39	<b>Singapur – 0,19 % (28. Februar 2021: 0,16 %)</b>		
EUR	300	0,08	EUR	810	0,19
EUR	1.000	0,26	<b>Spanien – 1,27 % (28. Februar 2021: 0,77 %)</b>		
EUR	400	0,10	EUR	2.400	0,53
EUR	400	0,11	EUR	800	0,19
EUR	1.100	0,26	GBP	500	0,15
EUR	2.200	0,56	EUR	1.700	0,40
GBP	3.200	0,96		5.644	1,27
EUR	600	0,15	<b>Supranational – 2,73 % (28. Februar 2021: 2,49 %)</b>		
EUR	300	0,08	GBP	3.000	0,90
EUR	400	0,10	GBP	6.300	1,83
EUR	1.040	0,25		8.129	1,83
EUR	1.100	0,28		12.125	2,73
GBP	1.700	0,52	<b>Schweden – 2,26 % (28. Februar 2021: 1,98 %)</b>		
	40.675	9,16	EUR	2.190	0,50
<b>Deutschland – 6,50 % (28. Februar 2021: 3,81 %)</b>			EUR	1.240	0,31
EUR	900	0,22	EUR	3.050	0,76
EUR	900	0,22	EUR	2.250	0,55
EUR	700	0,18	EUR	550	0,14
GBP	200	0,06		10.016	2,26
EUR	300	0,08	<b>Schweiz – 4,87 % (28. Februar 2021: 3,20 %)</b>		
EUR	600	0,15	EUR	800	0,20
EUR	500	0,13	GBP	3.530	1,01
EUR	1.500	0,36	GBP	500	0,12
GBP	6.000	1,79	GBP	1.050	0,31
EUR	500	0,13	GBP	320	0,10
EUR	300	0,08	EUR	680	0,18
GBP	1.200	0,36	EUR	180	0,05
EUR	4.000	1,01	EUR	3.000	0,75
EUR	200	0,05	EUR	7.000	1,51
EUR	360	0,09	EUR	200	0,05
EUR	920	0,24	EUR	2.400	0,63
GBP	900	0,27		21.651	4,87
EUR	2.200	0,53			
EUR	2.500	0,55			
	28.883	6,50			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Großbritannien — 7,81 % (28. Februar 2021: 5,78 %)</b>					
GBP	2.055	0,48	4.400	4.139	0,93
	1.700	0,50	240	225	0,05
EUR	400	0,10	910	990	0,22
	1.440	0,42	1.150	1.166	0,26
	190	0,04	1.700	1.724	0,39
	270	0,07	280	289	0,06
	550	0,14	2.000	2.246	0,51
	520	0,13	1.400	1.552	0,35
	1.660	0,38	2.550	2.789	0,63
	390	0,09	7.140	6.916	1,56
	1.220	0,27	570	587	0,13
	1.630	0,40	2.400	2.439	0,55
	300	0,09	330	374	0,08
	1.500	0,45	2.790	2.906	0,65
	1.000	0,25	5.410	5.483	1,23
	890	0,24	2.080	2.258	0,51
	200	0,05	1.600	1.622	0,36
	690	0,18	300	406	0,09
	1.250	0,36	1.510	1.695	0,38
	1.560	0,37	310	348	0,08
	650	0,15	1.250	1.415	0,32
	4.750	1,20	350	404	0,09
	680	0,15	2.120	2.075	0,47
	2.200	0,50	2.600	2.604	0,59
	580	0,13	570	582	0,13
	850	0,20	430	449	0,10
	480	0,12	1.000	1.122	0,25
	550	0,14	560	551	0,12
	810	0,21	1.150	1.195	0,27
			1.630	1.478	0,33
			1.340	1.703	0,38
			2.000	2.320	0,52
			4.043	4.408	0,99
			540	560	0,13
			4.000	3.946	0,89
			251	251	0,06
			39	39	0,01
				162.021	36,47
<b>USA — 36,47 % (28. Februar 2021: 35,72 %)</b>					
	2.100	0,46	<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen</b>		
	1.900	0,46	<b>(Anschaffungskosten 394.475 USD)</b>		
	1.240	0,28	<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 12,53 % (28. Februar 2021: 15,74 %)</b>		
	1.700	0,38	<b>Kanada – 0,36 % (28. Februar 2021: 0,32 %)</b>		
	4.500	0,94	<b>Deutschland — 0,25 % (28. Februar 2021: 0,24 %)</b>		
	1.980	0,47	<b>Südkorea — 0,16 % (28. Februar 2021: 0,39 %)</b>		
	2.200	0,47	<b>USA — 11,76 % (28. Februar 2021: 14,79 %)</b>		
	340	0,08	1.310 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/02/2023		
	1.520	0,38	590 United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31/07/2025		
	1.500	0,49	5.340 United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31/03/2026		
	200	0,05	15.130 United States Treasury Note/Bond, 2,500 %, fällig 15/11/2027		
	646	0,15	9.510 United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/02/2030		
	7.680	1,76	22.480 United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15/05/2030		
	800	0,23	52.242		
	500	0,13	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen</b>		
	530	0,14	<b>(Anschaffungskosten 59.185 USD)</b>		
	550	0,14	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,49 % (28. Februar 2021: 4,64 %)</b>		
	1.276	0,29	6.636 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar		
	1.900	0,45	Liquidity Fund – Class WA (Distributing)		
	1.700	0,38	6.636		
	7.500	1,56	6.636		
	800	0,18	<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Kosten 6.636 USD)</b>		
	2.400	0,53	6.636		
	310	0,07	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten</b>		
	1.300	0,32	<b>Anlagen (Anschaffungskosten 460.296 USD)</b>		
	800	0,20	<b>Devisenterminkontrakte – 0,94 % (28. Februar 2021: 1,45 %)</b>		
	150	0,03	<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>		
	230	0,07	4.176		
	7.940	1,83	<b>Futures – 0,49 % (28. Februar 2021: 0,27 %)</b>		
	1.300	0,33	<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>		
	390	0,09	2.194		
	1.800	0,39	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten</b>		
	1.600	0,37	<b>finanziellen Vermögenswerte</b>		
	7.000	1,49	451.723		
	2.000	0,44	<b>Devisenterminkontrakte — (1,05 %) (28. Februar 2021: (0,29 %))</b>		
	5.860	1,47	<b>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</b>		
	2.200	0,51	(6.465)		
	780	0,18	<b>Futures — (0,04 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
	1.830	0,43	<b>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</b>		
	1.750	0,44	(181)		
	4.500	0,97	<b>Summe – Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete</b>		
	2.800	0,64	<b>finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
	180	0,04	(4.826)		
	1.020	0,26	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten</b>		
	110	0,03	<b>finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
	3.090	0,72	446.897		
	320	0,08	<b>Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten</b>		
			(2.648)		
			<b>Gesamtvermögen</b>		
			\$444.249		
			100,00		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 11.333.000 USD oder 2,56 % des Nettovermögens.

\* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.

### Analyse des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,46
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,43
Finanzderivate	1,37
Sonstige Vermögenswerte	2,74
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### ABKÜRZUNGEN:

EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	71	Verkauf	EUR	63	\$ –
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	133	Verkauf	SEK	1.263	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	53	Verkauf	USD	59	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	3.297	Verkauf	USD	347	1
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	61	Verkauf	USD	81	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	59	Verkauf	EUR	53	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.170	Verkauf	EUR	1.027	17
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	226	Verkauf	GBP	169	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2.554	Verkauf	GBP	1.885	27
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	347	Verkauf	SEK	3.297	(1)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	553	Verkauf	SEK	5.179	5
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	1.263	Verkauf	USD	133	1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	15.166	Verkauf	USD	10.855	163
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	63	Verkauf	USD	71	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	48.990	Verkauf	USD	56.027	(1.061)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	199.316	Verkauf	USD	270.203	(2.779)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	31	Verkauf	USD	41	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	222.237	Verkauf	USD	24.156	(683)
18/05/2022	BNP Paribas	Kauf	USD	2.265	Verkauf	GBP	1.675	19
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	36.525	Verkauf	EUR	31.810	749
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	15.736	Verkauf	GBP	11.590	187
18/05/2022	Citi	Kauf	EUR	564	Verkauf	USD	642	(8)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	20.897	Verkauf	EUR	18.225	399
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	EUR	799	Verkauf	USD	898	1
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	GBP	1.560	Verkauf	USD	2.119	(26)
18/05/2022	HSBC	Kauf	USD	27.076	Verkauf	EUR	23.619	511
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	688	Verkauf	AUD	965	(14)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	45.891	Verkauf	EUR	40.195	683
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	1.896	Verkauf	GBP	1.400	18
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	1.190	Verkauf	USD	1.363	(24)
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.454	Verkauf	EUR	1.268	28
18/05/2022	Royal Bank of Canada	Kauf	USD	414	Verkauf	GBP	306	3
18/05/2022	UBS	Kauf	USD	38.097	Verkauf	EUR	33.231	721
18/05/2022	UBS	Kauf	USD	52.936	Verkauf	GBP	38.978	643
18/05/2022	UBS	Kauf	EUR	2.250	Verkauf	USD	2.580	(49)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 7.530 USD)								\$ 4.176
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.529) USD)								(4.645)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 6.001 USD)								\$ (469)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
Euro-Bobl March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(184)	\$(27.204)	\$ 342
Euro-Bund March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(225)	(42.141)	1.672
Long Gilt June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(167)	(27.574)	(181)
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	281	33.237	180
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.417 USD)				\$ 2.194
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (6) USD)				(181)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.411 USD)				\$ 2.013

# Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere — 6,46 % (28. Februar 2021: 9,04 %)</b>					
2.000	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	1,973	0,97	173	0,09
1.000	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ±	1,010	0,50	90	0,04
6	Fannie Mae Pool '255984', 4,500 %, fällig 01/11/2025	6	—	179	0,09
11	Fannie Mae Pool '975097', 5,000 %, fällig 01/06/2038	13	0,01	89	0,04
66	Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, fällig 01/01/2043	70	0,03	98	0,05
12	Fannie Mae Pool 'AL3572', 5,000 %, fällig 01/07/2041	14	0,01	95	0,05
89	Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000 %, fällig 01/05/2045	95	0,05	79	0,04
28	Fannie Mae Pool 'AS4271', 4,500 %, fällig 01/01/2045	31	0,02	166	0,09
60	Fannie Mae Pool 'AS8951', 3,500 %, fällig 01/03/2047	63	0,03	18	0,01
21	Fannie Mae Pool 'AS9760', 4,500 %, fällig 01/06/2047	23	0,01	20	0,01
322	Fannie Mae Pool 'AX0756', 3,500 %, fällig 01/07/2044	334	0,16	23	0,01
39	Fannie Mae Pool 'BC9077', 3,500 %, fällig 01/12/2046	41	0,02	17	0,01
120	Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, fällig 01/12/2037	123	0,06	5	—
137	Fannie Mae Pool 'BK7700', 4,500 %, fällig 01/10/2048	147	0,07	19	0,01
44	Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, fällig 01/12/2046	46	0,02	66	0,03
73	Fannie Mae Pool 'BM5521', 3,500 %, fällig 01/07/2048	76	0,04	14	0,01
35	Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500 %, fällig 01/11/2048	37	0,02	81	0,04
45	Fannie Mae Pool 'BP1585', 3,500 %, fällig 01/01/2050	46	0,02	29	0,01
62	Fannie Mae Pool 'BP7009', 3,000 %, fällig 01/08/2050	63	0,03	41	0,02
87	Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, fällig 01/02/2051	84	0,04	14	0,01
86	Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, fällig 01/02/2051	83	0,04	56	0,03
94	Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, fällig 01/03/2051	90	0,04	35	0,02
297	Fannie Mae Pool 'BU1030', 2,000 %, fällig 01/11/2051	286	0,14	286	0,14
63	Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500 %, fällig 01/07/2048	68	0,03	<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere</b>	
116	Fannie Mae Pool 'CA2199', 4,500 %, fällig 01/08/2048	124	0,06	<b>(Anschaffungskosten 13.276 USD)</b>	
61	Fannie Mae Pool 'CA2482', 4,500 %, fällig 01/10/2048	66	0,03	13.114	6,46
19	Fannie Mae Pool 'CA2652', 5,000 %, fällig 01/11/2048	20	0,01	<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 25,27 % (28. Februar 2021: 25,41 %)</b>	
100	Fannie Mae Pool 'CB2764', 2,000 %, fällig 01/02/2052	96	0,05	<b>Australien — 0,59 % (28. Februar 2021: 0,42 %)</b>	
28	Fannie Mae Pool 'FM1193', 3,500 %, fällig 01/06/2049	29	0,01	871	Glencore Finance Europe Ltd, 1,875 %, fällig 13/09/2023
163	Fannie Mae Pool 'FM1578', 3,500 %, fällig 01/09/2034	169	0,08	200	Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, fällig 27/03/2027
106	Fannie Mae Pool 'FM1579', 3,500 %, fällig 01/10/2034	110	0,05	1.204 0,59	
211	Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, fällig 01/09/2049	231	0,11	<b>Belgien — 0,32 % (28. Februar 2021: 0,45 %)</b>	
88	Fannie Mae Pool 'FM3215', 3,500 %, fällig 01/01/2049	92	0,05	260	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, fällig 01/02/2046
378	Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500 %, fällig 01/05/2047	393	0,19	110	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01/06/2040
85	Fannie Mae Pool 'FM3978', 4,000 %, fällig 01/07/2050	89	0,04	220	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01/06/2050
54	Fannie Mae Pool 'FM4737', 3,500 %, fällig 01/09/2050	55	0,03	242 0,12	
198	Fannie Mae Pool 'FM5828', 4,000 %, fällig 01/10/2048	209	0,10	654	0,32
348	Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000 %, fällig 01/01/2049	365	0,18	<b>Brasilien — 0,12 % (28. Februar 2021: 0,23 %)</b>	
95	Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, fällig 01/07/2051	94	0,05	230	Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01/02/2029
96	Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, fällig 01/07/2051	95	0,05	239 0,12	
97	Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, fällig 01/10/2051	97	0,05	<b>Kanada – 0,12 % (28. Februar 2021: 0,10 %)</b>	
686	Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, fällig 01/07/2051	662	0,33	130	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15/01/2028
199	Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000 %, fällig 01/01/2052	202	0,10	130	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15/02/2029
99	Fannie Mae Pool 'FS0352', 2,000 %, fällig 01/01/2052	95	0,05	126 0,06	
100	Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, fällig 01/01/2052	99	0,05	123	0,06
100	Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000 %, fällig 01/02/2052	102	0,05	249	0,12
100	Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500 %, fällig 01/02/2052	99	0,05	<b>China — 0,01 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>	
100	Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 01/02/2052	96	0,05	20	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144A, 2,700 %, fällig 01/05/2025
21	Fannie Mae Pool 'MA3211', 4,000 %, fällig 01/12/2047	22	0,01	20 0,01	
22	Fannie Mae Pool 'MA3239', 4,000 %, fällig 01/01/2048	23	0,01	<b>Frankreich — 0,53 % (28. Februar 2021: 0,66 %)</b>	
76	Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, fällig 01/04/2038	77	0,04	330	Aitice France SA/France, 144A, 5,500 %, fällig 15/10/2029
27	Freddie Mac Gold Pool 'G67721', 4,500 %, fällig 01/04/2049	29	0,01	200	BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09/06/2026 *
22	Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,100 %, fällig 01/03/2047 *	22	0,01	300	BNP Paribas SA, 1,875 %, fällig 14/12/2027
50	Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500 %, fällig 01/02/2050	52	0,03	200	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, fällig 17/09/2044
86	Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig 01/02/2051	82	0,04	198 0,10	
194	Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, fällig 01/08/2051	192	0,09	1.083 0,53	
94	Freddie Mac Pool 'QC6768', 3,000 %, fällig 01/09/2051	95	0,05	<b>Deutschland — 1,27 % (28. Februar 2021: 1,10 %)</b>	
100	Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, fällig 01/02/2052	99	0,05	250	E.ON International Finance BV, 5,625 %, fällig 06/12/2023
34	Freddie Mac Pool 'RA2358', 4,000 %, fällig 01/03/2050	36	0,02	500	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, fällig 26/05/2049 *
95	Freddie Mac Pool 'RA5040', 2,000 %, fällig 01/04/2051	91	0,05	1.420	Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, fällig 01/10/2024
87	Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig 01/04/2051	84	0,04	2.575 1,27	
96	Freddie Mac Pool 'SD0653', 3,000 %, fällig 01/07/2051	95	0,05	<b>Israel — 0,46 % (28. Februar 2021: 0,26 %)</b>	
197	Freddie Mac Pool 'SD0809', 3,000 %, fällig 01/01/2052	200	0,10	30	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01/10/2026
199	Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig 01/11/2051	197	0,10	200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,750 %, fällig 01/03/2028
92	Freddie Mac Pool 'ZA6680', 4,000 %, fällig 01/04/2049	97	0,05	720	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09/05/2029
53	Freddie Mac Pool 'ZM5146', 4,000 %, fällig 01/12/2047	56	0,03	691 0,34	
78	Freddie Mac Pool 'ZS3204', 5,000 %, fällig 01/06/2041	85	0,04	<b>Italien — 0,60 % (28. Februar 2021: 0,60 %)</b>	
160	Freddie Mac Pool 'ZS3940', 4,500 %, fällig 01/06/2038	174	0,09	EUR	1.100 UniCredit Spa, 1,200 %, fällig 20/01/2026 *
124	Freddie Mac Pool 'ZS4699', 4,000 %, fällig 01/01/2047	132	0,06	1.220 0,60	
46	Freddie Mac Pool 'ZS4720', 4,500 %, fällig 01/05/2047	49	0,02	<b>Luxemburg — 0,34 % (28. Februar 2021: 0,28 %)</b>	
62	Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000 %, fällig 15/09/2042	65	0,03	EUR	620 Logiqor Financing Sarl, 1,625 %, fällig 15/07/2027
433	Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15/06/2048	458	0,23	686 0,34	
22	Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15/09/2042	23	0,01		
12	Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15/09/2042	13	0,01		
53	Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15/10/2042	54	0,03		
35	Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, fällig 15/10/2042	36	0,02		
30	Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, fällig 15/11/2042	31	0,02		
28	Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, fällig 20/10/2049	29	0,01		
90	Ginnie Mae II Pool '785218', 2,000 %, fällig 20/12/2050	88	0,04		

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Macau — 0,09 % (28. Februar 2021: 0,07 %)</b>					
200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26/08/2028	174	0,09	60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15/03/2028	63	0,03
<b>Niederlande – 1,25 % (28. Februar 2021: 1,59 %)</b>					
EUR 800 ABN AMRO Bank NV, 7,125 %, fällig 06/07/2022	918	0,45	290 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30/03/2029	315	0,16
EUR 200 ING Groep NV, 3,000 %, fällig 11/04/2028 *	230	0,11	140 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01/04/2048	155	0,08
EUR 900 ING Groep NV, 2,500 %, fällig 15/02/2029 *	1.033	0,51	110 Cheniere Energy Partners LP, 144A, 3,250 %, fällig 31/01/2032	104	0,05
80 Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06/04/2030	80	0,04	260 Cigna Corp, 4,375 %, fällig 15/10/2028	282	0,14
200 Shell International Finance BV, 4,375 %, fällig 11/05/2045	222	0,11	310 Cigna Corp, 3,200 %, fällig 15/03/2040	287	0,14
60 Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06/04/2050	58	0,03	30 Citigroup Inc, 3,500 %, fällig 15/05/2023	31	0,02
	2.541	1,25	290 Citigroup Inc, 1,750 %, fällig 28/01/2025	335	0,16
<b>Peru — 0,14 % (28. Februar 2021: 0,11 %)</b>					
250 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08/11/2042	291	0,14	130 Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13/09/2025	142	0,07
<b>Südafrika — 0,36 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>					
EUR 640 Anglo American Capital Plc, 1,625 %, fällig 18/09/2025	730	0,36	290 Citigroup Inc, 4,600 %, fällig 09/03/2026	309	0,15
<b>Spanien — 0,35 % (28. Februar 2021: 0,28 %)</b>					
EUR 600 Banco Santander SA, 3,250 %, fällig 04/04/2026	713	0,35	350 Citigroup Inc, 4,300 %, fällig 20/11/2026	372	0,18
<b>Schweden — 0,37 % (28. Februar 2021: 0,28 %)</b>					
EUR 660 Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, fällig 02/03/2028 *	744	0,37	260 Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29/09/2027	278	0,14
<b>Schweiz — 1,20 % (28. Februar 2021: 1,19 %)</b>					
EUR 390 Credit Suisse Group AG, 3,250 %, fällig 02/04/2026 *	461	0,23	120 Citigroup Inc, 4,412 %, fällig 31/03/2031 *	130	0,06
250 Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01/04/2031 *	260	0,13	93 Citigroup Inc, 5,300 %, fällig 06/05/2044	110	0,05
EUR 1.470 UBS Group AG, 1,500 %, fällig 30/11/2024	1.681	0,83	85 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 30/07/2045	97	0,05
GBP 20 Zurich Finance UK Plc, 6,625 %, Perpetual *	27	0,01	20 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01/06/2040	18	0,01
	2.429	1,20	20 Coca-Cola Co/The, 2,600 %, fällig 01/06/2050	18	0,01
<b>Vereinigte Arabische Emirate — 0,81 % (28. Februar 2021: 0,15 %)</b>					
530 Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 2,625 %, fällig 31/03/2036	480	0,24	60 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 15/03/2051	69	0,03
420 MDGH GMTN RSC Ltd, 2,875 %, fällig 21/05/2030	417	0,21	66 Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01/11/2049	67	0,03
EUR 690 MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, fällig 10/03/2034	740	0,36	51 Comcast Corp, 4,049 %, fällig 01/11/2052	54	0,03
	1.637	0,81	57 Comcast Corp, 144A, 2,987 %, fällig 01/11/2063	48	0,02
<b>Großbritannien — 2,26 % (28. Februar 2021: 2,38 %)</b>					
GBP 670 Aviva Plc, 6,125 %, fällig 14/11/2036 *	1.003	0,49	370 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01/04/2030	388	0,19
GBP 100 Aviva Plc, 5,125 %, fällig 04/06/2050 *	145	0,07	200 CVS Health Corp, 2,700 %, fällig 21/08/2040	175	0,09
GBP 280 BAE Systems Plc, 4,125 %, fällig 08/06/2022	378	0,19	200 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25/03/2048	234	0,12
GBP 100 BUPA Finance Plc, 5,000 %, fällig 25/04/2023	139	0,07	120 Delta Air Lines Inc, 3,800 %, fällig 19/04/2023	121	0,06
565 HSBC Holdings Plc, 4,250 %, fällig 18/08/2025	587	0,29	550 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01/05/2025	611	0,30
GBP 100 HSBC Holdings Plc, 7,000 %, fällig 07/04/2038	178	0,09	170 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20/10/2025	175	0,09
GBP 1.000 Lloyds Bank Plc, 7,625 %, fällig 22/04/2025	1.533	0,76	150 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20/10/2028	157	0,08
EUR 210 Lloyds Banking Group Plc, 3,500 %, fällig 01/04/2026 *	253	0,12	140 Devon Energy Corp, 8,250 %, fällig 01/08/2023	151	0,07
GBP 260 Scottish Widows Ltd, 5,500 %, fällig 16/06/2023	362	0,18	590 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15/12/2025	658	0,32
	4.578	2,26	120 DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15/11/2024	120	0,06
<b>USA — 14,08 % (28. Februar 2021: 13,57 %)</b>					
100 3M Co, 3,700 %, fällig 15/04/2050	103	0,05	60 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01/12/2028	57	0,03
30 AbbVie Inc, 2,900 %, fällig 06/11/2022	30	0,01	70 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01/06/2029	59	0,03
EUR 120 AbbVie Inc, 1,500 %, fällig 15/11/2023	137	0,07	60 Duke Energy Progress LLC, 4,375 %, fällig 30/03/2044	65	0,03
100 AbbVie Inc, 3,800 %, fällig 15/03/2025	104	0,05	1.050 Energy Transfer LP, 3,750 %, fällig 15/05/2030	1.068	0,53
170 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21/11/2029	172	0,08	20 Enterprise Products Operating LLC, 3,350 %, fällig 15/03/2023	20	0,01
100 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14/11/2048	115	0,06	210 Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig 31/01/2030	207	0,10
320 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21/11/2049	341	0,17	330 Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, fällig 15/02/2045	370	0,18
510 Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/ Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig 01/06/2028	478	0,24	10 EQT Corp, 6,625 %, fällig 01/02/2025	11	0,01
80 Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22/08/2057	93	0,05	10 Exelon Corp, 5,625 %, fällig 15/06/2035	12	0,01
150 AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01/02/2032	139	0,07	100 Exxon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15/04/2051	99	0,05
184 AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09/03/2048	197	0,10	310 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12/02/2032	293	0,14
34 AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15/09/2059	31	0,02	520 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13/11/2030	517	0,25
60 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15/09/2031	55	0,03	110 Fox Corp, 5,476 %, fällig 25/01/2039	128	0,06
20 Bank of America Corp, 3,300 %, fällig 11/01/2023	20	0,01	50 General Motors Co, 6,600 %, fällig 01/04/2036	62	0,03
150 Bank of America Corp, 4,200 %, fällig 26/08/2024	156	0,08	10 General Motors Co, 5,200 %, fällig 01/04/2045	11	0,01
160 Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22/10/2026	171	0,08	70 General Motors Co, 6,750 %, fällig 01/04/2046	89	0,04
945 Bank of America Corp, 2,592 %, fällig 29/04/2031 *	904	0,45	150 Gilead Sciences Inc, 4,800 %, fällig 01/04/2044	171	0,08
27 Becton Dickinson and Co, 3,734 %, fällig 15/12/2024	28	0,01	30 Gilead Sciences Inc, 4,750 %, fällig 01/03/2046	34	0,02
500 Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01/05/2030	553	0,27	280 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,850 %, fällig 08/07/2024	290	0,14
100 Boeing Co/The, 3,300 %, fällig 01/03/2035	94	0,05	110 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01/04/2025	113	0,06
350 Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01/05/2050	416	0,21	620 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, fällig 01/10/2037	816	0,40
350 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06/04/2030	365	0,18	640 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01/02/2041	841	0,41
26 Bristol-Myers Squibb Co, 2,900 %, fällig 26/07/2024	27	0,01	280 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22/05/2045	337	0,17
130 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15/11/2035	120	0,06	340 HCA Inc, 5,000 %, fällig 15/03/2024	357	0,18
140 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01/05/2032	133	0,07	380 HCA Inc, 5,250 %, fällig 15/06/2026	412	0,20
200 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01/06/2033	188	0,09	200 HCA Inc, 4,500 %, fällig 15/02/2027	212	0,10
130 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23/07/2025	138	0,07	130 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15/04/2040	130	0,06
			110 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15/04/2050	108	0,05
			20 JPMorgan Chase & Co, 3,625 %, fällig 13/05/2024	21	0,01
			70 JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, fällig 15/12/2026	74	0,04
			300 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05/12/2029 *	325	0,16
			520 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22/04/2031 *	498	0,25
			440 JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, fällig 13/05/2031 *	428	0,21
			160 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22/04/2051 *	148	0,07
			177 Lehman Escrow Receipt, Null-Coupon, Perpetual	1	–
			30 McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01/09/2049	29	0,01
			110 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01/04/2050	118	0,06
			29 Medtronic Inc, 4,625 %, fällig 15/03/2045	34	0,02
			40 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15/12/2036	45	0,02

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
EUR	10	0,01	<b>Japan — 6,43 % (28. Februar 2021: 5,33 %)</b>		
	430	0,22	JPY 49.000 Japan Government Thirty Year Bond, Series 59, 0,700 %, fällig 20/06/2048	415	0,20
	850	0,50	JPY 505.100 Japan Government Thirty Year Bond, Series 66, 0,400 %, fällig 20/03/2050	3.893	1,92
	170	0,09	JPY 684.900 Japanese Government CPI Linked Bond, Series 21, 0,100 %, fällig 10/03/2026 <sup>ß</sup>	6.268	3,09
	80	0,05	JPY 269.400 Japanese Government CPI Linked Bond, Series 23, 0,100 %, fällig 10/03/2028 <sup>ß</sup>	2.476	1,22
	140	0,07		13.052	6,43
	70	0,03	<b>Mexiko — 3,78 % (28. Februar 2021: 4,28 %)</b>		
	80	0,05	MXN 91.000 Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	4.257	2,10
	320	0,15	EUR 820 Mexico Government International Bond, 2,875 %, fällig 08/04/2039	822	0,41
	600	0,28			
	80	0,04	1.090 Mexico Government International Bond, 5,550 %, fällig 21/01/2045	1.194	0,59
	80	0,04	1.440 Mexico Government International Bond, 4,600 %, fällig 23/01/2046	1.390	0,68
	80	0,04		7.663	3,78
	70	0,03	<b>Katar — 0,94 % (28. Februar 2021: 0,77 %)</b>		
	10	–	1.570 Qatar Government International Bond, 4,817 %, fällig 14/03/2049	1.911	0,94
	384	0,21	<b>Rumänien — 0,74 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
	10	0,01	EUR 1.227 Romanian Government International Bond, 2,000 %, fällig 14/04/2033	1.066	0,53
	4	–	EUR 420 Romanian Government International Bond, 3,750 %, fällig 07/02/2034	431	0,21
	90	0,04		1.497	0,74
	100	0,06	<b>Russland — 0,72 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
	40	0,02	RUB 313.535 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23/05/2029 <sup>†</sup>	1.465	0,72
	30	0,01	<b>Südafrika — 1,61 % (28. Februar 2021: 1,14 %)</b>		
	90	0,04	ZAR 75.222 Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28/02/2041	3.266	1,61
	240	0,12	<b>Südkorea — 1,01 % (28. Februar 2021: 0,80 %)</b>		
	60	0,03	KRW 2.533.840 Korea Treasury Bond, Series 2606, 1,875 %, fällig 10/06/2026	2.056	1,01
	100	0,05	<b>Spanien — 2,07 % (28. Februar 2021: 2,30 %)</b>		
	200	0,09	EUR 640 Spain Government Bond, 144A, 5,150 %, fällig 31/10/2044	1.203	0,59
	480	0,23	EUR 2.220 Spain Government Bond, Series 30Y, 144A, 2,700 %, fällig 31/10/2048	3.000	1,48
	50	0,03		4.203	2,07
	80	0,04	<b>Vereinigte Arabische Emirate — 0,71 % (28. Februar 2021: 0,61 %)</b>		
	150	0,07	1.350 Abu Dhabi Government International Bond, 3,875 %, fällig 16/04/2050	1.450	0,71
	70	0,03	<b>Großbritannien — 2,24 % (28. Februar 2021: 3,04 %)</b>		
	190	0,10	GBP 1.720 United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07/12/2040	3.278	1,61
	50	0,03	GBP 710 United Kingdom Gilt, 2,500 %, fällig 22/07/2065	1.269	0,63
	10	0,01		4.547	2,24
	12	0,01	<b>USA — 29,33 % (28. Februar 2021: 19,74 %)</b>		
	13	0,01	1.300 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15/08/2024	1.325	0,65
	90	0,04	15.070 United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30/04/2025	14.472	7,13
	90	0,04	4.460 United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 30/06/2025	4.252	2,10
	340	0,16	14.620 United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31/08/2025	13.899	6,85
	43	0,02	19.830 United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31/01/2026 #	18.814	9,27
	810	0,49	70 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/11/2041	67	0,03
	790	0,40	2.130 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15/11/2047	2.336	1,15
	550	0,28	1.800 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2049	2.045	1,01
			2.820 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/08/2050	2.322	1,14
	28.586	14,08		59.532	29,33
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 51.282 USD)</b>					
	51.282	25,27	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 123.283 USD)</b>	115.241	56,78
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 56,78 % (28. Februar 2021: 54,39 %)</b>					
<b>Belgien — 0,81 % (28. Februar 2021: 0,68 %)</b>					
EUR	760	0,65	1.346 Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	20.460	10,08
EUR	260	0,16	<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 17.860 USD)</b>		
	1.642	0,81	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 206.246 USD)</b>		
<b>Kanada — 1,44 % (28. Februar 2021: 1,25 %)</b>					
CAD	1.640	0,65		200.097	98,59
CAD	1.030	0,43			
CAD	860	0,36			
	2.914	1,44			
<b>Frankreich — 0,87 % (28. Februar 2021: 3,51 %)</b>					
EUR	700	0,42			
EUR	440	0,45			
	1.761	0,87			
<b>Indonesien — 2,60 % (28. Februar 2021: 4,13 %)</b>					
IDR	2.970	1,51			
	3.057	1,51			
	2.219	1,09			
	5.276	2,60			
<b>Italien — 1,48 % (28. Februar 2021: 1,45 %)</b>					
EUR	2.270	1,48			

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Zinsswaps – 0,07 % (28. Februar 2021: 0,19 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	142	0,07
<b>Devisenterminkontrakte – 0,89 % (28. Februar 2021: 0,58 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.797	0,89
<b>Futures – 0,41 % (28. Februar 2021: 0,43 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	837	0,41
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>202.873</b>	<b>99,96</b>

Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Schriftliche Optionen – 0,00 % (28. Februar 2021: (0,03 %))</b>		
EUR (2.240) EUR Call/NOK Put 10,25, fällig 06/04/2022 - Citi	(8)	-
<b>Geschriebene Optionen insgesamt (Kosten (27))</b>	<b>(8)</b>	<b>-</b>
<b>Inflation Swaps – (0,39 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(805)	(0,39)
<b>Zinsswaps – (0,35 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(703)	(0,35)
<b>Devisenterminkontrakte – (0,94 %) (28. Februar 2021: (0,43 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.907)	(0,94)
<b>Futures – (0,57 %) (28. Februar 2021: (0,26 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.170)	(0,57)
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(4.593)</b>	<b>(2,25)</b>
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>198.280</b>	<b>97,71</b>
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>	<b>4.668</b>	<b>2,29</b>
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>\$202.948</b>	<b>100,00</b>

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

144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 13.425.000 USD oder 6,62 % des Nettovermögens.

### Zeitplan der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating CAD 3M CAD CDOR, Receive Fixed 1,483 %	27/10/2023	21.130	\$ (45)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating EUR 6M Euribor Reuters, Receive Fixed -0,250 %	30/06/2026	10.560	(336)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating EUR 6M Euribor Reuters, Receive Fixed -0,150 %	15/08/2026	10.590	(304)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating CZK 6M Pribor PRBO, Receive Fixed 3,250 %	09/02/2032	115.580	(18)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,500 %, Receive Floating EUR 6M Euribor Reuters	30/06/2051	1.640	142
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 531 USD)				\$ 142
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(703)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 531 USD)				\$ (561)

### Zeitplan für Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CAD – Bankers' Acceptance CDOR	25/10/2024	1.000	\$ (12)
Bank of America Merrill Lynch	USD – CPI Urban Consumers	28/04/2026	7.030	(575)
Bank of America Merrill Lynch	GBP – RPI All Items NSA	15/10/2026	2.890	(218)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(805)
Nettowertminderung von Inflationsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ (805)

\* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.  
 † Illiquide.  
 ∞ Die Sicherheit wird nach Treu und Glauben vom Bewertungsausschuss oder nach dessen Ermessen zum beizulegenden Zeitwert bewertet.  
 γ Sicherheiten fallen aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen nach Jahresende nicht mehr an.  
 ∅ Sicherheit (ganz oder teilweise) als Sicherheit für den Handel mit Derivaten zum 28. Februar 2022 verpfändet.  
 ± Anzugebende Wertpapiere.  
 β Der Zinssatz für diese Art von Wertpapier ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Stand vom 28. Februar 2022.

#### ABKÜRZUNGEN:

VPI	- Verbraucherpreisindex.
Unbefristet	- Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.
TBA	- wird bekannt gegeben.
CAD	- Kanadischer Dollar
EUR	- Euro
GBP	- Britische Pfund
IDR	- Indonesische Rupiah
JPY	- Japanischer Yen
KRW	- Südkoreanischer Won
MXN	- Mexikanischer Peso
RUB	- Russischer Rubel
ZAR	- Südafrika Rand

#### Analyse des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	83,22
Organismen für gemeinsame Anlagen	9,48
Finanzderivate	1,29
Sonstige Vermögenswerte	6,01
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	EUR	1	\$ –
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.171	Verkauf	USD	2.432	3
10/03/2022	Citi	Kauf	USD	2.297	Verkauf	CNH	14.760	(37)
10/03/2022	Citi	Kauf	CNH	8.760	Verkauf	USD	1.380	6
10/03/2022	JP Morgan	Kauf	USD	17.469	Verkauf	CNH	112.240	(286)
10/03/2022	JP Morgan	Kauf	USD	54	Verkauf	IDR	793.761	(1)
10/03/2022	JP Morgan	Kauf	USD	2.248	Verkauf	KRW	2.684.000	16
10/03/2022	JP Morgan	Kauf	CNH	3.220	Verkauf	USD	510	–
10/03/2022	JP Morgan	Kauf	RUB	591	Verkauf	USD	8	(2)
10/03/2022	JP Morgan	Kauf	KRW	129.545	Verkauf	USD	110	(3)
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	2.485	Verkauf	BRL	12.680	31
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	2.354	Verkauf	TWD	64.780	43
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	TWD	65.030	Verkauf	USD	2.337	(17)
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	BRL	12.640	Verkauf	USD	2.196	251
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.427	Verkauf	CAD	1.821	(9)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2.433	Verkauf	EUR	2.171	(3)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	3.250	Verkauf	EUR	2.875	24
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	82	Verkauf	NZD	122	(1)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	135.827	Verkauf	USD	106.959	211
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	USD	1	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	42.264	Verkauf	USD	48.342	(921)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	9.197	Verkauf	USD	6.111	111
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	2	Verkauf	USD	3	–
25/03/2022	Citi	Kauf	USD	817	Verkauf	RUB	72.150	152
25/03/2022	JP Morgan	Kauf	USD	832	Verkauf	RUB	72.150	167
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	179	Verkauf	AUD	250	(3)
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	3.521	Verkauf	EUR	3.065	74
18/05/2022	Citi	Kauf	AUD	4.781	Verkauf	USD	3.447	29
18/05/2022	Citi	Kauf	EUR	300	Verkauf	USD	341	(4)
18/05/2022	Citi	Kauf	HUF	725.748	Verkauf	USD	2.322	(152)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.279	Verkauf	CAD	2.886	1
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	5.356	Verkauf	JPY	619.738	(45)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	656	Verkauf	MXN	13.633	–
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	EUR	1.851	Verkauf	USD	2.126	(45)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	AUD	1.461	Verkauf	USD	1.054	8
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	NOK	18.291	Verkauf	USD	2.073	1
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	3.193	Verkauf	ZAR	48.600	65
18/05/2022	HSBC	Kauf	USD	14.034	Verkauf	EUR	12.242	265
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	6.626	Verkauf	AUD	9.293	(131)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	4.352	Verkauf	CAD	5.540	(19)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	93	Verkauf	CZK	2.000	5
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	321	Verkauf	EUR	280	6
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	9.576	Verkauf	GBP	7.071	89
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	PLN	9.757	Verkauf	HUF	768.580	12
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	2.161	Verkauf	JPY	250.353	(21)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	100	Verkauf	USD	114	(1)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	HUF	802.970	Verkauf	USD	2.564	(163)
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	288	Verkauf	AUD	400	(3)
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	949	Verkauf	GBP	700	10
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	5.093	Verkauf	JPY	587.200	(24)
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	AUD	70	Verkauf	USD	51	–
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	MXN	10.750	Verkauf	USD	515	2
18/05/2022	UBS	Kauf	USD	11.300	Verkauf	EUR	9.857	214
18/05/2022	UBS	Kauf	USD	998	Verkauf	JPY	115.000	(4)
18/05/2022	UBS	Kauf	EUR	520	Verkauf	USD	596	(12)
18/05/2022	UBS	Kauf	JPY	27.000	Verkauf	USD	234	1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.652 USD)								\$ 1.797
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.236) USD)								(1.907)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 416 USD)								\$ (110)

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
90 Day Euro\$ December 2022	Bank of America Merrill Lynch	67	\$ 16.461	\$ (85)
90 Day Euro\$ December 2023	Bank of America Merrill Lynch	144	35.228	(459)
90 Day Euro\$ March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(144)	(35.764)	122
Australia 10 Year Bond March 2022	Bank of America Merrill Lynch	26	2.540	(86)
Australia 3 Year Bond March 2022	Bank of America Merrill Lynch	145	11.892	(115)
Canadian 10 Year Bond June 2022	Bank of America Merrill Lynch	21	2.264	7
Canadian 5 Year Bond June 2022	Bank of America Merrill Lynch	1	96	–
Euro-Bobl March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(9)	(1.331)	23
Euro-BTP March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(7)	(1.108)	63
Euro-Bund March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(41)	(7.679)	281
Euro-Buxl 30 Year Bond March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(10)	(2.218)	196
Euro-OAT March 2022	Bank of America Merrill Lynch	23	4.082	9
Japan 10 Year Bond (OSE) March 2022	Bank of America Merrill Lynch	4	5.236	(52)
Long Gilt June 2022	Bank of America Merrill Lynch	10	1.651	1
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(293)	(37.339)	(274)
U.S. 10 Year Ultra Note June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(58)	(8.197)	(95)
U.S. 2 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(1.291)	(4)
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	213	25.194	130
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	1	157	2
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	1	186	3
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.236 USD)				\$ 837
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (742) USD)				(1.170)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 494 USD)				\$ (333)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 90,58 % (28. Februar 2021: 88,60 %)</b>			<b>Hongkong – 0,27 % (28. Februar 2021: 0,26 %)</b>		
<b>Australien – 0,95 % (28. Februar 2021: 0,63 %)</b>			200 AIA Group Ltd, 144A, 3,200 %, fällig 11/03/2025		
EUR	240	0,33	205		0,27
EUR	370	0,55	<b>Irland – 0,47 % (28. Februar 2021: 0,80 %)</b>		
EUR	60	0,07	150		0,18
	731	0,95	240		0,29
<b>Österreich – 0,27 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>			365		0,47
EUR	200	0,27	<b>Israel – 0,33 % (28. Februar 2021: 0,33 %)</b>		
<b>Belgien – 1,28 % (28. Februar 2021: 0,89 %)</b>			EUR	240	0,33
EUR	490	0,85	<b>Italien – 3,43 % (28. Februar 2021: 3,67 %)</b>		
EUR	10	0,01	270		0,43
EUR	300	0,42	290		0,42
	993	1,28	EUR	380	0,56
<b>Brazilien – 0,69 % (28. Februar 2021: 1,80 %)</b>			EUR	200	0,23
EUR	300	0,44	EUR	250	0,36
EUR	160	0,25	EUR	200	0,28
	535	0,69	EUR	250	0,36
<b>Chile – 0,28 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			EUR	340	0,48
EUR	250	0,28	EUR	200	0,31
<b>China – 0,08 % (28. Februar 2021: 1,09 %)</b>			2.656		3,43
EUR	60	0,08	<b>Kasachstan – 0,27 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
<b>Kolumbien – 0,19 % (28. Februar 2021: 0,22 %)</b>			200		0,27
EUR	170	0,19	<b>Luxemburg – 2,79 % (28. Februar 2021: 2,30 %)</b>		
<b>Dänemark – 1,34 % (28. Februar 2021: 1,54 %)</b>			GBP	100	0,16
EUR	270	0,37	200		0,33
EUR	200	0,30	EUR	270	0,36
EUR	470	0,67	EUR	340	0,49
	1.034	1,34	EUR	350	0,54
<b>Finnland – 0,56 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			EUR	125	0,19
EUR	400	0,56	EUR	240	0,35
<b>Frankreich – 6,45 % (28. Februar 2021: 5,77 %)</b>			EUR	260	0,37
EUR	200	0,28	2.160		2,79
EUR	490	0,75	<b>Macau – 0,47 % (28. Februar 2021: 0,28 %)</b>		
GBP	400	0,54	200		0,25
GBP	400	0,67	200		0,22
GBP	410	0,52	200		0,47
GBP	200	0,33	<b>Mexiko – 0,61 % (28. Februar 2021: 0,31 %)</b>		
EUR	500	0,71	240		0,32
EUR	200	0,26	200		0,29
EUR	200	0,27	475		0,61
EUR	310	0,43	<b>Niederlande – 3,03 % (28. Februar 2021: 4,43 %)</b>		
EUR	300	0,42	EUR	194	0,29
EUR	300	0,48	EUR	300	0,43
EUR	200	0,26	EUR	270	0,40
EUR	200	0,27	EUR	260	0,35
EUR	200	0,27	EUR	100	0,14
EUR	200	0,27	EUR	140	0,21
EUR	200	0,27	EUR	200	0,30
EUR	200	0,27	EUR	300	0,44
EUR	200	0,27	EUR	200	0,30
EUR	200	0,27	EUR	110	0,17
EUR	200	0,27	2.342		3,03
EUR	200	0,27	<b>Peru – 0,23 % (28. Februar 2021: 0,27 %)</b>		
EUR	200	0,27	200		0,23
EUR	200	0,27	<b>Portugal – 0,40 % (28. Februar 2021: 0,37 %)</b>		
EUR	200	0,27	EUR	300	0,40
EUR	200	0,27	<b>Russland – 0,20 % (28. Februar 2021: 0,48 %)</b>		
EUR	200	0,27	EUR	350	0,48
EUR	200	0,27	<b>Singapur – 0,29 % (28. Februar 2021: 0,30 %)</b>		
EUR	200	0,27	EUR	200	0,29
EUR	200	0,27	<b>Südafrika – 0,47 % (28. Februar 2021: 0,49 %)</b>		
EUR	200	0,27	GBP	270	0,47
EUR	200	0,27	<b>Spanien – 2,27 % (28. Februar 2021: 2,13 %)</b>		
EUR	200	0,27	EUR	100	0,14
EUR	200	0,27	GBP	500	0,83
EUR	200	0,27	EUR	200	0,30
EUR	200	0,27	EUR	100	0,12
EUR	200	0,27	EUR	200	0,26
	6.205	8,02			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Spanien – (Fortsetzung)</b>					
EUR	140	0,24	150	154	0,20
	300	0,38	190	216	0,28
			90	94	0,12
			160	142	0,18
			170	199	0,26
	1.754	2,27	125	183	0,24
<b>Schweden — 1,96 % (28. Februar 2021: 1,45 %)</b>					
EUR	140	0,19	100	92	0,12
EUR	100	0,14	90	82	0,11
EUR	350	0,46	400	433	0,56
EUR	350	0,44	340	345	0,45
EUR	320	0,46	140	157	0,20
EUR	200	0,27	200	188	0,24
	1.518	1,96	310	344	0,44
<b>Schweiz — 3,06 % (28. Februar 2021: 4,02 %)</b>					
EUR	340	0,52	250	266	0,34
GBP	300	0,50	120	109	0,14
			570	601	0,78
			380	401	0,52
			140	167	0,22
EUR	300	0,44	190	196	0,25
EUR	200	0,28	80	69	0,09
EUR	230	0,31	210	222	0,29
	2.366	3,06	190	205	0,27
<b>Taiwan — 0,25 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
EUR	200	0,25	190	205	0,27
<b>Großbritannien — 13,19 % (28. Februar 2021: 12,21 %)</b>					
GBP	130	0,21	470	447	0,58
EUR	400	0,59	400	367	0,47
EUR	350	0,53	500	783	1,01
GBP	130	0,22	40	34	0,04
EUR	280	0,41	70	85	0,11
GBP	210	0,37	170	190	0,25
EUR	170	0,22	60	55	0,07
GBP	220	0,42	150	156	0,20
GBP	220	0,40	230	220	0,28
GBP	160	0,27	440	515	0,67
GBP	100	0,16	130	157	0,20
GBP	180	0,24	150	161	0,21
EUR	200	0,30	20	21	0,03
EUR	200	0,25	78	82	0,11
GBP	260	0,45	230	257	0,33
EUR	250	0,38	210	236	0,31
GBP	160	0,28	160	189	0,24
EUR	240	0,37	70	81	0,10
EUR	200	0,28	60	63	0,08
GBP	180	0,29	40	38	0,05
GBP	200	0,34	250	232	0,30
GBP	200	0,27	280	275	0,36
EUR	450	0,67	220	227	0,29
EUR	200	0,27	450	455	0,59
GBP	420	0,55	190	206	0,27
GBP	180	0,30	270	255	0,33
GBP	290	0,46	280	309	0,40
EUR	100	0,14	170	161	0,21
EUR	100	0,17	275	368	0,48
EUR	180	0,23	80	84	0,11
EUR	260	0,34	110	122	0,16
EUR	270	0,35	50	62	0,08
EUR	100	0,14	130	165	0,21
EUR	180	0,23	200	193	0,25
EUR	260	0,34	16	14	0,02
EUR	270	0,35	280	337	0,44
EUR	100	0,17	110	115	0,15
EUR	100	0,17	460	553	0,72
	10.206	13,19	70	78	0,10
<b>USA — 36,48 % (28. Februar 2021: 34,79 %)</b>					
EUR	410	0,58	370	367	0,47
EUR	230	0,34	270	281	0,36
EUR	830	1,09	150	151	0,20
EUR	380	0,57	180	164	0,21
EUR	140	0,18	20	22	0,03
EUR	210	0,26	250	279	0,36
EUR	160	0,21	20	18	0,02
	164	0,21	270	263	0,34
			30	26	0,03

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
130 Mars Inc, 4,200 %, fällig 01/04/2059	147	0,19	RUB 10.945 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23/05/2029 †‡	51	0,06
20 Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375 %, fällig 15/04/2050	19	0,02	EUR 300 Russian Foreign Bond – Eurobond, 1,125 %, fällig 20/11/2027 †‡	130	0,17
370 McDonald's Corp, 3,700 %, fällig 30/01/2026	390	0,50		181	0,23
30 MDC Holdings Inc, 2,500 %, fällig 15/01/2031	27	0,04	<b>USA — 1,32 % (28. Februar 2021: 3,79 %)</b>		
150 MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15/01/2043	163	0,21	60 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2041	56	0,07
500 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17/03/2052	478	0,62	80 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/05/2041	80	0,10
170 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15/04/2038	175	0,23	40 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/11/2041	38	0,05
250 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, fällig 15/10/2027	256	0,33	290 United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/05/2050	232	0,30
GBP 530 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692 %, fällig 05/06/2028	711	0,92	335 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/08/2050	276	0,36
EUR290 Netflix Inc, 3,625 %, fällig 15/06/2030	349	0,45	360 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2051	335	0,44
180 Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig 15/01/2028	184	0,24		1.017	1,32
270 Northwest Pipeline LLC, 4,000 %, fällig 01/04/2027	285	0,37	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 4.035 USD)</b>		
60 NRG Energy Inc, 144A, 2,450 %, fällig 02/12/2027	57	0,07		3.403	4,40
100 Nuveen LLC, 4,000 %, fällig 01/11/2028	109	0,14	<b>Darlehensanleihen — 0,34 % (28. Februar 2021: 0,09 %)</b>		
80 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig 15/01/2031	74	0,10	160 ICON Luxembourg S.a.r.l., 2,750 %, fällig 01/07/2028 *	158	0,20
420 Prologis Euro Finance LLC, 0,625 %, fällig 10/09/2031	424	0,55	40 Indigo Merger Sub, Inc., 2,750 %, fällig 01/07/2028 *	39	0,05
220 Prudential Financial Inc, 3,000 %, fällig 10/03/2040	208	0,27	69 Murphy USA Inc., 0,000 %, fällig 21/01/2028 *	70	0,09
420 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, fällig 15/10/2026	395	0,51	<b>Gesamtdarlehensanleihen (Anschaffungskosten 268 USD)</b>		
410 Schlumberger Holdings Corp, 4,000 %, fällig 21/12/2025	428	0,55		267	0,34
220 Service Corp International/US, 3,375 %, fällig 15/08/2030	203	0,26	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen — 0,93 % (28. Februar 2021: 1,14 %)</b>		
360 Stellantis NV, 5,250 %, fällig 15/04/2023	373	0,48	718 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	718	0,93
70 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,000 %, fällig 15/01/2028	72	0,09	<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Kosten 718 USD)</b>		
340 Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15/03/2039	371	0,48		718	0,93
310 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01/07/2038	389	0,50	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 77.550 USD)</b>		
150 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01/02/2026	177	0,23		74.454	96,25
26 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875 %, fällig 15/01/2026	26	0,03	<b>Devisenterminkontrakte – 1,07 % (28. Februar 2021: 0,13 %)</b>		
290 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15/04/2026	290	0,37	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	827	1,07
300 United Rentals North America Inc, 3,750 %, fällig 15/01/2032	286	0,37	<b>Futures — 0,57 % (28. Februar 2021: 0,16 %)</b>		
420 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15/12/2048	484	0,63	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	437	0,57
290 US Bancorp, 0,850 %, fällig 07/06/2024	328	0,42	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
210 Verizon Communications Inc, 2,100 %, fällig 22/03/2028	203	0,26		75.718	97,89
60 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16/03/2037	72	0,09	<b>Credit Default Swaps — (0,37 %) (28. Februar 2021: (0,77 %))</b>		
240 Verizon Communications Inc, 1,850 %, fällig 18/05/2040	256	0,33	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(283)	(0,37)
310 Verizon Communications Inc, 3,550 %, fällig 22/03/2051	301	0,39	<b>Zinsswaps – (0,14 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
220 VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 4,125 %, fällig 15/08/2030	219	0,28	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(110)	(0,14)
200 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 15/02/2029	188	0,24	<b>Devisenterminkontrakte – (0,15 %) (28. Februar 2021: (0,23 %))</b>		
EUR 250 Wells Fargo & Co, 2,250 %, fällig 02/05/2023	287	0,37	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(116)	(0,15)
EUR 600 Wells Fargo & Co, 1,000 %, fällig 02/02/2027	662	0,86	<b>Futures – (0,06 %) (28. Februar 2021: (0,18 %))</b>		
GBP 200 Wells Fargo & Co, 4,875 %, fällig 29/11/2035	308	0,40	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(44)	(0,06)
190 Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig 01/04/2044	195	0,25	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
130 Western Midstream Operating LP, 5,750 %, fällig 01/02/2050	132	0,17		(553)	(0,72)
190 Williams Cos Inc/The, 5,750 %, fällig 24/06/2044	224	0,29	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
20 Williams Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15/10/2051	18	0,02		75.165	97,17
	28.218	36,48	<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		
				2.188	2,83
			<b>Gesamtnettvermögen</b>		
				\$77.353	100,00
			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile, weniger als 0,01 %.		
			144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 4.033.000 USD oder 5,20 % des Nettovermögens.		
			* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.		
			† Illiquide.		
			‡ Sicherheiten fallen aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen nach Jahresende nicht mehr an.		
			<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
			Unbefristet – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.		
			EUR – Euro		
			GBP – Britische Pfund		
			MXN – Mexikanischer Peso		
			RUB – Russischer Rubel		
					<b>% des Gesamtvermögens</b>
			<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
					93,80
			Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden		
					0,34
			Organismen für gemeinsame Anlagen		
					0,92
			Finanzderivate		
					1,61
			Sonstige Vermögenswerte		
					3,33
			<b>Gesamtvermögen</b>		
					100,00

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Kauf	20/12/2026	4.200	\$ (61)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 % – Kauf	20/12/2026	6.970	(107)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 5,000 % – Kauf	20/12/2026	1.550	(115)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (636) USD)				(283)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (636) USD)				\$ (283)

## Zeitplan der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating EUR 6M Euribor Reuters, Receive Fixed -0,150 %	15/08/2026	3.840	\$ (110)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(110)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ (110)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	4	Verkauf	USD	5	\$ –
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	BRL	1.600	Verkauf	USD	278	32
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf	EUR	4	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	283	Verkauf	EUR	248	4
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	–	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	4.724	Verkauf	USD	5.403	(102)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	48	Verkauf	USD	65	(1)
18/05/2022	BNP Paribas	Kauf	USD	817	Verkauf	EUR	714	14
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	7.267	Verkauf	EUR	6.325	153
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	333	Verkauf	GBP	246	4
18/05/2022	Citi	Kauf	EUR	290	Verkauf	USD	329	(3)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	123	Verkauf	AUD	170	(1)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	11.329	Verkauf	EUR	9.860	238
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.263	Verkauf	GBP	1.667	28
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	EUR	192	Verkauf	USD	219	(2)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	GBP	137	Verkauf	USD	186	(2)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	JPY	93.549	Verkauf	USD	809	7
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	AUD	100	Verkauf	USD	71	2
18/05/2022	HSBC	Kauf	USD	69	Verkauf	EUR	60	1
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	9.201	Verkauf	EUR	8.059	136
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	5.591	Verkauf	GBP	4.129	52
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	GBP	200	Verkauf	USD	271	(3)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	100	Verkauf	USD	114	(2)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	AUD	66	Verkauf	USD	47	1
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	12	Verkauf	EUR	11	–
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.774	Verkauf	EUR	1.547	34
18/05/2022	Royal Bank of Canada	Kauf	USD	587	Verkauf	EUR	513	10
18/05/2022	UBS	Kauf	USD	4.633	Verkauf	EUR	4.041	88
18/05/2022	UBS	Kauf	USD	1.891	Verkauf	GBP	1.393	23
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 110 USD)							\$	827
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (193) USD)								(116)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (83) USD)							\$	711

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
Euro-Bobl March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(41)	\$(6.062)	104
Euro-Bund March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(29)	(5.432)	194
Euro-Buxl 30 Year Bond March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(222)	17
Long Gilt June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(13)	(2.146)	(14)
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	36	4.588	44
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	36	4.258	22
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(17)	(2.664)	(30)
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	24	4.463	56
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 128 USD)				\$ 437
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (147) USD)				(44)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (19) USD)				\$ 393

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 84,47 % (28. Februar 2021: 82,03 %)</b>			<b>Rumänien – 1,23 % (28. Februar 2021: 1,87 %)</b>		
<b>Belgien – 1,14 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			500 RCS & RDS SA, 3,250 %, fällig 05/02/2028		
	428	1,14	459	1,23	
<b>Brasilien – 1,83 % (28. Februar 2021: 1,96 %)</b>			<b>Spanien – 10,31 % (28. Februar 2021: 7,38 %)</b>		
GBP 550 Petrobras Global Finance BV, 6,625 %, fällig 16/01/2034			200 Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, fällig 15/02/2033		
	684	1,83	169	0,45	
<b>Kanada – 0,57 % (28. Februar 2021: 0,43 %)</b>			350 Grupo Antolin-Irausa SA, 3,500 %, fällig 30/04/2028		
230 Primo Water Holdings Inc, 3,875 %, fällig 31/10/2028			470 Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, fällig 18/09/2027		
	214	0,57	451	1,20	
<b>Frankreich – 7,33 % (28. Februar 2021: 8,12 %)</b>			270 Neinor Homes SA, 4,500 %, fällig 15/10/2026		
100 Accor SA, 2,375 %, fällig 29/11/2028			345 Repsol International Finance BV, 4,500 %, fällig 25/03/2075 *		
100 Adevinta ASA, 3,000 %, fällig 15/11/2027			900 Telefonica Europe BV, 4,375 %, Perpetual *		
100 Afflelou SAS, 4,250 %, fällig 19/05/2026			500 Telefonica Europe BV, Series NC5, 3,000 %, Perpetual *		
150 Burger King France SAS, 4,750 %, fällig 01/11/2026 *			590 Tendam Brands SAU, 5,000 %, fällig 15/09/2024		
230 CAB SELAS, 3,375 %, fällig 01/02/2028			290 Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA, 5,250 %, fällig 01/04/2026		
400 Casino Guichard Perrachon SA, 3,992 %, Perpetual *			290		
280 Faurecia SE, 3,750 %, fällig 15/06/2028			3.860		
360 Goldstory SASU, 5,375 %, fällig 01/03/2026			10,31		
100 IPD 3 BV, 5,500 %, fällig 01/12/2025			<b>Schweden – 2,88 % (28. Februar 2021: 2,41 %)</b>		
455 Kapla Holding SAS, 3,375 %, fällig 15/12/2026			200 Heimstaden AB, 4,250 %, fällig 09/03/2026		
270 Picard Groupe SAS, 3,875 %, fällig 01/07/2026			350 Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,624 %, Perpetual *		
500 Renault SA, 2,500 %, fällig 01/04/2028			500 Verisure Holding AB, 3,875 %, fällig 15/07/2026		
	2.745	7,33	94	0,25	
<b>Deutschland – 11,80 % (28. Februar 2021: 9,58 %)</b>			100 Verisure Midholding AB, 5,250 %, fällig 15/02/2029		
100 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, fällig 15/01/2027			1.080		
200 Bayer AG, 2,375 %, fällig 12/11/2079 *			<b>Schweiz – 0,40 % (28. Februar 2021: 0,56 %)</b>		
475 Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4,375 %, fällig 15/01/2028			150 Holcim Finance Luxembourg SA, 3,000 %, Perpetual *		
410 CT Investment GmbH, 5,500 %, fällig 15/04/2026			149		
230 HT Troplast GmbH, 9,250 %, fällig 15/07/2025			<b>Großbritannien – 16,90 % (28. Februar 2021: 17,09 %)</b>		
495 Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, fällig 30/09/2025			GBP 250 Bellis Acquisition Co Plc, 4,500 %, fällig 16/02/2026		
560 PCF GmbH, 4,750 %, fällig 15/04/2026			GBP 220 Co-operative Group Holdings 2011 Ltd, 7,500 %, fällig 08/07/2026		
500 Renk AG/Frankfurt am Main, 5,750 %, fällig 15/07/2025			500 Energia Group NI FinanceCo Plc/Energia Group ROI Holdings DAC, 4,000 %, fällig 15/09/2025		
680 Schenck Process Holding GmbH/Darmstadt, 5,375 %, fällig 15/06/2023			GBP 540 Galaxy Bidco Ltd, 6,500 %, fällig 31/07/2026		
90 TK Elevator Holdco GmbH, 6,625 %, fällig 15/07/2028			GBP 600 Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07/04/2026		
120 TK Elevator Midco GmbH, 4,375 %, fällig 15/07/2027			GBP 250 Marks & Spencer Plc, 3,750 %, fällig 19/05/2026		
210 TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig 15/05/2026			GBP 350 Marston's Issuer Plc, Series B1, 3,049 %, fällig 16/07/2035 *		
500 ZF Finance GmbH, 2,000 %, fällig 06/05/2027			GBP 320 Pinewood Finance Co Ltd, 3,250 %, fällig 30/09/2025		
	4.418	11,80	GBP 200 Premier Foods Finance Plc, 3,500 %, fällig 15/10/2026		
<b>Irland – 1,66 % (28. Februar 2021: 2,25 %)</b>			GBP 480 Saga Plc, 5,500 %, fällig 15/07/2026		
680 eircom Finance DAC, 2,625 %, fällig 15/02/2027			GBP 260 TalkTalk Telecom Group Ltd, 3,875 %, fällig 20/02/2025		
	623	1,66	GBP 139 Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, fällig 13/07/2044		
<b>Israel – 2,87 % (28. Februar 2021: 3,30 %)</b>			550 Victoria Plc, 3,625 %, fällig 24/08/2026		
630 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,125 %, fällig 15/10/2024			GBP 200 Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250 %, fällig 15/05/2029		
170 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 6,000 %, fällig 31/01/2025			GBP 400 Vmed O2 UK Financing I Plc, 4,500 %, fällig 15/07/2031		
300 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 4,500 %, fällig 01/03/2025			GBP 430 Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, fällig 15/07/2026		
	299	0,80	6.329		
	1.073	2,87	16,90		
<b>Italien – 6,31 % (28. Februar 2021: 6,53 %)</b>			<b>USA – 6,45 % (28. Februar 2021: 8,08 %)</b>		
600 ASR Media and Sponsorship SpA, 5,125 %, fällig 01/08/2024			GBP 500 Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 4,875 %, fällig 01/06/2028		
360 Brunello Bidco SpA, 3,750 %, fällig 15/02/2028 *			240 Carnival Corp, 10,125 %, fällig 01/02/2026		
290 Castor SpA, 6,000 %, fällig 15/02/2029			170 Energizer Gamma Acquisition BV, 3,500 %, fällig 30/06/2029		
180 International Design Group SpA, 4,250 %, fällig 15/05/2026 *			180 Ford Motor Credit Co LLC, 2,748 %, fällig 14/06/2024		
400 Marcolin SpA, 6,125 %, fällig 15/11/2026			450 International Game Technology Plc, 2,375 %, fällig 15/04/2028		
440 Telecom Italia SpA/Milano, 3,625 %, fällig 25/05/2026			310 Kronos International Inc, 3,750 %, fällig 15/09/2025		
140 Verde Bidco SpA, 4,625 %, fällig 01/10/2026			250 OI European Group BV, 2,875 %, fällig 15/02/2025		
	2.364	6,31	300 Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 3,000 %, fällig 15/06/2029		
<b>Luxemburg – 4,73 % (28. Februar 2021: 3,42 %)</b>			2.415		
330 Altice Financing SA, 4,250 %, fällig 15/08/2029			<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 32.550 EUR)</b>		
480 Altice France Holding SA, 8,000 %, fällig 15/05/2027			31.633		
290 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01/04/2028			<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,28 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
650 Summer BC Holdco B SARL, 5,750 %, fällig 31/10/2026			<b>Großbritannien – 0,28 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
	1.772	4,73	GBP 100 United Kingdom Gilt, 0,625 %, fällig 31/07/2035		
<b>Mexiko – 1,59 % (28. Februar 2021: 1,54 %)</b>			<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 110 EUR)</b>		
670 Petroleos Mexicanos, 2,750 %, fällig 21/04/2027			105		
<b>Niederlande – 6,47 % (28. Februar 2021: 5,99 %)</b>			<b>Darlehensanleihen – 2,75 % (28. Februar 2021: 1,97 %)</b>		
190 Nobel Bidco BV, 3,125 %, fällig 15/06/2028			140 CTEC III GmbH, 0,000 %, fällig 19/01/2029 *		
220 Promontoria Holding 264 BV, 6,375 %, fällig 01/03/2027			270 Fronier Lux FinCo SARL, 2,375 %, fällig 30/01/2027 *		
500 Schoeller Packaging BV, 6,375 %, fällig 01/11/2024			200 Hestia Holding, 4,000 %, fällig 01/06/2027 *		
500 Trivium Packaging Finance BV, 3,750 %, fällig 15/08/2026			300 Ineos 226 Ltd, 2,750 %, fällig 21/01/2026 *		
580 United Group BV, 4,000 %, fällig 15/11/2027			140 lu Finance Management GmbH, 5,000 %, fällig 28/12/2028 *		
400 United Group BV, 5,250 %, fällig 01/02/2030			1.030		
160 WP/AP Telecom Holdings IV BV, 3,750 %, fällig 15/01/2029			<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,62 %)</b>		
	2.423	6,47	USD 2 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)		
<b>Gesamte kollektive Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 2 EUR)</b>			2		
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 33.703 EUR)</b>			32.770		
			87,51		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts	ABKÜRZUNGEN:		
<b>Devisenterminkontrakte – 0,02 % (28. Februar 2021: 0,01 %)</b>			Unbefristet	–	Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	8	0,02	GBP	–	Britische Pfund
			USD	–	US-Dollar
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>32.778</b>	<b>87,53</b>			
<b>Devisenterminkontrakte – (0,18 %) (28. Februar 2021: (0,20 %))</b>			<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(66)	(0,18)	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(66)</b>	<b>(0,18)</b>	Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden		
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>32.712</b>	<b>87,35</b>	Organismen für gemeinsame Anlagen		
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>	<b>4.736</b>	<b>12,65</b>	Finanzderivate		
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>€ 37.448</b>	<b>100,00</b>	Sonstige Vermögenswerte		
			<b>Gesamtvermögen</b>		
			<b>100,00</b>		

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

\* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkauf		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	6	Verkauf	EUR	7	€	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	GBP	–	–	–
18/05/2022	BNP Paribas	Kauf	EUR	1.712	Verkauf	GBP	1.447	(15)	
18/05/2022	Citi	Kauf	GBP	470	Verkauf	EUR	556	5	
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	410	Verkauf	GBP	346	(2)	
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	154	Verkauf	USD	176	(2)	
18/05/2022	Royal Bank of Canada	Kauf	EUR	217	Verkauf	GBP	184	(2)	
18/05/2022	Societe Generale	Kauf	EUR	147	Verkauf	GBP	124	(1)	
18/05/2022	UBS	Kauf	USD	200	Verkauf	EUR	175	3	
18/05/2022	UBS	Kauf	EUR	6.198	Verkauf	GBP	5.232	(44)	
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 4 EUR)								€	8
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (109) EUR)									(66)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (105) EUR)								€	(58)

# Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Asset-Backed Securities – 4,54 % (28. Februar 2021: 0,99 %)</b>					
16.250 Apidos CLO XXXVI, Series 2021 36A, Class D, 144A, 3,018 %, fällig 20/07/2034 *	15.852	0,38	27.820 Petrobras Global Finance BV, 5,999 %, fällig 27/01/2028	29.370	0,70
11.460 Apidos CLO XXXVIII, Series 2021 38A, Class D, 144A, 3,192 %, fällig 21/01/2034 *	11.488	0,27	13.890 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05/06/2115	12.910	0,31
15.430 Bain Capital Credit CLO 2021-4 Ltd, Series 2021 4A, Class D, 144A, 3,226 %, fällig 20/10/2034 *	15.016	0,36	1.820 Suzano Austria GmbH, 3,750 %, fällig 15/01/2031	1.707	0,04
10.119 Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Series 2016 1A, Class AA, 144A, 2,487 %, fällig 16/12/2041	9.932	0,24		52.869	1,26
8.270 Canyon Capital CLO 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Class DR, 144A, 3,241 %, fällig 15/07/2030 *	8.291	0,20	<b>Kanada — 0,13 % (28. Februar 2021: 0,17 %)</b>		
3.592 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class A1, 144A, 2,750 %, fällig 25/07/2057 *	3.620	0,09	5.220 Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig 15/12/2027	5.472	0,13
14.410 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class A2, 144A, 2,975 %, fällig 25/07/2057 *	14.670	0,35	<b>China — 0,90 % (28. Februar 2021: 0,41 %)</b>		
4.082 CWHQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I, Series 2006 I, Class 2A, 0,331 %, fällig 15/01/2037 *	3.920	0,09	13.710 Alibaba Group Holding Ltd, 4,200 %, fällig 06/12/2047	13.305	0,32
14.480 DB Master Finance LLC, Series 2021 1A, Class A23, 144A, 2,791 %, fällig 20/11/2051	13.636	0,33	4.660 Alibaba Group Holding Ltd, 3,150 %, fällig 09/02/2051	3.748	0,09
8.000 Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Series 2018 4, Class A, 4,060 %, fällig 15/11/2030	8.691	0,21	8.430 Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13/07/2031	7.075	0,17
7.790 ICG US CLO 2014-1 Ltd, Series 2014 1A, Class CR2, 144A, 3,884 %, fällig 20/10/2034 *	7.753	0,19	17.620 Prosus NV, 144A, 3,832 %, fällig 08/02/2051	13.344	0,32
2.485 Loanpal Solar Loan Ltd, Series 2020 3GS, Class B, 144A, 3,450 %, fällig 20/12/2047	2.454	0,06		37.472	0,90
3.844 Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS, Series 2018 2GS, Class A, 144A, 4,200 %, fällig 22/02/2044	4.005	0,09	<b>Kolumbien — 0,43 % (28. Februar 2021: 0,33 %)</b>		
8.025 Nassau 2021-I Ltd, Series 2021 IA, Class D, 144A, 3,991 %, fällig 26/08/2034 *	7.728	0,19	8.510 Ecopetrol SA, 5,375 %, fällig 26/06/2026	8.736	0,21
7.000 Ocean Trails Clo X, Series 2020 10A, Class DR, 144A, 3,961 %, fällig 15/10/2034 *	6.844	0,16	10.720 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28/05/2045	9.355	0,22
19.503 Sonic Capital LLC, Series 2020 1A, Class A2I, 144A, 3,845 %, fällig 20/01/2050	19.950	0,48		18.091	0,43
8.649 Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class A, 144A, 2,675 %, fällig 28/02/2033	8.458	0,20	<b>Dänemark — 0,51 % (28. Februar 2021: 0,46 %)</b>		
4.485 Store Master Funding I-VII XIV XIX XX, Series 2021 1A, Class A3, 144A, 2,860 %, fällig 20/06/2051	4.305	0,10	EUR 18.920 Danske Bank A/S, 5,875 %, Perpetual *	21.267	0,51
7.200 Venture XXVI CLO Ltd, Series 2017 26A, Class D, 144A, 4,504 %, fällig 20/01/2029 *	7.210	0,17	<b>Frankreich — 1,52 % (28. Februar 2021: 1,48 %)</b>		
10.000 Vibrant Clo VII Ltd, Series 2017 7A, Class C, 144A, 3,854 %, fällig 15/09/2030 *	9.950	0,24	EUR 20.489 BNP Paribas SA, 6,125 %, Perpetual *	23.246	0,56
6.100 Vibrant CLO XI Ltd, Series 2019 11A, Class CR, 144A, 3,754 %, fällig 20/07/2032 *	6.041	0,14	400 BNP Paribas SA, 144A, 7,000 %, Perpetual *	435	0,01
			9.600 BNP Paribas SA, 144A, 7,375 %, Perpetual *	10.471	0,25
<b>Summe der vermögensbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 190.664 USD)</b>					
	189.814	4,54	11.610 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetual *	13.112	0,31
			11.220 Credit Agricole SA, 7,500 %, Perpetual *	16.247	0,39
				63.511	1,52
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere — 2,26 % (28. Februar 2021: 1,37 %)</b>					
18.790 BBCCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Class D, 144A, 4,563 %, fällig 10/08/2033 *	18.363	0,44	<b>Deutschland — 0,13 % (28. Februar 2021: 0,09 %)</b>		
10.400 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Series 2021 R03, Class 1M2, 144A, 1,699 %, fällig 25/12/2041 *	10.117	0,24	EUR 5.000 Hamburg Commercial Bank AG, 0,750 %, fällig 23/11/2023	5.625	0,13
2.808 CSMC Series 2015-12R, Series 2015 12R, Class 2A1, 144A, 0,602 %, fällig 30/11/2037 *	2.807	0,07	<b>Indien — 0,60 % (28. Februar 2021: 0,39 %)</b>		
40.117 CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class B2, 144A, 3,600 %, fällig 25/02/2048 *	39.368	0,94	INR 500.000 NTPC Ltd, Series 53, 9,170 %, fällig 22/09/2024	7.219	0,17
41 Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500 %, fällig 01/12/2047	43	—	INR 500.000 Power Finance Corp Ltd, Series 130C, 8,390 %, fällig 19/04/2025	7.081	0,17
78 Flagstar Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Class A4, 144A, 3,500 %, fällig 25/04/2048 *	78	—	INR 250.000 Power Grid Corp of India Ltd, Series C, 8,200 %, fällig 23/01/2025	3.538	0,09
9.850 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Series 2021 DNA3, Class M2, 144A, 2,149 %, fällig 25/10/2033 *	9.848	0,24	INR 500.000 REC Ltd, Series 133, 8,300 %, fällig 10/04/2025	7.061	0,17
7.870 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Series 2021 DNA6, Class M2, 144A, 1,549 %, fällig 25/10/2041 *	7.605	0,18		24.899	0,60
1.781 MortgageIT Trust 2005-3, Series 2005 3, Class A1, 0,787 %, fällig 25/08/2035 *	1.768	0,04	<b>Irland — 0,10 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
3.846 New Residential Mortgage Loan Trust 2017-4, Series 2017 4A, Class A1, 144A, 4,000 %, fällig 25/05/2057 *	3.958	0,09	4.500 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30/01/2032	4.276	0,10
738 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Series 2021 NQ2R, Class A3, 144A, 1,353 %, fällig 25/10/2058 *	729	0,02	<b>Israel — 2,75 % (28. Februar 2021: 1,50 %)</b>		
			9.512 Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, fällig 18/12/2022	9.476	0,23
<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 93.075 USD)</b>					
	94.684	2,26	8.027 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig 01/02/2036	8.120	0,19
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 43,01 % (28. Februar 2021: 43,42 %)</b>					
<b>Belgien — 0,11 % (28. Februar 2021: 0,62 %)</b>					
3.680 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, fällig 23/01/2049	4.566	0,11	5.853 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21/07/2023	5.740	0,14
<b>Brasilien — 1,26 % (28. Februar 2021: 0,94 %)</b>					
7.900 Petrobras Global Finance BV, 7,375 %, fällig 17/01/2027	8.882	0,21	22.213 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig 31/01/2025	23.353	0,56
			11.705 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01/10/2026	10.684	0,25
			2.390 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,750 %, fällig 01/03/2028	2.511	0,06
			2.400 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09/05/2029	2.304	0,05
			66.981 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, fällig 01/10/2046	53.000	1,27
				115.188	2,75
			<b>Italien — 0,09 % (28. Februar 2021: 0,98 %)</b>		
			2.950 Enel Finance International NV, 144A, 6,000 %, fällig 07/10/2039	3.621	0,09
			<b>Luxemburg — 0,05 % (28. Februar 2021: 0,17 %)</b>		
			1.550 ArcelorMittal SA, 7,000 %, fällig 15/10/2039	1.890	0,05
			<b>Macau — 0,31 % (28. Februar 2021: 0,19 %)</b>		
			4.380 Sands China Ltd, 5,125 %, fällig 08/08/2025	4.357	0,10
			2.180 Sands China Ltd, 144A, 2,300 %, fällig 08/03/2027	1.897	0,05
			2.390 Sands China Ltd, 144A, 2,850 %, fällig 08/03/2029	2.013	0,05
			910 Sands China Ltd, 144A, 3,250 %, fällig 08/08/2031	742	0,02
			3.920 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26/08/2028	3.419	0,08
			400 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 15/12/2029	340	0,01
				12.768	0,31
			<b>Malaysia — 0,39 % (28. Februar 2021: 0,26 %)</b>		
			18.750 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig 19/08/2050	16.390	0,39

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
<b>Mexiko — 0,57 % (28. Februar 2021: 0,41 %)</b>					
2.900 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 6,875 %, Perpetual *	2.896	0,07	4.180 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig 15/01/2035	4.116	0,10
8.900 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625 %, Perpetual *	8.741	0,21	5.230 Cameron LNG LLC, 144A, 3,701 %, fällig 15/01/2039	5.230	0,13
14.780 Petroleos Mexicanos, 6,375 %, fällig 23/01/2045	12.037	0,29	13.380 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15/03/2028	13.966	0,33
	23.674	0,57	4.830 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01/04/2038	5.059	0,12
<b>Niederlande – 0,76 % (28. Februar 2021: 1,02 %)</b>					
EUR 27.600 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, Perpetual *	31.950	0,76	910 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01/03/2042	786	0,02
<b>Russland — 0,10 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
11.050 Lukoil Capital DAC, 144A, 3,600 %, fällig 26/10/2031	4.171	0,10	1.540 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01/03/2050	1.509	0,04
<b>Supranational — 0,21 % (28. Februar 2021: 0,19 %)</b>					
IDR 127.100.000 European Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, fällig 06/10/2026	8.772	0,21	10.730 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,834 %, fällig 23/10/2055	13.468	0,32
<b>Schweden — 0,32 % (28. Februar 2021: 0,22 %)</b>					
13.600 Svenska Handelsbanken AB, 4,750 %, Perpetual *	13.364	0,32	1.780 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 5,125 %, fällig 30/06/2027	1.943	0,05
<b>Schweiz — 1,62 % (28. Februar 2021: 1,38 %)</b>					
770 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, Perpetual *	797	0,02	1.620 Cheniere Energy Inc, 4,625 %, fällig 15/10/2028	1.657	0,04
8.680 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, Perpetual *	8.854	0,21	2.660 Cheniere Energy Partners LP, 144A, 3,250 %, fällig 31/01/2032	2.505	0,06
23.330 Credit Suisse Group AG, 144A, 5,250 %, Perpetual *	22.244	0,53	6.095 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15/07/2039	9.550	0,23
200 Credit Suisse Group AG, 144A, 6,375 %, Perpetual *	202	0,01	45.695 Citigroup Inc, Series P, 5,950 %, Perpetual *	47.466	1,13
15.800 UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	16.460	0,39	8.789 CommonSpirit Health, 4,350 %, fällig 01/11/2042	9.287	0,22
11.160 UBS Group AG, 6,875 %, Perpetual *	11.779	0,28	2.890 CommonSpirit Health, 3,817 %, fällig 01/10/2049	2.928	0,07
7.050 UBS Group AG, 7,000 %, Perpetual *	7.514	0,18	60 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15/01/2028	62	–
	67.850	1,62	5.060 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig 15/01/2031	5.651	0,14
<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,57 % (28. Februar 2021: 0,40 %)</b>					
22.500 MDGH GMTN RSC Ltd, 3,950 %, fällig 21/05/2050	23.946	0,57	8.260 Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, fällig 01/06/2044	8.339	0,20
<b>Großbritannien — 0,91 % (28. Februar 2021: 2,57 %)</b>					
588 Barclays Bank Plc, 7,625 %, fällig 21/11/2022	610	0,02	2.650 Coterra Energy Inc, 144A, 3,900 %, fällig 15/05/2027	2.763	0,07
11.720 Barclays Plc, 8,000 %, Perpetual *	12.526	0,30	5.690 Coterra Energy Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15/03/2029	6.113	0,15
9.260 Barclays Plc, 7,750 %, Perpetual *	9.702	0,23	5.110 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01/02/2029	5.182	0,12
2.710 BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig 15/08/2047	2.507	0,06	3.070 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15/11/2031	2.798	0,07
8.028 HSBC Holdings Plc, 6,500 %, Perpetual *	8.344	0,20	610 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25/03/2048	713	0,02
3.280 Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, Perpetual *	3.469	0,08	4.342 DCP Midstream LP, Series A, 7,375 %, Perpetual *	4.114	0,10
900 Reynolds American Inc, 6,150 %, fällig 15/09/2043	1.001	0,02	2.405 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03/11/2036	2.912	0,07
	38.159	0,91	5.990 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, fällig 15/09/2037	7.325	0,18
<b>USA — 28,67 % (28. Februar 2021: 28,03 %)</b>					
4.370 AbbVie Inc, 4,050 %, fällig 21/11/2039	4.594	0,11	2.940 Delta Air Lines Inc, 3,800 %, fällig 19/04/2023	2.966	0,07
155 Altria Group Inc, 4,800 %, fällig 14/02/2029	168	–	3.916 Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig 28/10/2024	3.871	0,09
2.780 Altria Group Inc, 2,450 %, fällig 04/02/2032	2.484	0,06	7.440 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01/05/2025	8.270	0,20
3.270 Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14/02/2049	3.640	0,09	4.020 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15/01/2026	4.516	0,11
3.265 Altria Group Inc, 6,200 %, fällig 14/02/2059	3.661	0,09	354 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,500 %, fällig 20/10/2025	364	0,01
3.957 Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22/08/2057	4.589	0,11	11.030 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20/10/2025	11.328	0,27
18.540 Amazon.com Inc, 2,700 %, fällig 03/06/2060	18.611	0,38	354 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,750 %, fällig 20/10/2028	369	0,01
610 Apache Corp, 4,875 %, fällig 15/11/2027	628	0,02	4.920 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20/10/2028	5.136	0,12
510 Apache Corp, 7,750 %, fällig 15/12/2029	595	0,01	6.980 Devon Energy Corp, 8,250 %, fällig 01/08/2023	7.511	0,18
560 Apache Corp, 6,000 %, fällig 15/01/2037	624	0,01	8.660 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15/12/2025	9.664	0,23
28.226 Apache Corp, 5,100 %, fällig 01/09/2040	28.273	0,68	1.736 Devon Energy Corp, 5,250 %, fällig 15/10/2027	1.800	0,04
4.550 Apache Corp, 5,250 %, fällig 01/02/2042	4.489	0,11	1.670 Devon Energy Corp, 5,875 %, fällig 15/06/2028	1.783	0,04
6.480 Apache Corp, 4,750 %, fällig 15/04/2043	6.183	0,15	1.436 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15/01/2030	1.501	0,04
7.120 Apache Corp, 4,250 %, fällig 15/01/2044	6.367	0,15	1.690 Devon Energy Corp, 7,875 %, fällig 30/09/2031	2.277	0,05
740 Apache Corp, 7,375 %, fällig 15/08/2047	853	0,02	1.440 Devon Energy Corp, 7,950 %, fällig 15/04/2032	1.949	0,05
1.970 Apache Corp, 5,350 %, fällig 01/07/2049	1.964	0,05	3.942 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15/07/2041	4.617	0,11
17.330 BAC Capital Trust XIV, Series G, 4,000 %, Perpetual *	15.230	0,36	5.512 Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15/05/2042	5.940	0,14
20.180 Bank of America Corp, Series X, 6,250 %, Perpetual *	21.088	0,50	5.305 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15/06/2045	5.924	0,14
29.340 Bank of America Corp, Series FF, 5,875 %, Perpetual *	30.147	0,72	1.380 Diamondback Energy Inc, 2,875 %, fällig 01/12/2024	1.397	0,03
15.985 Bank of America Corp, Series AA, 6,100 %, Perpetual *	16.831	0,40	2.100 Diamondback Energy Inc, 3,250 %, fällig 01/12/2026	2.146	0,05
1.504 Bausch Health Americas Inc, 144A, 8,500 %, fällig 31/01/2027	1.525	0,04	400 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01/12/2029	405	0,01
2.600 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01/11/2025	2.612	0,06	2.520 Diamondback Energy Inc, 4,400 %, fällig 24/03/2051	2.617	0,06
1.416 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,250 %, fällig 30/01/2030	1.144	0,03	3.720 Dignity Health, 5,267 %, fällig 01/11/2064	4.670	0,11
2.978 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15/02/2026	2.937	0,07	4.760 DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15/11/2024	4.765	0,11
2.510 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15/12/2025	2.642	0,06	170 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01/12/2026	167	–
9.590 Boeing Co/The, 3,250 %, fällig 01/02/2035	8.990	0,21	1.220 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01/06/2029	1.032	0,02
780 Boeing Co/The, 3,550 %, fällig 01/03/2038	723	0,02	1.530 Energy Transfer LP, 6,850 %, fällig 15/02/2040	1.792	0,04
600 Boeing Co/The, 3,750 %, fällig 01/02/2050	559	0,01	2.520 Energy Transfer LP, 6,500 %, fällig 01/02/2042	2.977	0,07
10.000 Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01/05/2050	11.898	0,28	2.135 Energy Transfer LP, 6,100 %, fällig 15/02/2042	2.388	0,06
3.000 Boeing Co/The, 3,950 %, fällig 01/08/2059	2.731	0,07	4.065 Energy Transfer LP, 5,950 %, fällig 01/10/2043	4.503	0,11
8.862 Boeing Co/The, 5,930 %, fällig 01/05/2060	10.546	0,25	16.485 Energy Transfer LP, 5,300 %, fällig 15/04/2047	17.262	0,41
128 Broadcom Inc, 144A, 3,187 %, fällig 15/11/2036	119	–	8.342 Energy Transfer LP, 5,400 %, fällig 01/10/2047	8.945	0,21
4.540 California Institute of Technology, 3,650 %, fällig 01/09/2119	4.275	0,10	4.980 Energy Transfer LP, 6,000 %, fällig 15/06/2048	5.600	0,13
			4.610 Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig 15/04/2049	5.335	0,13
			4.240 Energy Transfer LP, 5,000 %, fällig 15/05/2050	4.419	0,11
			12.260 Energy Transfer LP, Series F, 6,750 %, Perpetual *	11.754	0,28
			15.060 Energy Transfer LP, Series G, 7,125 %, Perpetual *	14.796	0,35
			12.320 Energy Transfer LP, Series H, 6,500 %, Perpetual *	12.211	0,29

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
12.990 Energy Transfer LP, Series B, 6,625 %, Perpetual *	11.772	0,28	5.320 Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, fällig 15/03/2040	5.928	0,14
2.568 Enterprise Products Operating LLC, 6,125 %, fällig 15/10/2039	3.177	0,08	11.725 Occidental Petroleum Corp, 4,500 %, fällig 15/07/2044	11.099	0,27
4.131 Enterprise Products Operating LLC, 6,450 %, fällig 01/09/2040	5.275	0,13	17.150 Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, fällig 15/06/2045	16.539	0,40
1.566 Enterprise Products Operating LLC, 5,950 %, fällig 01/02/2041	1.912	0,05	7.820 Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig 15/03/2046	9.357	0,22
2.330 Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, fällig 15/02/2045	2.611	0,06	5.500 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15/04/2046	5.234	0,13
2.995 Enterprise Products Operating LLC, 4,250 %, fällig 15/02/2048	3.044	0,07	2.360 Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, fällig 15/02/2047	2.187	0,05
4.680 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15/02/2078 *	4.350	0,10	14.270 Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig 15/03/2048	13.366	0,32
200 EQT Corp, 6,625 %, fällig 01/02/2025	216	0,01	2.860 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01/02/2031	2.549	0,06
2.610 EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15/05/2026	2.570	0,06	890 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01/08/2040	751	0,02
2.870 EQT Corp, 3,900 %, fällig 01/10/2027	2.905	0,07	3.190 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01/08/2050	2.646	0,06
700 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15/01/2029	740	0,02	2.280 Plains All American Pipeline LP, Series B, 6,125 %, Perpetual *	1.897	0,05
730 EQT Corp, 7,500 %, fällig 01/02/2030	872	0,02	2.180 Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700 %, fällig 15/05/2036	2.518	0,06
2.120 EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15/05/2031	2.065	0,05	2.325 PulteGroup Inc, 6,375 %, fällig 15/05/2033	2.875	0,07
28.515 FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, fällig 15/11/2031	35.745	0,85	835 Range Resources Corp, 5,875 %, fällig 01/07/2022	837	0,02
90 FirstEnergy Corp, Series C, 5,350 %, fällig 15/07/2047	95	–	1.809 Range Resources Corp, 5,000 %, fällig 15/03/2023	1.831	0,04
70 Freeport-McMoRan Inc, 3,875 %, fällig 15/03/2023	71	–	4.800 Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15/01/2029	5.266	0,13
250 Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, fällig 14/11/2024	261	0,01	6.910 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15/04/2040	7.059	0,17
1.120 Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig 01/08/2030	1.158	0,03	670 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01/02/2032	667	0,02
4.450 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15/03/2043	5.125	0,12	2.262 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20/09/2025	2.461	0,06
2.901 GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418 %, fällig 15/11/2035	3.265	0,08	2.740 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15/03/2032	3.806	0,09
675 Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, Perpetual *	584	0,01	210 Sprint Corp, 7,875 %, fällig 15/09/2023	226	0,01
12.340 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, fällig 01/10/2037	16.235	0,39	310 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,375 %, fällig 01/02/2027	319	0,01
2.560 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,210 %, fällig 22/04/2042 *	2.392	0,06	3.810 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, fällig 01/03/2030	4.039	0,10
5.530 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,908 %, fällig 21/07/2042 *	4.918	0,12	1.970 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01/02/2031	2.028	0,05
16.590 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22/05/2045	19.948	0,48	280 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig 15/01/2032	276	0,01
5.990 Hackensack Meridian Health Inc, 4,211 %, fällig 01/07/2048	6.836	0,16	11.910 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, fällig 22/08/2050 t∞	10.679	0,26
610 HCA Inc, 5,375 %, fällig 01/02/2025	647	0,02	1.300 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01/07/2038	1.630	0,04
2.370 HCA Inc, 7,690 %, fällig 15/06/2025	2.663	0,06	120 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15/02/2026	116	–
380 HCA Inc, 5,625 %, fällig 01/09/2028	422	0,01	2.100 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15/02/2029	1.973	0,05
1.110 HCA Inc, 5,875 %, fällig 01/02/2029	1.242	0,03	1.550 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15/02/2031	1.457	0,03
1.610 HCA Inc, 3,500 %, fällig 01/09/2030	1.596	0,04	200 T-Mobile USA Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15/04/2031	197	–
4.401 HCA Inc, 7,500 %, fällig 15/11/2095	5.523	0,13	40 T-Mobile USA Inc, 4,500 %, fällig 15/04/2050	42	–
6.290 ILFC E-Capital Trust I, 144A, 3,370 %, fällig 21/12/2065 *	5.191	0,12	10.190 Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, Null-Coupon, fällig 15/02/2024	9.451	0,23
450 JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, fällig 13/05/2031 *	438	0,01	2.100 Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, Null-Coupon, fällig 15/02/2038	954	0,02
40 JPMorgan Chase & Co, 3,964 %, fällig 15/11/2048 *	42	–	1.640 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15/04/2026	1.638	0,04
1.170 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, fällig 23/01/2049 *	1.221	0,03	10.630 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/04/2029	10.389	0,25
2.700 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22/04/2051 *	2.499	0,06	4.200 Verizon Communications Inc, 3,700 %, fällig 22/03/2061	4.012	0,10
1.265 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,950 %, fällig 15/01/2038	1.610	0,04	7.400 Wells Fargo & Co, 4,650 %, fällig 04/11/2044	8.145	0,19
6.189 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,500 %, fällig 01/09/2039	7.547	0,18	3.210 Wells Fargo & Co, 4,400 %, fällig 14/06/2046	3.446	0,08
5.130 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,550 %, fällig 15/09/2040	6.339	0,15	2.930 Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig 07/12/2046	3.295	0,08
5.250 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,375 %, fällig 01/03/2041	6.350	0,15	2.130 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04/04/2051 *	2.629	0,06
6.450 Kinder Morgan Inc, 5,300 %, fällig 01/12/2034	7.242	0,17	3.926 Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Perpetual *	4.129	0,10
170 Kraft Heinz Foods Co, 6,750 %, fällig 15/03/2032	215	0,01	3.490 Wesleyan University, 4,781 %, fällig 01/07/2116	4.221	0,10
480 Kraft Heinz Foods Co, 6,875 %, fällig 26/01/2039	636	0,02	1.460 Western Midstream Operating LP, 3,600 %, fällig 01/02/2025	1.465	0,04
120 Kraft Heinz Foods Co, 144A, 7,125 %, fällig 01/08/2039	164	–	4.630 Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig 01/06/2025	4.693	0,11
120 Kraft Heinz Foods Co, 4,625 %, fällig 01/10/2039	129	–	765 Western Midstream Operating LP, 4,650 %, fällig 01/07/2026	794	0,02
60 Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig 04/06/2042	66	–	5.100 Western Midstream Operating LP, 4,500 %, fällig 01/03/2028	5.305	0,13
1.750 Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, fällig 01/06/2046	1.796	0,04	5.040 Western Midstream Operating LP, 4,750 %, fällig 15/08/2028	5.225	0,12
1.930 Kraft Heinz Foods Co, 4,875 %, fällig 01/10/2049	2.140	0,05	9.610 Western Midstream Operating LP, 4,550 %, fällig 01/02/2030	9.900	0,24
8.050 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08/08/2024	7.941	0,19	8.751 Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig 01/04/2044	8.984	0,21
610 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25/06/2025	587	0,01	3.370 Western Midstream Operating LP, 5,300 %, fällig 01/03/2048	3.476	0,08
3.140 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20/06/2027	3.316	0,08	7.650 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15/08/2048	7.857	0,19
7.720 MPLX LP, 5,200 %, fällig 01/03/2047	8.519	0,20	1.330 Western Midstream Operating LP, 5,750 %, fällig 01/02/2050	1.355	0,03
4.580 MPLX LP, 4,700 %, fällig 15/04/2048	4.742	0,11	2.130 Williams Cos Inc/The, 3,750 %, fällig 15/06/2027	2.222	0,05
8.730 MPLX LP, 5,500 %, fällig 15/02/2049	9.978	0,24	7.350 Williams Cos Inc/The, Series A, 7,500 %, fällig 15/01/2031	9.463	0,23
2.490 Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01/03/2028	2.621	0,06	9.840 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15/03/2032	13.811	0,33
6.040 Occidental Petroleum Corp, 6,950 %, fällig 01/07/2024	6.561	0,16	3.600 Williams Cos Inc/The, 6,300 %, fällig 15/04/2040	4.433	0,11
1.940 Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, fällig 15/03/2026	2.087	0,05	8.940 Williams Cos Inc/The, 5,750 %, fällig 24/06/2044	10.528	0,25
13.300 Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, fällig 01/09/2030	15.498	0,37	665 Williams Cos Inc/The, 5,100 %, fällig 15/09/2045	735	0,02
24.830 Occidental Petroleum Corp, 6,125 %, fällig 01/01/2031	28.272	0,68	3.980 Willis-Knighton Medical Center, Series 2018, 4,813 %, fällig 01/09/2048	4.853	0,12
120.933 Occidental Petroleum Corp, Null-Coupon, fällig 10/10/2036	64.881	1,55			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
7.313 XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig 01/05/2034	7.994	0,19		1.472	0,04
	1.199.499	28,67		43.872	1,05
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.774.281 USD)</b>	<b>1.799.290</b>	<b>43,01</b>		<b>91.548</b>	<b>2,19</b>
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 35,29 % (28. Februar 2021: 42,35 %)</b>					
<b>Australien — 1,75 % (28. Februar 2021: 1,56 %)</b>					
AUD 66.110 Australia Government Bond, Series 150, 3,000 %, fällig 21/03/2047	51.367	1,23		75.939	1,82
AUD 36.330 Australia Government Bond, Series 162, 1,750 %, fällig 21/06/2051	21.698	0,52		34.909	0,83
	73.065	1,75		74.399	1,78
<b>Brasilien — 2,74 % (28. Februar 2021: 2,06 %)</b>					
BRL 81.530 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNFB, 10,000 %, fällig 01/01/2027	15.113	0,36		21.539	0,51
BRL 316.647 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNFB, 10,000 %, fällig 01/01/2031	56.570	1,35		3.134	0,07
5.630 Brazilian Government International Bond, 4,250 %, fällig 07/01/2025	5.875	0,14		5.418	0,13
41.800 Brazilian Government International Bond, 5,000 %, fällig 27/01/2045	37.229	0,89		19.770	0,47
	114.787	2,74		372.000	8,89
<b>China — 3,48 % (28. Februar 2021: 3,58 %)</b>					
CNY 54.500 China Government Bond, 3,380 %, fällig 21/11/2024	8.865	0,21			
CNY 121.000 China Government Bond, 3,480 %, fällig 29/06/2027	20.082	0,48			
CNY 11.000 China Government Bond, 3,600 %, fällig 27/06/2028	1.839	0,04			
CNY 490.000 China Government Bond, Series INBK, 3,390 %, fällig 16/03/2050	77.223	1,85			
CNY 222.000 China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14/09/2050	37.764	0,90			
	145.773	3,48			
<b>Elfenbeinküste (Elfenbeinküste) – 0,59 % (28. Februar 2021: 0,38 %)</b>					
EUR 4.020 Ivory Coast Government International Bond, 144A, 4,875 %, fällig 30/01/2032	3.856	0,09			
EUR 4.010 Ivory Coast Government International Bond, 4,875 %, fällig 30/01/2032	3.846	0,09			
972 Ivory Coast Government International Bond, 5,750 %, fällig 31/12/2032	954	0,02			
4.164 Ivory Coast Government International Bond, 6,125 %, fällig 15/06/2033	4.011	0,10			
12.540 Ivory Coast Government International Bond, 144A, 6,125 %, fällig 15/06/2033	12.081	0,29			
	24.748	0,59			
<b>Dominikanische Republik — 0,20 % (28. Februar 2021: 0,16 %)</b>					
9.920 Dominican Republic International Bond, 144A, 5,875 %, fällig 30/01/2060	8.383	0,20			
<b>Ägypten – 0,34 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>					
EGP 22.000 Egypt Government Bond, Series 7YR, 18,400 %, fällig 30/05/2024	1.518	0,04			
10.640 Egypt Government International Bond, 144A, 7,625 %, fällig 29/05/2032	8.928	0,21			
EGP 57.275 Egypt Treasury Bills, Null-Coupon, fällig 12/04/2022	3.610	0,09			
	14.056	0,34			
<b>Ghana — 0,16 % (28. Februar 2021: 0,17 %)</b>					
2.180 Ghana Government International Bond, 144A, 7,875 %, fällig 26/03/2027	1.584	0,04			
2.170 Ghana Government International Bond, 144A, 10,750 %, fällig 14/10/2030	2.126	0,05			
4.700 Ghana Government International Bond, 144A, 8,950 %, fällig 26/03/2051	3.075	0,07			
	6.785	0,16			
<b>Indien — 3,57 % (28. Februar 2021: 1,88 %)</b>					
INR 300.000 Export-Import Bank of India, Series P-03, 9,300 %, fällig 11/05/2022	4.021	0,10			
INR 1.580.000 India Government Bond, Series SPB, 8,130 %, fällig 21/09/2022	21.423	0,51			
INR 500.000 India Government Bond, 7,160 %, fällig 20/05/2023	6.826	0,16			
INR 1.200.000 India Government Bond, 8,830 %, fällig 25/11/2023	16.935	0,41			
INR 900.000 India Government Bond, 6,180 %, fällig 04/11/2024	12.231	0,29			
INR 1.000.000 India Government Bond, 5,630 %, fällig 12/04/2026	13.138	0,31			
INR 1.480.000 India Government Bond, 8,150 %, fällig 24/11/2026	21.195	0,51			
INR 300.000 India Government Bond, 7,170 %, fällig 08/01/2028	4.122	0,10			
INR 1.300.000 India Government Bond, 7,590 %, fällig 20/03/2029	18.082	0,43			
INR 1.500.000 India Government Bond, 5,790 %, fällig 11/05/2030	18.783	0,45			
INR 1.000.000 India Government Bond, 6,190 %, fällig 16/09/2034	12.428	0,30			
	149.184	3,57			
<b>Indonesien — 8,89 % (28. Februar 2021: 6,60 %)</b>					
IDR 18.941.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR56, 8,375 %, fällig 15/09/2026				1.472	0,04
IDR 547.847.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15/03/2029				43.872	1,05
IDR 1.186.761.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR78, 8,250 %, fällig 15/05/2029				91.548	2,19
IDR 1.057.630.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR82, 7,000 %, fällig 15/02/2031				75.939	1,82
IDR 500.248.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR87, 6,500 %, fällig 15/02/2031				34.909	0,83
IDR 947.841.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR68, 8,375 %, fällig 15/03/2034				74.399	1,78
IDR 276.928.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR72, 8,250 %, fällig 15/05/2036				21.539	0,51
IDR 39.561.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR79, 8,375 %, fällig 15/04/2039				3.134	0,07
IDR 75.986.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR92, 7,125 %, fällig 15/06/2042				5.418	0,13
IDR 274.060.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR76, 7,375 %, fällig 15/05/2048				19.770	0,47
				372.000	8,89
<b>Mexiko – 9,05 % (28. Februar 2021: 6,69 %)</b>					
MXN 6.476.784 Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	302.955	7,24			
MXN 1.580.470 Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07/11/2047	75.638	1,81			
	378.593	9,05			
<b>Russland — 4,39 % (28. Februar 2021: 10,07 %)</b>					
RUB 1.043.860 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6219, 7,750 %, fällig 16/09/2026 ty				5.740	0,14
RUB 1.043.840 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6226, 7,950 %, fällig 07/10/2026 ty				7.626	0,18
RUB 4.555.801 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6207, 8,150 %, fällig 03/02/2027 ty				25.305	0,61
RUB 443.320 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6232, 6,000 %, fällig 06/10/2027 ty				2.104	0,05
RUB 11.647.347 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19/01/2028 ty				57.699	1,38
RUB 8.416.700 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23/05/2029 ty				39.331	0,94
RUB 287.190 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10/04/2030 ty				1.397	0,03
RUB 5.294.380 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6225, 7,250 %, fällig 10/05/2034 ty				23.717	0,57
RUB 3.194.750 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6230, 7,700 %, fällig 16/03/2039 ty				20.616	0,49
				183.535	4,39
<b>Ukraine — 0,05 % (28. Februar 2021: 0,10 %)</b>					
6.370 Ukraine Government International Bond, 144A, 7,375 %, fällig 25/09/2032				2.170	0,05
<b>USA — 0,08 % (28. Februar 2021: 5,64 %)</b>					
1.820 Morongo Band of Mission Indians/The, 144A, 7,000 %, fällig 01/10/2039				2.333	0,05
700 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/11/2041				671	0,02
500 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/08/2049				504	0,01
				3.508	0,08
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.891.344 USD)</b>					
				1.476.587	35,29
<b>Darlehensanleihen – 1,85 % (28. Februar 2021: 1,47 %)</b>					
5.429 1011778 BC ULC, 1,959 %, fällig 14/11/2026 *				5.336	0,13
1.443 Alterra Mountain Co, 4,000 %, fällig 30/07/2028 *				1.432	0,03
234 Aramark Services Inc, 1,959 %, fällig 11/03/2025 *				230	–
2.781 Asurion LLC, 3,209 %, fällig 03/11/2024 *				2.748	0,06
1.388 Berry Global Inc, 1,876 %, fällig 01/07/2026 *				1.366	0,03
6.264 Caesars Resort Collection LLC, 2,959 %, fällig 22/12/2024 *				6.209	0,15
4.585 Change Healthcare Holdings LLC, 3,500 %, fällig 01/03/2024 *				4.567	0,11
6.129 Charter Communications Operating LLC, 1,960 %, fällig 30/04/2025 *				6.113	0,15
1.440 Edelman Financial Center LLC/The, 4,250 %, fällig 05/04/2028 *				1.431	0,03
2.084 Entercom Media Corp, 2,609 %, fällig 17/11/2024 *				2.056	0,05
2.163 Hilton Worldwide Finance LLC, 1,937 %, fällig 21/06/2026 *				2.134	0,05
5.650 Hunter Douglas Inc, 0,000 %, fällig 09/02/2029 *				5.576	0,13
1.624 Jane Street Group, LLC, 2,959 %, fällig 21/01/2027 *				1.607	0,04
4.206 Level 3 Parent LLC, 1,959 %, fällig 01/03/2027 *				4.113	0,10
1.336 Phoenix Guarantor Inc, 3,459 %, fällig 05/03/2026 *				1.320	0,03

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Loan Notes – (Fortsetzung)</b>					
5.772 Prime Security Installations Ltd, 3,500 %, fällig 23/09/2026 *	5.718	0,14			
3.244 RegionalCare Hospital Partners Holding, 3,959 %, fällig 16/11/2025 *	3.214	0,08			
1.626 Reynolds Consumer Products LLC, 1,959 %, fällig 04/02/2027 *	1.605	0,04	EUR		
6.681 Scientific Games International Inc, 2,959 %, fällig 14/08/2024 *	6.645	0,16	EUR		
4.309 SFR Group SA, 3,927 %, fällig 06/01/2026 *	4.253	0,10	EUR		
7.829 Univision Communications Inc, 4,000 %, fällig 24/03/2026 *	7.784	0,19	EUR		
549 Valeant Pharmaceuticals International, 3,209 %, fällig 28/05/2025 *	545	0,01	EUR		
1.550 Virgin Media Bristol LLC, 2,691 %, fällig 04/01/2028 *	1.527	0,04	EUR		
<b>Gesamtdarlehensanleihen (Anschaffungskosten 78.433 USD)</b>	<b>77.529</b>	<b>1,85</b>			
<b>Kommunalanleihen — 0,55 % (28. Februar 2021: 0,35 %)</b>					
4.240 City of Detroit MI, 4,000 %, fällig 01/04/2044	3.874	0,09			
950 Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 3,706 %, fällig 15/05/2120	955	0,02			
16.530 State of Illinois, 5,100 %, fällig 01/06/2033	18.248	0,44			
<b>Summe Kommunalanleihen (Anschaffungskosten 20.705 USD)</b>	<b>23.077</b>	<b>0,55</b>			
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,96 % (28. Februar 2021: 2,38 %)</b>					
9.927 Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	150.896	3,61			
EUR 122 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	14.535	0,35			
<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 150.793 USD)</b>	<b>165.431</b>	<b>3,96</b>			
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 4.199.295 USD)</b>					
	<b>3.826.412</b>	<b>91,46</b>			
<b>Verträge</b>					
(in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts			
<b>Gekaufte Optionen – 0,67 % (28. Februar 2021: 0,48 %)</b>					
– Australian Dollar Currency Future March 2022 Call 70,00, fällig 04/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	646	0,02			
– Australian Dollar Currency Future March 2022 Call 72,00, fällig 04/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	281	0,01			
– Japanese Yen Currency Future March 2022 Call 87,00, fällig 04/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	88	–			
2 U.S. 5 Year April 2022 Call 117,50, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	2.026	0,05			
50.790 USD Call/CNH Put 6,4620, fällig 29/03/2022 – Morgan Stanley	12	–			
52.650 USD Call/RUB Put 78,60, fällig 30/04/2022 – Citi	17.729	0,42			
209.730 USD Put/AUD Put 0,74, fällig 29/04/2022 – Goldman Sachs	1.802	0,04			
48.550 USD Put/BRL Call 5,50, fällig 26/04/2022 – Morgan Stanley	2.995	0,07			
53.190 USD Put/EUR Call 1,1310, fällig 28/04/2022 – Goldman Sachs	535	0,01			
50.740 USD Put/INR Call 75,9856, fällig 20/06/2022 – Morgan Stanley	524	0,01			
54.760 USD Put/MXN Call 20,40, fällig 12/04/2022 – Goldman Sachs	483	0,01			
49.040 USD Put/MXN Call 20,6810, fällig 28/04/2022 – Morgan Stanley	808	0,02			
55.910 USD Put/RUB Call 74,00, fällig 11/03/2022 – Goldman Sachs	31	–			
27.360 USD Put/RUB Call 78,00, fällig 23/04/2022 – Goldman Sachs	213	0,01			
<b>Gekaufte Optionen gesamt (Anschaffungskosten 8.925 USD)</b>	<b>28.173</b>	<b>0,67</b>			
<b>Credit Default Swaps — 0,27 % (28. Februar 2021: 0,30 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	11.462	0,27			
<b>Inflation Swaps — 0,12 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	4.912	0,12			
<b>Zinsswaps – 3,64 % (28. Februar 2021: 9,24 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	152.352	3,64			
<b>Index-Swaps — 1,41 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	58.980	1,41			
<b>Swaptions – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	7	–			
<b>Devisenterminkontrakte – 2,68 % (28. Februar 2021: 1,37 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	112.006	2,68			
<b>Futures — 5,11 % (28. Februar 2021: 1,77 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	213.705	5,11			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					
	<b>4.408.009</b>	<b>105,36</b>			
<b>Schriftliche Optionen — (3,05 %) (28. Februar 2021: (0,51 %))</b>					
– Australian Dollar Currency Future April 2022 Put 71,50, fällig 08/04/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(106)	–			
– Australian Dollar Currency Future March 2022 Put 70,50, fällig 04/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	–	–			
(1) Euro-Bund April 2022 Call 163,50, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(2.619)	(0,06)			
– Euro-Bund April 2022 Call 164,50, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(263)	(0,01)			
(1) Euro-Bund April 2022 Call 166,00, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(736)	(0,02)			
– Euro-Bund April 2022 Call 167,50, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(78)	–			
– Euro-Bund April 2022 Call 168,00, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(63)	–			
– Euro-Bund April 2022 Put 163,50, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(485)	(0,01)			
(2) IMM Euro\$ De-cember 2022 Call 98,50, fällig 19/12/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(1.499)	(0,04)			
(1) IMM Euro\$ De-cember 2022 Call 99,00, fällig 19/12/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(255)	(0,01)			
– U.S. 10 Year April 2022 Call 126,50, fällig 25/03/2022– Bank of America Merrill Lynch	(418)	(0,01)			
(1) U.S. 10 Year April 2022 Call 126,75, fällig 25/03/2022– Bank of America Merrill Lynch	(1.806)	(0,04)			
(3) U.S. 10 Year April 2022 Call 127,00, fällig 25/03/2022– Bank of America Merrill Lynch	(4.002)	(0,10)			
(3) U.S. 10 Year April 2022 Call 127,50, fällig 25/03/2022– Bank of America Merrill Lynch	(2.910)	(0,07)			
(5) U.S. 10 Year April 2022 Call 128,00, fällig 25/03/2022– Bank of America Merrill Lynch	(3.582)	(0,09)			
(3) U.S. 10 Year April 2022 Call 128,50, fällig 25/03/2022– Bank of America Merrill Lynch	(1.678)	(0,04)			
(4) U.S. 10 Year April 2022 Call 129,00, fällig 25/03/2022– Bank of America Merrill Lynch	(1.359)	(0,03)			
(2) U.S. 10 Year April 2022 Call 129,50, fällig 25/03/2022– Bank of America Merrill Lynch	(598)	(0,01)			
(8) U.S. 10 Year April 2022 Call 130,00, fällig 25/03/2022– Bank of America Merrill Lynch	(1.694)	(0,04)			
(1) U.S. 10 Year April 2022 Call 130,50, fällig 25/03/2022– Bank of America Merrill Lynch	(91)	–			
– U.S. 10 Year April 2022 Put 126,00, fällig 25/03/2022– Bank of America Merrill Lynch	(155)	–			
– U.S. 10 Year April 2022 Put 126,50, fällig 25/03/2022– Bank of America Merrill Lynch	(223)	–			
– U.S. 10 Year April 2022 Put 127,50, fällig 25/03/2022– Bank of America Merrill Lynch	(412)	(0,01)			
(4) U.S. 10 Year June 2022 Call 127,00, fällig 20/05/2022– Bank of America Merrill Lynch	(6.612)	(0,16)			
(4) U.S. 10 Year June 2022 Call 130,00, fällig 20/05/2022– Bank of America Merrill Lynch	(2.231)	(0,05)			
(1) U.S. 10 Year May 2022 Call 127,00, fällig 22/04/2022– Bank of America Merrill Lynch	(1.114)	(0,03)			
– U.S. 10 Year May 2022 Put 126,50, fällig 22/04/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(234)	(0,01)			
(4) U.S. 5 Year April 2022 Call 117,75, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(3.269)	(0,08)			
(6) U.S. 5 Year April 2022 Call 118,00, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(4.270)	(0,10)			
(4) U.S. 5 Year April 2022 Call 118,25, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(2.421)	(0,06)			
(2) U.S. 5 Year April 2022 Call 118,50, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(1.117)	(0,03)			
(9) U.S. 5 Year April 2022 Call 118,75, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(3.429)	(0,08)			
(1) U.S. 5 Year April 2022 Call 119,00, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(400)	(0,01)			
(1) U.S. 5 Year April 2022 Call 119,50, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(207)	–			
(1) U.S. 5 Year April 2022 Put 116,75, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(84)	–			
– U.S. 5 Year April 2022 Put 117,00, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(60)	–			
(2) U.S. 5 Year April 2022 Put 117,25, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(395)	(0,01)			
(1) U.S. 5 Year April 2022 Put 117,50, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(263)	(0,01)			
(1) U.S. 5 Year April 2022 Put 118,00, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(437)	(0,01)			
(1) U.S. Bond April 2022 Call 154,00, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(4.546)	(0,11)			
(1) U.S. Bond April 2022 Call 155,00, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(2.130)	(0,05)			
– U.S. Bond April 2022 Call 156,00, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(584)	(0,01)			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Schriftliche Optionen – (Fortsetzung)</b>		
(2) U.S. Bond April 2022 Call 157,00, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(3.898)	(0,09)
(1) U.S. Bond April 2022 Call 158,00, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(1.932)	(0,05)
– U.S. Bond April 2022 Call 159,00, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(532)	(0,01)
– U.S. Bond April 2022 Call 160,00, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(162)	–
– U.S. Bond April 2022 Put 153,00, fällig 25/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(246)	(0,01)
(39.316) USD Call/RUB Put 79,75, fällig 30/04/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(12.895)	(0,31)
(105.300) USD Call/RUB Put 84,00, fällig 30/04/2022 – Citi	(31.239)	(0,75)
(27.360) USD Call/RUB Put 86,50, fällig 23/04/2022 – Goldman Sachs	(7.361)	(0,18)
(52.230) USD Put/BRL Call 5,05, fällig 17/05/2022 – JP Morgan	(677)	(0,02)
(97.100) USD Put/BRL Call 5,3250, fällig 26/04/2022 – Morgan Stanley	(3.607)	(0,09)
(50.790) USD Put/BRL Call 5,5839, fällig 29/03/2022 – Morgan Stanley	(3.930)	(0,09)
(109.520) USD Put/MXN Call 20,00, fällig 12/04/2022 – Goldman Sachs	(337)	(0,01)
(48.190) USD Put/MXN Call 20,20, fällig 17/05/2022 – Morgan Stanley	(366)	(0,01)
(50.137) USD Put/MXN Call 20,4371, fällig 30/04/2022 – Morgan Stanley	(534)	(0,01)
(50.790) USD Put/MXN Call 20,5080, fällig 29/03/2022 – Morgan Stanley	(501)	(0,01)
(111.820) USD Put/RUB Call 72,00, fällig 11/03/2022 – Goldman Sachs	(40)	–
(50.790) USD Put/RUB Call 73,2171, fällig 29/03/2022 – Morgan Stanley	(162)	–
(50.650) USD Put/RUB Call 77,00, fällig 24/05/2022 – Citi	(446)	(0,01)
<b>Geschriebene Optionen insgesamt (Anschaffungskosten (57.906 USD))</b>	<b>(127.700)</b>	<b>(3,05)</b>
<b>Credit Default Swaps – (0,40 %) (28. Februar 2021: (0,13 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(16.749)	(0,40)
<b>Inflationsswaps – (0,40 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(16.551)	(0,40)
<b>Zinsswaps – (4,88 %) (28. Februar 2021: (0,33 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(204.363)	(4,88)
<b>Index-Swaps – (0,04 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.721)	(0,04)
<b>Swaptions – (0,01 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(528)	(0,01)
<b>Devisenterminkontrakte – (2,35 %) (28. Februar 2021: (0,60 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(98.156)	(2,35)
<b>Futures – (5,69 %) (28. Februar 2021: (2,93 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(237.864)	(5,69)
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(703.632)</b>	<b>(16,82)</b>
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>3.704.377</b>	<b>88,54</b>
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>	<b>479.457</b>	<b>11,46</b>
<b>Gesamtnettvermögen</b>	<b>\$4.183.834</b>	<b>100,00</b>

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

144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 563.997.000 USD oder 13,49 % des Nettovermögens.

\* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.

† Illiquide.

∞ Die Sicherheit wird nach Treu und Glauben vom Bewertungsausschuss oder nach dessen Ermessen zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

γ Wertpapiere, die nach Jahresende aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen nicht mehr ertragswirksam sind.

**ABKÜRZUNGEN:**

Unbefristet – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.

REMIC – Anlageschutz für Immobilienhypotheken.

AUD – Australischer Dollar

BRL – Brasilianischer Real

CNY – Chinesischer Renminbi

EGP – Ägyptisches Pfund

EUR – Euro

GBP – Britische Pfund

IDR – Indonesische Rupiah

INR – Indische Rupie

MXN – Mexikanischer Peso

RUB – Russischer Rubel

	% des Gesamt- vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	67,60
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	1,46
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,12
Finanzderivate	10,97
Sonstige Vermögenswerte	16,85
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Zeitplan für Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 % – Kauf	20/12/2026	279.962	\$ (15.576)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20/12/2026	781.484	11.462
Bank of America Merrill Lynch	Teva Pharmaceutical Industries Ltd, 1,000 % – Verkauf	20/06/2026	12.479	(1.173)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 19.851 USD)				\$ 11.462
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (9.000) USD)				(16.749)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 10.851 USD)				\$ (5.287)

### Zeitplan der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (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	\$ (1.159)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 9,433 %	02/01/2024	1.788.948	(10.184)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,207 %	03/01/2024	1.569.360	(19.698)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,820 %	04/06/2024	1.153.974	(14.731)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 1,410 %	01/03/2025	3.835.937	(23.284)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 1,515 %	21/06/2025	1.284.450	(5.972)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,450 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15/05/2027	404.294	28.005

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Zinsswaps – (Fortsetzung)

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,250 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15/02/2028	155.552	5.391
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,350 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15/02/2028	341.330	9.894
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,689 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	24/06/2030	315.326	29.942
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,680 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	08/07/2030	678.310	65.206
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,200 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	07/10/2050	23.117	4.148
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,000 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	03/06/2051	5.929	(8)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,050 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	07/06/2051	17.796	(228)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,671 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	09/07/2051	132.484	9.766
Goldman Sachs	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,400 %	02/01/2024	1.139.622	(13.484)
Goldman Sachs	Pay Floating RUB 3M MosPrime Reuters, Receive Fixed 7,555 %	21/09/2026	10.800.005	(27.119)
Goldman Sachs	Pay Floating RUB 3M MosPrime NFEA, Receive Fixed 7,750 %	08/10/2026	1.994.618	(4.798)
Goldman Sachs	Pay Floating RUB 3M MosPrime Reuters, Receive Fixed 7,850 %	08/10/2026	1.994.618	(4.751)
Goldman Sachs	Pay Floating RUB 3M MosPrime Reuters, Receive Fixed 7,020 %	02/03/2031	2.905.700	(9.930)
Goldman Sachs	Pay Floating RUB 3M MosPrime Reuters, Receive Fixed 7,805 %	08/10/2031	2.962.577	(9.185)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 6,520 %	02/01/2024	955.170	(13.235)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 6,917 %	02/01/2024	763.700	(9.172)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,280 %	03/01/2024	516.537	(5.602)
JP Morgan	Pay Floating RUB 3M MosPrime Reuters, Receive Fixed 8,985 %	27/10/2024	6.074.106	(11.484)
JP Morgan	Pay Floating RUB 3M MosPrime Reuters, Receive Fixed 8,882 %	28/10/2024	9.403.617	(17.883)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating EUR 6M Euribor Reuters, Receive Fixed -0,150 %	15/08/2026	3.840	\$ (110)
Morgan Stanley	Pay Floating RUB 3M MosPrime Reuters, Receive Fixed 7,880 %	08/10/2031	800.000	(2.456)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 614.088 USD)				\$ 152.352
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (21.745) USD)				(204.363)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 592.343 USD)				\$ (52.011)

## Zeitplan für Index-Swaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,560 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20/07/2045	21.760	\$ 5.031
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,710 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/05/2027	490.643	21.219
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,130 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/08/2028	363.289	10.528
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,200 %, Receive Floating USD SOFR Compound	01/11/2028	68.314	1.760
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,220 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/08/2028	213.642	5.001
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20/11/2026	142.530	838
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/02/2047	153.696	7.089
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,630 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/05/2047	295.510	6.766
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,729 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/02/2047	144.501	521
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,733 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20/10/2031	93.640	227
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 1,396 %	13/10/2025	582.851	(1.721)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Index Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 58.980
Nicht realisierte Wertminderung von Index-Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(1.721)
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 57.259

## Zeitplan für Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	USD – CPI Urban Consumers	18/11/2023	125.420	\$ 1.960
Bank of America Merrill Lynch	USD – CPI Urban Consumers	12/05/2026	109.870	(7.216)
Bank of America Merrill Lynch	GBP – RPI All Items NSA	15/10/2026	73.040	(5.499)
Bank of America Merrill Lynch	USD – CPI Urban Consumers	20/10/2026	93.190	2.952
Bank of America Merrill Lynch	USD – CPI Urban Consumers	18/11/2026	125.420	(1.110)
Bank of America Merrill Lynch	USD – CPI Urban Consumers	20/10/2031	93.190	(2.514)
Bank of America Merrill Lynch	USD – CPI Urban Consumers	07/10/2051	17.250	(212)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 4.912
Nicht realisierte Wertminderung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(16.551)
Nettowertminderung von Inflationsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ (11.639)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan der Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Datum des Inkrafttretens	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Swaption Payer Strike 1,07 %	21/04/2022	22.007	(528)
BNP Paribas	Swaption Receiver Strike 1,09 %	17/03/2022	59.200	\$ 7
Nicht realisierte Wertsteigerung von Swaptions (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 7
Nicht realisierte Wertminderung von Swaptions (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(528)
Nettowertminderung von Swaptions (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ (521)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)	
01/03/2022	BNY Mellon	Kaufen	USD	1.758	Verkauf	EUR	1.570 (2)
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	66	Verkauf	GBP	49 –
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	13	Verkauf	NOK	120 –
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	132	Verkauf	USD	94 1
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	641	Verkauf	USD	67 –
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	107	Verkauf	USD	79 –
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NOK	213	Verkauf	USD	24 –
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	882	Verkauf	USD	1.180 2
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	11.512	Verkauf	USD	12.893 13
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	13.326	Verkauf	BRL	70.671 (380)
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	145.384	Verkauf	BRL	743.944 1.101
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	806.509	Verkauf	USD	147.498 8.920
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	8.106	Verkauf	USD	1.576 (4)
04/03/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	12.000	Verkauf	USD	2.354 (27)
08/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	MYR	69.376	Verkauf	USD	16.588 (61)
09/03/2022	Goldman Sachs	Kauf	MYR	8.750	Verkauf	USD	2.091 (7)
09/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	MYR	80.000	Verkauf	USD	19.116 (57)
10/03/2022	Goldman Sachs	Kauf	MYR	39.280	Verkauf	USD	9.381 (23)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	16.111	Verkauf	AUD	22.470 (216)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	13.381	Verkauf	CHF	12.364 (111)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	92	Verkauf	CNH	579 –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	504	Verkauf	CNH	3.197 (2)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	73.419	Verkauf	EUR	65.475 (44)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	124.650	Verkauf	EUR	109.872 1.378
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	15.357	Verkauf	GBP	11.462 (21)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	27.669	Verkauf	GBP	20.428 261
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	7.961	Verkauf	JPY	918.613 (33)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	960	Verkauf	NOK	8.541 (8)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	306	Verkauf	PLN	1.234 14
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.759	Verkauf	SEK	16.400 24
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	215	Verkauf	SEK	2.049 –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	8.489	Verkauf	SGD	11.457 44
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	2.157	Verkauf	USD	1.586 3
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	153	Verkauf	USD	36 –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	7.826	Verkauf	USD	1.973 (111)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	11.047.871	Verkauf	USD	95.801 334
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	227.041	Verkauf	USD	162.518 2.422
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	300.044	Verkauf	USD	406.765 (4.190)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	50.502	Verkauf	USD	5.528 (194)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	735	Verkauf	USD	77 1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	104.765	Verkauf	USD	77.945 (675)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.430.432	Verkauf	USD	1.635.901 (30.936)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	947	Verkauf	USD	150 –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	6.291	Verkauf	USD	8.406 34
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	43.269	Verkauf	USD	6.785 56
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	30.318	Verkauf	USD	33.858 160
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NOK	76.504	Verkauf	USD	8.661 16
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CHF	74.496	Verkauf	USD	80.659 633
15/03/2022	Citi	Kauf	RUB	932.500	Verkauf	USD	11.855 (3.249)
15/03/2022	Goldman Sachs	Kauf	RUB	932.500	Verkauf	USD	11.516 (2.911)
15/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	33.655	Verkauf	RUB	2.566.693 9.968
16/03/2022	BNP Paribas	Kauf	USD	16.789	Verkauf	RUB	1.336.798 4.455
24/03/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	51.208	Verkauf	BRL	260.442 999
29/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	RUB	1.556.911	Verkauf	USD	20.707 (6.383)
30/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	MXN	417.359	Verkauf	USD	19.925 340
30/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	BRL	107.587	Verkauf	USD	18.675 2.030
04/04/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	7.201	Verkauf	BRL	37.261 40
04/04/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	729.594	Verkauf	USD	141.380 (1.150)
13/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	MXN	78.589	Verkauf	USD	3.791 16
19/04/2022	BNP Paribas	Kauf	USD	18.315	Verkauf	EUR	16.022 \$ 315
19/04/2022	BNP Paribas	Kauf	USD	35.577	Verkauf	EUR	31.753 (98)
19/04/2022	BNP Paribas	Kauf	NOK	46.992	Verkauf	USD	5.333 (5)
19/04/2022	BNP Paribas	Kauf	EUR	47.500	Verkauf	USD	54.437 (1.071)
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	25.203	Verkauf	BRL	127.780 738

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Zinsswaps – (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	186.260	Verkauf	CNH	1.195.364	(2.269)
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	70.098	Verkauf	EUR	61.410	1.103
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	3.310	Verkauf	EUR	2.961	(16)
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	269.778	Verkauf	IDR	3.913.642.193	(1.543)
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	167.678	Verkauf	INR	12.639.058	1.262
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	366.182	Verkauf	MXN	7.651.062	(4.023)
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	21.889	Verkauf	RUB	1.817.341	5.845
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	84.138	Verkauf	TWD	2.307.491	1.810
19/04/2022	Citi	Kauf	CAD	1.000	Verkauf	USD	785	4
19/04/2022	Citi	Kauf	AUD	3.000	Verkauf	USD	2.116	64
19/04/2022	Citi	Kauf	GBP	12.300	Verkauf	USD	16.712	(208)
19/04/2022	Citi	Kauf	JPY	50.000	Verkauf	USD	433	2
19/04/2022	Citi	Kauf	EUR	59.895	Verkauf	USD	67.946	(654)
19/04/2022	Citi	Kauf	TWD	210.632	Verkauf	USD	7.605	(90)
19/04/2022	Citi	Kauf	KRW	96.514.864	Verkauf	USD	80.436	(222)
19/04/2022	Citi	Kauf	EUR	1.000	Verkauf	USD	1.118	5
19/04/2022	Citi	Kauf	IDR	1.048.431.372	Verkauf	USD	72.292	393
19/04/2022	Citi	Kauf	BRL	864.280	Verkauf	USD	147.942	17.535
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	26.712	Verkauf	EUR	23.452	365
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	27.481	Verkauf	GBP	20.269	284
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	56.515	Verkauf	HUF	17.775.890	3.202
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	21.268	Verkauf	MXN	444.880	(258)
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	68.484	Verkauf	RUB	5.230.410	22.310
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	HUF	17.775.894	Verkauf	USD	55.523	(2.211)
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	RUB	1.458.390	Verkauf	USD	18.699	(5.824)
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	MXN	721.311	Verkauf	USD	34.840	62
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	GBP	376	Verkauf	USD	510	(5)
19/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD	39.074	Verkauf	AUD	54.914	(841)
19/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD	231.440	Verkauf	CNH	1.484.928	(2.757)
19/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD	2.350	Verkauf	EUR	2.054	43
19/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD	57.945	Verkauf	MXN	1.202.528	(241)
19/04/2022	JP Morgan	Kauf	AUD	65.574	Verkauf	USD	47.125	538
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	28.396	Verkauf	AUD	40.160	(795)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	49.666	Verkauf	CAD	62.994	(40)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	2.567	Verkauf	CNH	16.447	(27)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.659	Verkauf	COP	6.602.894	(8)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	20.436	Verkauf	EUR	18.212	(25)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	2.688	Verkauf	INR	201.144	40
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	38.595	Verkauf	JPY	4.393.188	338
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	325.313	Verkauf	JPY	37.631.255	(2.387)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	2.798	Verkauf	KRW	3.382.443	(13)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.882	Verkauf	KRW	2.251.449	11
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	26.999	Verkauf	MXN	556.555	70
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	INR	101.116	Verkauf	USD	1.341	(9)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	COP	194.603.482	Verkauf	USD	47.181	1.967
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	NZD	2.144	Verkauf	USD	1.461	(11)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	CAD	135.119	Verkauf	USD	106.171	448
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	ZAR	105.867	Verkauf	USD	6.651	189
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	BRL	536.565	Verkauf	USD	92.403	10.330
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	RUB	2.382.183	Verkauf	USD	31.215	(10.185)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	MXN	2.664.466	Verkauf	USD	128.246	678
25/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	15.574	Verkauf	RUB	1.265.711	4.541
25/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	RUB	1.265.711	Verkauf	USD	15.631	(4.598)
27/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	BRL	19.462	Verkauf	USD	3.457	262
29/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	18.785	Verkauf	EUR	16.810	(107)
29/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	19.625	Verkauf	MXN	413.990	(371)
03/05/2022	BNP Paribas	Kauf	USD	19.892	Verkauf	MXN	414.629	(119)
03/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	MXN	414.629	Verkauf	USD	19.901	111
04/05/2022	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	11.576	Verkauf	RUB	907.568	3.757
04/05/2022	Citi	Kauf	RUB	99.430	Verkauf	USD	1.264	(407)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	18.384	Verkauf	MXN	379.563	119
18/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	MXN	379.563	Verkauf	USD	18.390	(125)
24/05/2022	Citi	Kauf	RUB	1.551.740	Verkauf	USD	18.993	(5.798)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 90.962 USD)								\$ 112.006
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (39.458) USD)								(98.156)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 51.504 USD)								\$ 13.850

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
90 Day Euro\$ December 2022	Bank of America Merrill Lynch	33.109	\$8.134.467	\$ (25.190)
90 Day Euro\$ December 2023	Bank of America Merrill Lynch	50.553	12.367.160	(118.005)
90 Day Euro\$ June 2023	Bank of America Merrill Lynch	2.061	504.481	(6.879)
90 Day Euro\$ September 2023	Bank of America Merrill Lynch	5.244	1.283.010	(15.612)
Australia 10 Year Bond March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(932)	(91.065)	3.205
Australian Dollar Currency March 2022	Bank of America Merrill Lynch	2.878	209.044	2.846
British Pound Currency March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(72)	(6.037)	(97)
Canadian Dollar Currency March 2022	Bank of America Merrill Lynch	785	61.878	10
Euribor 3 Month June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(4.229)	(1.190.776)	461
Euribor 3 Month March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(5.905)	(1.663.688)	312
Euro FX Currency March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(1.011)	(141.875)	1.854
Euro-Bobl March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(1.489)	(220.146)	1.622
Euro-BTP March 2022	Bank of America Merrill Lynch	288	45.580	296
Euro-Bund March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(8.138)	(1.524.196)	51.449
Euro-Buxl 30 Year Bond March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(370)	(82.051)	6.500
Japanese Yen Currency March 2022	Bank of America Merrill Lynch	4.403	479.211	(5.040)
Long Gilt June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(862)	(142.326)	(935)
Mexican Peso Currency March 2022	Bank of America Merrill Lynch	8.197	199.310	6.929
RUB/USD March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(1.352)	(29.744)	13.770
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(79.927)	(10.185.697)	(61.844)
U.S. 10 Year Ultra Note June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(7.492)	(1.058.830)	(4.262)
U.S. 2 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	2.729	587.353	828
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	77.359	9.150.119	58.435
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	28.051	4.395.241	53.521
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	4.150	771.641	11.667
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 117.968 USD)				\$ 213.705
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (194.870) USD)				(237.864)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (76.902) USD)				\$ (24.159)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts		
<b>Asset-Backed Securities – 9,77 % (28. Februar 2021: 8,70 %)</b>							
73	ABFC 2003-OPT1 Trust, Series 2003 OPT1, Class A3, 0,867 %, fällig 25/04/2033 *	71	0,02	2.349	National Collegiate VI 2007-4 Class A-3L Commutation Trust, Series 2007 4VI, Class O, 144A, 0,958 %, fällig 29/03/2038 *†	561	0,15
1.274	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 2005-HE3, Series 2005 HE3, Class M4, 1,132 %, fällig 25/05/2035 *	1.262	0,34	250	Oaktree CLO 2015-1 Ltd, Series 2015 1A, Class DR, 144A, 5,454 %, fällig 20/10/2027 *	250	0,07
700	Aegis Asset Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Cfs Ser 2005-4, Series 2005 4, Class M2, 0,892 %, fällig 25/10/2035 *	687	0,18	1.000	Ocean Trails CLO V, Series 2014 5A, Class DRR, 144A, 3,694 %, fällig 13/10/2031 *	947	0,25
1.200	AGL CLO 12 Ltd, Series 2021 12A, Class D, 144A, 3,104 %, fällig 20/07/2034 *	1.175	0,32	650	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, Series 2018 1A, Class C, 144A, 2,854 %, fällig 20/01/2031 *	627	0,17
1.000	Allegro CLO XIII Ltd, Series 2021 1A, Class E, 144A, 6,864 %, fällig 20/07/2034 *	973	0,26	940	Option One Mortgage Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class M4, 1,117 %, fällig 25/08/2035 *	905	0,24
400	Ammc Clo 20 Ltd, Series 2017 20A, Class E, 144A, 6,051 %, fällig 17/04/2029 *	392	0,11	304	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Series 2007 FXD1, Class 1A1, 5,866 %, fällig 25/01/2037	295	0,08
450	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd, Series 2014 3RA, Class E, 144A, 5,778 %, fällig 28/01/2031 *	440	0,12	605	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Series 2007 FXD1, Class 2A1, 5,866 %, fällig 25/01/2037	585	0,16
700	Apex Credit CLO 2019-II Ltd, Series 2019 2A, Class D, 144A, 4,308 %, fällig 25/10/2032 *	682	0,18	820	RAMP Series 2006-NC3 Trust, Series 2006 NC3, Class M1, 0,697 %, fällig 25/03/2036 *	809	0,22
750	Apidos CLO XII, Series 2013 12A, Class ER, 144A, 5,641 %, fällig 15/04/2031 *	678	0,18	120	RBS SP Resecuritization Trust 2010-4, Series 2010 4, Class 6A2, 144A, 5,825 %, fällig 26/02/2036	120	0,03
300	Ballyrock CLO 16 Ltd, Series 2021 16A, Class D, 144A, 6,504 %, fällig 20/07/2034 *	287	0,08	1.320	Saranac CLO III Ltd, Series 2014 3A, Class DR, 144A, 3,464 %, fällig 22/06/2030 *	1.271	0,34
1.225	Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Class C, 144A, 3,404 %, fällig 20/04/2031 *	1.219	0,33	320	SMB Private Education Loan Trust 2015-C, Series 2015 C, Class C, 144A, 4,500 %, fällig 17/09/2046	329	0,09
720	Barings CLO Ltd 2016-II, Series 2016 2A, Class ER2, 144A, 6,754 %, fällig 20/01/2032 *	702	0,19	500	Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Class ERR, 144A, 5,981 %, fällig 15/04/2027 *	459	0,12
729	Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Series 2016 1A, Class AA, 144A, 2,487 %, fällig 16/12/2041	716	0,19	750	Voya CLO 2016-3 Ltd, Series 2016 3A, Class A1R, 144A, 1,431 %, fällig 18/10/2031 *	750	0,20
1.000	BlueMountain CLO XXII Ltd, Series 2018 22A, Class A1, 144A, 1,319 %, fällig 15/07/2031 *	997	0,27	1.000	Voya CLO 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Class C, 144A, 3,571 %, fällig 17/04/2030 *	988	0,27
313	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-B, Series 2004 B, Class 2A, 0,411 %, fällig 15/02/2029 *	299	0,08	200	VOYA CLO 2017-2, Series 2017 2A, Class D, 144A, 6,261 %, fällig 07/06/2030 *	194	0,05
29	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-D, Series 2005 D, Class 2A, 0,381 %, fällig 15/11/2035 *	28	0,01	706	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE4 Trust, Series 2007 HE4, Class 1A, 0,357 %, fällig 25/07/2047 *	580	0,15
744	Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Series 2018 2, Class B, 144A, 4,250 %, fällig 20/12/2038	779	0,21	600	Wellfleet CLO 2017-3 Ltd, Series 2017 3A, Class C, 144A, 2,991 %, fällig 17/01/2031 *	586	0,16
624	Educational Funding Co LLC/The, Series 2006 1A, Class A3, 144A, 0,608 %, fällig 25/04/2033 *	496	0,13	<b>Summe der vermögensbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 36,373 USD)</b>		36.339	9,77
660	Encore Credit Receivables Trust 2005-2, Series 2005 2, Class M4, 1,117 %, fällig 25/11/2035 *	655	0,18	<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 10,09 % (28. Februar 2021: 11,67 %)</b>			
97	First Franklin Mortgage Loan Trust 2003-FF4, Series 2003 FF4, Class M1, 1,906 %, fällig 25/10/2033 *	98	0,03	323	Alternative Loan Trust 2007-4CB, Series 2007 4CB, Class 1A5, 5,750 %, fällig 25/04/2037	318	0,09
1.000	Golub Capital Partners CLO 21M Ltd, Series 2014 21A, Class CR, 144A, 2,708 %, fällig 25/01/2031 *	991	0,27	377	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Series 2016 GG10, Class AJA, 144A, 5,831 %, fällig 10/08/2045 *	154	0,04
1.000	Golub Capital Partners CLO 53B Ltd, Series 2021 53A, Class E, 144A, 6,954 %, fällig 20/07/2034 *	981	0,26	602	Banc of America Funding Corp, Series 2015 R3, Class 1A2, 144A, 0,505 %, fällig 27/03/2036 *	554	0,15
157	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Series 2021 4GS, Class A, 144A, 1,930 %, fällig 20/07/2048	150	0,04	140	BCCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Class D, 144A, 4,563 %, fällig 10/08/2033 *	137	0,04
250	Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Class E, 144A, 5,191 %, fällig 15/04/2031 *	238	0,06	840	BBSG 2016-MRP Mortgage Trust, Series 2016 MRP, Class A, 144A, 3,275 %, fällig 05/06/2036	823	0,22
1.000	Grippen Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Class D, 144A, 3,554 %, fällig 20/01/2030 *	1.003	0,27	510	BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Class C, 144A, 2,091 %, fällig 15/07/2035 *	502	0,14
1.400	Harriman Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class ER, 144A, 6,654 %, fällig 20/04/2034 *	1.374	0,37	154	BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA, Series 2018 BIOA, Class A, 144A, 0,862 %, fällig 15/03/2037 *	153	0,04
145	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1, Class C, 144A, 1,826 %, fällig 16/06/2036 *	144	0,04	619	BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA, Series 2018 BIOA, Class E, 144A, 2,142 %, fällig 15/03/2037 *	611	0,16
170	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1, Class D, 144A, 2,476 %, fällig 16/06/2036 *	169	0,05	520	BX Trust 2021-VIEW, Series 2021 VIEW, Class C, 144A, 2,541 %, fällig 15/06/2023 *	511	0,14
1.050	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS2005-C, Series 2005 C, Class M2, 0,937 %, fällig 25/10/2035 *	1.046	0,28	1.020	BXMT 2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2, Class A, 144A, 1,063 %, fällig 15/02/2038 *	1.015	0,28
1.300	LCM XXII Ltd 22A, Class DR, 144A, 5,754 %, fällig 20/10/2028 *	1.243	0,33	680	CHT 2017-COSMO Mortgage Trust, Series 2017 CSMO, Class E, 144A, 3,191 %, fällig 15/11/2036 *	678	0,18
300	Long Beach Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class M4, 1,462 %, fällig 25/02/2035 *	299	0,08	11.325	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Series 2017 P8, Class XA, 0,887 %, fällig 15/09/2050 *	462	0,12
1.000	Magnetite XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144A, 5,921 %, fällig 15/10/2031 *	975	0,26	710	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1, Class C, 4,306 %, fällig 10/02/2048 *	695	0,19
1.270	Marble Point CLO XIV Ltd, Series 2018 2A, Class D, 144A, 3,784 %, fällig 20/01/2032 *	1.232	0,33	730	Connecticut Avenue Securities Trust 2018-R07, Series 2018 R07, Class 1B1, 144A, 4,537 %, fällig 25/04/2031 *	746	0,20
604	Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE2, Series 2007 HE2, Class A1, 1,337 %, fällig 25/08/2037 *	587	0,16	360	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 3,587 %, fällig 25/10/2039 *	351	0,10
354	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, Series 2018 1A, Class CERT, 144A, 0,000 %, fällig 22/06/2043	202	0,05	190	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Series 2021 R03, Class 1B1, 144A, 2,799 %, fällig 25/12/2041 *	177	0,05
710	National Collegiate II Commutation Trust, Series 2005 AR15, Class AR15, 0,000 %, fällig 01/06/2045	127	0,03	330	CSAIL 2017-C8 Commercial Mortgage Trust, Series 2017 C8, Class C, 4,325 %, fällig 15/06/2050 *	318	0,09
630	National Collegiate Student Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class B, 0,567 %, fällig 26/03/2035 *	573	0,15	1.480	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class F, 144A, 4,373 %, fällig 15/09/2037	1.131	0,30
103	National Collegiate Student Loan Trust 2006-1, Series 2006 1, Class A5, 0,537 %, fällig 25/03/2033 *	100	0,03	630	CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class F, 144A, 4,541 %, fällig 15/07/2032 *	594	0,16
790	National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Series 2006 3, Class B, 0,547 %, fällig 26/01/2032 *	656	0,18	440	CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class H, 144A, 7,541 %, fällig 15/07/2032 *	369	0,10
1.084	National Collegiate Student Loan Trust 2007-2, Series 2007 2, Class A4, 0,477 %, fällig 25/01/2033 *	1.034	0,28	670	DSL A Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Series 2007 AR1, Class 1A1B, 0,311 %, fällig 19/04/2047 *	600	0,16
1.302	National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A6, Class 1O, 144A, 0,000 %, fällig 25/03/2038 *	323	0,09	700	Eagle RE 2020-1 Ltd, Series 2020 1, Class M1C, 144A, 1,987 %, fällig 25/01/2030 *	680	0,18
				790	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05, Class 1B1, 3,787 %, fällig 25/01/2030 *	800	0,22
				593	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05, Class 1M2, 2,387 %, fällig 25/01/2030 *	603	0,16

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>					
1.070			834		
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C06, Class 1B1, 4,337 %, fällig 25/02/2030 *	1.131	0,30	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Class E, 144A, 3,592 %, fällig 11/11/2034 *	810	0,22
630			891		
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C07, Class 1B1, 4,187 %, fällig 25/05/2030 *	645	0,17	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Class F, 144A, 4,364 %, fällig 11/11/2034 *	862	0,23
950			114		
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C01, Class 1B1, 3,737 %, fällig 25/07/2030 *	952	0,26	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series 2007-C33, Series 2007 C33, Class AJ, 5,887 %, fällig 15/02/2051 *	88	0,02
1.050			116		
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05, Class 1B1, 4,437 %, fällig 25/01/2031 *	1.068	0,29	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR17 Trust, Series 2005 AR17, Class A1C3, 1,147 %, fällig 25/12/2045 *	77	0,02
520			847		
Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, Series 2020 DNA1, Class B1, 144A, 2,487 %, fällig 25/01/2050 *	500	0,13	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR2 Trust, Series 2005 AR2, Class B1, 0,982 %, fällig 25/01/2045 *	719	0,19
680			388		
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, Series 2020 DNA6, Class B1, 144A, 3,049 %, fällig 25/12/2050 *	637	0,17	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR13 Trust, Series 2006 AR13, Class 2A, 1,723 %, fällig 25/10/2046 *	380	0,10
450			151		
Freddie Mac STACR Trust 2018-DNA2, Series 2018 DNA2, Class B1, 144A, 3,887 %, fällig 25/12/2030 *	455	0,12	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR3 Trust, Series 2006 AR3, Class A1B, 1,104 %, fällig 25/02/2046 *	146	0,04
165			<b>Gesamte hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 39.675 USD)</b>		
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2017 SP1, Class B, 144A, 4,043 %, fällig 25/09/2047 *	159	0,04		37.510	10,09
380			<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 52,04 % (28. Februar 2021: 54,75 %)</b>		
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2021 DNA2, Class M2, 144A, 2,349 %, fällig 25/08/2033 *	385	0,10	<b>Argentinien — 0,55 % (28. Februar 2021: 0,32 %)</b>		
482			710		
GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Class C, 144A, 4,191 %, fällig 15/09/2031 *	162	0,04	Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750 %, fällig 02/05/2025	636	0,17
67			790		
GSMPS Mortgage Loan Trust 2006-RP1, Series 2006 RP1, Class 1A2, 144A, 7,500 %, fällig 25/01/2036	68	0,02	YPF SA, 144A, 8,500 %, fällig 28/07/2025	632	0,17
330			566		
Hilton USA Trust 2016-HHV, Series 2016 HHV, Class D, 144A, 4,194 %, fällig 05/11/2038 *	330	0,09	YPF SA, 144A, 4,000 %, fällig 12/02/2026	482	0,13
1.256			420		
Impac Secured Assets Trust 2006-3, Series 2006 3, Class A7, 0,727 %, fällig 25/11/2036 *	1.051	0,28	YPF SA, 144A, 6,950 %, fällig 21/07/2027	287	0,08
1.010				2.037	0,55
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Series 2018 PHMZ, Class M, 144A, 8,549 %, fällig 15/06/2035 *†	51	0,01	<b>Belgien — 0,31 % (28. Februar 2021: 0,59 %)</b>		
2			EUR	1.000	0,31
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12, Series 2007 LD12, Class AJ, 6,444 %, fällig 15/02/2051 *	2	–	<b>Brasilien — 1,59 % (28. Februar 2021: 1,63 %)</b>		
1.300			760		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Series 2018 WPT, Class FFL, 144A, 3,261 %, fällig 05/07/2033 *	1.283	0,35	B3 SA—Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig 20/09/2031	685	0,19
537			650		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-NNN MZ, Series 2020 NNNZ, Class M, 144A, 8,542 %, fällig 16/01/2037	494	0,13	Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 4,500 %, fällig 10/01/2028	658	0,18
282			870		
JP Morgan Resecuritization Trust Series 2009-10, Series 2009 10, Class 7A2, 144A, 4,899 %, fällig 26/02/2037 *	164	0,04	MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14/01/2031	768	0,21
31			530		
ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Series 2007 5, Class AJ, 5,450 %, fällig 12/08/2048 *	15	–	Petrobras Global Finance BV, 5,299 %, fällig 27/01/2025	557	0,15
31			690		
ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Series 2007 5, Class AJFL, 144A, 5,450 %, fällig 12/08/2048 *	15	–	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05/06/2115	641	0,17
381			210		
Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP, Series 2018 MP, Class A, 144A, 4,276 %, fällig 11/07/2040 *	404	0,11	Suzano Austria GmbH, 5,750 %, fällig 14/07/2026	230	0,06
166			780		
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-2AR, Series 2005 2AR, Class B1, 0,687 %, fällig 25/04/2035 *	142	0,04	Suzano Austria GmbH, 6,000 %, fällig 15/01/2029	855	0,23
880			600		
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class D, 144A, 4,398 %, fällig 15/08/2036 *	790	0,21	Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15/01/2032	534	0,14
361			470		
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class E, 144A, 4,398 %, fällig 15/08/2036 *	314	0,09	Vale Overseas Ltd, 6,250 %, fällig 10/08/2026	533	0,14
406			350		
New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Series 2021 NQ2R, Class A3, 144A, 1,353 %, fällig 25/10/2058 *	401	0,11	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 10/11/2039	434	0,12
524				5.895	1,59
Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Series 2015 4R, Class 2A2, 144A, 0,388 %, fällig 26/10/2036 *	475	0,13	<b>Kanada — 1,96 % (28. Februar 2021: 2,08 %)</b>		
387			400		
PMT Credit Risk Transfer Trust 2019-3R, Series 2019 3R, Class A, 144A, 2,808 %, fällig 27/10/2022 *	387	0,10	Air Canada, 144A, 3,875 %, fällig 15/08/2026	389	0,10
1.260			320		
Radnor Re 2018-1 Ltd, Series 2018 1, Class M2, 144A, 2,887 %, fällig 25/03/2028 *	1.256	0,34	Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15/01/2028	321	0,09
1.390			CAD	420	0,09
Radnor RE 2020-1 Ltd, Series 2020 1, Class M1C, 144A, 1,937 %, fällig 25/01/2030 *	1.341	0,36	Dorman Building Materials Group Ltd, 144A, 5,250 %, fällig 15/05/2026	326	0,09
1.390			380		
Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Series 2017 4, Class M, 144A, 4,750 %, fällig 25/06/2057 *	1.412	0,38	GFL Environmental Inc, 144A, 4,250 %, fällig 01/06/2025	381	0,10
1.362			735		
Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-1, Series 2017 1, Class M1, 144A, 4,000 %, fällig 25/01/2056 *	1.367	0,37	GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15/12/2026	751	0,20
1.320			280		
Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1, Series 2018 1, Class M, 4,750 %, fällig 25/05/2057 *	1.331	0,36	Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, fällig 01/04/2026	271	0,07
790			510		
Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-4, Series 2018 4, Class M, 144A, 4,750 %, fällig 25/03/2058	802	0,22	Hudbay Minerals Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01/04/2029	522	0,14
598			74		
Sequoia Mortgage Trust 2007-2, Series 2007 2, Class 1A3, 0,802 %, fällig 20/06/2036 *	580	0,16	MEG Energy Corp, 144A, 6,500 %, fällig 15/01/2025	75	0,02
250			480		
Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class C, 144A, 2,942 %, fällig 15/11/2027 *	37	0,01	MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01/02/2027	501	0,14
410			80		
Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class D, 144A, 3,692 %, fällig 15/11/2027 *†	–	–	MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01/02/2029	81	0,02
370			380		
Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class E, 144A, 4,592 %, fällig 15/11/2027 *†	–	–	Mountain Province Diamonds Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15/12/2022	380	0,10
853			140		
Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Class D, 144A, 2,412 %, fällig 11/11/2034 *	840	0,23	Open Text Corp, 144A, 3,875 %, fällig 15/02/2028	136	0,04
			380		
			Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15/02/2030	365	0,10
			890		
			Ritchie Bros Holdings Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15/12/2031	886	0,24
			320		
			Superior Plus LP / Superior General Partner Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15/03/2029	306	0,08
			130		
			Teck Resources Ltd, 6,000 %, fällig 15/08/2040	154	0,04
			330		
			Teck Resources Ltd, 5,400 %, fällig 01/02/2043	367	0,10
			1.020		
			TransAlta Corp, 6,500 %, fällig 15/03/2040	1.084	0,29
				7.296	1,96
			<b>Kaimaninseln — 0,32 % (28. Februar 2021: 0,33 %)</b>		
			1.256		
			Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15/09/2024	1.195	0,32
			<b>Chile — 0,25 % (28. Februar 2021: 0,10 %)</b>		
			150		
			Liberty Latin America Ltd, 2,000 %, fällig 15/07/2024	139	0,04
			803		
			VTR Comunicaciones SpA, 144A, 5,125 %, fällig 15/01/2028	796	0,21
				935	0,25
			<b>China — 0,32 % (28. Februar 2021: 0,31 %)</b>		
			400		
			Country Garden Holdings Co Ltd, 8,000 %, fällig 27/01/2024	341	0,09
			200		
			Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, fällig 12/11/2023	207	0,06
			770		
			Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13/07/2031	646	0,17
				1.194	0,32

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Kolumbien — 0,19 % (28. Februar 2021: 0,23 %)</b>					
342 Millicom International Cellular SA, 144A, 6,250 %, fällig 25/03/2029	355	0,10			
363 Millicom International Cellular SA, 144A, 4,500 %, fällig 27/04/2031	340	0,09			
	695	0,19			
<b>Frankreich — 0,38 % (28. Februar 2021: 0,78 %)</b>					
200 Altice France SA/France, 144A, 8,125 %, fällig 01/02/2027	211	0,06			
350 Altice France SA/France, 144A, 5,125 %, fällig 15/07/2029	317	0,08			
400 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, fällig 15/10/2029	367	0,10			
470 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetual *	531	0,14			
	1.426	0,38			
<b>Deutschland — 0,21 % (28. Februar 2021: 0,22 %)</b>					
520 Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 144A, 5,500 %, fällig 15/01/2028	520	0,14			
160 Mercer International Inc, 5,125 %, fällig 01/02/2029	157	0,04			
EUR 100 Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, fällig 30/09/2025	101	0,03			
	778	0,21			
<b>Hongkong — 0,17 % (28. Februar 2021: 0,23 %)</b>					
730 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 04/12/2029	635	0,17			
<b>Indien — 0,06 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
210 CA Magnum Holdings, 144A, 5,375 %, fällig 31/10/2026	211	0,06			
<b>Irland — 0,20 % (28. Februar 2021: 0,32 %)</b>					
420 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30/01/2032	399	0,11			
320 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 15/04/2026	329	0,09			
	728	0,20			
<b>Israel — 0,53 % (28. Februar 2021: 0,23 %)</b>					
1.290 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig 01/02/2036	1.305	0,35			
700 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig 09/05/2027	675	0,18			
	1.980	0,53			
<b>Italien — 0,30 % (28. Februar 2021: 1,15 %)</b>					
230 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig 15/01/2026	243	0,07			
200 UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, fällig 02/04/2034 *	218	0,06			
640 UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, fällig 30/06/2035 *	638	0,17			
	1.099	0,30			
<b>Kasachstan — 0,52 % (28. Februar 2021: 0,55 %)</b>					
1.080 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 4,750 %, fällig 19/04/2027	1.115	0,30			
830 KazTransGas JSC, 144A, 4,375 %, fällig 26/09/2027	833	0,22			
	1.948	0,52			
<b>Kuwait — 0,27 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
880 MEGlobal Canada ULC, 144A, 5,875 %, fällig 18/05/2030	1.000	0,27			
<b>Luxemburg — 0,61 % (28. Februar 2021: 0,54 %)</b>					
1.030 Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig 15/05/2027	1.080	0,29			
430 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30/06/2027	412	0,11			
GBP 460 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01/10/2024	568	0,15			
200 FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15/08/2026	203	0,06			
	2.263	0,61			
<b>Macau — 0,44 % (28. Februar 2021: 0,64 %)</b>					
270 Sands China Ltd, 5,125 %, fällig 08/08/2025	269	0,07			
200 Sands China Ltd, 144A, 2,300 %, fällig 08/03/2027	174	0,05			
200 Sands China Ltd, 144A, 3,250 %, fällig 08/08/2031	163	0,04			
200 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 01/10/2024	186	0,05			
530 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26/08/2028	462	0,13			
430 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 15/12/2029	366	0,10			
	1.620	0,44			
<b>Malaysia — 0,19 % (28. Februar 2021: 0,22 %)</b>					
790 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig 19/08/2050	691	0,19			
<b>Mexiko — 0,41 % (28. Februar 2021: 0,26 %)</b>					
820 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,500 %, Perpetual *	802	0,22			
740 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625 %, Perpetual *	727	0,19			
	1.529	0,41			
<b>Niederlande — 0,42 % (28. Februar 2021: 0,39 %)</b>					
EUR 1.000 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, Perpetual *	1.158	0,31			
EUR 310 Stichting AK Rabobank Certificaten, 6,500 %, Perpetual	420	0,11			
	1.578	0,42			
<b>Russland — 0,13 % (28. Februar 2021: 0,30 %)</b>					
320 Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA, 144A, 4,950 %, fällig 23/03/2027	146	0,04			
770 Lukoil International Finance BV, 144A, 4,750 %, fällig 02/11/2026	338	0,09			
	484	0,13			
<b>Singapur — 0,12 % (28. Februar 2021: 0,07 %)</b>					
420 Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, fällig 19/06/2024	438	0,12			
<b>Südafrika — 0,25 % (28. Februar 2021: 0,04 %)</b>					
450 Sasol Financing USA LLC, 4,375 %, fällig 18/09/2026	441	0,12			
510 Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, fällig 18/03/2031	489	0,13			
	930	0,25			
<b>Spanien — 0,15 % (28. Februar 2021: 0,22 %)</b>					
EUR 400 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 5,875 %, Perpetual *	460	0,12			
EUR 100 Tendam Brands SAU, 5,250 %, fällig 15/09/2024 *	112	0,03			
	572	0,15			
<b>Schweiz — 0,27 % (28. Februar 2021: 0,54 %)</b>					
200 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, Perpetual *	207	0,05			
200 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, Perpetual *	204	0,05			
420 UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Perpetual *	437	0,12			
180 Vistaleat Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01/02/2030	172	0,05			
	1.020	0,27			
<b>Türkei — 0,20 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
760 Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 6,875 %, fällig 28/02/2025	758	0,20			
<b>Vereinigte Arabische Emirate — 0,26 % (28. Februar 2021: 0,61 %)</b>					
860 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, fällig 25/09/2048	962	0,26			
<b>Großbritannien — 2,09 % (28. Februar 2021: 1,60 %)</b>					
EUR 550 Barclays Plc, 2,000 %, fällig 07/02/2028 *	621	0,17			
EUR 470 HSBC Holdings Plc, 5,250 %, Perpetual *	533	0,14			
EUR 720 Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, Perpetual *	835	0,22			
842 McLaren Finance Plc, 144A, 7,500 %, fällig 01/08/2026	840	0,23			
GBP 970 NatWest Group Plc, 4,500 %, Perpetual *	1.196	0,32			
430 Neptune Energy Bondco Plc, 144A, 6,625 %, fällig 15/05/2025	435	0,12			
GBP 278 Saga Plc, 3,375 %, fällig 12/05/2024	351	0,09			
GBP 640 Saga Plc, 5,500 %, fällig 15/07/2026	824	0,22			
800 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15/05/2029	800	0,22			
530 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15/07/2031	509	0,14			
GBP 650 Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, fällig 15/07/2026	825	0,22			
	7.769	2,09			
<b>USA — 37,58 % (28. Februar 2021: 39,02 %)</b>					
260 Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig 01/03/2028	267	0,07			
330 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, fällig 01/05/2028	307	0,08			
350 AdaptHealth LLC, 144A, 6,125 %, fällig 01/08/2028	347	0,09			
380 AdaptHealth LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01/08/2029	343	0,09			
210 AdaptHealth LLC, 144A, 5,125 %, fällig 01/03/2030	194	0,05			
720 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01/03/2028	645	0,17			
320 AES Corp/The, 2,450 %, fällig 15/01/2031	296	0,08			
630 Akumin Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01/11/2025	551	0,15			
440 Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,125 %, fällig 15/05/2028	464	0,12			
1.150 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15/02/2028	1.144	0,31			
1.170 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15/07/2026	1.200	0,32			
275 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01/06/2029	256	0,07			
360 Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig 01/06/2028	337	0,09			
240 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 10,000 %, fällig 15/06/2026	222	0,06			
336 American Airlines 2017-1 Class B Pass Through Trust, Series B, 4,950 %, fällig 15/02/2025	331	0,09			
300 American Airlines Inc, 144A, 11,750 %, fällig 15/07/2025	364	0,10			
380 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 20/04/2026	389	0,10			
350 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20/04/2029	358	0,10			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
210 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01/10/2029	199	0,05	860 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15/06/2045	960	0,26
1.502 American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig 01/09/2026	1.739	0,47	260 Diamondback Energy Inc, 4,400 %, fällig 24/03/2051	270	0,07
250 Antero Resources Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01/03/2030	255	0,07	1.370 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15/08/2027	1.372	0,37
550 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/06/2029	497	0,13	400 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01/07/2026	406	0,11
680 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh MetalPackaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, fällig 01/09/2029	639	0,17	530 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01/12/2028	508	0,14
360 Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15/12/2024	383	0,10	980 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01/06/2029	829	0,22
550 Ball Corp, 2,875 %, fällig 15/08/2030	503	0,14	840 DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15/08/2026	764	0,21
340 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15/09/2031	313	0,08	530 Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig 15/06/2025	561	0,15
700 Bath & Body Works Inc, 5,250 %, fällig 01/02/2028	730	0,20	210 Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, fällig 15/02/2028	190	0,05
610 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01/10/2030	661	0,18	1.270 DraftKings Inc, 144A, Null-Coupon, fällig 15/03/2028	963	0,26
700 Bausch Health Americas Inc, 144A, 8,500 %, fällig 31/01/2027	710	0,19	370 Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15/07/2025	387	0,10
410 Bausch Health Cos Inc, 144A, 9,000 %, fällig 15/12/2025	423	0,11	373 Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig 30/01/2028	387	0,10
320 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01/02/2027	323	0,09	1.150 Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc, 144A, 9,500 %, fällig 31/07/2027	1.123	0,30
140 Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15/01/2028	128	0,03	600 Endo Luxembourg Finance Co I Sarl / Endo US Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01/04/2029	565	0,15
1.050 Bed Bath & Beyond Inc, 5,165 %, fällig 01/08/2044	771	0,21	540 Energy Transfer LP, 5,350 %, fällig 15/05/2045	572	0,15
1.580 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15/02/2026	1.558	0,42	250 Energy Transfer LP Series G, 7,125 %, Perpetual *	246	0,07
420 Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01/09/2028	398	0,11	340 Entegris Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15/04/2028	334	0,09
890 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15/12/2025	937	0,25	580 Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, fällig 31/01/2051	542	0,15
530 Boeing Co/The, 2,196 %, fällig 04/02/2026	517	0,14	380 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31/01/2060	358	0,10
160 Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01/05/2030	177	0,05	170 EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000 %, fällig 01/07/2025	174	0,05
420 Boeing Co/The, 3,250 %, fällig 01/02/2035	394	0,11	190 EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, fällig 01/07/2027	199	0,05
640 Boeing Co/The, 5,930 %, fällig 01/05/2060	762	0,20	160 EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15/05/2026	158	0,04
750 Boyne USA Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15/05/2029	738	0,20	380 EQT Corp, 7,500 %, fällig 01/02/2030	454	0,12
343 Brink's Co/The, 144A, 4,625 %, fällig 15/10/2027	335	0,09	140 Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/01/2029	134	0,04
120 Cano Health LLC, 144A, 6,250 %, fällig 01/10/2028	107	0,03	180 Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15/01/2030	172	0,05
1.904 Carnival Corp, 144A, 9,875 %, fällig 01/08/2027	2.140	0,58	930 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01/01/2030	925	0,25
960 Carnival Plc, 7,875 %, fällig 01/06/2027	1.088	0,29	230 FirstEnergy Corp, Series B, 4,400 %, fällig 15/07/2027	239	0,06
160 Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15/10/2029	152	0,04	140 FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, fällig 15/11/2031	175	0,05
550 Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15/05/2029	520	0,14	800 Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, fällig 15/11/2025	817	0,22
290 Carrolls Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01/07/2029	250	0,07	1.270 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12/02/2032	1.200	0,32
800 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,000 %, fällig 01/02/2028	806	0,22	450 Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, fällig 16/06/2025	471	0,13
790 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 15/08/2030	762	0,20	950 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13/11/2030	944	0,25
870 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01/05/2032	828	0,22	670 Freeport Minerals Corp, 7,125 %, fällig 01/11/2027	810	0,22
320 CDK Global Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15/05/2029	329	0,09	1.330 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15/03/2043	1.532	0,41
380 CDW LLC / CDW Finance Corp, 4,125 %, fällig 01/05/2025	386	0,10	500 Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000 %, fällig 01/11/2026	498	0,13
170 CDW LLC / CDW Finance Corp, 3,250 %, fällig 15/02/2029	159	0,04	280 Gartner Inc, 144A, 3,625 %, fällig 15/06/2029	272	0,07
20 Centene Corp, 4,250 %, fällig 15/12/2027	20	0,01	290 GEO Group Inc/The, 5,125 %, fällig 01/04/2023	276	0,07
50 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01/03/2042	43	0,01	1.020 GEO Group Inc/The, 5,875 %, fällig 15/10/2024	901	0,24
900 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01/07/2049	918	0,25	157 GEO Group Inc/The, 6,000 %, fällig 15/04/2026	130	0,03
250 Chegg Inc, Null-Coupon, fällig 01/09/2026	205	0,06	1.030 Granite Point Mortgage Trust Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01/12/2022	1.033	0,28
800 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15/04/2029	777	0,21	470 Granite US Holdings Corp, 144A, 11,000 %, fällig 01/10/2027	502	0,13
970 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01/04/2030	903	0,24	800 Guitar Center Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15/01/2026	840	0,23
570 Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 144A, 8,500 %, fällig 15/05/2027	595	0,16	600 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15/12/2028	562	0,15
290 Clarivate Science Holdings Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01/07/2029	273	0,07	640 Halozyme Therapeutics Inc, 144A, 0,250 %, fällig 01/03/2027	558	0,15
1.100 Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01/06/2029	1.144	0,31	440 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20/01/2026	446	0,12
480 Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, fällig 01/10/2031	424	0,11	1.090 HCA Inc, 5,625 %, fällig 01/09/2028	1.209	0,33
1.190 Colgate Energy Partners III LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01/07/2029	1.226	0,33	540 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15/01/2027	537	0,14
650 CommScope Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01/03/2027	648	0,17	760 iHeartCommunications Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15/01/2028	736	0,20
420 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig 15/01/2031	469	0,13	1.120 IIP Operating Partnership LP, 5,500 %, fällig 25/05/2026	1.151	0,31
1.100 CoreCivic Inc, 8,250 %, fällig 15/04/2026	1.119	0,30	300 International Game Technology Plc, 144A, 5,250 %, fällig 15/01/2029	306	0,08
1.140 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01/02/2029	1.156	0,31	170 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15/11/2029	166	0,04
260 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15/01/2030	230	0,06	470 Jazz Securities DAC, 144A, 4,375 %, fällig 15/01/2029	466	0,13
240 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01/12/2030	216	0,06	380 Kraft Heinz Foods Co, 5,500 %, fällig 01/06/2050	457	0,12
250 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15/11/2031	228	0,06	270 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08/08/2024	266	0,07
300 DCP Midstream LP, Series A, 7,375 %, Perpetual *	284	0,08	190 Las Vegas Sands Corp, 3,500 %, fällig 18/08/2026	185	0,05
100 DCP Midstream Operating LP, 3,875 %, fällig 15/03/2023	101	0,03	400 LD Holdings Group LLC, 144A, 6,125 %, fällig 01/04/2028	357	0,10
40 DCP Midstream Operating LP, 5,625 %, fällig 15/07/2027	43	0,01	300 Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 4,375 %, fällig 15/02/2027	285	0,08
190 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, fällig 15/09/2037	232	0,06	710 Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01/02/2026	696	0,19
680 Delta Air Lines Inc, 3,800 %, fällig 19/04/2023	686	0,18	800 Liberty Interactive LLC, 8,500 %, fällig 15/07/2029	786	0,21
1.600 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01/05/2025	1.778	0,48	130 Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01/02/2030	128	0,03
240 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20/10/2028	251	0,07	80 Liberty TripAdvisor Holdings Inc, 144A, 0,500 %, fällig 30/06/2051	65	0,02
			460 LogMeIn Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01/09/2027	438	0,12
			90 LPL Holdings Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15/05/2031	88	0,02
			410 LSF11 A5 HoldCo LLC, 144A, 6,625 %, fällig 15/10/2029	391	0,11
			760 Madison IAQ LLC, 144A, 5,875 %, fällig 30/06/2029	691	0,19
			380 Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01/06/2028	382	0,10
			690 Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig 01/05/2028	646	0,17
			630 Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, fällig 01/05/2029	552	0,15

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 14,10 % (28. Februar 2021: 10,34 %)</b>					
<b>Argentinien — 0,67 % (28. Februar 2021: 0,48 %)</b>					
8 Argentine Republic Government International Bond, 1,000 %, fällig 09/07/2029	2	–			
47 Argentine Republic Government International Bond, 0,500 %, fällig 09/07/2030	15	–			
90 Argentine Republic Government International Bond, 1,125 %, fällig 09/07/2035	27	0,01			
500 Ciudad Autonoma De Buenos Aires/Government Bonds, 7,500 %, fällig 01/06/2027	427	0,12			
3.698 Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 3,900 %, fällig 01/09/2037	1.576	0,42			
665 Provincia de Cordoba, 144A, 5,000 %, fällig 01/06/2027	430	0,12			
	2.477	0,67			
<b>Bahamas — 0,14 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
550 Bahamas Government International Bond, 144A, 5,750 %, fällig 16/01/2024	521	0,14			
<b>Brasilien — 0,75 % (28. Februar 2021: 0,83 %)</b>					
BRL 122 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie B, Series NTNFB, 6,000 %, fällig 15/05/2023	92	0,02			
BRL 6.194 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNFF, 10,000 %, fällig 01/01/2027	1.148	0,31			
BRL 905 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNFF, 10,000 %, fällig 01/01/2029	165	0,04			
1.570 Brazilian Government International Bond, 5,000 %, fällig 27/01/2045	1.398	0,38			
	2.803	0,75			
<b>Côte d'Ivoire (Elfenbeinküste) — 0,30 % (28. Februar 2021: 0,26 %)</b>					
EUR 180 Ivory Coast Government International Bond, 144A, 4,875 %, fällig 30/01/2032	172	0,05			
512 Ivory Coast Government International Bond, 5,750 %, fällig 31/12/2032	503	0,13			
460 Ivory Coast Government International Bond, 6,125 %, fällig 15/06/2033	443	0,12			
	1.118	0,30			
<b>Dominikanische Republik — 0,26 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
490 Dominican Republic International Bond, 144A, 5,500 %, fällig 22/02/2029	488	0,13			
500 Dominican Republic International Bond, 144A, 6,000 %, fällig 22/02/2033	493	0,13			
	981	0,26			
<b>Ägypten — 0,21 % (28. Februar 2021: 0,15 %)</b>					
850 Egypt Government International Bond, 144A, 7,600 %, fällig 01/03/2029	765	0,21			
<b>Gabun — 0,11 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
450 Gabon Government International Bond, 144A, 7,000 %, fällig 24/11/2031	415	0,11			
<b>Deutschland — 0,09 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
EUR 280 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15/08/2026	317	0,09			
<b>Ghana — 0,20 % (28. Februar 2021: 0,24 %)</b>					
200 Ghana Government International Bond, 8,125 %, fällig 18/01/2026	158	0,04			
200 Ghana Government International Bond, 144A, 7,625 %, fällig 16/05/2029	136	0,04			
670 Ghana Government International Bond, 144A, 8,125 %, fällig 26/03/2032	452	0,12			
	746	0,20			
<b>Indonesien — 2,51 % (28. Februar 2021: 2,62 %)</b>					
750 Indonesia Government International Bond, 3,500 %, fällig 11/01/2028	775	0,21			
500 Indonesia Government International Bond, 6,625 %, fällig 17/02/2037	634	0,17			
1.200 Indonesia Government International Bond, 5,250 %, fällig 17/01/2042	1.350	0,36			
IDR 37.154.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR56, 8,375 %, fällig 15/09/2026	2.887	0,78			
IDR 48.151.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR59, 7,000 %, fällig 15/05/2027	3.563	0,96			
IDR 763.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR87, 6,500 %, fällig 15/02/2031	53	0,01			
IDR 721.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR68, 8,375 %, fällig 15/03/2034	57	0,02			
	9.319	2,51			
<b>Israel — 0,21 % (28. Februar 2021: 0,18 %)</b>					
360 Israel Government International Bond, 2,750 %, fällig 03/07/2030	367	0,10			
			440 State of Israel, 3,375 %, fällig 15/01/2050	431	0,11
				798	0,21
<b>Japan — 0,07 % (28. Februar 2021: 0,08 %)</b>					
JPY 29.100 Japanese Government CPI Linked Bond, Series 21, 0,100 %, fällig 10/03/2026				266	0,07
<b>Kasachstan — 0,24 % (28. Februar 2021: 0,27 %)</b>					
			840 Kazakhstan Government International Bond, 5,125 %, fällig 21/07/2025	902	0,24
<b>Mexiko — 0,87 % (28. Februar 2021: 0,79 %)</b>					
MXN 24.000 Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31/05/2029				1.214	0,33
			600 Mexico Government International Bond, 2,659 %, fällig 24/05/2031	553	0,15
			1.480 Mexico Government International Bond, 4,750 %, fällig 08/03/2044	1.470	0,39
				3.237	0,87
<b>Panama — 0,29 % (28. Februar 2021: 0,16 %)</b>					
			1.130 Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 01/04/2056	1.096	0,29
<b>Peru — 0,29 % (28. Februar 2021: 0,23 %)</b>					
			1.140 Peruvian Government International Bond, 2,783 %, fällig 23/01/2031	1.080	0,29
<b>Katar — 0,38 % (28. Februar 2021: 0,38 %)</b>					
			570 Qatar Government International Bond, 144A, 5,103 %, fällig 23/04/2048	717	0,19
			570 Qatar Government International Bond, 144A, 4,817 %, fällig 14/03/2049	694	0,19
				1.411	0,38
<b>Russland — 0,53 % (28. Februar 2021: 1,52 %)</b>					
RUB 397.822 Russian Federal Bond — OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19/01/2028 ty				1.971	0,53
<b>Vereinigte Arabische Emirate — 0,18 % (28. Februar 2021: 0,17 %)</b>					
			590 Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 4,125 %, fällig 11/10/2047	658	0,18
<b>USA — 5,80 % (28. Februar 2021: 1,98 %)</b>					
			21.780 United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 30/11/2023	21.436	5,76
			140 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/11/2041	134	0,04
				21.570	5,80
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 58.273 USD)</b>					
				52.451	14,10
<b>Darlehensanleihen — 6,54 % (28. Februar 2021: 8,83 %)</b>					
			430 8th Avenue Food & Provisions Inc, 7,959 %, fällig 01/10/2026 *	398	0,11
			64 Academy Ltd, 4,500 %, fällig 06/11/2027 *	64	0,02
			550 Acrisure LLC, 4,750 %, fällig 15/02/2027 *	546	0,15
			267 Acrisure LLC, 3,724 %, fällig 15/02/2027 *	263	0,07
			114 Allen Media LLC, 5,724 %, fällig 10/02/2027 *	114	0,03
			233 Allied Universal Holdco LLC, 4,250 %, fällig 14/05/2028 *	230	0,06
			403 AMC Entertainment Holdings Inc, 4,080 %, fällig 22/04/2026 *	366	0,10
			170 Amentum Government Services Holdings LLC, 10,000 %, fällig 31/01/2028 *	170	0,05
			196 American Axle & Manufacturing Inc, 3,000 %, fällig 06/04/2024 *	195	0,05
			58 API Group Inc, 2,709 %, fällig 01/10/2026 *	57	0,02
			68 Apollo Group CMR, 2,959 %, fällig 15/05/2026 *	66	0,02
			154 AppLovin Corporation, 3,459 %, fällig 15/08/2025 *	153	0,04
			195 Asurion LLC, 3,459 %, fällig 18/12/2026 *	192	0,05
			577 Asurion LLC, 3,209 %, fällig 03/11/2024 *	571	0,15
			301 Asurion LLC, 3,334 %, fällig 03/11/2023 *	299	0,08
			237 Brightview Landscapes LLC, 2,750 %, fällig 15/08/2025 *	234	0,06
			324 Caesars Resort Collection LLC, 3,605 %, fällig 19/06/2025 *	323	0,09
			297 Caesars Resort Collection LLC, 2,959 %, fällig 22/12/2024 *	295	0,08
			409 City Brewing Co LLC, 4,250 %, fällig 31/03/2028 *	387	0,10
			876 ClubCorp Holdings Inc, 2,970 %, fällig 18/09/2024 *	841	0,23
			155 Corrections Corporation of America, 5,500 %, fällig 12/12/2024 *	155	0,04
			386 CWGS Group, LLC, 3,250 %, fällig 03/06/2028 *	381	0,10
			445 DCert Buyer, Inc., 4,209 %, fällig 16/10/2026 *	444	0,12
			192 Deerfield Dakota Holding LLC, 4,750 %, fällig 05/03/2027 *	191	0,05
			196 Doosan Bobcat, 2,474 %, fällig 18/05/2024 *	195	0,05
			75 Entercom Media Corp, 2,609 %, fällig 17/11/2024 *	74	0,02
			650 Equinox Holdings Inc, 10,000 %, fällig 08/03/2024 *	660	0,18
			306 Eyecare Partners LLC, 3,974 %, fällig 05/02/2027 *	304	0,08
			540 First Brands Group LLC, 6,000 %, fällig 24/03/2027 *	538	0,14
			692 Focus Financial Partners LLC, 2,105 %, fällig 03/07/2024 *	684	0,18
			790 Froneri Lux FinCo SARL, 2,375 %, fällig 30/01/2027 *	848	0,23
			335 Froneri U.S. Inc, 2,459 %, fällig 30/01/2027 *	329	0,09

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Loan Notes – (Fortsetzung)</b>					
208 Garda World Security Corp, 4,430 %, fällig 30/10/2026 *	207	0,05	<b>Index-Swaps — 0,01 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
78 Global Medical Response, Inc, 5,250 %, fällig 24/09/2025 *	78	0,02	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
127 Global Tel'Link Corp, 4,459 %, fällig 29/11/2025 *	124	0,03	30	0,01	
720 Gray Television Inc, 3,106 %, fällig 27/10/2028 *	716	0,19	<b>Devisenterminkontrakte — 1,44 % (28. Februar 2021: 2,05 %)</b>		
205 Great Outdoors Group LLC, 4,500 %, fällig 05/03/2028 *	204	0,05	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
636 Greystone Select Financial, 5,750 %, fällig 06/05/2028 *	634	0,17	5.345	1,44	
198 Hayward Industries Inc., 3,000 %, fällig 14/05/2028 *	196	0,05	<b>Futures – 0,21 % (28. Februar 2021: 0,19 %)</b>		
287 Jazz Financing Lux S.a.r.l., 4,000 %, fällig 22/04/2028 *	286	0,08	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
207 Leslie's Poolmart Inc, 3,019 %, fällig 08/03/2028 *	205	0,06	774	0,21	
480 LRS Holdings LLC, 4,750 %, fällig 12/08/2028 *	479	0,13	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
208 LTR Intermediate Holdings, Inc., 5,500 %, fällig 23/04/2028 *	207	0,06	364.911	98,14	
307 Madison IAQ LLC, 3,750 %, fällig 16/06/2028 *	303	0,08			
261 Mister Car Wash, 3,209 %, fällig 14/05/2026 *	258	0,07			
1.935 Monitronics International Inc, 7,750 %, fällig 29/03/2024 *	1.626	0,44			
481 One Call Corp, 6,250 %, fällig 07/04/2027 *	479	0,13			
298 Particle Investments S.a.r.l., 5,750 %, fällig 11/05/2027 *	298	0,08			
805 PECF USS Intermediate Holding Corp, 4,750 %, fällig 04/11/2028 *	802	0,22			
425 Peraton Corporation, 4,500 %, fällig 22/02/2028 *	423	0,11			
167 Phoenix Guarantor Inc, 3,459 %, fällig 05/03/2026 *	165	0,04			
420 Project Sky Merger Sub, Inc., 6,500 %, fällig 10/08/2029 *	417	0,11			
290 Proofpoint, Inc., 3,758 %, fällig 10/06/2028 *	287	0,08			
800 Radiology Partners Inc, 4,412 %, fällig 09/07/2025 *	788	0,21			
319 Redstone Holdco 2 LP, 5,500 %, fällig 27/04/2028 *	299	0,08			
152 RegionalCare Hospital Partners Holding, 3,959 %, fällig 16/11/2025 *	151	0,04			
29 Seattle SpinCo Inc, 2,959 %, fällig 18/04/2024 *	28	0,01			
136 Sedgwick Claims Management Services Inc, 5,250 %, fällig 03/09/2026 *	136	0,04			
312 Sedgwick Claims Management Services Inc, 3,459 %, fällig 05/11/2025 *	308	0,08			
244 Sovos Brands, 4,500 %, fällig 03/06/2028 *	244	0,07			
355 Surf Holdings LLC, 3,690 %, fällig 14/10/2026 *	352	0,09			
99 Triton Water Holdings, Inc., 4,000 %, fällig 16/03/2028 *	97	0,03			
361 U.S. Renal Care Inc, 5,209 %, fällig 14/06/2026 *	348	0,09			
118 United Airlines Inc, 4,500 %, fällig 14/04/2028 *	117	0,03			
390 USI Inc, 3,224 %, fällig 16/05/2024 *	387	0,10			
510 UST Holdings Ltd, 4,250 %, fällig 29/10/2028 *	505	0,14			
250 Vertex Aerospace LLC, 4,750 %, fällig 27/11/2028 *	249	0,07			
260 Virgin Media Bristol LLC, 2,691 %, fällig 04/01/2028 *	256	0,07			
289 Virgin Pulse Inc, 4,750 %, fällig 30/03/2028 *	286	0,08			
518 WP CityMD Bidco LLC, 3,750 %, fällig 18/11/2028 *	515	0,14			
320 Ziggo BV, 2,691 %, fällig 15/04/2028 *	314	0,08			
<b>Gesamtdarlehensanleihen (Anschaffungskosten 24.701 USD)</b>	<b>24.341</b>	<b>6,54</b>			
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,55 % (28. Februar 2021: 1,75 %)</b>					
EUR 24 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	2.845	0,77			
32 Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US\$ Distributing (M)	2.902	0,78			
<b>Gesamte kollektive Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 5.832 USD)</b>	<b>5.747</b>	<b>1,55</b>			
<b>Vorzugsaktien — 2,23 % (28. Februar 2021: 0,78 %)</b>					
<b>USA — 2,23 % (28. Februar 2021: 0,78 %)</b>					
8 B Riley Financial Inc	182	0,05			
9 B Riley Financial Inc	215	0,06			
70 MPLX LP, Series A	2.349	0,63			
5 Targa Resources Corp, Series A	5.529	1,49			
	8.275	2,23			
<b>Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 8.035 USD)</b>	<b>8.275</b>	<b>2,23</b>			
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 375.766 USD)</b>					
	358.203	96,32			
<b>Verträge (in Tsd.)</b>					
<b>Gekaufte Optionen – 0,11 % (28. Februar 2021: 0,08 %)</b>					
– S&P 500 E-mini March 2022 Put 4.000,00, fällig 18/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	129	0,04			
– S&P 500 E-mini W3 April 2022 Put 3.800,00, fällig 14/04/2022 – Bank of America Merrill Lynch	162	0,04			
8.840 USD Call/EUR Put 1,1245, fällig 02/04/2022 – Goldman Sachs	91	0,03			
<b>Gekaufte Optionen insgesamt (Kosten 899 USD)</b>	<b>382</b>	<b>0,11</b>			
<b>Credit Default Swaps – 0,03 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	107	0,03			
<b>Inflation Swaps — 0,02 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	70	0,02			
<b>Verträge (in Tsd.)</b>					
<b>Schriftliche Optionen — (0,05 %) (28. Februar 2021: (0,08 %))</b>					
– S&P 500 E-mini March 2022 Put 3.600,00, fällig 18/03/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(14)	–			
(3.370) USD Call/EUR Put 1,0975, fällig 30/03/2022 – BNP Paribas	(10)	–			
(3.370) USD Call/EUR Put 1,1050, fällig 27/04/2022 – BNP Paribas	(23)	(0,01)			
(8.840) USD Call/EUR Put 1,1050, fällig 02/04/2022 – Goldman Sachs	(40)	(0,01)			
(3.370) USD Call/EUR Put 1,1120, fällig 14/04/2022 – Goldman Sachs	(25)	(0,01)			
(1.953) USD Call/EUR Put 1,1245, fällig 08/04/2022 – JP Morgan	(22)	(0,01)			
(4.500) USD Call/JPY Put 117,65, fällig 27/04/2022 – BNP Paribas	(9)	–			
(3.370) USD Put/EUR Call 1,1605, fällig 14/04/2022 – Goldman Sachs	(6)	–			
(1.953) USD Put/EUR Call 1,1675, fällig 08/04/2022 – JP Morgan	(2)	–			
(1.770) USD Put/NOK Call 8,4825, fällig 13/04/2022 – Goldman Sachs	(7)	–			
(3.600) USD Put/RUB Call 73,85, fällig 15/04/2022 – JP Morgan	(19)	(0,01)			
<b>Geschriebene Optionen insgesamt (Kosten 5(242))</b>	<b>(177)</b>	<b>(0,05)</b>			
<b>Inflationsswaps — (0,01 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(40)	(0,01)			
<b>Zinsswaps – (0,15 %) (28. Februar 2021: (0,07 %))</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(532)	(0,15)			
<b>Devisenterminkontrakte — (1,95 %) (28. Februar 2021: (0,09 %))</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(7.240)	(1,95)			
<b>Futures – (0,60 %) (28. Februar 2021: (0,20 %))</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(2.239)	(0,60)			
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>					
	(10.228)	(2,76)			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>					
	354.683	95,38			
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>					
	17.216	4,62			
<b>Gesamtvermögen</b>				<b>\$371.899</b>	<b>100,00</b>
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile, weniger als 0,01 %.					
144A	Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 180.598.000 USD oder 48,59 % des Nettovermögens.				
*	Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.				
†	Illiquide.				
∞	Die Sicherheit wird nach Treu und Glauben vom Bewertungsausschuss oder nach dessen Ermessen zum beizulegenden Zeitwert bewertet.				
ε	Sicherheit ist mit Stand vom 28. Februar 2022 in Verzug (entweder Kapital und/oder Zinsen).				
γ	Wertpapiere, die nach Jahresende aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen nicht mehr ertragswirksam sind.				
β	Der Zinssatz für diese Art von Wertpapier ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Stand vom 28. Februar 2022.				
<b>ABKÜRZUNGEN:</b>					
CPI	– Verbraucherpreisindex.				
Unbefristet	– Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.				
REMIC	– Hypothekenanlageanlage.				
BRL	– Brasilianischer Real				
CAD	– Kanadischer Dollar				
EUR	– Euro				
GBP	– Britische Pfund				
IDR	– Indonesische Rupiah				
JPY	– Japanischer Yen				
MXN	– Mexikanischer Peso				
RUB	– Russischer Rubel				

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

	% des Gesamt vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	85,08
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	6,31
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,49
Finanzderivate	1,74
Sonstige Vermögenswerte	5,38
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

## Zeitplan für Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20/12/2026	7.280	\$ 107
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 107
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (982) USD)				–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (982) USD)				\$ 107

## Zeitplan der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,450 %	18/07/2029	170.990	\$ (182)
Citi	Pay Floating BRL CDI CETIP, Receive Fixed 7,024 %	04/01/2027	9.200	(138)
Citi	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,024 %	04/01/2027	7.800	(117)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 7,044 %	04/01/2027	6.400	(95)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 7.272 USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (802) USD)				(532)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 6.470 USD)				\$ (532)

## Zeitplan für Index-Swaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20/11/2026	5.090	\$ 30
Nicht realisierte Wertsteigerung von Index Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 30
Nicht realisierte Wertminderung von Index-Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				–
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 30

## Zeitplan für Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	USD – CPI Urban Consumers	18/11/2023	4.470	\$ 70
Bank of America Merrill Lynch	USD – CPI Urban Consumers	18/11/2026	4.470	(40)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 70
Nicht realisierte Wertminderung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(40)
Nettowertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 30

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Währung	Menge	Verkauf	Verkaufswährung (in Tsd.)	Wert	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	44	Verkauf	USD	59	\$ –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.057	Verkauf	AUD	1.481	(19)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	CHF	1	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	715	Verkauf	EUR	631	6
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2.231	Verkauf	GBP	1.648	19
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	61	Verkauf	GBP	45	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	138.452	Verkauf	USD	187.691	(1.927)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	2	Verkauf	USD	2	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	59.441	Verkauf	USD	67.990	(1.296)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CHF	45	Verkauf	USD	49	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	141.888	Verkauf	USD	101.553	1.528
15/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.156	Verkauf	RUB	88.144	342
22/03/2022	Goldman Sachs	Kauf	RUB	46.670	Verkauf	USD	599	\$ (169)
22/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	RUB	33.810	Verkauf	USD	434	(122)
31/03/2022	BNP Paribas	Kauf	USD	802	Verkauf	EUR	719	(5)
31/03/2022	BNP Paribas	Kauf	EUR	719	Verkauf	USD	802	5
05/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	EUR	1.591	Verkauf	USD	1.801	(14)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Zinsswaps – (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
15/04/2022	JP Morgan	Kauf	RUB	82.347	Verkauf	USD	1.056 (323)
19/04/2022	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	JPY	232.180	Verkauf	USD	2.011 11
19/04/2022	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	RUB	39.309	Verkauf	USD	499 (152)
19/04/2022	BNP Paribas	Kauf	USD	1.800	Verkauf	NOK	15.700 20
19/04/2022	BNP Paribas	Kauf	USD	222	Verkauf	RUB	17.310 69
19/04/2022	BNP Paribas	Kauf	NOK	91.960	Verkauf	USD	10.437 (10)
19/04/2022	BNP Paribas	Kauf	EUR	700	Verkauf	USD	792 (6)
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	1.698	Verkauf	BRL	9.731 (165)
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	1.016	Verkauf	CNH	6.520 (12)
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	15.712	Verkauf	EUR	13.886 111
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	6.654	Verkauf	IDR	96.522.024 (38)
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	–	Verkauf	INR	2 –
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	1.007	Verkauf	MXN	20.909 (4)
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	2.250	Verkauf	MXN	46.460 2
19/04/2022	Citi	Kauf	USD	5.148	Verkauf	RUB	393.215 1.678
19/04/2022	Citi	Kauf	CAD	1.132	Verkauf	USD	890 4
19/04/2022	Citi	Kauf	JPY	439.440	Verkauf	USD	3.812 15
19/04/2022	Citi	Kauf	MXN	111.304	Verkauf	USD	5.297 88
19/04/2022	Citi	Kauf	ZAR	12	Verkauf	USD	1 –
19/04/2022	Citi	Kauf	EUR	2.500	Verkauf	USD	2.837 (29)
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.003	Verkauf	AUD	2.770 (11)
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	4.828	Verkauf	GBP	3.560 51
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.327	Verkauf	NZD	1.960 2
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.827	Verkauf	RUB	216.722 915
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	NOK	3.869	Verkauf	USD	443 (4)
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	CAD	1.220	Verkauf	USD	961 2
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	NZD	1.750	Verkauf	USD	1.174 10
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	RUB	523.272	Verkauf	USD	6.732 (2.112)
19/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD	1.050	Verkauf	AUD	1.440 4
19/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD	2.740	Verkauf	AUD	3.820 (38)
19/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD	436	Verkauf	CNH	2.800 (6)
19/04/2022	JP Morgan	Kauf	AUD	10.373	Verkauf	USD	7.360 180
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	946	Verkauf	CAD	1.200 (1)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	5.591	Verkauf	CAD	7.020 51
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	481	Verkauf	GBP	350 11
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	2.491	Verkauf	JPY	288.100 (18)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.317	Verkauf	JPY	150.414 7
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	887	Verkauf	MXN	18.190 6
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.405	Verkauf	NOK	12.240 17
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	444	Verkauf	RUB	34.000 144
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	CAD	1.660	Verkauf	USD	1.310 –
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	CAD	11.923	Verkauf	USD	9.363 45
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	JPY	150.290	Verkauf	USD	1.308 1
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	EUR	1.420	Verkauf	USD	1.619 (23)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	RUB	182.770	Verkauf	USD	2.330 (717)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	MXN	5.735	Verkauf	USD	277 1
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	NZD	3.719	Verkauf	USD	2.534 (19)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1	Verkauf	ZAR	12 –
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 22.104 USD)							\$ 5.345
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (949) USD)							(7.240)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 21.155 USD)							\$ (1.895)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
90 Day Euro\$ December 2022	Bank of America Merrill Lynch	156	\$38.327	\$ (144)
90 Day Euro\$ December 2023	Bank of America Merrill Lynch	927	226.779	(1.281)
Australia 10 Year Bond March 2022	Bank of America Merrill Lynch	13	1.270	(43)
Euro-Bund March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(26)	(4.869)	193
Euro-Buxl 30 Year Bond March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(222)	17
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(640)	(81.560)	(598)
U.S. 10 Year Ultra Note June 2022	Bank of America Merrill Lynch	19	2.685	29
U.S. 2 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	375	80.710	174
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(88)	(10.409)	(37)
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(78)	(12.221)	(136)
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	157	29.192	361
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 2.034 USD)				\$ 774
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (2.125) USD)				(2.239)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (91) USD)				\$ (1.465)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Asset-Backed Securities – 19,51 % (28. Februar 2021: 14,45 %)</b>					
1.190 Accredited Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class M5, 3,487 %, fällig 25/04/2035 *	1.218	0,11	1.350 Loanpal Solar Loan Ltd, Series 2020 3GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig 20/12/2047	1.253	0,12
4.560 Aegis Asset Backed Securities Trust 2005-3, Series 2005 3, Class M3, 0,922 %, fällig 25/08/2035 *	4.335	0,41	37 Long Beach Mortgage Loan Trust 2002-2, Series 2002 2, Class M2, 1,908 %, fällig 25/07/2032 *	36	–
26 AFC Trust Series 2000-3, Series 2000 3, Class 1A, 144A, 0,937 %, fällig 25/10/2030 *	25	–	4.799 Magnolia Finance, 0,000 %, fällig 09/08/2024	4.693	0,44
2.213 Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2019 1A, Class A2I, 144A, 4,194 %, fällig 05/06/2049	2.216	0,21	102 Mastr Specialized Loan Trust, Series 2006 2, Class A, 144A, 0,707 %, fällig 25/02/2036 *	100	0,01
7.920 Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2019 1A, Class A2II, 144A, 4,723 %, fällig 05/06/2049	7.984	0,75	5 Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust Series 2003-SD1, Series 2003 SD1, Class A1, 1,187 %, fällig 25/03/2033 *	5	–
4.210 Asset Backed Securities Corp Home Equity Loan Trust Series OOMC 2006-HE5, Series 2006 HE5, Class M1, 0,467 %, fällig 25/07/2036 *	3.654	0,35	1.367 Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, Series 2018 1A, Class CERT, 144A, 0,000 %, fällig 22/06/2043**	781	0,07
8.500 Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2020 1A, Class D, 144A, 3,340 %, fällig 20/08/2026	8.204	0,78	3.000 National Collegiate II Commutation Trust, Series 2005 AR15, Class AR15, 0,000 %, fällig 01/06/2045	536	0,05
2.390 BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Series 1996 1, Class B1, 7,875 %, fällig 10/10/2026	178	0,02	1.370 National Collegiate Student Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class B, 0,567 %, fällig 26/03/2035 *	1.246	0,12
805 Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Series 2007 B, Class 1A2, 7,331 %, fällig 28/08/2047	762	0,07	10.796 National Collegiate Student Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class B, 0,687 %, fällig 27/07/2037 *	8.750	0,83
1.244 Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Series 2007 B, Class 1A3, 7,719 %, fällig 28/08/2047	432	0,04	1.590 National Collegiate Student Loan Trust 2006-1, Series 2006 1, Class A5, 0,537 %, fällig 25/03/2033 *	1.540	0,15
116 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Series 2005 CL1, Class A1, 0,500 %, fällig 25/09/2034 *	113	0,01	2.500 National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Series 2006 3, Class B, 0,547 %, fällig 26/01/2032 *	2.074	0,20
3.751 Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Series 2016 1A, Class B, 144A, 5,682 %, fällig 16/12/2041	3.517	0,33	5.678 National Collegiate Student Loan Trust 2006-4, Series 2006 4, Class A4, 0,497 %, fällig 25/05/2032 *	5.513	0,52
4.189 Citigroup Mortgage Loan Trust Inc, Series 2006 WFH2, Class M3, 0,652 %, fällig 25/08/2036 *	4.094	0,39	5.987 National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A5, Class 10, 144A, 0,000 %, fällig 25/03/2038 *	1.484	0,14
2.025 Citigroup Mortgage Loan Trust Series 2004-OPT1 Asset Backed Pass-Through Certifi, Series 2004 OPT1, Class M5, 1,762 %, fällig 25/10/2034 *	2.003	0,19	6.140 National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A6, Class 10, 144A, 0,000 %, fällig 25/03/2038 *	1.522	0,14
5.602 Conseqo Finance Securitizations Corp, Series 2000 3, Class A, 144A, 8,260 %, fällig 01/12/2030 *	1.951	0,18	8.716 NRZ Excess Spread-Collateralized Notes, Series 2021 FHT1, Class A, 144A, 3,104 %, fällig 25/07/2026	8.435	0,80
952 Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2007 SD1, Class A1, 144A, 1,087 %, fällig 25/03/2047 *	842	0,08	1.468 Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Series 2007 FXD1, Class 3A4, 5,860 %, fällig 25/01/2037	1.452	0,14
1.811 Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC, Series 2007 MX1, Class A4, 144A, 6,231 %, fällig 25/12/2036	1.847	0,17	929 Owinit Mortgage Loan Trust Series 2005-3, Series 2005 3, Class M1, 0,862 %, fällig 25/06/2036 *	930	0,09
4.373 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B1, 144A, 2,975 %, fällig 25/07/2057 *	4.019	0,38	1.116 PFCa Home Equity Investment Trust, Series 2003 IFC6, Class A, 144A, 4,683 %, fällig 22/04/2035 *	1.127	0,11
5.017 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B2, 144A, 2,975 %, fällig 25/07/2057 *	4.441	0,42	2.545 Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-2, Series 2005 2, Class M2, 6,217 %, fällig 25/04/2035	2.300	0,22
4.266 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B3, 144A, 2,975 %, fällig 25/07/2057 *	3.248	0,31	2.578 Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-5, Series 2005 5, Class MV2, 1,132 %, fällig 25/11/2035 *	2.486	0,23
4.471 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B4, 144A, 2,975 %, fällig 25/07/2057 *	979	0,09	4.135 RASC Series 2005-KS12 Trust, Series 2005 KS12, Class M4, 1,147 %, fällig 25/01/2036 *	4.018	0,38
1.888 CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-9, Series 2004 9, Class MF2, 5,572 %, fällig 25/11/2034 *	1.918	0,18	3.900 RASC Series 2006-KS2 Trust, Series 2006 KS2, Class M3, 0,802 %, fällig 25/03/2036 *	3.812	0,36
993 CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-B, Series 2004 B, Class 2A, 0,411 %, fällig 15/02/2029 *	948	0,09	3.000 Saxon Asset Securities Trust 2005-3, Series 2005 3, Class M4, 1,087 %, fällig 25/11/2035 *	2.846	0,27
102 CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-J, Series 2004 J, Class 1A, 0,481 %, fällig 15/12/2033 *	100	0,01	5.435 Saxon Asset Securities Trust 2006-2, Series 2006 2, Class M2, 0,487 %, fällig 25/09/2036 *	4.854	0,46
1.821 Dividend Solar Loans 2018-1 LLC, Series 2018 1, Class D, 144A, 6,390 %, fällig 20/07/2038	1.860	0,18	120 SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F LLC, Series 2017 F, Class R1, 144A, 0,000 %, fällig 25/01/2041	2.587	0,24
3.540 Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Series 2018 2, Class D, 144A, 5,910 %, fällig 20/12/2038	3.517	0,33	1 Southern Pacific Secured Asset Corp, Series 1998 1, Class A7, 6,510 %, fällig 25/12/2027 *	1	–
4.869 Firststone Mortgage Investment Trust Series 2005-2, Series 2005 2, Class M3, 0,967 %, fällig 25/12/2035 *	4.752	0,45	1.858 Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class A, 144A, 2,675 %, fällig 28/02/2033	1.817	0,17
4 First Franklin Mortgage Loan Trust 2002-FF1, Series 2002 FF1, Class 1A2, 1,231 %, fällig 25/04/2032 *	4	–	4.655 Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class B, 144A, 3,821 %, fällig 28/02/2033	4.540	0,43
6.949 Fremont Home Loan Trust 2006-B, Series 2006 B, Class 1A, 0,337 %, fällig 25/08/2036 *	3.355	0,32	3.291 Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, Series 2005 9XS, Class M2, 1,083 %, fällig 25/06/2035 *	3.255	0,31
2.750 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Series 2021 4GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig 20/07/2048	2.633	0,25	3.197 Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-WF4, Series 2005 WF4, Class M8, 2,812 %, fällig 25/11/2035 *	3.255	0,31
3.500 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2022-1, Series 2022 1GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig 20/01/2049	3.346	0,32	1.710 Structured Asset Securities Corp Trust 2005-SC1, Series 2005 SC1, Class 1A1, 144A, 0,457 %, fällig 25/05/2031 *	1.314	0,12
3.794 HERO Funding Trust 2016-1, Series 2016 1A, Class R, 144A, 0,000 %, fällig 20/09/2041	640	0,06	5.061 Sunnova Sol Issuer LLC, Series 2020 1A, Class B, 144A, 5,540 %, fällig 01/02/2055	5.016	0,47
1.195 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1, Class C, 144A, 1,826 %, fällig 16/06/2036 *	1.187	0,11	3.900 Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Class B2, 144A, 3,266 %, fällig 25/03/2058 *	3.887	0,37
1.190 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1, Class D, 144A, 2,476 %, fällig 16/06/2036 *	1.182	0,11	7.118 Towd Point Mortgage Trust 2018-4, Series 2018 4, Class B2, 144A, 3,240 %, fällig 25/06/2058 *	6.572	0,62
500 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1, Class E, 144A, 3,076 %, fällig 16/06/2036 *	498	0,05	4.738 TRTX 2022-FL5 Issuer Ltd, Series 2022 FL5, Class E, 144A, 4,400 %, fällig 15/02/2039 *	4.732	0,45
2.650 Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2005-B, Series 2005 B, Class M6, 1,252 %, fällig 25/08/2035 *	2.620	0,25	3.858 Vivint Solar Financing VI LLC, Series 2018 2A, Class B, 144A, 5,258 %, fällig 29/08/2023 *	3.831	0,36
6.429 Home Partners of America 2021-2 Trust, Series 2021 2, Class F, 144A, 3,799 %, fällig 17/12/2026	6.108	0,58	<b>Summe der vermögensgesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 210.521 USD)</b>		
1.538 KeyCorp Student Loan Trust 2004-A, Series 2004 A, Class 1B, 0,698 %, fällig 27/01/2043 *	1.490	0,14	<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere — 73,99 % (28. Februar 2021: 73,52 %)</b>		
7.910 KeyCorp Student Loan Trust 2005-A, Series 2005 A, Class 2C, 1,520 %, fällig 27/12/2038 *	7.672	0,72	522 Alternative Loan Trust 2005-56, Series 2005 56, Class 4A1, 0,807 %, fällig 25/11/2035 *	502	0,05
1.653 Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Series 2021 1GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig 20/01/2048	1.549	0,15	505 Alternative Loan Trust 2005-59, Series 2005 59, Class 1A1, 0,831 %, fällig 20/11/2035 *	485	0,05
2.520 Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Series 2021 2GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig 20/03/2048	2.334	0,22	1.290 Alternative Loan Trust 2005-80CB, Series 2005 80CB, Class 2A1, 6,000 %, fällig 25/02/2036	1.297	0,12
			2.336 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A14, 6,000 %, fällig 25/08/2036	1.784	0,17
			594 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A15, 6,000 %, fällig 25/08/2036	454	0,04

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>					
608 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A16, 6,000 %, fällig 25/08/2036	465	0,04	553 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11, Series 2005 11, Class 6A1, 0,787 %, fällig 25/03/2035 *	439	0,04
689 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A20, 36,079 %, fällig 25/08/2036 *	834	0,08	245 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-25, Series 2005 25, Class A15, 27,642 %, fällig 25/11/2035 *	258	0,02
666 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A24, 6,000 %, fällig 25/08/2036	508	0,05	2.210 CHT2017-COSMO Mortgage Trust, Series 2017 CSMO, Class E, 144A, 3,191 %, fällig 15/11/2036 *	2.205	0,21
847 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A3, 6,000 %, fällig 25/08/2036 *	647	0,06	996 Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2007-3, Series 2007 3, Class 1A4, 6,000 %, fällig 25/04/2037	994	0,09
90 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A7, 6,000 %, fällig 25/08/2036	69	0,01	9.200 Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Series 2006 AR6, Class 2A4, 0,627 %, fällig 25/09/2036 *	3.208	0,30
404 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A8, 6,000 %, fällig 25/08/2036	308	0,03	773 Citigroup Mortgage Loan Trust 2008-3, Series 2008 3, Class A3, 144A, 6,100 %, fällig 25/04/2037	385	0,04
4.997 Alternative Loan Trust 2006-28CB, Series 2006 28CB, Class A12, 5,713 %, fällig 25/10/2036 **	1.223	0,12	3.529 Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-J2, Series 2014 J2, Class B5, 144A, 3,849 %, fällig 25/11/2044 *	3.409	0,32
6.732 Alternative Loan Trust 2007-12T1, Series 2007 12T1, Class A3, 6,000 %, fällig 25/06/2037	4.524	0,43	3.250 COLT 2021-RPL1 Trust, Series 2021 RPL1, Class B1, 144A, 4,812 %, fällig 25/09/2061 *	3.158	0,30
1.009 Alternative Loan Trust 2007-23CB, Series 2007 23CB, Class A8, 27,653 %, fällig 25/09/2037*	1.164	0,11	1.908 Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, Series 2014 UBS2, Class E, 144A, 5,004 %, fällig 10/03/2047 **	1.598	0,15
7.006 Alternative Loan Trust 2007-5CB, Series 2007 5CB, Class 1A20, 5,273 %, fällig 25/04/2037 **	1.652	0,16	6.500 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 4,287 %, fällig 25/07/2039 *	6.490	0,61
4.000 Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF, Series 2018 ASHF, Class E, 144A, 3,291 %, fällig 15/04/2035 *	3.803	0,36	8.330 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 3,587 %, fällig 25/10/2039 *	8.131	0,77
5.000 Ashford Hospitality Trust 2018-KEYS, Series 2018 KEYS, Class C, 144A, 2,042 %, fällig 15/06/2035 *	4.945	0,47	6.360 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Class 1B1, 144A, 3,437 %, fällig 25/01/2040 *	6.045	0,57
5.579 BAML Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Series 2016 GG10, Class AJA, 144A, 5,831 %, fällig 10/08/2045 *	2.288	0,22	4.500 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Series 2020 SBT1, Class 1M2, 144A, 3,837 %, fällig 25/02/2040 *	4.642	0,44
8.244 Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3, Series 2017 BNK3, Class E, 144A, 4,495 %, fällig 15/02/2050 *	6.468	0,61	8.760 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1B1, 144A, 3,149 %, fällig 25/10/2041 *	8.272	0,78
2.253 Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Series 2015 R4, Class 4A2, 144A, 4,500 %, fällig 27/01/2030 *	2.305	0,22	122 Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Series 2005 C2, Class AMFX, 4,877 %, fällig 15/04/2037	122	0,01
3.672 Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Series 2015 R4, Class 4A3, 144A, 8,065 %, fällig 27/01/2030 *	1.326	0,13	347 CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series 2004-AR5, Series 2004 AR5, Class CB2, 2,573 %, fällig 25/06/2034 *	276	0,03
9.000 BBCCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Class F, 144A, 4,563 %, fällig 10/08/2033 *	8.170	0,77	12.200 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class E, 144A, 4,373 %, fällig 15/09/2037	10.617	1,00
6.650 BBCCRE Trust 2018-BXH, Series 2018 BXH, Class C, 144A, 1,691 %, fällig 15/10/2037 *	6.511	0,62	9.200 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class F, 144A, 4,373 %, fällig 15/09/2037	7.031	0,66
898 BCAP LLC2011-RR2 Trust, Series 2011 RR2, Class 1A4, 144A, 2,889 %, fällig 26/07/2036 *	491	0,05	2.361 CSMC 2017-RPL3 Trust, Series 2017 RPL3, Class B3, 144A, 4,374 %, fällig 01/08/2057 *	2.456	0,23
6.475 BCAP LLC2014-RR2, Series 2014 RR2, Class 10A2, 144A, 0,528 %, fällig 26/07/2046 *	6.257	0,59	6.359 CSMC 2017-RPL3 Trust, Series 2017 RPL3, Class B4, 144A, 4,374 %, fällig 01/08/2057 *	6.451	0,61
5.308 BCAP LLC2014-RR2, Series 2014 RR2, Class 11A2, 144A, 0,274 %, fällig 26/05/2037 *	5.055	0,48	8.208 CSMC Mortgage-Backed Trust 2006-7, Series 2006 7, Class 11A2, 6,313 %, fällig 25/08/2036 **	2.500	0,24
1.123 BCAP LLC Trust 2007-AA3, Series 2007 AA3, Class 1A2, 0,727 %, fällig 25/04/2037 *	1.379	0,13	143 CSMC Resecuritization Trust 2006-1R, Series 2006 1R, Class 1A2, 144A, 18,951 %, fällig 27/07/2036 *	195	0,02
1.503 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-AC6, Series 2004 AC6, Class A1, 5,750 %, fällig 25/11/2034	1.456	0,14	4.638 CSMC Series 2015-2R, Series 2015 2R, Class 7A2, 144A, 2,610 %, fällig 27/08/2036 *	4.118	0,39
2.254 Bellemeade Re 2017-1 Ltd, Series 2017 1, Class M2, 144A, 3,537 %, fällig 25/10/2027 *	2.267	0,21	4.282 CSMC Trust 2013-IVR5, Series 2013 IVR5, Class B5, 144A, 3,612 %, fällig 25/10/2043 *	3.858	0,36
3.813 Bellemeade Re 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Class M2, 144A, 3,087 %, fällig 25/04/2028 *	3.801	0,36	11.730 CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class F, 144A, 4,541 %, fällig 15/07/2032 *	11.056	1,05
6.676 Bellemeade Re 2018-3 Ltd, Series 2018 3A, Class B1, 144A, 4,087 %, fällig 25/10/2028 *	6.560	0,62	5.900 CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class H, 144A, 7,541 %, fällig 15/07/2032 *	4.947	0,47
5.810 Bellemeade Re 2018-3 Ltd, Series 2018 3A, Class M2, 144A, 2,937 %, fällig 25/10/2028 *	5.761	0,55	26.368 CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class B7, 144A, 5,117 %, fällig 25/02/2048 *	25.253	2,39
3.000 BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Class C, 144A, 2,091 %, fällig 15/07/2035 *	2.953	0,28	- CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class SA, 144A, 0,000 %, fällig 25/02/2048	-	-
24.000 BHMS 2018-MZB, Series 2018 MZB, Class MZB, 144A, 6,828 %, fällig 15/07/2025 *	23.072	2,18	4.000 CSWF 2018-TOP, Series 2018 TOP, Class H, 144A, 3,604 %, fällig 15/08/2035 *	3.893	0,37
2.018 BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA, Series 2018 BIOA, Class D, 144A, 1,512 %, fällig 15/03/2037 *	1.995	0,19	2.100 DBUS 2011-LC3 Mortgage Trust, Series 2011 LC3A, Class G, 144A, 3,750 %, fällig 10/08/2044 †	-	-
2.008 BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA, Series 2018 BIOA, Class E, 144A, 2,142 %, fällig 15/03/2037 *	1.984	0,19	695 DSLA Mortgage Loan Trust 2004-AR4, Series 2004 AR4, Class 2A2B, 1,011 %, fällig 19/01/2045 *	483	0,05
4.500 BX Trust 2018-GW MZ, Series 2018 GWMZ, Class MC, 144A, 5,679 %, fällig 15/05/2037 *	4.227	0,40	1.810 DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR3, Series 2005 AR3, Class 2A1B, 0,651 %, fällig 19/07/2045 *	1.774	0,17
1.750 BX Trust 2018-GW, Series 2018 GW, Class G, 144A, 3,111 %, fällig 15/05/2035 *	1.695	0,16	2.624 DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR5, Series 2005 AR5, Class 2A1B, 0,851 %, fällig 19/09/2045 *	2.468	0,23
2.250 BX Trust 2021-VIEW, Series 2021 VIEW, Class D, 144A, 3,091 %, fällig 15/06/2023 *	2.207	0,21	484 DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Series 2007 AR1, Class 2A1B, 0,351 %, fällig 19/04/2047 *	588	0,06
870 BX Trust 2021-VIEW, Series 2021 VIEW, Class E, 144A, 3,791 %, fällig 15/06/2023 *	842	0,08	5.336 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C01, Class 1B, 11,937 %, fällig 25/08/2028 *	5.942	0,56
1.055 Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2004-4, Series 2004 4A, Class B1, 144A, 0,645 %, fällig 25/10/2035 *	816	0,08	3.664 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C02, Class 1B, 12,437 %, fällig 25/09/2028 *	4.185	0,40
420 Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2005-1, Series 2005 1A, Class A2, 144A, 0,387 %, fällig 25/01/2036 *	397	0,04	2.941 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C03, Class 1B, 11,937 %, fällig 25/10/2028 *	3.339	0,32
547 Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2005-B, Series 2005 BA, Class B1, 144A, 0,587 %, fällig 25/06/2036 *	494	0,05	4.880 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C04, Class 1B, 10,437 %, fällig 25/01/2029 *	5.369	0,51
468 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2004-25, Series 2004 25, Class 2A1, 0,867 %, fällig 25/02/2035 *	439	0,04	7.168 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C06, Class 1B, 9,437 %, fällig 25/04/2029 *	7.814	0,74
448 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11, Series 2005 11, Class 3A3, 2,500 %, fällig 25/04/2035 *	370	0,03	3.500 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C01, Class 1B1, 5,937 %, fällig 25/07/2029 *	3.858	0,36
			2.550 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05, Class 1B1, 3,787 %, fällig 25/01/2030 *	2.582	0,24
			8.696 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05, Class 1M2C, 2,387 %, fällig 25/01/2030 *	8.791	0,83

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>					
6.000 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C06, Class 1B1, 4,337 %, fällig 25/02/2030 *	6.340	0,60	27.113 GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Class D, 144A, 6,441 %, fällig 15/09/2031 *	6.882	0,65
3.210 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C07, Class 1B1, 4,187 %, fällig 25/05/2030 *	3.287	0,31	6.500 GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, Series 2018 3PCK, Class B, 144A, 2,691 %, fällig 15/09/2031 *	6.375	0,60
5.060 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1B1, 3,937 %, fällig 25/10/2030 *	5.113	0,48	5.000 GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-LUAI, Series 2018 LUAI, Class G, 144A, 4,641 %, fällig 15/11/2032 *	4.923	0,47
3.426 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1M2C, 2,337 %, fällig 25/10/2030 *	3.505	0,33	1.250 GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26, Series 2014 GC26, Class D, 144A, 4,524 %, fällig 10/11/2047 *	899	0,08
6.088 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05, Class 1B1, 4,437 %, fällig 25/01/2031 *	6.193	0,59	4.250 GSMSR Resecuritization Trust 2014-2R, Series 2014 2R, Class 3B, 144A, 0,712 %, fällig 26/11/2037 *	3.832	0,36
7.750 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C06, Class 1B1, 3,937 %, fällig 25/03/2031 *	7.727	0,73	5.057 GSR Mortgage Loan Trust 2006-1F, Series 2006 1F, Class 6A1, 0,587 %, fällig 25/02/2036 *	324	0,03
2.145 Fannie Mae REMICS, Series 2017 85, Class SC, 6,013 %, fällig 25/11/2047 *	358	0,03	97 HarborView Mortgage Loan Trust 2004-11, Series 2004 11, Class 3A3, 0,931 %, fällig 19/01/2035 *	90	0,01
6.840 Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Series 2021 MN2, Class M2, 144A, 3,399 %, fällig 25/07/2041 *	6.321	0,60	59 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class 2A1A, 0,711 %, fällig 19/03/2035 *	59	0,01
6.605 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K038, Class X3, 2,489 %, fällig 25/06/2042 *	327	0,03	279 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-10, Series 2005 10, Class 2A1A, 0,791 %, fällig 19/11/2035 *	243	0,02
19.370 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K052, Class X3, 1,614 %, fällig 25/01/2044 *	1.057	0,10	482 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-2, Series 2005 2, Class 2A1A, 0,611 %, fällig 19/05/2035 *	465	0,04
9.000 Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, Series 2020 DNA1, Class B2, 144A, 5,437 %, fällig 25/01/2050 *	8.736	0,83	272 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class 2A1A, 0,651 %, fällig 19/06/2035 *	272	0,03
8.000 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Series 2020 DNA2, Class B2, 144A, 4,987 %, fällig 25/02/2050 *	7.461	0,71	2.559 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-8, Series 2005 8, Class 2A2, 1,604 %, fällig 19/09/2035 *	2.347	0,22
5.530 Freddie Mac STACR Remic Trust 2021-DNA5, Series 2021 DNA5, Class B2, 144A, 5,549 %, fällig 25/01/2034 *	5.046	0,48	543 HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10, Series 2006 10, Class 2A1A, 0,283 %, fällig 19/11/2036 *	533	0,05
7.520 Freddie Mac STACR Remic Trust 2021-DNA6, Series 2021 DNA6, Class B2, 144A, 7,549 %, fällig 25/10/2041 *	7.217	0,68	2.876 HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10, Series 2006 10, Class 2A1B, 0,343 %, fällig 19/11/2036 *	2.878	0,27
4.620 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA1, Series 2019 DNA1, Class B2, 144A, 10,937 %, fällig 25/01/2049 *	5.039	0,48	1.074 Impac CMB Trust Series 2005-1, Series 2005 1, Class M1, 0,877 %, fällig 25/04/2035 *	1.053	0,10
2.250 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA2, Series 2019 DNA2, Class B2, 144A, 10,687 %, fällig 25/03/2049 *	2.419	0,23	1.934 Impac CMB Trust Series 2005-3, Series 2005 3, Class A2, 0,787 %, fällig 25/08/2035 *	1.836	0,17
4.600 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Series 2019 DNA3, Class B1, 144A, 3,437 %, fällig 25/07/2049 *	4.575	0,43	894 Impac CMB Trust Series 2005-4, Series 2005 4, Class 1M1, 0,832 %, fällig 25/05/2035 *	882	0,08
6.100 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Series 2019 DNA3, Class B2, 144A, 8,337 %, fällig 25/07/2049 *	6.320	0,60	1.340 Impac CMB Trust Series 2005-7, Series 2005 7, Class A1, 0,707 %, fällig 25/11/2035 *	1.271	0,12
5.550 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Series 2019 DNA4, Class B2, 144A, 6,437 %, fällig 25/10/2049 *	5.515	0,52	2.807 Impac Secured Assets Corp Series 2004-4, Series 2004 4, Class M5, 1,837 %, fällig 25/02/2035 *	2.718	0,26
7.000 Freddie Mac Stacr Trust 2019-FTR4, Series 2019 FTR4, Class B2, 144A, 5,187 %, fällig 25/11/2047 *	6.532	0,62	1.268 Impac Secured Assets Trust 2006-2, Series 2006 2, Class 2B, 1,837 %, fällig 25/08/2036 *	1.292	0,12
4.933 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA1, Class B, 10,187 %, fällig 25/07/2028 *	5.477	0,52	650 Impac Secured Assets Trust 2006-2, Series 2006 2, Class 2M3, 1,837 %, fällig 25/08/2036 *	656	0,06
2.512 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA2, Class B, 10,687 %, fällig 25/10/2028 *	2.880	0,27	5.300 Independence Plaza Trust 2018-INDP, Series 2018 INDP, Class B, 144A, 3,911 %, fällig 10/07/2035	5.343	0,50
2.550 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA3, Class B, 11,437 %, fällig 25/12/2028 *	2.969	0,28	691 IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR13, Series 2005 AR13, Class 1A1, 2,772 %, fällig 25/08/2035 *	466	0,04
5.494 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA4, Class B, 8,787 %, fällig 25/03/2029 *	5.812	0,55	732 IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR2, Series 2005 AR2, Class 2A1B, 0,967 %, fällig 25/02/2035 *	599	0,06
6.926 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2017 DNA2, Class B2, 11,437 %, fällig 25/10/2029 *	7.308	0,69	1.894 IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR6, Series 2005 AR6, Class 2A2, 0,847 %, fällig 25/04/2035 *	1.646	0,16
6.458 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2017 HRP1, Class B2D, 3,187 %, fällig 25/12/2042 *	4.352	0,41	9.650 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Series 2017 FL11, Class E, 144A, 4,211 %, fällig 15/10/2032 *	9.351	0,88
5.500 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SPI1, Class B, 144A, 3,726 %, fällig 25/02/2048 *	5.200	0,49	2.250 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Series 2017 FL11, Class F, 144A, 5,511 %, fällig 15/10/2032 *	2.017	0,19
5.884 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SPI2, Class B, 144A, 3,804 %, fällig 25/05/2048 *	5.654	0,53	3.000 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-ASH8, Series 2018 ASH8, Class C, 144A, 1,641 %, fällig 15/02/2035 *	2.965	0,28
10.546 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SPI3, Class B, 144A, 4,146 %, fällig 25/08/2048 *	10.143	0,96	28.545 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Series 2018 PHMZ, Class M, 144A, 8,549 %, fällig 15/06/2035 *†	1.429	0,14
29.917 FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Series 2018 SB48, Class B, 144A, 3,663 %, fällig 25/02/2038 *	23.406	2,21	830 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012-C8, Series 2012 C8, Class E, 144A, 4,672 %, fällig 15/10/2045 *	772	0,07
749 Government National Mortgage Association, Series 2010 102, Class IO, 0,010 %, fällig 16/06/2052 *	-	-	4.022 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-FL7, Series 2015 FL7, Class D, 144A, 1,636 %, fällig 15/05/2028 *	3.602	0,34
3.976 Government National Mortgage Association, Series 2010 13, Class IO, 0,000 %, fällig 16/11/2051 *	-	-	6.800 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Series 2018 WPT, Class GFL, 144A, 3,761 %, fällig 05/07/2033 *	6.670	0,63
5.762 Government National Mortgage Association, Series 2011 127, Class IO, 0,074 %, fällig 16/03/2047 *	12	-	6.574 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Class G, 144A, 4,441 %, fällig 15/12/2036 *	5.934	0,56
16.215 Government National Mortgage Association, Series 2011 95, Class IO, 0,000 %, fällig 16/04/2051 *	-	-	6.867 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Class H, 144A, 6,941 %, fällig 15/12/2036 *	5.868	0,55
11.660 Government National Mortgage Association, Series 2012 114, Class IO, 0,661 %, fällig 16/01/2053 *	237	0,02	2.048 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-NNN MZ, Series 2020 NNNZ, Class M, 144A, 8,542 %, fällig 16/01/2037	1.884	0,18
4.262 Government National Mortgage Association, Series 2013 163, Class IO, 1,023 %, fällig 16/02/2046 *	94	0,01	4.000 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2021-NYMZ, Series 2021 NYMZ, Class M, 144A, 7,441 %, fällig 15/06/2026 *	3.991	0,38
7.969 Government National Mortgage Association, Series 2014 16, Class IO, 0,499 %, fällig 16/06/2055 *	146	0,01	3.914 JP Morgan Mortgage Trust 2007-S3, Series 2007 S3, Class 1A18, 0,687 %, fällig 25/08/2037 *	1.416	0,13
7.673 Government National Mortgage Association, Series 2014 171, Class IO, 0,453 %, fällig 16/11/2055 *	110	0,01	12.419 JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Series 2018 4, Class AX1, 144A, 0,227 %, fällig 25/10/2048 *†	18	-
871 Government National Mortgage Association, Series 2014 47, Class IA, 0,143 %, fällig 16/02/2048 *	9	-	13.054 JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Class AX1, 144A, 0,250 %, fällig 25/10/2048 *†	29	-
4.642 Government National Mortgage Association, Series 2014 50, Class IO, 0,599 %, fällig 16/09/2055 *	139	0,01			
771 Government National Mortgage Association, Series 2016 135, Class SB, 5,974 %, fällig 16/10/2046 *	190	0,02			
798 Government National Mortgage Association, Series 2016 51, Class NS, 5,888 %, fällig 20/04/2046 *	136	0,01			
4.226 Government National Mortgage Association, Series 2018 125, Class HS, 6,088 %, fällig 20/09/2048 *	590	0,06			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>					
6.856 JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Class B3, 144A, 3,750 %, fällig 25/10/2048 *	6.965	0,66	5.710 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, Series 2017 2, Class M1, 144A, 4,000 %, fällig 25/08/2056 *	5.710	0,54
4.173 JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Class B4, 144A, 3,750 %, fällig 25/10/2048 *	4.063	0,38	4.457 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, Series 2017 2, Class M2, 144A, 4,000 %, fällig 25/08/2056 *	4.464	0,42
1.952 JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Class B5, 144A, 3,750 %, fällig 25/10/2048 *	1.823	0,17	455.990 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, Series 2017 2, Class XSIO, 144A, 0,075 %, fällig 25/08/2056 *†	1.230	0,12
2.728 JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Class B6, 144A, 3,750 %, fällig 25/10/2048 *	2.257	0,21	6.500 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3, Series 2017 3, Class M2, 144A, 4,750 %, fällig 25/07/2056 *	6.545	0,62
5.420 JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C25, Series 2014 C25, Class D, 144A, 3,939 %, fällig 15/11/2047 *	4.288	0,41	2.937 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1, Series 2018 1, Class M, 4,750 %, fällig 25/05/2057 *	2.961	0,28
16 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-15, Series 2004 15, Class 6A1, 0,517 %, fällig 25/12/2034 *	16	–	11.553 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-2, Series 2018 2, Class BX, 3,768 %, fällig 25/11/2057 *	5.785	0,55
1.964 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-6, Series 2004 6, Class B1, 2,260 %, fällig 25/07/2034 *	1.951	0,18	16.229 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3, Series 2018 3, Class BX, 144A, 3,023 %, fällig 25/08/2057 *	7.323	0,69
1.252 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-8, Series 2004 8, Class B1, 2,256 %, fällig 25/09/2034 *	1.167	0,11	2.630 STACR Trust 2018-DNA3, Series 2018 DNA3, Class B1, 144A, 4,087 %, fällig 25/09/2048 *	2.629	0,25
802 MASTR Reperforming Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class 1A1, 144A, 6,000 %, fällig 25/08/2034	656	0,06	6.000 STACR Trust 2018-DNA3, Series 2018 DNA3, Class B2, 144A, 7,937 %, fällig 25/09/2048 *	6.285	0,59
929 MASTR Reperforming Loan Trust 2005-2, Series 2005 2, Class 1A1F, 144A, 0,537 %, fällig 25/05/2035 *	483	0,05	650 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class D, 144A, 3,692 %, fällig 15/11/2027 *†	–	–
381 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Series 2007 5, Class AJ, 5,450 %, fällig 12/08/2048 *	187	0,02	14.332 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class E, 144A, 4,592 %, fällig 15/11/2027 *†	–	–
188 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Series 2007 5, Class AJFL, 144A, 5,450 %, fällig 12/08/2048 *	92	0,01	5.571 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust Series 2005-19XS, Series 2005 19XS, Class 1A2B, 0,547 %, fällig 25/10/2035 *	5.394	0,51
5.000 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32, Series 2016 C32, Class D, 144A, 3,396 %, fällig 15/12/2049 *	3.966	0,37	355 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Series 2004 2, Class 1A1, 2,874 %, fällig 25/03/2034 *	356	0,03
2.012 Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-11AR, Series 2004 11AR, Class 1B1, 0,787 %, fällig 25/01/2035 *	1.715	0,16	714 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Series 2005 8XS, Class M1, 0,832 %, fällig 25/04/2035 *	707	0,07
3.539 Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-8AR, Series 2006 8AR, Class 1A3, 0,507 %, fällig 25/06/2036 *	1.022	0,10	3.725 Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR5, Series 2006 AR5, Class 4A1, 0,627 %, fällig 25/05/2046 *	1.371	0,13
5.000 MRA Issuance Trust 2021-EBO1, Series 2021 EBO1, Class A2X, 144A, 1,856 %, fällig 15/04/2022 *	5.014	0,47	66 Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR6, Series 2006 AR6, Class 1A1, 0,547 %, fällig 25/07/2046 *	59	0,01
775 Multifamily Trust 2016-1, Series 2016 1, Class B, 144A, 9,644 %, fällig 25/04/2046 *	844	0,08	5.266 Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Series 2018 THL, Class E, 144A, 3,592 %, fällig 11/11/2034 *	5.109	0,48
12.708 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class D, 144A, 4,398 %, fällig 15/08/2036 *	11.413	1,08	4.000 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-NYCH, Series 2018 NYCH, Class F, 144A, 4,012 %, fällig 15/02/2032 *	3.868	0,37
4.870 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class E, 144A, 4,398 %, fällig 15/08/2036 *	4.239	0,40	2.000 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-NYCH, Series 2018 NYCH, Class G, 144A, 5,029 %, fällig 15/02/2032 *	1.890	0,18
4.002 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-4, Series 2016 4A, Class B5, 144A, 4,843 %, fällig 25/11/2056 *	3.964	0,37	5.706 UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust 2012-C2, Series 2012 C2, Class G, 144A, 5,000 %, fällig 10/05/2063 *†	56	0,01
3.000 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Series 2021 NQM3, Class B2, 144A, 4,051 %, fällig 27/11/2056 *	2.903	0,27	990 UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust 2012-C2, Series 2012 C2, Class H, 144A, 5,000 %, fällig 10/05/2063 *†	–	–
4.212 Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Series 2015 4R, Class 4A7, 144A, 3,162 %, fällig 26/03/2037 *	4.259	0,40	3.499 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR11 Trust, Series 2005 AR11, Class B1, 1,102 %, fällig 25/08/2045 *	3.133	0,30
385 Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Series 2006 1, Class M1, 0,742 %, fällig 25/04/2036 *	2.583	0,24	678 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR15 Trust, Series 2005 AR15, Class A1C4, 0,987 %, fällig 25/11/2045 *	378	0,04
4.662 PMT Credit Risk Transfer Trust 2019-3R, Series 2019 3R, Class A, 144A, 2,808 %, fällig 27/10/2022 *	4.660	0,44	6.257 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR2 Trust, Series 2005 AR2, Class B1, 0,982 %, fällig 25/01/2045 *	5.310	0,50
4.951 PMT Credit Risk Transfer Trust 2020-1R, Series 2020 1R, Class A, 144A, 2,458 %, fällig 27/02/2023 *	4.945	0,47	1.236 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR9 Trust, Series 2005 AR9, Class B1, 1,132 %, fällig 25/07/2045 *	1.008	0,10
4.725 PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Series 2021 1R, Class A, 144A, 3,087 %, fällig 27/02/2024 *	4.802	0,45	1.343 Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Series 2015 SBC5, Class B, 144A, 7,140 %, fällig 14/09/2022 *	1.082	0,10
7.760 Radnor Re 2018-1 Ltd, Series 2018 1, Class M2, 144A, 2,887 %, fällig 25/03/2028 *	7.736	0,73	1.252 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22, Series 2014 C22, Class D, 144A, 3,899 %, fällig 15/09/2057 *	1.155	0,11
714 RALI Series 2006-QA2 Trust, Series 2006 QA2, Class 1A1, 0,437 %, fällig 25/02/2036 *	512	0,05	6.540 ZH Trust 2021-1, Series 2021 1, Class B, 144A, 3,262 %, fällig 18/02/2027	6.389	0,60
8.227 RBSGC Mortgage Loan Trust 2007-A, Series 2007 A, Class 3A1, 0,537 %, fällig 25/01/2037 *	1.170	0,11	<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 868.544 USD)</b>	<b>782.823</b>	<b>73,99</b>
13.526 Redwood Funding Trust 2019-1, Series 2019 1, Class PT, 144A, 4,213 %, fällig 27/09/2024	13.584	1,28	<b>Darlehensanleihen — 2,76 % (28. Februar 2021: 4,89 %)</b>		
1.409 Reperforming Loan REMIC Trust 2006-R2, Series 2006 R2, Class AF1, 144A, 0,607 %, fällig 25/07/2036 *	1.346	0,13	30.000 American Dream, – %, fällig 29/06/2024 *∞	9.741	0,92
3.782 Residential Asset Securitization Trust 2006-A7CB, Series 2006 A7CB, Class 1A3, 6,250 %, fällig 25/07/2036	3.675	0,35	2.935 Freehand Hotel, 4,750 %, fällig 17/12/2024 *∞	2.894	0,28
13.104 Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Series 2017 4, Class B, 144A, 0,000 %, fällig 25/06/2057 †	3.715	0,35	5.452 Freehand Hotel, 4,750 %, fällig 17/12/2024 *∞	5.377	0,51
20.009 Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Series 2017 4, Class BIO, 144A, 3,474 %, fällig 25/06/2057 *†	3.704	0,35	1.613 Freehand Hotel, 4,750 %, fällig 17/12/2024 *∞	1.591	0,15
4.425 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Class B, 144A, 0,000 %, fällig 25/09/2055 †	1.700	0,16	9.592 Sono Retail Loan, 4,265 %, fällig 06/08/2022 *∞	9.556	0,90
8.606 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Class BIO, 144A, 0,791 %, fällig 25/09/2055 *†	966	0,09	<b>Gesamtdarlehensanleihen (Anschaffungskosten 49.488 USD)</b>	<b>29.159</b>	<b>2,76</b>
4.153 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Class M2, 144A, 3,750 %, fällig 25/09/2055 *	4.146	0,39	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen — 3,43 % (28. Februar 2021: 5,34 %)</b>		
56.475 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Class XSIO, 144A, 0,075 %, fällig 25/09/2055 *†	137	0,01	36.257 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing) 36.257 3,43		
13.083 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, Series 2017 2, Class B, 144A, 0,000 %, fällig 25/08/2056 †	4.259	0,40	<b>Summe kollektiver Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 36.257 USD)</b>	<b>36.257</b>	<b>3,43</b>
22.114 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, Series 2017 2, Class BIO, 144A, 1,751 %, fällig 25/08/2056 *†	2.467	0,23	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.164.810 USD)</b>	<b>1.054.614</b>	<b>99,69</b>
			<b>Credit Default Swaps – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,01 %)</b>		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	144	0,01
			<b>Zinsswaps – 0,03 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	256	0,03
			<b>Index-Swaps – 0,06 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	658	0,06

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Swaptions — 0,26 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	2.784	0,26
<b>Devisenterminkontrakte – 0,02 % (28. Februar 2021: 0,09 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	203	0,02
<b>Futures – 0,05 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	502	0,05
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>1.059.161</b>	<b>100,12</b>
<b>Credit Default Swaps — (0,05 %) (28. Februar 2021: (0,06 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(592)	(0,05)
<b>Swaptions — (0,12 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.269)	(0,12)
<b>Devisenterminkontrakte – (0,33 %) (28. Februar 2021: (0,08 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(3.513)	(0,33)
<b>Futures – (0,20 %) (28. Februar 2021: (0,04 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(2.083)	(0,20)
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(7.457)</b>	<b>(0,70)</b>
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>1.051.704</b>	<b>99,42</b>
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>	<b>6.237</b>	<b>0,58</b>
<b>Gesamtnettvermögen</b>	<b>\$1.057.941</b>	<b>100,00</b>

### Zeitplan für Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3,000 % – Kauf	17/08/2061	1.550	\$ 144
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3,000 % – Verkauf	17/10/2057	3.280	(470)
Goldman Sachs	CMBX.NA.BBB, 3,000 % – Verkauf	17/10/2057	850	(122)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 109 USD)				\$ 144
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (646) USD)				(592)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (537) USD)				\$ (448)

### Zeitplan der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,650 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/05/2047	13.609	\$ 256
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 256
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (868) USD)				–
Nettowertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (868) USD)				\$ 256

### Zeitplan für Index-Swaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,130 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/08/2028	6.134	\$ 178
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,220 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/08/2028	10.907	255
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/02/2047	4.873	225
Nicht realisierte Wertsteigerung von Index Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 658
Nicht realisierte Wertminderung von Index-Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				–
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 658

### Zeitplan der Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Datum des Inkrafttretens	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
BNP Paribas	Swaption Payer Strike 1,00 %	16/06/2022	360.000	\$ (708)
BNP Paribas	Swaption Payer Strike 0,75 %	16/06/2022	360.000	1.404
Credit Suisse	Swaption Payer Strike 0,90 %	21/04/2022	469.570	(561)
Credit Suisse	Swaption Payer Strike 0,70 %	21/04/2022	469.570	\$ 1.380
Nicht realisierte Wertsteigerung von Swaptions (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				2.784
Nicht realisierte Wertminderung von Swaptions (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ (1.269)
Nettowertsteigerung von Swaptions (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 1.515

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile, weniger als 0,01 %.
- 144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 695.524.000 USD oder 65,72 % des Nettovermögens.
- \* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.
- † Illiquide.
- ∞ Die Sicherheit wird nach Treu und Glauben vom Bewertungsausschuss oder nach dessen Ermessen zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

#### ABKÜRZUNGEN:

REMIC – Anlageschutz für Immobilienhypotheken.

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,76
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	2,73
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,40
Finanzderivate	0,43
Sonstige Vermögenswerte	0,68
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	550	Verkauf	EUR	483	\$ 8
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	54	Verkauf	GBP	40	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	6.134.900	Verkauf	USD	53.200	184
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	9.652	Verkauf	USD	13.083	(134)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	155.114	Verkauf	USD	177.420	(3.379)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CHF	1.307	Verkauf	USD	1.415	11
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 962 USD)								\$ 203
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (862) USD)								(3.513)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 100 USD)								\$ (3.310)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
90 Day Euro\$ December 2022	Bank of America Merrill Lynch	791	\$194.339	\$ (613)
90 Day Euro\$ December 2023	Bank of America Merrill Lynch	288	70.456	(780)
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(523)	(66.650)	(488)
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(476)	(56.302)	(202)
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	82	12.848	171
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	144	26.775	331
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 502
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (492) USD)				(2.083)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (492) USD)				\$ (1.581)

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Asset-Backed Securities – 1,75 % (28. Februar 2021: 0,16 %)</b>					
1.230 DB Master Finance LLC, Series 2021 1A, Class A23, 144A, 2,791 %, fällig 20/11/2051	1.158	0,10	142 Fannie Mae Pool '745802', 6,000 %, fällig 01/07/2036	163	0,01
2.723 Hardee's Funding LLC, Series 2020 1A, Class A2, 144A, 3,981 %, fällig 20/12/2050	2.768	0,24	12 Fannie Mae Pool '745959', 5,500 %, fällig 01/11/2036	13	–
2.000 HGI CRE CLO 2021-FL2 Ltd, Series 2021 FL2, Class A, 144A, 1,126 %, fällig 17/09/2036 *	1.978	0,17	176 Fannie Mae Pool '836390', 5,000 %, fällig 01/10/2035	196	0,02
2.958 Home Partners of America 2021-3 Trust, Series 2021 3, Class A, 144A, 2,200 %, fällig 17/01/2041	2.888	0,25	568 Fannie Mae Pool '836398', 1,973 %, fällig 01/10/2035 *	594	0,05
2.604 Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Series 2021 2GS, Class B, 144A, 2,790 %, fällig 20/03/2048	2.489	0,22	9 Fannie Mae Pool '836852', 1,912 %, fällig 01/10/2035 *	10	–
1.500 MF1 2021-FL6 Ltd, Series 2021 FL6, Class A, 144A, 1,226 %, fällig 16/07/2036 *	1.492	0,13	9 Fannie Mae Pool '843823', 2,004 %, fällig 01/11/2035 *	10	–
2.570 MF1 2021-FL7 Ltd, Series 2021 FL7, Class A, 144A, 1,206 %, fällig 16/10/2036 *	2.547	0,22	126 Fannie Mae Pool '843997', 1,876 %, fällig 01/11/2035 *	131	0,01
853 Navient Student Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Class A3, 144A, 1,537 %, fällig 25/06/2065 *	870	0,08	26 Fannie Mae Pool '865915', 2,122 %, fällig 01/03/2036 *	26	–
971 SBA Small Business Investment Cos, Series 2018 10B, Class 1, 3,548 %, fällig 10/09/2028	1.003	0,09	160 Fannie Mae Pool '888218', 5,000 %, fällig 01/03/2037	178	0,02
1.350 SMB Private Education Loan Trust 2015-C, Series 2015 C, Class C, 144A, 4,500 %, fällig 17/09/2046	1.389	0,12	13 Fannie Mae Pool '889117', 5,000 %, fällig 01/10/2035	14	–
1.495 Store Master Funding I-VII XIV XIX XX, Series 2021 1A, Class A3, 144A, 2,860 %, fällig 20/06/2051	1.435	0,13	423 Fannie Mae Pool '890345', 5,000 %, fällig 01/06/2041	472	0,04
<b>Summe der vermögensgesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 20.476 USD)</b>					
	20.017	1,75	661 Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, fällig 01/10/2044	718	0,06
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 95,73 % (28. Februar 2021: 100,65 %)</b>					
64.944 BANK 2017-BNK8, Series 2017 BNK8, Class XA, 0,725 %, fällig 15/11/2050 *	2.273	0,20	18 Fannie Mae Pool '902663', 6,000 %, fällig 01/10/2036	20	–
2.400 BANK 2018-BNK10, Series 2018 BN10, Class A5, 3,688 %, fällig 15/02/2061	2.510	0,22	3 Fannie Mae Pool '909856', 6,000 %, fällig 01/03/2037	3	–
2.210 Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Series 2018 B1, Class A5, 3,666 %, fällig 15/01/2051 *	2.311	0,20	190 Fannie Mae Pool '934231', 5,000 %, fällig 01/01/2039	210	0,02
4.050 BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Class A, 144A, 1,441 %, fällig 15/07/2035 *	4.015	0,35	84 Fannie Mae Pool '961907', 5,000 %, fällig 01/03/2038	94	0,01
3.870 BXM 2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2, Class A, 144A, 1,063 %, fällig 15/02/2038 *	3.853	0,34	615 Fannie Mae Pool '962687', 5,000 %, fällig 01/04/2038	685	0,06
36.854 CD 2017-CD6 Mortgage Trust, Series 2017 CD6, Class XA, 0,917 %, fällig 13/11/2050 *	1.234	0,11	9 Fannie Mae Pool '973013', 4,500 %, fällig 01/03/2038	9	–
580 COLT 2021-RPL1 Trust, Series 2021 RPL1, Class A1, 144A, 1,665 %, fällig 25/09/2061 *	568	0,05	1 Fannie Mae Pool '974763', 4,500 %, fällig 01/04/2038	1	–
2.455 CSMC 2021-NQMB, Series 2021 NQMB, Class A1, 144A, 1,841 %, fällig 25/10/2066 *	2.407	0,21	16 Fannie Mae Pool '981766', 4,500 %, fällig 01/04/2038	17	–
1.437 Fannie Mae Interest Strip 406, Class 2, 4,000 %, fällig 25/02/2041	210	0,02	5 Fannie Mae Pool '995072', 5,500 %, fällig 01/08/2038	6	–
351 Fannie Mae Interest Strip 407, Class 9, 5,000 %, fällig 25/02/2041 *	57	–	560 Fannie Mae Pool '995948', 5,000 %, fällig 01/03/2039	624	0,05
776 Fannie Mae Interest Strip 407, Class C10, 5,000 %, fällig 25/01/2038	123	0,01	72 Fannie Mae Pool 'AA8438', 5,000 %, fällig 01/06/2039	79	0,01
480 Fannie Mae Interest Strip 409, Class C13, 3,500 %, fällig 25/11/2041	49	–	68 Fannie Mae Pool 'AB0129', 5,000 %, fällig 01/04/2035	75	0,01
2.544 Fannie Mae Interest Strip 417, Class C5, 3,500 %, fällig 25/02/2043	356	0,03	612 Fannie Mae Pool 'AB0131', 5,000 %, fällig 01/12/2038	682	0,06
6.004 Fannie Mae Interest Strip 418, Class C15, 3,500 %, fällig 25/08/2043	895	0,08	36 Fannie Mae Pool 'AB2725', 5,500 %, fällig 01/04/2041	40	–
29.700 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	29.304	2,55	20 Fannie Mae Pool 'AB2817', 5,000 %, fällig 01/04/2041	23	–
8.800 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ±	8.889	0,77	1.123 Fannie Mae Pool 'AB3882', 4,500 %, fällig 01/11/2041	1.222	0,11
11.000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500 % ±	11.329	0,99	455 Fannie Mae Pool 'AB5692', 4,000 %, fällig 01/06/2042	489	0,04
– Fannie Mae Pool '252875', 8,000 %, fällig 01/11/2029	1	–	60 Fannie Mae Pool 'AB7668', 3,000 %, fällig 01/10/2043	62	0,01
– Fannie Mae Pool '253184', 8,000 %, fällig 01/04/2030	–	–	176 Fannie Mae Pool 'AB8144', 5,000 %, fällig 01/04/2037	195	0,02
– Fannie Mae Pool '253399', 8,500 %, fällig 01/08/2030	–	–	222 Fannie Mae Pool 'AB9107', 3,500 %, fällig 01/04/2033	233	0,02
– Fannie Mae Pool '253438', 8,500 %, fällig 01/09/2030	–	–	35 Fannie Mae Pool 'AC2389', 5,000 %, fällig 01/02/2037	39	–
1 Fannie Mae Pool '253598', 8,500 %, fällig 01/12/2030	1	–	1.078 Fannie Mae Pool 'AD1645', 5,000 %, fällig 01/03/2040	1.198	0,10
101 Fannie Mae Pool '254793', 5,000 %, fällig 01/07/2033	112	0,01	60 Fannie Mae Pool 'AD2963', 5,000 %, fällig 01/04/2040	66	0,01
5.310 Fannie Mae Pool '387771', 3,790 %, fällig 01/08/2028	5.634	0,49	11 Fannie Mae Pool 'AD3336', 5,500 %, fällig 01/04/2040	12	–
– Fannie Mae Pool '535270', 8,500 %, fällig 01/04/2030	–	–	15 Fannie Mae Pool 'AD3796', 5,000 %, fällig 01/10/2040	16	–
12 Fannie Mae Pool '535299', 7,500 %, fällig 01/05/2030	13	–	3 Fannie Mae Pool 'AD4567', 5,500 %, fällig 01/04/2040	3	–
1 Fannie Mae Pool '535332', 8,500 %, fällig 01/04/2030	1	–	5 Fannie Mae Pool 'AD4598', 5,500 %, fällig 01/05/2040	5	–
– Fannie Mae Pool '535351', 8,000 %, fällig 01/06/2030	–	–	11 Fannie Mae Pool 'AD4614', 5,500 %, fällig 01/06/2040	12	–
– Fannie Mae Pool '535435', 8,500 %, fällig 01/08/2030	–	–	8 Fannie Mae Pool 'AD8281', 5,500 %, fällig 01/07/2040	9	–
1 Fannie Mae Pool '535608', 9,500 %, fällig 01/04/2030	1	–	47 Fannie Mae Pool 'AD8326', 5,500 %, fällig 01/07/2040	51	–
5 Fannie Mae Pool '535996', 7,500 %, fällig 01/06/2031	5	–	78 Fannie Mae Pool 'AD8642', 5,500 %, fällig 01/08/2040	86	0,01
– Fannie Mae Pool '537715', 8,500 %, fällig 01/09/2030	–	–	66 Fannie Mae Pool 'AD9893', 5,500 %, fällig 01/07/2040	73	0,01
25 Fannie Mae Pool '545189', 7,500 %, fällig 01/08/2031	28	–	14 Fannie Mae Pool 'AE0758', 7,000 %, fällig 01/02/2039	17	–
23 Fannie Mae Pool '545190', 7,500 %, fällig 01/08/2031	25	–	84 Fannie Mae Pool 'AH4029', 5,000 %, fällig 01/04/2041	90	0,01
2 Fannie Mae Pool '545612', 8,000 %, fällig 01/04/2032	2	–	34 Fannie Mae Pool 'AH5036', 5,500 %, fällig 01/02/2041	37	–
2 Fannie Mae Pool '545990', 7,500 %, fällig 01/04/2031	2	–	50 Fannie Mae Pool 'AH8309', 5,000 %, fällig 01/04/2041	54	–
– Fannie Mae Pool '546591', 8,500 %, fällig 01/06/2030	–	–	16 Fannie Mae Pool 'AH9785', 5,500 %, fällig 01/04/2041	17	–
2 Fannie Mae Pool '548965', 8,500 %, fällig 01/07/2030	2	–	65 Fannie Mae Pool 'AI0199', 5,000 %, fällig 01/04/2041	70	0,01
11 Fannie Mae Pool '555676', 7,500 %, fällig 01/12/2032	12	–	26 Fannie Mae Pool 'AI9532', 5,500 %, fällig 01/09/2041	28	–
125 Fannie Mae Pool '555743', 5,000 %, fällig 01/09/2033	139	0,01	16 Fannie Mae Pool 'AJ2033', 5,500 %, fällig 01/10/2041	17	–
32 Fannie Mae Pool '727181', 5,000 %, fällig 01/08/2033	36	–	34 Fannie Mae Pool 'AJ4713', 4,500 %, fällig 01/11/2041	37	–
24 Fannie Mae Pool '735578', 5,000 %, fällig 01/06/2035	27	–	52 Fannie Mae Pool 'AL0521', 5,000 %, fällig 01/06/2041	58	0,01
19 Fannie Mae Pool '745248', 7,500 %, fällig 01/08/2034	21	–	144 Fannie Mae Pool 'AL1051', 4,500 %, fällig 01/09/2041	155	0,01
554 Fannie Mae Pool '745580', 5,000 %, fällig 01/06/2036	616	0,05	634 Fannie Mae Pool 'AL1469', 7,000 %, fällig 01/02/2039	745	0,06
			302 Fannie Mae Pool 'AL1470', 7,000 %, fällig 01/04/2037	346	0,03
			4.379 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, fällig 01/01/2043	4.611	0,40
			38 Fannie Mae Pool 'AL3026', 3,500 %, fällig 01/12/2042	40	–
			1.615 Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, fällig 01/05/2040	1.839	0,16
			156 Fannie Mae Pool 'AL4741', 4,500 %, fällig 01/01/2044	170	0,01
			6.017 Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000 %, fällig 01/05/2045	6.413	0,56
			1.095 Fannie Mae Pool 'AL7877', 4,000 %, fällig 01/12/2045	1.167	0,10
			1.040 Fannie Mae Pool 'AL8991', 3,000 %, fällig 01/08/2035	1.074	0,09
			131 Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, fällig 01/11/2046	136	0,01
			4.610 Fannie Mae Pool 'AN8048', 3,080 %, fällig 01/01/2028	4.816	0,42
			136 Fannie Mae Pool 'AQ0102', 4,000 %, fällig 01/06/2042	146	0,01
			439 Fannie Mae Pool 'AP9766', 4,000 %, fällig 01/10/2042	469	0,04
			1.386 Fannie Mae Pool 'AQ6295', 3,500 %, fällig 01/12/2032	1.447	0,13
			113 Fannie Mae Pool 'AQ7130', 3,500 %, fällig 01/12/2032	118	0,01
			414 Fannie Mae Pool 'AQ7270', 3,500 %, fällig 01/12/2032	432	0,04
			351 Fannie Mae Pool 'AQ7306', 3,000 %, fällig 01/01/2043	363	0,03
			434 Fannie Mae Pool 'AQ7864', 3,000 %, fällig 01/12/2032	453	0,04
			128 Fannie Mae Pool 'AQ7869', 3,500 %, fällig 01/11/2032	133	0,01
			161 Fannie Mae Pool 'AQ7913', 3,500 %, fällig 01/12/2032	168	0,01
			249 Fannie Mae Pool 'AQ8677', 3,500 %, fällig 01/12/2032	260	0,02
			91 Fannie Mae Pool 'AR1198', 3,000 %, fällig 01/01/2043	94	0,01
			335 Fannie Mae Pool 'AR1202', 3,000 %, fällig 01/01/2043	347	0,03
			626 Fannie Mae Pool 'AS0462', 3,500 %, fällig 01/09/2033	655	0,06
			239 Fannie Mae Pool 'AS0469', 4,000 %, fällig 01/09/2033	255	0,02
			136 Fannie Mae Pool 'AS1281', 3,500 %, fällig 01/12/2033	140	0,01
			4.134 Fannie Mae Pool 'AS4347', 4,000 %, fällig 01/01/2045	4.434	0,39
			1.843 Fannie Mae Pool 'AS4363', 4,500 %, fällig 01/02/2045	2.028	0,18

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>					
343 Fannie Mae Pool 'FM5931', 2,500 %, fällig 01/02/2051	339	0,03	1.599 Fannie Mae Pool 'MA3384', 4,000 %, fällig 01/06/2048	1.677	0,15
241 Fannie Mae Pool 'FM5944', 2,500 %, fällig 01/01/2051	239	0,02	7.809 Fannie Mae Pool 'MA4031', 4,500 %, fällig 01/05/2050	8.267	0,72
329 Fannie Mae Pool 'FM6117', 3,000 %, fällig 01/11/2048	336	0,03	1.182 Fannie Mae REMICS, Series 2010 2, Class AI, 5,500 %, fällig 25/02/2040	209	0,02
9.166 Fannie Mae Pool 'FM6251', 4,000 %, fällig 01/07/2049	9.623	0,84	1.153 Fannie Mae REMICS, Series 2012 124, Class SD, 5,963 %, fällig 25/11/2042 *	220	0,02
180 Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, fällig 01/03/2051	179	0,02	1.790 Fannie Mae REMICS, Series 2012 22, Class SM, 6,313 %, fällig 25/03/2042 *	312	0,03
281 Fannie Mae Pool 'FM6871', 2,500 %, fällig 01/04/2051	278	0,02	765 Fannie Mae REMICS, Series 2012 9, Class PT, 11,479 %, fällig 25/07/2036 *	1.008	0,09
9.032 Fannie Mae Pool 'FM7167', 4,500 %, fällig 01/08/2050	9.580	0,83	977 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class BC, 6,500 %, fällig 25/07/2042	1.129	0,10
4.004 Fannie Mae Pool 'FM7210', 2,000 %, fällig 01/04/2051	3.852	0,34	4.610 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class CB, 5,500 %, fällig 25/04/2042	5.095	0,44
188 Fannie Mae Pool 'FM7304', 2,500 %, fällig 01/05/2051	186	0,02	7.613 Fannie Mae REMICS, Series 2016 48, Class IA, 4,500 %, fällig 25/06/2038	1.143	0,10
18.941 Fannie Mae Pool 'FM7382', 3,000 %, fällig 01/05/2051	19.175	1,67	1.984 Fannie Mae REMICS, Series 2017 74, Class PZ, 3,500 %, fällig 25/10/2047	2.215	0,19
2.732 Fannie Mae Pool 'FM7518', 2,500 %, fällig 01/06/2051	2.705	0,24	4.481 Fannie Mae REMICS, Series 2018 3, Class IO, 4,000 %, fällig 25/02/2048	749	0,07
354 Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, fällig 01/06/2051	352	0,03	1.226 Fannie Mae REMICS, Series 2019 25, Class PI, 5,000 %, fällig 25/05/2048	227	0,02
95 Fannie Mae Pool 'FM7676', 2,500 %, fällig 01/06/2051	94	0,01	5.364 Fannie Mae REMICS, Series 2019 38, Class SH, 5,942 %, fällig 25/07/2049 *	921	0,08
277 Fannie Mae Pool 'FM7727', 2,500 %, fällig 01/06/2051	276	0,02	2.514 Fannie Mae REMICS, Series 2019 44, Class SM, 5,863 %, fällig 25/08/2049 *	494	0,04
7.118 Fannie Mae Pool 'FM7740', 2,500 %, fällig 01/06/2051	7.042	0,61	2.729 Fannie Mae REMICS, Series 2019 45, Class BS, 5,863 %, fällig 25/08/2049 *	428	0,04
353 Fannie Mae Pool 'FM7741', 2,500 %, fällig 01/05/2051	349	0,03	4.814 Fannie Mae REMICS, Series 2019 5, Class IO, 4,500 %, fällig 25/03/2049	835	0,07
1.130 Fannie Mae Pool 'FM7750', 2,000 %, fällig 01/05/2051	1.087	0,09	1.452 Fannie Mae REMICS, Series 2019 57, Class NS, 5,813 %, fällig 25/10/2049 *	223	0,02
1.230 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, fällig 01/07/2051	1.220	0,11	1.844 Fannie Mae REMICS, Series 2019 58, Class HS, 5,813 %, fällig 25/10/2049 *	278	0,02
955 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, fällig 01/07/2051	952	0,08	3.993 Fannie Mae REMICS, Series 2019 59, Class SH, 5,813 %, fällig 25/10/2049 *	674	0,06
2.028 Fannie Mae Pool 'FM8188', 3,000 %, fällig 01/03/2040	2.071	0,18	1.456 Fannie Mae REMICS, Series 2020 26, Class SA, 5,763 %, fällig 25/05/2050 *	287	0,03
4.027 Fannie Mae Pool 'FM8189', 3,000 %, fällig 01/08/2038	4.126	0,36	930 Fannie Mae REMICS, Series 2020 47, Class GZ, 2,000 %, fällig 25/07/2050	787	0,07
1.517 Fannie Mae Pool 'FM8210', 3,000 %, fällig 01/04/2050	1.541	0,13	1.909 Fannie Mae REMICS, Series 2020 62, Class BI, 2,000 %, fällig 25/09/2050	219	0,02
1.807 Fannie Mae Pool 'FM8227', 3,500 %, fällig 01/06/2049	1.874	0,16	2.656 Fannie Mae REMICS, Series 2020 67, Class IH, 2,000 %, fällig 25/09/2050	357	0,03
10.618 Fannie Mae Pool 'FM8415', 2,000 %, fällig 01/08/2051	10.211	0,89	170 Fannie Mae REMICS, Series 2020 74, Class EI, 2,500 %, fällig 25/10/2050	25	-
1.791 Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000 %, fällig 01/02/2050	1.835	0,16	15.366 Fannie Mae REMICS, Series 2020 88, Class GI, 2,500 %, fällig 25/12/2050	2.204	0,19
17.165 Fannie Mae Pool 'FM8685', 3,000 %, fällig 01/09/2051	17.383	1,52	1.177 Fannie Mae REMICS, Series 2020 89, Class DI, 2,500 %, fällig 25/12/2050	168	0,01
486 Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, fällig 01/10/2051	483	0,04	9.944 Fannie Mae REMICS, Series 2020 91, Class IO, 2,500 %, fällig 25/12/2050	1.428	0,12
97 Fannie Mae Pool 'FM8977', 2,500 %, fällig 01/09/2051	96	0,01	7.093 Fannie Mae REMICS, Series 2020 93, Class LI, 2,500 %, fällig 25/01/2051	966	0,08
99 Fannie Mae Pool 'FM9174', 2,000 %, fällig 01/10/2051	95	0,01	27.740 Fannie Mae REMICS, Series 2021 42, Class NI, 2,500 %, fällig 25/11/2048	3.867	0,34
2.949 Fannie Mae Pool 'FM9264', 2,000 %, fällig 01/10/2041	2.895	0,25	8.492 Fannie Mae REMICS, Series 2021 46, Class BI, 2,500 %, fällig 25/12/2048	1.183	0,10
196 Fannie Mae Pool 'FM9335', 2,500 %, fällig 01/10/2051	194	0,02	1.365 Fannie Mae REMICS, Series 2021 54, Class KI, 2,500 %, fällig 25/05/2049	178	0,02
3.448 Fannie Mae Pool 'FM9362', 3,000 %, fällig 01/06/2038	3.548	0,31	10.178 Fannie Mae REMICS, Series 2021 59, Class TI, 2,500 %, fällig 25/09/2051	1.459	0,13
17.907 Fannie Mae Pool 'FM9434', 2,000 %, fällig 01/11/2051	17.222	1,50	1.652 Fannie Mae REMICS, Series 2021 61, Class KI, 2,500 %, fällig 25/04/2049	233	0,02
2.951 Fannie Mae Pool 'FM9444', 2,500 %, fällig 01/10/2041	2.980	0,26	6.360 Fannie Mae REMICS, Series 2021 85, Class IN, 2,500 %, fällig 25/02/2050	913	0,08
6.231 Fannie Mae Pool 'FM9456', 3,500 %, fällig 01/11/2051	6.524	0,57	14.581 Fannie Mae REMICS, Series 2021 91, Class IG, 2,500 %, fällig 25/01/2052	2.226	0,19
7.841 Fannie Mae Pool 'FM9507', 3,000 %, fällig 01/03/2037	8.054	0,70	512 Fannie Mae-Aces, Series 2016 M11, Class AL, 2,944 %, fällig 25/07/2039	513	0,04
17.249 Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, fällig 01/07/2051	16.637	1,45	18.325 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M11, Class X1, 1,190 %, fällig 25/06/2029 *	1.142	0,10
1.178 Fannie Mae Pool 'FM9585', 2,500 %, fällig 01/11/2041	1.185	0,10	19.822 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M13, Class X1, 0,824 %, fällig 25/06/2034 *	1.087	0,09
7.990 Fannie Mae Pool 'FM9589', 3,000 %, fällig 01/04/2037	8.178	0,71	39.531 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M14, Class X1, 0,588 %, fällig 25/06/2029 *	1.427	0,12
8.887 Fannie Mae Pool 'FM9733', 2,500 %, fällig 01/10/2051	8.800	0,77	5.549 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M11, Class IO, 1,749 %, fällig 25/01/2029 *	552	0,05
4.585 Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000 %, fällig 01/01/2052	4.649	0,41	34.555 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M16, Class X1, 0,475 %, fällig 25/04/2032 *	1.235	0,11
3.773 Fannie Mae Pool 'FS0352', 2,000 %, fällig 01/01/2052	3.625	0,32	6.048 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M24, Class X1, 1,772 %, fällig 25/01/2037 *	888	0,08
10.369 Fannie Mae Pool 'FS0392', 2,500 %, fällig 01/01/2052	10.246	0,89	18.420 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M31, Class X2, 1,325 %, fällig 25/12/2032 *	1.721	0,15
2.891 Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, fällig 01/01/2052	2.873	0,25	56 Freddie Mac Gold Pool 'A29586', 5,000 %, fällig 01/01/2035	62	0,01
299 Fannie Mae Pool 'FS0464', 2,000 %, fällig 01/01/2052	288	0,03			
2.497 Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000 %, fällig 01/02/2052	2.547	0,22			
2.992 Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500 %, fällig 01/02/2052	2.966	0,26			
496 Fannie Mae Pool 'FS0534', 2,500 %, fällig 01/07/2051	492	0,04			
1.800 Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, fällig 01/02/2052	1.784	0,16			
1.600 Fannie Mae Pool 'FS0583', 2,500 %, fällig 01/02/2052	1.584	0,14			
1.600 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 01/02/2052	1.538	0,13			
8.200 Fannie Mae Pool 'FS0605', 2,500 %, fällig 01/02/2052	8.110	0,71			
900 Fannie Mae Pool 'FS0612', 2,000 %, fällig 01/02/2052	867	0,08			
11 Fannie Mae Pool 'MA0440', 5,500 %, fällig 01/05/2040	13	-			
28 Fannie Mae Pool 'MA0619', 5,500 %, fällig 01/11/2040	31	-			
6 Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, fällig 01/04/2031	7	-			
15 Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, fällig 01/05/2031	16	-			
18 Fannie Mae Pool 'MA0766', 5,500 %, fällig 01/05/2041	20	-			
8 Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, fällig 01/06/2031	8	-			
167 Fannie Mae Pool 'MA0823', 5,500 %, fällig 01/07/2041	186	0,02			
67 Fannie Mae Pool 'MA0867', 5,500 %, fällig 01/09/2041	75	0,01			
174 Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, fällig 01/11/2031	185	0,02			
202 Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, fällig 01/12/2031	214	0,02			
42 Fannie Mae Pool 'MA0968', 4,500 %, fällig 01/12/2031	44	-			
225 Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500 %, fällig 01/09/2042	237	0,02			
14 Fannie Mae Pool 'MA1221', 4,500 %, fällig 01/09/2042	15	-			
55 Fannie Mae Pool 'MA1363', 3,000 %, fällig 01/02/2043	57	-			
1.825 Fannie Mae Pool 'MA1393', 4,000 %, fällig 01/03/2043	1.968	0,17			
379 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, fällig 01/09/2043	413	0,04			
295 Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500 %, fällig 01/10/2043	324	0,03			
198 Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500 %, fällig 01/11/2043	214	0,02			
257 Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500 %, fällig 01/12/2043	278	0,02			
519 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, fällig 01/07/2036	531	0,05			
498 Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, fällig 01/12/2036	512	0,04			
223 Fannie Mae Pool 'MA3057', 3,500 %, fällig 01/07/2047	230	0,02			
313 Fannie Mae Pool 'MA3058', 4,000 %, fällig 01/07/2047	330	0,03			
446 Fannie Mae Pool 'MA3088', 4,000 %, fällig 01/08/2047	470	0,04			
162 Fannie Mae Pool 'MA3149', 4,000 %, fällig 01/10/2047	171	0,01			
399 Fannie Mae Pool 'MA3210', 3,500 %, fällig 01/12/2047	415	0,04			
152 Fannie Mae Pool 'MA3239', 4,000 %, fällig 01/01/2048	160	0,01			
5.733 Fannie Mae Pool 'MA3332', 3,500 %, fällig 01/04/2048	5.941	0,52			

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>					
408 Freddie Mac Pool 'ZT1596', 5,000 %, fällig 01/01/2049	443	0,04	1 Ginnie Mae I Pool '676940', 5,000 %, fällig 15/04/2038	2	–
48 Freddie Mac Pool 'ZT1854', 4,500 %, fällig 01/03/2049	52	–	5 Ginnie Mae I Pool '683926', 5,000 %, fällig 15/02/2038	5	–
195 Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500 %, fällig 01/04/2033	204	0,02	6 Ginnie Mae I Pool '684334', 5,000 %, fällig 15/02/2038	7	–
2.612 Freddie Mac Pool 'ZT2228', 3,500 %, fällig 01/06/2049	2.699	0,24	3 Ginnie Mae I Pool '684754', 5,000 %, fällig 15/04/2038	3	–
4.600 Freddie Mac REMICS 3810, Class WA, 5,592 %, fällig 15/06/2040 *	5.565	0,49	2 Ginnie Mae I Pool '684848', 5,000 %, fällig 15/04/2038	2	–
3.820 Freddie Mac REMICS 3998, Class DS, 6,309 %, fällig 15/02/2042 *	751	0,07	3 Ginnie Mae I Pool '686062', 5,000 %, fällig 15/05/2038	3	–
2.557 Freddie Mac REMICS 4134, Class IM, 3,500 %, fällig 15/11/2042	395	0,03	54 Ginnie Mae I Pool '698086', 6,000 %, fällig 15/04/2039	59	0,01
1.415 Freddie Mac REMICS 4280, Class AI, 3,000 %, fällig 15/02/2028	40	–	12 Ginnie Mae I Pool '701501', 5,000 %, fällig 15/12/2038	14	–
528 Freddie Mac REMICS 4403, Class IG, 3,500 %, fällig 15/07/2032	21	–	321 Ginnie Mae I Pool '701947', 5,000 %, fällig 15/06/2039	364	0,03
1.565 Freddie Mac REMICS 4715, Class JS, 5,959 %, fällig 15/08/2047 *	295	0,03	136 Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, fällig 15/04/2040	154	0,01
563 Freddie Mac REMICS 4759, Class MI, 4,000 %, fällig 15/09/2045	28	–	316 Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, fällig 15/05/2040	358	0,03
1.681 Freddie Mac REMICS 4808, Class SB, 6,009 %, fällig 15/07/2048 *	320	0,03	2 Ginnie Mae I Pool '780732', 7,000 %, fällig 15/03/2028	2	–
230 Freddie Mac REMICS 4813, Class CJ, 3,000 %, fällig 15/08/2048	232	0,02	– Ginnie Mae I Pool '780991', 9,000 %, fällig 15/11/2024	–	–
1.977 Freddie Mac REMICS 4856, Class IO, 5,000 %, fällig 15/01/2049	355	0,03	1 Ginnie Mae I Pool '781001', 7,500 %, fällig 15/03/2029	1	–
1.092 Freddie Mac REMICS 4870, Class ES, 5,809 %, fällig 15/04/2049 *	182	0,02	59 Ginnie Mae I Pool '781590', 5,500 %, fällig 15/04/2033	67	0,01
2.200 Freddie Mac REMICS 4882, Class S, 5,859 %, fällig 15/05/2049 *	339	0,03	404 Ginnie Mae I Pool '781994', 5,500 %, fällig 15/11/2033	458	0,04
2.811 Freddie Mac REMICS 4921, Class SN, 5,863 %, fällig 25/10/2049 *	556	0,05	2 Ginnie Mae I Pool '782198', 6,000 %, fällig 15/10/2037	3	–
1.058 Freddie Mac REMICS 4936, Class YZ, 2,500 %, fällig 25/12/2049	1.038	0,09	354 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15/06/2048	374	0,03
1.717 Freddie Mac REMICS 4962, Class SP, 5,863 %, fällig 25/03/2050 *	265	0,02	154 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15/09/2042	159	0,01
4.652 Freddie Mac REMICS 4988, Class AZ, 2,000 %, fällig 25/07/2050	3.937	0,34	172 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15/09/2042	178	0,02
12.222 Freddie Mac REMICS 4988, Class BI, 2,500 %, fällig 25/06/2050	1.675	0,15	53 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15/10/2042	54	–
2.684 Freddie Mac REMICS 4995, Class IQ, 2,500 %, fällig 25/07/2050	357	0,03	281 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, fällig 15/10/2042	290	0,03
11.633 Freddie Mac REMICS 4995, Class QI, 2,500 %, fällig 25/07/2050	1.507	0,13	242 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, fällig 15/11/2042	250	0,02
5.616 Freddie Mac REMICS 5000, Class IB, 2,500 %, fällig 25/07/2050	708	0,06	2.626 Ginnie Mae I Pool 'BS8462', 3,500 %, fällig 15/06/2050	2.764	0,24
4.350 Freddie Mac REMICS 5000, Class UI, 2,500 %, fällig 25/07/2050	684	0,06	8 Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500 %, fällig 20/10/2037	9	–
1.835 Freddie Mac REMICS 5027, Class HI, 2,000 %, fällig 25/10/2050	249	0,02	12 Ginnie Mae II Pool '4170', 6,000 %, fällig 20/06/2038	13	–
165 Freddie Mac REMICS 5040, Class IB, 2,500 %, fällig 25/11/2050	22	–	810 Ginnie Mae II Pool '4245', 6,000 %, fällig 20/09/2038	906	0,08
2.629 Freddie Mac REMICS 5058, Class IL, 2,500 %, fällig 25/01/2051	371	0,03	121 Ginnie Mae II Pool '4602', 6,000 %, fällig 20/12/2039	138	0,01
747 Freddie Mac REMICS 5059, Class IB, 2,500 %, fällig 25/01/2051	123	0,01	133 Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500 %, fällig 20/01/2040	144	0,01
5.389 Freddie Mac REMICS 5070, Class NI, 2,000 %, fällig 25/02/2051	781	0,07	67 Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500 %, fällig 20/05/2040	73	0,01
9.660 Freddie Mac REMICS 5078, Class EI, 1,500 %, fällig 25/01/2051	1.064	0,09	42 Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000 %, fällig 20/07/2040	48	–
23.075 Freddie Mac REMICS 5085, Class IK, 2,500 %, fällig 25/03/2051	3.829	0,33	48 Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000 %, fällig 20/08/2040	54	–
12.747 Freddie Mac REMICS 5092, Class IU, 2,500 %, fällig 25/02/2051	1.531	0,13	4 Ginnie Mae II Pool '4774', 6,000 %, fällig 20/08/2040	5	–
3.970 Freddie Mac REMICS 5113, Class NI, 2,500 %, fällig 25/06/2051	534	0,05	101 Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000 %, fällig 20/09/2040	113	0,01
12.844 Freddie Mac REMICS 5134, Class KI, 2,500 %, fällig 25/07/2048	1.744	0,15	42 Ginnie Mae II Pool '4855', 5,000 %, fällig 20/11/2040	48	–
11.806 Freddie Mac REMICS 5135, Class DI, 2,500 %, fällig 25/05/2048	1.388	0,12	16 Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500 %, fällig 20/01/2041	17	–
1.572 Freddie Mac REMICS 5149, Class NI, 2,500 %, fällig 25/01/2051	241	0,02	10 Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000 %, fällig 20/01/2041	12	–
10.600 Freddie Mac REMICS 5162, Class DI, 2,500 %, fällig 25/11/2051	1.474	0,13	534 Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, fällig 20/03/2041	585	0,05
7.700 Freddie Mac REMICS 5169, Class PW, 2,000 %, fällig 25/09/2051	7.029	0,61	1.207 Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000 %, fällig 20/07/2040	1.343	0,12
7.200 Freddie Mac REMICS 5178, Class CY, 2,000 %, fällig 25/01/2042	6.557	0,57	881 Ginnie Mae II Pool '783298', 4,500 %, fällig 20/04/2041	965	0,08
1.494 Freddie Mac Strips 312, Class S1, 5,759 %, fällig 15/09/2043 *	256	0,02	84 Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, fällig 20/01/2046	88	0,01
4.000 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2021 DNA2, Class M2, 144A, 2,349 %, fällig 25/08/2033 *	4.049	0,35	2.566 Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000 %, fällig 20/07/2047	2.716	0,24
– Ginnie Mae I Pool '410304', 7,500 %, fällig 15/12/2025	–	–	70 Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, fällig 20/01/2050	71	0,01
1 Ginnie Mae I Pool '417463', 7,000 %, fällig 15/09/2025	1	–	581 Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000 %, fällig 20/03/2051	569	0,05
– Ginnie Mae I Pool '430208', 7,000 %, fällig 15/09/2027	–	–	2.948 Ginnie Mae II Pool '892346', 2,795 %, fällig 20/08/2059 *	3.040	0,27
1 Ginnie Mae I Pool '462669', 7,000 %, fällig 15/04/2028	1	–	251 Ginnie Mae II Pool '892614', 2,143 %, fällig 20/08/2060 *	260	0,02
– Ginnie Mae I Pool '486470', 6,500 %, fällig 15/08/2028	–	–	1.074 Ginnie Mae II Pool 'AV0243', 3,500 %, fällig 20/08/2046	1.131	0,10
– Ginnie Mae I Pool '486516', 6,500 %, fällig 15/09/2028	–	–	1.320 Ginnie Mae II Pool 'AV8311', 3,500 %, fällig 20/08/2046	1.389	0,12
– Ginnie Mae I Pool '519569', 8,000 %, fällig 15/05/2030	–	–	1.576 Ginnie Mae II Pool 'AV8312', 3,500 %, fällig 20/08/2046	1.653	0,14
27 Ginnie Mae I Pool '646044', 6,500 %, fällig 15/10/2037	29	–	683 Ginnie Mae II Pool 'AZ3074', 4,000 %, fällig 20/02/2047	715	0,06
1 Ginnie Mae I Pool '652203', 5,000 %, fällig 15/03/2036	1	–	629 Ginnie Mae II Pool 'BC5293', 3,500 %, fällig 20/08/2047	658	0,06
3 Ginnie Mae I Pool '658182', 6,000 %, fällig 15/11/2036	3	–	3.891 Ginnie Mae II Pool 'BC5429', 3,500 %, fällig 20/10/2047	4.085	0,36
1 Ginnie Mae I Pool '675375', 5,000 %, fällig 15/05/2038	1	–	262 Ginnie Mae II Pool 'BD3554', 3,500 %, fällig 20/10/2047	271	0,02
			1.484 Ginnie Mae II Pool 'BD3636', 3,500 %, fällig 20/10/2047	1.566	0,14
			44 Ginnie Mae II Pool 'BG7951', 4,500 %, fällig 20/06/2048	46	–
			876 Ginnie Mae II Pool 'BH1521', 4,500 %, fällig 20/07/2048	930	0,08
			1.525 Ginnie Mae II Pool 'BH1870', 4,500 %, fällig 20/08/2048	1.654	0,14
			801 Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, fällig 20/02/2050	832	0,07
			178 Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000 %, fällig 20/10/2049	188	0,02
			733 Ginnie Mae II Pool 'BS1728', 4,000 %, fällig 20/01/2050	784	0,07
			634 Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, fällig 20/02/2050	675	0,06
			89 Ginnie Mae II Pool 'BS8546', 2,500 %, fällig 20/12/2050	88	0,01
			534 Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500 %, fällig 20/12/2050	534	0,05
			1.461 Ginnie Mae II Pool 'BT9472', 4,000 %, fällig 20/05/2050	1.549	0,13
			3.046 Ginnie Mae II Pool 'BU3196', 4,000 %, fällig 20/05/2050	3.198	0,28
			1.058 Ginnie Mae II Pool 'BW7380', 4,500 %, fällig 20/07/2050	1.141	0,10
			1.310 Ginnie Mae II Pool 'BW7384', 4,000 %, fällig 20/08/2050	1.418	0,12
			1.689 Ginnie Mae II Pool 'BX2423', 3,000 %, fällig 20/10/2050	1.720	0,15
			199 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, fällig 20/04/2046	209	0,02
			110 Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, fällig 20/05/2046	115	0,01
			189 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, fällig 20/06/2046	197	0,02
			114 Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, fällig 20/07/2046	119	0,01
			6.815 Ginnie Mae II Pool 'MA4003', 3,000 %, fällig 20/10/2046	6.998	0,61
			948 Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, fällig 20/02/2047	973	0,08
			497 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, fällig 20/06/2047	523	0,05
			2.789 Ginnie Mae II Pool 'MA4586', 3,500 %, fällig 20/07/2047	2.906	0,25
			105 Ginnie Mae II Pool 'MA4587', 4,000 %, fällig 20/07/2047	111	0,01
			153 Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500 %, fällig 20/08/2047	163	0,01
			205 Ginnie Mae II Pool 'MA4781', 5,000 %, fällig 20/10/2047	221	0,02
			253 Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, fällig 20/11/2047	267	0,02
			227 Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, fällig 20/12/2047	239	0,02
			72 Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, fällig 20/02/2048	76	0,01
			114 Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, fällig 20/03/2048	120	0,01
			239 Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500 %, fällig 20/04/2048	253	0,02
			176 Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, fällig 20/05/2048	186	0,02
			25 Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, fällig 20/06/2048	26	–
			189 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, fällig 20/07/2048	200	0,02
			2.492 Ginnie Mae II Pool 'MA5399', 4,500 %, fällig 20/08/2048	2.614	0,23
			55 Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500 %, fällig 20/09/2048	59	0,01

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Mortgage-Backed Securities - (Fortsetzung)</b>					
86 Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, fällig 20/12/2048	91	0,01	255 Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class NI, 3,500 %, fällig 20/04/2050	38	–
278 Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, fällig 20/01/2049	292	0,03	1.373 Government National Mortgage Association, Series 2020 61, Class CI, 4,000 %, fällig 20/03/2050	169	0,01
183 Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, fällig 20/03/2049	192	0,02	1.019 Government National Mortgage Association, Series 2020 85, Class CI, 3,500 %, fällig 20/04/2050	132	0,01
17 Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, fällig 20/04/2049	17	–	7.265 Government National Mortgage Association, Series 2020 H08, Class BI, 0,593 %, fällig 01/04/2070 *	319	0,03
168 Ginnie Mae II Pool 'MA6412', 4,500 %, fällig 20/01/2050	176	0,02	1.641 Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class FL, 1,312 %, fällig 20/05/2070 *	1.708	0,15
168 Ginnie Mae II Pool 'MA6602', 4,500 %, fällig 20/04/2050	176	0,02	194 Government National Mortgage Association, Series 2020 H12, Class F, 0,662 %, fällig 20/07/2070 *	195	0,02
5.360 Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000 %, fällig 20/05/2050	5.583	0,49	1.290 Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Class FA, 0,612 %, fällig 20/07/2070 *	1.295	0,11
2.758 Ginnie Mae II Pool 'MA6869', 4,500 %, fällig 20/09/2050	2.913	0,25	29.487 Government National Mortgage Association, Series 2021 110, Class IO, 0,879 %, fällig 16/11/2063 *	2.372	0,21
3.480 Ginnie Mae II Pool 'MA6935', 4,500 %, fällig 20/10/2050	3.660	0,32	6.908 Government National Mortgage Association, Series 2021 156, Class IE, 2,500 %, fällig 20/09/2051	855	0,07
2.819 Ginnie Mae II Pool 'MA7314', 3,500 %, fällig 20/04/2051	2.915	0,25	15.772 Government National Mortgage Association, Series 2021 158, Class IN, 2,500 %, fällig 20/09/2051	2.124	0,19
6.807 Ginnie Mae II Pool 'MA7316', 4,500 %, fällig 20/04/2051	7.168	0,62	3.869 Government National Mortgage Association, Series 2021 180, Class IO, 0,905 %, fällig 16/11/2063 *	324	0,03
6.098 Ginnie Mae II Pool 'MA7420', 3,500 %, fällig 20/06/2051	6.305	0,55	11.481 Government National Mortgage Association, Series 2021 29, Class DI, 2,000 %, fällig 20/02/2051	1.406	0,12
5.238 Ginnie Mae II Pool 'MA7475', 4,000 %, fällig 20/07/2051	5.452	0,48	51.041 Government National Mortgage Association, Series 2021 37, Class IO, 0,805 %, fällig 16/01/2061 *	3.560	0,31
36.500 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ±	37.109	3,23	23.978 Government National Mortgage Association, Series 2021 5, Class IO, 1,091 %, fällig 16/01/2061 *	2.095	0,18
6.700 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,500 % ±	6.913	0,60	31.252 Government National Mortgage Association, Series 2021 60, Class IO, 0,835 %, fällig 16/05/2063 *	2.279	0,20
853 Government National Mortgage Association, Series 2004 81, Class SK, 6,074 %, fällig 16/10/2034 *	98	0,01	5.553 Government National Mortgage Association, Series 2021 7, Class TI, 2,500 %, fällig 16/01/2051	1.057	0,09
1.473 Government National Mortgage Association, Series 2008 40, Class SC, 6,224 %, fällig 16/05/2038 *	215	0,02	3.536 GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Class A, 144A, 1,741 %, fällig 15/09/2031 *	3.193	0,28
1.823 Government National Mortgage Association, Series 2008 79, Class ID, 6,638 %, fällig 20/06/2035 *	279	0,02	3.668 GS Mortgage Securities Corp II, Series 2018 SRP5, Class B, 144A, 2,941 %, fällig 15/09/2031 *	3.006	0,26
482 Government National Mortgage Association, Series 2010 H02, Class FA, 0,788 %, fällig 20/02/2060 *	484	0,04	2.120 GS Mortgage Securities Trust 2017-GS8, Series 2017 GS8, Class A4, 3,469 %, fällig 10/11/2050	2.202	0,19
990 Government National Mortgage Association, Series 2010 H20, Class AF, 0,431 %, fällig 20/10/2060 *	989	0,09	9.549 JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Class AX1, 144A, 0,250 %, fällig 25/10/2048 *†	21	–
699 Government National Mortgage Association, Series 2010 H22, Class FE, 0,451 %, fällig 20/05/2059 *	699	0,06	1.443 New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Series 2018 3A, Class A1, 144A, 4,500 %, fällig 25/05/2058 *	1.510	0,13
490 Government National Mortgage Association, Series 2010 H28, Class FE, 0,501 %, fällig 20/12/2060 *	490	0,04	2.022 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Series 2021 NQM3, Class A1, 144A, 1,156 %, fällig 27/11/2056 *	1.975	0,17
812 Government National Mortgage Association, Series 2011 146, Class KS, 5,974 %, fällig 16/11/2041 *	162	0,01	<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 1.115.271 USD)</b>	<b>1.098.307</b>	<b>95,73</b>
1.067 Government National Mortgage Association, Series 2011 79, Class KS, 5,238 %, fällig 20/05/2041 *	160	0,01	<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 12,73 % (28. Februar 2021: 8,38 %)</b>		
3.314 Government National Mortgage Association, Series 2012 H21, Class FA, 0,601 %, fällig 20/07/2062 *	3.322	0,29	<b>USA — 12,73 % (28. Februar 2021: 8,38 %)</b>		
11.741 Government National Mortgage Association, Series 2013 93, Class SA, 6,074 %, fällig 16/06/2043 *	2.345	0,20	104.650 United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 03/05/2022	104.609	9,12
648 Government National Mortgage Association, Series 2014 118, Class HS, 6,038 %, fällig 20/08/2044 *	121	0,01	15.300 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 26/04/2022	15.296	1,33
1.026 Government National Mortgage Association, Series 2014 2, Class CI, 4,500 %, fällig 20/01/2044	227	0,02	12.640 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 16/06/2022	12.625	1,10
2.963 Government National Mortgage Association, Series 2014 60, Class SA, 5,974 %, fällig 16/04/2044 *	537	0,05	2.600 United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 11/08/2022	2.592	0,23
9.824 Government National Mortgage Association, Series 2015 136, Class IO, 0,484 %, fällig 16/08/2055 *	235	0,02	3.000 United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 30/09/2022	3.017	0,26
4.656 Government National Mortgage Association, Series 2015 177, Class MI, 5,000 %, fällig 20/10/2044	899	0,08	60 United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 28/02/2025	59	–
27.919 Government National Mortgage Association, Series 2017 111, Class IO, 0,536 %, fällig 16/02/2059 *	1.145	0,10	8.220 United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30/04/2026	7.894	0,69
2.331 Government National Mortgage Association, Series 2017 19, Class SE, 6,024 %, fällig 16/02/2047 *	398	0,03		146.092	12,73
4.733 Government National Mortgage Association, Series 2017 26, Class IQ, 5,000 %, fällig 20/02/2040	938	0,08	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 146.439 USD)</b>	<b>146.092</b>	<b>12,73</b>
8.619 Government National Mortgage Association, Series 2017 8, Class IO, 0,435 %, fällig 16/08/2058 *	274	0,02	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,63 % (28. Februar 2021: 9,00 %)</b>		
2.243 Government National Mortgage Association, Series 2018 125, Class HS, 6,088 %, fällig 20/09/2048 *	313	0,03	18.650 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	18.650	1,63
3.682 Government National Mortgage Association, Series 2018 134, Class SM, 6,038 %, fällig 20/10/2048 *	518	0,05	<b>Gesamte kollektive Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 18.650 USD)</b>	<b>18.650</b>	<b>1,63</b>
837 Government National Mortgage Association, Series 2018 37, Class QA, 2,750 %, fällig 20/03/2048	856	0,07	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.300.836 USD)</b>	<b>1.283.066</b>	<b>111,84</b>
500 Government National Mortgage Association, Series 2019 128, Class AL, 2,500 %, fällig 20/10/2049	491	0,04	<b>Zinsswaps – 0,04 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
16.194 Government National Mortgage Association, Series 2019 85, Class LS, 3,128 %, fällig 20/07/2049 *	1.006	0,09	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	423	0,04
6.178 Government National Mortgage Association, Series 2020 116, Class GI, 2,500 %, fällig 20/08/2050	825	0,07	<b>Index-Swaps — 0,07 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
2.112 Government National Mortgage Association, Series 2020 122, Class IM, 2,500 %, fällig 20/08/2050	280	0,02	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	873	0,07
4.561 Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class EI, 2,500 %, fällig 20/08/2050	620	0,05	<b>Futures – 0,14 % (28. Februar 2021: 0,15 %)</b>		
547 Government National Mortgage Association, Series 2020 129, Class IE, 2,500 %, fällig 20/09/2050	75	0,01	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.640	0,14
185 Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class IH, 2,500 %, fällig 20/10/2050	26	–	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>1.286.002</b>	<b>112,09</b>
5.790 Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class QI, 2,500 %, fällig 20/10/2050	1.097	0,10	<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
271 Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class VI, 2,500 %, fällig 20/10/2050	35	–	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(14)	–
820 Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class YI, 2,500 %, fällig 20/10/2050	106	0,01	<b>Futures – (0,06 %) (28. Februar 2021: (0,15 %))</b>		
1.420 Government National Mortgage Association, Series 2020 181, Class WI, 2,000 %, fällig 20/12/2050	149	0,01	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(666)	(0,06)
4.293 Government National Mortgage Association, Series 2020 191, Class IX, 2,500 %, fällig 20/12/2050	780	0,07	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(680)</b>	<b>(0,06)</b>
5.291 Government National Mortgage Association, Series 2020 36, Class GS, 5,938 %, fällig 20/03/2050 *	951	0,08	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>1.285.322</b>	<b>112,03</b>
643 Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class MI, 3,500 %, fällig 20/04/2050	91	0,01	<b>Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten</b>	<b>(138.042)</b>	<b>(12,03)</b>
			<b>Gesamtvermögen</b>	<b>\$1.147.280</b>	<b>100,00</b>

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile, weniger als 0,01 %.
- 144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 43.611.000 USD oder 3,80 % des Nettovermögens.
- \* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.
- † Illiquide.
- ± Anzugebende Wertpapiere.

	% des Gesamt vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,55
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,38
Finanzderivate	0,22
Sonstige Vermögenswerte	4,85
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### ABKÜRZUNGEN:

- REMIC – Anlageschutz für Immobilienhypotheken.
- TBA – Wird bekannt gegeben.

### Zeitplan der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,250 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15/02/2028	3.893	\$ 135
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,650 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/05/2047	15.289	288
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 423
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (332) USD)				–
Nettowertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (332) USD)				\$ 423

### Zeitplan für Index-Swaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,130 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/08/2028	14.580	\$ 423
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,220 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/08/2028	10.651	249
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/02/2047	4.368	201
Nicht realisierte Wertsteigerung von Index Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 873
Nicht realisierte Wertminderung von Index-Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				–
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 873

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Verkaufswährung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf EUR 640	Verkauf USD 732	\$ (14)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 9 USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(14)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 9 USD)				\$ (14)

### Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
90 Day Euro\$ December 2022	Bank of America Merrill Lynch	356	\$87.465	\$ (130)
90 Day Euro\$ December 2023	Bank of America Merrill Lynch	124	30.335	(202)
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	89	11.342	109
U.S. 10 Year Ultra Note June 2022	Bank of America Merrill Lynch	204	28.831	306
U.S. 2 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(526)	(113.209)	(324)
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(24)	(2.839)	(10)
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	357	55.937	746
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	208	38.675	479
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.252 USD)				\$ 1.640
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.278) USD)				(666)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (26) USD)				\$ 974

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

	Wert (in Tsd.) £	% des Netto- inventar- werts		Wert (in Tsd.) £	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 89,45 % (28. Februar 2021: 90,39 %)</b>			<b>Supranational — 3,00 % (28. Februar 2021: 5,15 %)</b>		
<b>Australien — 1,61 % (28. Februar 2021: 1,16 %)</b>			810 European Investment Bank, 1,375 %, fällig 07/03/2025		
				808	1,10
			1.240 European Investment Bank, 3,750 %, fällig 07/12/2027		
				1.399	1,90
				2.207	3,00
<b>Belgien — 1,02 % (28. Februar 2021: 1,05 %)</b>			<b>Schweden — 1,41 % (28. Februar 2021: 0,89 %)</b>		
			550 Swedbank AB, 1,375 %, fällig 08/12/2027 *		
				522	0,71
			570 Vattenfall AB, 2,500 %, fällig 29/06/2083 *		
				519	0,70
				1.041	1,41
<b>USA — 1,02 % (28. Februar 2021: 1,05 %)</b>			<b>Schweiz — 3,74 % (28. Februar 2021: 1,85 %)</b>		
			110 Credit Suisse Group AG, 2,125 %, fällig 12/09/2025 *		
				108	0,15
			350 Credit Suisse Group AG, 2,250 %, fällig 09/06/2028 *		
				337	0,46
			580 Credit Suisse Group AG, 2,125 %, fällig 15/11/2029 *		
				546	0,74
			350 Glencore Finance Canada Ltd, 6,000 %, fällig 15/11/2041		
				319	0,43
			210 Holcim Sterling Finance Netherlands BV, 3,000 %, fällig 12/05/2032		
				208	0,28
			390 Holcim Sterling Finance Netherlands BV, 2,250 %, fällig 04/04/2034		
				350	0,48
			930 UBS Group AG, 1,875 %, fällig 03/11/2029 *		
				887	1,20
				2.755	3,74
<b>Kanada — 0,72 % (28. Februar 2021: 1,17 %)</b>			<b>Großbritannien — 42,35 % (28. Februar 2021: 42,16 %)</b>		
			160 Anglian Water Osprey Financing Plc, 2,000 %, fällig 31/07/2028		
				152	0,21
			220 Anglian Water Services Financing Plc, 1,625 %, fällig 10/08/2025		
				218	0,30
			603 Annington Funding Plc, 2,646 %, fällig 12/07/2025		
				605	0,82
			540 Annington Funding Plc, 2,308 %, fällig 06/10/2032		
				497	0,67
			456 Aspire Defence Finance Plc, Series A, 4,674 %, fällig 31/03/2040		
				558	0,76
			230 Associated British Foods Plc, 2,500 %, fällig 16/06/2034		
				227	0,31
			470 Assura Financing Plc, 3,000 %, fällig 19/07/2028		
				490	0,66
			270 Assura Financing Plc, 1,625 %, fällig 30/06/2033		
				244	0,33
			237 Aviva Plc, 5,125 %, fällig 04/06/2050 *		
				256	0,35
			190 Aviva Plc, 6,875 %, fällig 20/05/2058 *		
				256	0,35
			70 Aviva Plc, 6,125 %, Perpetual *		
				71	0,10
			444 BAE Systems Plc, 4,125 %, fällig 08/06/2022		
				447	0,61
			610 Barclays Plc, 2,375 %, fällig 06/10/2023 *		
				612	0,83
			360 Barclays Plc, 3,375 %, fällig 02/04/2025 *		
				317	0,43
			260 Barclays Plc, 1,700 %, fällig 03/11/2026 *		
				251	0,34
			493 Barclays Plc, 3,250 %, fällig 12/02/2027		
				504	0,68
			310 BP Capital Markets Plc, 2,274 %, fällig 03/07/2026		
				313	0,42
			800 British Land Co Plc/The, 2,375 %, fällig 14/09/2029		
				785	1,07
			130 Burberry Group Plc, 1,125 %, fällig 21/09/2025		
				125	0,17
			350 Cadent Finance Plc, 2,625 %, fällig 22/09/2038		
				317	0,43
			200 Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge/The, 2,350 %, fällig 27/06/2078		
				225	0,30
			300 Clarion Funding Plc, 1,250 %, fällig 13/11/2032		
				265	0,36
			300 Clarion Funding Plc, 1,875 %, fällig 22/01/2035		
				274	0,37
			150 Clarion Funding Plc, 3,125 %, fällig 19/04/2048		
				159	0,22
			189 Close Brothers Finance Plc, 2,750 %, fällig 19/10/2026		
				194	0,26
			320 Close Brothers Group Plc, 2,000 %, fällig 11/09/2031 *		
				301	0,41
			191 Clydesdale Bank Plc, 4,625 %, fällig 08/06/2026		
				215	0,29
			257 Coventry Building Society, 5,875 %, fällig 28/09/2022		
				264	0,36
			300 Coventry Building Society, 2,000 %, fällig 20/12/2030		
				277	0,38
			606 CPUK Finance Ltd, 3,588 %, fällig 28/08/2025		
				631	0,86
			195 Crh Finance UK Plc, 4,125 %, fällig 02/12/2029		
				216	0,29
			750 Derwent London Plc, 1,875 %, fällig 17/11/2031		
				695	0,94
			151 Dignity Finance Plc, Series A, 3,546 %, fällig 31/12/2034		
				162	0,22
			152 Eastern Power Networks Plc, 5,750 %, fällig 08/03/2024		
				164	0,22
			92 Eastern Power Networks Plc, 6,250 %, fällig 12/11/2036		
				130	0,18
			370 Experian Finance Plc, 0,739 %, fällig 29/10/2025		
				353	0,48
			170 Experian Finance Plc, 3,250 %, fällig 07/04/2032		
				177	0,24
			319 FCE Bank Plc, 2,727 %, fällig 03/06/2022		
				320	0,43
			220 Folio Residential Finance NO 1 Plc, 1,246 %, fällig 31/10/2027		
				211	0,29
			278 Gatwick Funding Ltd, 6,125 %, fällig 02/03/2026		
				316	0,43
			100 Gatwick Funding Ltd, 2,500 %, fällig 15/04/2030		
				94	0,13
			340 Gatwick Funding Ltd, 3,250 %, fällig 26/02/2048		
				314	0,43
			190 GlaxoSmithKline Capital Plc, 6,375 %, fällig 09/03/2039		
				282	0,38
			104 GlaxoSmithKline Capital Plc, 4,250 %, fällig 18/12/2045		
				130	0,18
			210 Grainger Plc, 3,375 %, fällig 24/04/2028		
				213	0,29
			190 Grainger Plc, 3,000 %, fällig 03/07/2030		
				184	0,25
			164 Greene King Finance Plc, Series A2, 5,318 %, fällig 15/09/2031		
				182	0,25
			230 Greene King Finance Plc, Series B1, 1,898 %, fällig 15/12/2034 *		
				190	0,26
			310 Guinness Partnership Ltd/The, 2,000 %, fällig 22/04/2055		
				266	0,36
			400 HSBC Holdings Plc, 7,000 %, fällig 07/04/2038		
				530	0,72
			387 HSBC Holdings Plc, 6,000 %, fällig 29/03/2040		
				471	0,64
			430 HSBC Holdings Plc, 5,875 %, Perpetual *		
				433	0,59
			100 Hutchison Whampoa Finance UK Plc, Series B, 5,625 %, fällig 24/11/2026		
				116	0,16
			210 Land Securities Capital Markets Plc, 2,399 %, fällig 08/02/2029		
				213	0,29
			100 Land Securities Capital Markets Plc, 2,625 %, fällig 22/09/2037		
				99	0,13

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) £	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) £	% des Nettoinventarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Großbritannien – (Fortsetzung)</b>					
790 Leeds Building Society, 1,375 %, fällig 06/10/2027	749	1,02	580 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,125 %, fällig 25/07/2029	594	0,81
190 Leeds Building Society, 3,750 %, fällig 25/04/2029 *	190	0,26	110 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,875 %, fällig 18/01/2038	150	0,20
240 Legal & General Group Plc, 3,750 %, fällig 26/11/2049 *	235	0,32	300 JPMorgan Chase & Co, 1,895 %, fällig 28/04/2033 *	278	0,38
190 Legal & General Group Plc, 4,500 %, fällig 01/11/2050 *	195	0,26	191 Kraft Heinz Foods Co, 4,125 %, fällig 01/07/2027	204	0,28
330 Liberty Living Finance Plc, 3,375 %, fällig 28/11/2029	342	0,46	200 McDonald's Corp, 2,950 %, fällig 15/03/2034	203	0,27
120 LiveWest Treasury Plc, 2,250 %, fällig 10/10/2043	113	0,15	92 MetLife Inc, 5,375 %, fällig 09/12/2024	100	0,14
430 Lloyds Bank Plc, 5,125 %, fällig 07/03/2025	475	0,65	220 Mondelez International Inc, 4,500 %, fällig 03/12/2035	256	0,35
510 Lloyds Bank Plc, 7,625 %, fällig 22/09/2040	583	0,79	440 Morgan Stanley, 2,625 %, fällig 09/03/2027	443	0,60
453 Lloyds Bank Plc, 6,500 %, fällig 17/09/2040	688	0,93	380 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692 %, fällig 05/06/2028	380	0,50
340 Lloyds Banking Group Plc, 5,125 %, Perpetual *	334	0,45	400 Omnicom Capital Holdings Plc, 2,250 %, fällig 22/11/2033	372	0,52
350 Logicor 2019-1 UK Plc, 1,875 %, fällig 17/11/2026	348	0,47	210 Prologis LP, 2,250 %, fällig 30/06/2029	208	0,28
280 London Stock Exchange Group Plc, 1,625 %, fällig 06/04/2030	264	0,36	290 Realty Income Corp, 1,875 %, fällig 14/01/2027	284	0,39
177 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,125 %, fällig 02/04/2024	184	0,25	365 Time Warner Cable LLC, 5,750 %, fällig 02/06/2031	428	0,58
340 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,750 %, fällig 31/03/2034	386	0,52	300 Toyota Motor Credit Corp, 0,750 %, fällig 19/11/2026	284	0,39
160 Manchester Airport Group Funding Plc, 2,875 %, fällig 30/09/2044	143	0,19	590 Verizon Communications Inc, 1,875 %, fällig 19/09/2030	553	0,75
305 Marston's Issuer Plc, Series A3, 5,177 %, fällig 15/07/2032 *	308	0,42	110 Verizon Communications Inc, 2,500 %, fällig 08/04/2031	108	0,15
108 Marston's Issuer Plc, Series B1, 3,049 %, fällig 16/07/2035 *	86	0,12	320 Verizon Communications Inc, 1,875 %, fällig 03/11/2038	269	0,36
28 Mitchells & Butlers Finance Plc, Series B1, 5,965 %, fällig 15/12/2023	28	0,04	26 Walmart Inc, 5,250 %, fällig 28/09/2035	34	0,05
93 Mitchells & Butlers Finance Plc, Series B2, 6,013 %, fällig 15/12/2028	99	0,13	310 Wells Fargo & Co, 1,375 %, fällig 30/06/2022	310	0,42
300 National Express Group Plc, 2,375 %, fällig 20/11/2028	292	0,40	850 Wells Fargo & Co, 4,875 %, fällig 29/11/2035	977	1,33
250 National Grid Electricity Transmission Plc, 2,000 %, fällig 17/04/2040	213	0,29	200 Wells Fargo Bank NA, 5,250 %, fällig 01/08/2023	208	0,28
310 National Grid Gas Plc, 1,375 %, fällig 07/02/2031	273	0,37		11.827	16,06
100 Nationwide Building Society, 3,000 %, fällig 06/05/2026	104	0,14	<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 66.657 GBP)</b>		
206 Nationwide Building Society, 3,250 %, fällig 20/01/2028	218	0,30		65.867	89,45
230 NatWest Group Plc, 3,125 %, fällig 28/03/2027 *	234	0,32	<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 5,81 % (28. Februar 2021: 6,75 %)</b>		
460 NatWest Group Plc, 2,105 %, fällig 28/11/2031 *	436	0,59	<b>Deutschland — 0,42 % (28. Februar 2021: 0,43 %)</b>		
120 Notting Hill Genesis, 2,875 %, fällig 31/01/2029	124	0,17	EUR 370 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15/02/2030		
140 Onward Pensions Trustee Ltd, 2,125 %, fällig 25/03/2053	123	0,17		309	0,42
390 Paragon Treasury Plc, 2,000 %, fällig 07/05/2036	358	0,49	<b>Großbritannien — 4,38 % (28. Februar 2021: 5,39 %)</b>		
120 Sanctuary Capital Plc, 5,000 %, fällig 26/04/2047	171	0,23	1.910 United Kingdom Gilt, 2,750 %, fällig 07/09/2024		
190 Sanctuary Capital Plc, 2,375 %, fällig 14/04/2050	180	0,24		1.988	2,70
440 Santander UK Group Holdings Plc, 2,920 %, fällig 08/05/2026 *	442	0,60	250 United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig 22/07/2027		
170 Santander UK Plc, 5,750 %, fällig 02/03/2026	198	0,27		252	0,34
467 Santander UK Plc, 3,875 %, fällig 15/10/2029	518	0,70	140 United Kingdom Gilt, 3,250 %, fällig 22/01/2044		
120 Scotland Gas Networks Plc, Series A35, 4,875 %, fällig 21/12/2034	139	0,19		412	0,56
198 Scottish Widows Ltd, 7,000 %, fällig 16/06/2043	264	0,36	400 United Kingdom Gilt, 1,750 %, fällig 22/01/2049		
350 Segro Plc, 2,875 %, fällig 11/10/2037	354	0,48		389	0,53
140 Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,625 %, fällig 22/02/2033	139	0,19		3.222	4,38
180 Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,000 %, fällig 02/06/2040	157	0,21	<b>USA — 1,01 % (28. Februar 2021: 0,93 %)</b>		
100 Severn Trent Utilities Finance Plc, 4,875 %, fällig 24/01/2042	129	0,18	USD 510 United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31/10/2024		
252 South Eastern Power Networks Plc, 5,500 %, fällig 05/06/2026	288	0,39		379	0,52
191 Southern Gas Networks Plc, 2,500 %, fällig 03/02/2025	194	0,26	USD 30 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/11/2041		
380 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500 %, fällig 02/05/2025	383	0,52		21	0,03
190 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,750 %, fällig 27/04/2030	188	0,25	USD 140 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2049		
393 Tesco Property Finance 3 Plc, 5,744 %, fällig 13/04/2040	477	0,65		173	0,23
190 UNITE Group Plc/The, 3,500 %, fällig 15/10/2028	199	0,27	USD 70 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/02/2050		
350 UNITE USAF II Plc, 3,921 %, fällig 30/06/2025	370	0,50		742	1,01
220 United Utilities Water Finance Plc, 1,875 %, fällig 03/06/2042	189	0,26	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 4.504 GBP)</b>		
170 University of Oxford, 2,544 %, fällig 08/12/2117	166	0,23		4.273	5,81
260 Wellcome Trust Ltd/The, 2,517 %, fällig 07/02/2118	252	0,34	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 71.161 GBP)</b>		
362 Western Power Distribution East Midlands Plc, 5,250 %, fällig 17/01/2023	373	0,51	<b>Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,06 %)</b>		
275 Western Power Distribution East Midlands Plc, 6,250 %, fällig 10/12/2040	395	0,54	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
100 Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31/05/2027	96	0,13		8	0,01
100 Whitbread Group Plc, 3,000 %, fällig 31/05/2031	96	0,13	<b>Futures – 0,08 % (28. Februar 2021: 0,05 %)</b>		
180 Yorkshire Building Society, 3,500 %, fällig 21/04/2026	190	0,26	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	31.183	42,35		59	0,08
<b>USA — 16,06 % (28. Februar 2021: 17,54 %)</b>					
USD 700 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21/11/2029	529	0,72	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
USD 141 Amgen Inc, 4,000 %, fällig 13/09/2029	155	0,21		70.207	95,26
USD 100 Apache Corp, 4,750 %, fällig 15/04/2043	71	0,10	<b>Devisenterminkontrakte – (0,05 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
420 AT&T Inc, Series GBP, 2,900 %, fällig 04/12/2026	431	0,58	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
383 AT&T Inc, 4,250 %, fällig 01/06/2043	418	0,57		(35)	(0,05)
200 Bank of America Corp, 7,000 %, fällig 31/07/2028	252	0,34	<b>Futures – (0,01 %) (28. Februar 2021: (0,08 %))</b>		
330 Bank of America Corp, 1,667 %, fällig 02/06/2029 *	311	0,42	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
180 Becton Dickinson and Co, 3,020 %, fällig 24/05/2025	184	0,25		(10)	(0,01)
260 Berkshire Hathaway Finance Corp, 2,625 %, fällig 19/06/2059	243	0,33	<b>Summe – Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
519 Citigroup Inc, 7,375 %, fällig 01/09/2039	840	1,14		(45)	(0,06)
190 Comcast Corp, 1,875 %, fällig 20/02/2036	170	0,23	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
USD 60 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01/04/2040	46	0,06		70.162	95,29
200 Digital Stout Holding LLC, 3,750 %, fällig 17/10/2030	212	0,29	<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		
330 GE Capital UK Funding Unlimited Co, 5,875 %, fällig 18/01/2033	410	0,56		3.471	4,71
560 General Motors Financial Co Inc, 2,350 %, fällig 03/09/2025	556	0,75	<b>Gesamtnettvermögen</b>		
309 Goldman Sachs Group Inc/The, 7,125 %, fällig 07/08/2025	356	0,48		£73.633	100,00

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)	
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	110	Verkauf	GBP	81	£	1
18/05/2022	Citi	Kauf	GBP	944	Verkauf	USD	1.281		(11)
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	GBP	1.320	Verkauf	USD	1.793		(16)
18/05/2022	JP Morgan	Kauf	GBP	192	Verkauf	USD	260		(2)
18/05/2022	UBS	Kauf	GBP	102	Verkauf	AUD	193		(3)
18/05/2022	UBS	Kauf	GBP	1.010	Verkauf	EUR	1.197		7
18/05/2022	UBS	Kauf	GBP	269	Verkauf	USD	365		(3)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 49 GBP)								£	8
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – GBP)									(35)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 49 GBP)								£	(27)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)	
Euro-Bund March 2022	Bank of America Merrill Lynch	(4)	£ (558)	£	22
Long Gilt June 2022	Bank of America Merrill Lynch	21	2.585		2
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(15)	(1.425)		(10)
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	37	3.262		17
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	9	1.051		14
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(832)		4
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 38 GBP)				£	59
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (65) GBP)					(10)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (27) GBP)				£	49

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Vermögensgesicherte Wertpapiere — 0,15 % (28. Februar 2021: 0,16 %)</b>			<b>Frankreich — 2,59 % (28. Februar 2021: 3,34 %)</b>		
263 SMB Private Education Loan Trust 2020-A, Series 2020 A, Class A2A, 144A, 2,230 %, fällig 15/09/2037			560 BNP Paribas SA, 144A, 2,819 %, fällig 19/11/2025 *		
	261	0,15	480 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09/06/2026 *	471	0,27
<b>Summe der forderungsbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 272 USD)</b>			320 BNP Paribas SA, 144A, 1,323 %, fällig 13/01/2027 *		
	261	0,15	770 BNP Paribas SA, 144A, 1,675 %, fällig 30/06/2027 *	301	0,17
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 81,87 % (28. Februar 2021: 87,35 %)</b>			340 BNP Paribas SA, 144A, 2,159 %, fällig 15/09/2029 *		
<b>Australien — 1,08 % (28. Februar 2021: 0,73 %)</b>			400 BNP Paribas SA, 144A, 2,824 %, fällig 26/01/2041		
200 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 2,688 %, fällig 11/03/2031			370 BPCE SA, 144A, 3,116 %, fällig 19/10/2032 *		
	187	0,11	1.350 Societe Generale SA, 144A, 1,488 %, fällig 14/12/2026 *	1.263	0,72
200 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 3,743 %, fällig 12/09/2039			200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, fällig 17/09/2044		
	198	0,11		198	0,11
200 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 3,305 %, fällig 11/03/2041					
	185	0,11	<b>Deutschland — 0,04 % (28. Februar 2021: 0,04 %)</b>		
30 Glencore Funding LLC, 144A, 3,000 %, fällig 27/10/2022			50 Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, fällig 15/06/2030		
	30	0,02		69	0,04
460 Glencore Funding LLC, 144A, 4,625 %, fällig 29/04/2024			<b>Indien — 0,31 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
	481	0,27	580 Reliance Industries Ltd, 144A, 2,875 %, fällig 12/01/2032		
120 Glencore Funding LLC, 144A, 1,625 %, fällig 01/09/2025				543	0,31
	116	0,07	<b>Irland — 1,00 % (28. Februar 2021: 1,52 %)</b>		
40 Glencore Funding LLC, 144A, 3,875 %, fällig 27/10/2027			270 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,500 %, fällig 15/09/2023		
	41	0,02		278	0,16
100 Glencore Funding LLC, 144A, 2,625 %, fällig 23/09/2031			410 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,150 %, fällig 15/02/2024		
	92	0,05		414	0,24
120 Westpac Banking Corp, 2,668 %, fällig 15/11/2035 *			160 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30/01/2032		
	109	0,06		152	0,09
130 Westpac Banking Corp, 3,020 %, fällig 18/11/2036 *			150 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,400 %, fällig 29/10/2033		
	121	0,07		142	0,08
370 Westpac Banking Corp, 3,133 %, fällig 18/11/2041			180 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,850 %, fällig 29/10/2041		
	333	0,19		167	0,09
	1.893	1,08	28 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 01/05/2022		
				28	0,01
<b>Belgien — 0,36 % (28. Februar 2021: 0,52 %)</b>			180 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 01/10/2023		
570 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15/04/2048				186	0,11
	626	0,36	380 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 15/04/2026		
				391	0,22
<b>Bermuda — 0,15 % (28. Februar 2021: 0,25 %)</b>					
260 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15/10/2025				1.758	1,00
	270	0,15	<b>Israel — 0,01 % (28. Februar 2021: 0,53 %)</b>		
<b>Brasilien — 0,57 % (28. Februar 2021: 0,22 %)</b>			23 Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, fällig 18/12/2022		
360 MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14/01/2031				23	0,01
	317	0,18	<b>Italien — 0,94 % (28. Februar 2021: 1,88 %)</b>		
120 Petrobras Global Finance BV, 5,999 %, fällig 27/01/2028			370 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,125 %, fällig 14/07/2022		
	127	0,07		372	0,21
180 Petrobras Global Finance BV, 6,900 %, fällig 19/03/2049			800 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,375 %, fällig 12/01/2023		
	180	0,10		809	0,46
130 Petrobras Global Finance BV, 5,500 %, fällig 10/06/2051			200 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01/06/2032 *		
	111	0,07		181	0,11
290 Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15/01/2032			310 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,950 %, fällig 01/06/2042 *		
	258	0,15		275	0,16
	993	0,57		1.637	0,94
<b>Kanada — 1,86 % (28. Februar 2021: 2,46 %)</b>			<b>Japan — 1,19 % (28. Februar 2021: 1,24 %)</b>		
140 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30/05/2041			200 Nippon Life Insurance Co, 144A, 3,400 %, fällig 23/01/2050 *		
	174	0,10		191	0,11
60 Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950 %, fällig 15/10/2039			540 Nippon Life Insurance Co, 144A, 2,750 %, fällig 21/01/2051 *		
	76	0,04		492	0,28
300 Canadian Pacific Railway Co, 2,450 %, fällig 02/12/2031			810 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,043 %, fällig 15/09/2023		
	288	0,16		818	0,47
90 Canadian Pacific Railway Co, 3,000 %, fällig 02/12/2041			200 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,522 %, fällig 17/09/2025		
	84	0,05		203	0,11
100 Canadian Pacific Railway Co, 3,100 %, fällig 02/12/2051			200 NTT Finance Corp, 144A, 1,162 %, fällig 03/04/2026		
	91	0,05		190	0,11
790 CI Financial Corp, 3,200 %, fällig 17/12/2030			200 NTT Finance Corp, 144A, 2,065 %, fällig 03/04/2031		
	745	0,42		189	0,11
160 Element Fleet Management Corp, 144A, 1,600 %, fällig 06/04/2024				2.083	1,19
	157	0,09	<b>Kasachstan — 0,10 % (28. Februar 2021: 0,11 %)</b>		
100 GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15/12/2026			200 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, fällig 14/04/2033		
	102	0,06		182	0,10
54 MEG Energy Corp, 144A, 6,500 %, fällig 15/01/2025			<b>Kuwait — 0,22 % (28. Februar 2021: 0,21 %)</b>		
	55	0,03	390 NBK SPC Ltd, 144A, 2,750 %, fällig 30/05/2022		
150 MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01/02/2027				391	0,22
	157	0,09	<b>Luxemburg — 0,03 % (28. Februar 2021: 0,03 %)</b>		
480 Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig 14/07/2026			40 ArcelorMittal SA, 7,000 %, fällig 15/10/2039		
	455	0,26		49	0,03
50 Teck Resources Ltd, 3,900 %, fällig 15/07/2030			<b>Macau — 1,07 % (28. Februar 2021: 0,67 %)</b>		
	51	0,03	580 Sands China Ltd, 5,125 %, fällig 08/08/2025		
290 Teck Resources Ltd, 6,250 %, fällig 15/07/2041			200 Sands China Ltd, 3,800 %, fällig 08/01/2026		
	351	0,20		191	0,11
10 Teck Resources Ltd, 5,400 %, fällig 01/02/2043			200 Sands China Ltd, 144A, 2,300 %, fällig 08/03/2027		
	11	0,01		174	0,10
60 TransAlta Corp, 6,500 %, fällig 15/03/2040			270 Sands China Ltd, 144A, 2,850 %, fällig 08/03/2029		
	64	0,04		227	0,13
350 Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig 15/12/2027			200 Sands China Ltd, 4,375 %, fällig 18/06/2030		
	367	0,21		185	0,10
40 Yamana Gold Inc, 2,630 %, fällig 15/08/2031			200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01/10/2027		
	37	0,02		176	0,10
	3.265	1,86	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26/08/2028		
				175	0,10
<b>Kaimaninseln — 0,08 % (28. Februar 2021: 0,14 %)</b>			200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 15/12/2029		
144 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15/09/2024				170	0,10
	138	0,08		1.875	1,07
<b>Chile — 0,26 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			<b>Mexiko — 0,43 % (28. Februar 2021: 0,44 %)</b>		
530 Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 144A, 3,500 %, fällig 10/09/2051			200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 8,375 %, Perpetual *		
	453	0,26		209	0,12
<b>China — 0,44 % (28. Februar 2021: 0,52 %)</b>			200 Comision Federal de Electricidad, 144A, 3,348 %, fällig 09/02/2031		
200 Alibaba Group Holding Ltd, 2,125 %, fällig 09/02/2031				178	0,10
	180	0,10	200 Comision Federal de Electricidad, 144A, 4,677 %, fällig 09/02/2051		
440 Alibaba Group Holding Ltd, 3,150 %, fällig 09/02/2051				166	0,10
	354	0,20	220 Fresnillo Plc, 144A, 4,250 %, fällig 02/10/2050		
260 Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,840 %, fällig 22/04/2051				201	0,11
	239	0,14		754	0,43
	773	0,44	<b>Dänemark — 0,34 % (28. Februar 2021: 1,11 %)</b>		
<b>Kolumbien — 0,23 % (28. Februar 2021: 0,09 %)</b>			400 Danske Bank A/S, 144A, 3,244 %, fällig 20/12/2025 *		
170 Ecopetrol SA, 4,625 %, fällig 02/11/2031				405	0,23
	152	0,09	200 Danske Bank A/S, 144A, 1,549 %, fällig 10/09/2027 *		
160 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28/05/2045				189	0,11
	140	0,08		594	0,34
130 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 02/11/2051					
	109	0,06			
	401	0,23			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
130 Burlington Northern Santa Fe LLC, 4,400 %, fällig 15/03/2042	146	0,08	110 Costco Wholesale Corp, 1,600 %, fällig 20/04/2030	102	0,06
90 California Institute of Technology, 3,650 %, fällig 01/09/2119	85	0,05	30 Costco Wholesale Corp, 1,750 %, fällig 20/04/2032	28	0,02
70 Cameron LNG LLC, 144A, 3,701 %, fällig 15/01/2039	70	0,04	290 Coterra Energy Inc, 144A, 4,375 %, fällig 01/06/2024	301	0,17
70 Carlyle Finance LLC, 144A, 5,650 %, fällig 15/09/2048	85	0,05	580 Coterra Energy Inc, 144A, 3,900 %, fällig 15/05/2027	605	0,35
140 Carrier Global Corp, 2,493 %, fällig 15/02/2027	139	0,08	189 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25/03/2028	204	0,12
340 Centene Corp, 3,000 %, fällig 15/10/2030	325	0,19	70 CVS Health Corp, 3,250 %, fällig 15/08/2029	71	0,04
240 CenterPoint Energy Houston Electric LLC, Series AA, 3,000 %, fällig 01/02/2027	246	0,14	240 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15/09/2031	222	0,13
180 Charles Schwab Corp/The, 2,000 %, fällig 20/03/2028	175	0,10	10 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25/03/2038	11	0,01
400 Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, Perpetual *	371	0,21	880 CVS Health Corp, 2,700 %, fällig 21/08/2040	769	0,44
390 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,750 %, fällig 15/02/2028	398	0,23	50 CVS Health Corp, 5,125 %, fällig 20/07/2045	58	0,03
50 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15/03/2028	52	0,03	120 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25/03/2048	140	0,08
490 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 2,250 %, fällig 15/01/2029	453	0,26	150 Danaher Corp, 2,800 %, fällig 10/12/2051	133	0,08
520 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01/06/2041	450	0,26	90 DCP Midstream LP, Series A, 7,375 %, Perpetual *	85	0,05
140 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01/03/2042	121	0,07	140 DCP Midstream Operating LP, 3,250 %, fällig 15/02/2032	131	0,07
50 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01/05/2047	53	0,03	40 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03/11/2036	48	0,03
240 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01/04/2048	266	0,15	92 Dell International LLC / EMC Corp, 8,100 %, fällig 15/07/2036	128	0,07
60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01/07/2049	61	0,03	200 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01/05/2025	222	0,13
80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,850 %, fällig 01/04/2061	67	0,04	50 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15/01/2026	56	0,03
150 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,950 %, fällig 30/06/2062	126	0,07	400 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20/10/2025	411	0,23
250 Cheniere Energy Partners LP, 144A, 3,250 %, fällig 31/01/2032	235	0,13	360 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20/10/2028	376	0,21
40 Chevron USA Inc, 2,343 %, fällig 12/08/2050	33	0,02	630 Dermira Inc, 3,000 %, fällig 15/05/2022	635	0,36
160 Cigna Corp, 4,375 %, fällig 15/10/2028	174	0,10	320 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15/12/2025	357	0,20
620 Cigna Corp, 2,400 %, fällig 15/03/2030	590	0,34	182 Devon Energy Corp, 5,875 %, fällig 15/06/2028	194	0,11
130 Cigna Corp, 4,800 %, fällig 15/08/2038	145	0,08	274 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15/01/2030	286	0,16
570 Cigna Corp, 3,200 %, fällig 15/03/2040	528	0,30	70 Devon Energy Corp, 7,950 %, fällig 15/04/2032	95	0,05
150 Cimarex Energy Co, 4,375 %, fällig 15/03/2029	147	0,08	400 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15/07/2041	468	0,27
70 Cintas Corp No 2, 3,700 %, fällig 01/04/2027	74	0,04	450 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15/06/2045	503	0,29
130 Citigroup Inc, 3,980 %, fällig 20/03/2030 *	137	0,08	260 Devon OEI Operating LLC, 7,500 %, fällig 15/09/2027	303	0,17
280 Citigroup Inc, 2,976 %, fällig 05/11/2030 *	277	0,16	240 Diamondback Energy Inc, 3,250 %, fällig 01/12/2026	245	0,14
1.010 Citigroup Inc, 2,561 %, fällig 01/05/2032 *	959	0,55	430 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01/12/2029	435	0,25
430 Citigroup Inc, 2,520 %, fällig 03/11/2032 *	405	0,23	220 Diamondback Energy Inc, 4,400 %, fällig 24/03/2051	228	0,13
660 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15/07/2039	1.034	0,59	200 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01/12/2028	192	0,11
130 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 23/07/2048	152	0,09	110 Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, fällig 01/05/2024	108	0,06
280 Citigroup Inc, Series Y, 4,150 %, Perpetual *	268	0,15	220 Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, fällig 15/02/2040	267	0,15
200 Clorox Co/The, 1,800 %, fällig 15/05/2030	184	0,11	60 Duke Energy Corp, 3,150 %, fällig 15/08/2027	61	0,04
100 Coca-Cola Co/The, 1,375 %, fällig 15/03/2031	90	0,05	210 Duke Energy Florida LLC, 2,400 %, fällig 15/12/2031	200	0,11
180 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01/06/2040	163	0,09	240 Duke Energy Indiana LLC, Series YYY, 3,250 %, fällig 01/10/2049	222	0,13
50 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01/04/2030	52	0,03	110 Duke Energy Ohio Inc, 2,125 %, fällig 01/06/2030	104	0,06
260 Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15/10/2030	286	0,16	180 Eaton Corp, 4,150 %, fällig 02/11/2042	194	0,11
40 Comcast Corp, 7,050 %, fällig 15/03/2033	53	0,03	90 eBay Inc, 2,600 %, fällig 10/05/2031	86	0,05
91 Comcast Corp, 6,500 %, fällig 15/11/2035	121	0,07	150 Edison International, 4,950 %, fällig 15/04/2025	158	0,09
80 Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01/04/2040	81	0,05	130 Edison International, Series B, 5,000 %, Perpetual *	125	0,07
50 Comcast Corp, 3,969 %, fällig 01/11/2047	51	0,03	100 Edison International, Series A, 5,375 %, Perpetual *	99	0,06
632 Comcast Corp, 144A, 2,887 %, fällig 01/11/2051	549	0,31	280 El Paso Natural Gas Co LLC, 7,500 %, fällig 15/11/2026	337	0,19
190 Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15/10/2058	231	0,13	200 Energy Transfer LP, Series SY, 4,200 %, fällig 15/09/2023	206	0,12
70 CommonSpirit Health, 2,782 %, fällig 01/10/2030	68	0,04	90 Energy Transfer LP, 3,900 %, fällig 15/07/2026	93	0,05
80 CommonSpirit Health, 3,910 %, fällig 01/10/2050	81	0,05	250 Energy Transfer LP, 5,500 %, fällig 01/06/2027	276	0,16
240 Commonwealth Edison Co, 6,450 %, fällig 15/01/2038	323	0,18	250 Energy Transfer LP, 4,950 %, fällig 15/06/2028	269	0,15
30 Commonwealth Edison Co, 4,000 %, fällig 01/03/2048	32	0,02	10 Energy Transfer LP, Series 20Y, 5,800 %, fällig 15/06/2038	11	0,01
200 Comstock Resources Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15/05/2025	205	0,12	400 Energy Transfer LP, 6,125 %, fällig 15/12/2045	450	0,26
120 ConocoPhillips, 144A, 3,750 %, fällig 01/10/2027	128	0,07	210 Energy Transfer LP, Series F, 6,750 %, Perpetual *	201	0,11
40 Constellation Brands Inc, 3,700 %, fällig 06/12/2026	42	0,02	810 Energy Transfer LP, Series G, 7,125 %, Perpetual *	796	0,45
30 Constellation Brands Inc, 3,500 %, fällig 09/05/2027	31	0,02	160 Energy Transfer LP, Series H, 6,500 %, Perpetual *	159	0,09
40 Consumers Energy Co, 2,500 %, fällig 01/05/2060	31	0,02	130 Energy Transfer LP, Series B, 6,625 %, Perpetual *	118	0,07
9 Continental Airlines 2007-1 Class A Pass Through Trust, Series 071A, 5,983 %, fällig 19/04/2022	9	0,01	430 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig 16/10/2028	464	0,26
50 Continental Resources Inc/OK, 4,400 %, fällig 15/04/2023	51	0,03	110 Enterprise Products Operating LLC, Series D, 6,875 %, fällig 01/03/2033	141	0,08
100 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,268 %, fällig 15/11/2026	95	0,05	630 Enterprise Products Operating LLC, 4,250 %, fällig 15/02/2048	640	0,37
420 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15/01/2028	435	0,25	190 Enterprise Products Operating LLC, 3,300 %, fällig 15/02/2053	167	0,10
140 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,875 %, fällig 01/04/2032	128	0,07	80 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31/01/2060	75	0,04
40 Corning Inc, 3,900 %, fällig 15/11/2049	40	0,02	450 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15/02/2078 *	418	0,24
			190 EOG Resources Inc, 4,150 %, fällig 15/01/2026	203	0,12
			290 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15/04/2030	320	0,18
			30 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15/04/2050	37	0,02
			420 EQT Corp, 3,000 %, fällig 01/10/2022	424	0,24
			40 EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15/05/2026	39	0,02
			140 EQT Corp, 3,900 %, fällig 01/10/2027	142	0,08
			140 EQT Corp, 7,500 %, fällig 01/02/2030	167	0,10
			30 EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15/05/2031	29	0,02
			270 Equifax Inc, 2,350 %, fällig 15/09/2031	248	0,14
			60 Exxon Mobil Corp, 3,482 %, fällig 19/03/2030	63	0,04
			30 Exxon Mobil Corp, 2,995 %, fällig 16/08/2039	29	0,02
			360 Exxon Mobil Corp, 4,227 %, fällig 19/03/2040	397	0,23
			40 Exxon Mobil Corp, 4,114 %, fällig 01/03/2046	44	0,03
			50 Exxon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15/04/2051	49	0,03
			290 FirstEnergy Corp, Series B, 4,400 %, fällig 15/07/2027	301	0,17
			210 FirstEnergy Corp, Series C, 7,375 %, fällig 15/11/2031	263	0,15
			30 FirstEnergy Corp, Series C, 5,350 %, fällig 15/07/2047	32	0,02
			650 Florida Gas Transmission Co LLC, 144A, 2,300 %, fällig 01/10/2031	597	0,34
			50 Florida Power & Light Co, 3,150 %, fällig 01/10/2049	48	0,03

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
360 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12/02/2032	340	0,19	60 Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375 %, fällig 15/04/2050	57	0,03
760 Ford Motor Credit Co LLC, 3,350 %, fällig 01/11/2022	763	0,44	140 Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 4,900 %, fällig 01/04/2077	163	0,09
300 Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, fällig 10/08/2026	288	0,16	300 Mastercard Inc, 3,350 %, fällig 26/03/2030	315	0,18
200 Ford Motor Credit Co LLC, 4,125 %, fällig 17/08/2027	202	0,12	200 Mastercard Inc, 1,900 %, fällig 15/03/2031	189	0,11
140 Fortinet Inc, 2,200 %, fällig 15/03/2031	129	0,07	80 Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26/03/2050	87	0,05
180 Fox Corp, 5,476 %, fällig 25/01/2039	210	0,12	120 McDonald's Corp, 2,125 %, fällig 01/03/2030	114	0,07
130 General Motors Co, 4,875 %, fällig 02/10/2023	136	0,08	90 McDonald's Corp, 4,450 %, fällig 01/03/2047	99	0,06
80 General Motors Co, 6,125 %, fällig 01/10/2025	89	0,05	230 McDonald's Corp, 4,450 %, fällig 01/09/2048	253	0,14
140 General Motors Co, 6,600 %, fällig 01/04/2036	174	0,10	190 MDC Holdings Inc, 2,500 %, fällig 15/01/2031	173	0,10
20 General Motors Co, 6,750 %, fällig 01/04/2046	25	0,01	70 MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15/01/2043	76	0,04
130 General Motors Co, 5,950 %, fällig 01/04/2049	156	0,09	280 Merck & Co Inc, 1,900 %, fällig 10/12/2028	271	0,15
120 General Motors Financial Co Inc, 3,700 %, fällig 09/05/2023	122	0,07	80 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24/06/2030	73	0,04
630 Genting New York LLC / GENNY Capital Inc, 144A, 3,300 %, fällig 15/02/2026	606	0,35	100 Merck & Co Inc, 2,350 %, fällig 24/06/2040	88	0,05
100 Gilead Sciences Inc, 4,000 %, fällig 01/09/2036	107	0,06	270 Micron Technology Inc, 2,703 %, fällig 15/04/2032	253	0,14
250 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, fällig 21/10/2025	263	0,15	224 Microsoft Corp, 3,450 %, fällig 08/08/2036	241	0,14
430 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig 12/02/2026 *	411	0,23	67 Microsoft Corp, 2,525 %, fällig 01/06/2050	60	0,03
810 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16/11/2026	830	0,47	89 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17/03/2052	85	0,05
1.470 Goldman Sachs Group Inc/The, Series VAR, 1,093 %, fällig 09/12/2026 *	1.384	0,79	50 MidAmerican Energy Co, 3,650 %, fällig 15/04/2029	53	0,03
240 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800 %, fällig 15/03/2030	250	0,14	180 MidAmerican Energy Co, 3,150 %, fällig 15/04/2050	170	0,10
450 Goldman Sachs Group Inc/The, Series DMTN, 2,383 %, fällig 21/07/2032 *	417	0,24	310 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20/06/2027	327	0,19
500 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,650 %, fällig 21/10/2032 *	475	0,27	40 Molson Coors Beverage Co, 3,000 %, fällig 15/07/2026	41	0,02
140 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22/05/2045	168	0,10	80 Molson Coors Beverage Co, 4,200 %, fällig 15/07/2046	80	0,05
50 Halliburton Co, 2,920 %, fällig 01/03/2030	49	0,03	40 Mondelez International Inc, 2,625 %, fällig 04/09/2050	34	0,02
10 Halliburton Co, 5,000 %, fällig 15/11/2045	11	0,01	270 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28/04/2026 *	267	0,15
100 HCA Inc, 5,125 %, fällig 15/06/2039	112	0,06	1.830 Morgan Stanley, 0,985 %, fällig 10/12/2026 *	1.715	0,98
150 Hershey Co/The, 1,700 %, fällig 01/06/2030	140	0,08	50 Morgan Stanley, 1,593 %, fällig 04/05/2027 *	48	0,03
40 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15/04/2040	40	0,02	70 Morgan Stanley, 1,794 %, fällig 13/02/2032 *	63	0,04
100 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15/04/2050	98	0,06	210 Morgan Stanley, 2,239 %, fällig 21/07/2032 *	193	0,11
70 Humana Inc, 4,950 %, fällig 01/10/2044	82	0,05	300 Morgan Stanley, 2,511 %, fällig 20/10/2032 *	284	0,16
540 ILLFC E-Capital Trust I, 144A, 3,370 %, fällig 21/12/2065 *	446	0,25	520 Morgan Stanley, 2,484 %, fällig 16/09/2036 *	473	0,27
140 Intel Corp, 2,800 %, fällig 12/08/2041	126	0,07	310 Morgan Stanley, 3,217 %, fällig 22/04/2042 *	296	0,17
220 Intel Corp, 3,200 %, fällig 12/08/2061	195	0,11	20 MPLX LP, 4,800 %, fällig 15/02/2029	22	0,01
80 Jersey Central Power & Light Co, 144A, 4,300 %, fällig 15/01/2026	84	0,05	430 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15/04/2038	443	0,25
370 Johnson & Johnson, 2,100 %, fällig 01/09/2040	318	0,18	330 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692 %, fällig 05/06/2028	443	0,25
90 Johnson & Johnson, 2,450 %, fällig 01/09/2060	75	0,04	330 Nasdaq Inc, 2,500 %, fällig 21/12/2040	277	0,16
70 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23/07/2029 *	75	0,04	90 New York Life Insurance Co, 144A, 3,750 %, fällig 15/05/2050	93	0,05
840 JPMorgan Chase & Co, 2,739 %, fällig 15/10/2030 *	821	0,47	80 New York Life Insurance Co, 144A, 4,450 %, fällig 15/05/2069	89	0,05
20 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22/04/2031 *	19	0,01	70 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 1,050 %, fällig 08/03/2024	68	0,04
450 JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, fällig 13/05/2031 *	438	0,25	90 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,000 %, fällig 09/03/2026	85	0,05
900 JPMorgan Chase & Co, 1,953 %, fällig 04/02/2032 *	821	0,47	110 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, fällig 09/03/2028	105	0,06
260 JPMorgan Chase & Co, 2,580 %, fällig 22/04/2032 *	249	0,14	390 Nordstrom Inc, 2,300 %, fällig 08/04/2024	376	0,21
90 JPMorgan Chase & Co, 2,545 %, fällig 08/11/2032 *	86	0,05	120 Norfolk Southern Railway Co, 7,875 %, fällig 15/05/2043	181	0,10
90 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01/06/2045	108	0,06	80 Northwest Pipeline LLC, 7,125 %, fällig 01/12/2025	92	0,05
140 JPMorgan Chase & Co, 4,260 %, fällig 22/02/2048 *	154	0,09	480 Northwest Pipeline LLC, 4,000 %, fällig 01/04/2027	506	0,29
170 JPMorgan Chase & Co, 3,964 %, fällig 15/11/2048 *	180	0,10	170 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,850 %, fällig 30/09/2047	172	0,10
120 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, fällig 23/01/2049 *	125	0,07	170 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,450 %, fällig 30/03/2051	163	0,09
300 JPMorgan Chase & Co, 3,328 %, fällig 22/04/2052 *	289	0,16	90 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,625 %, fällig 30/09/2059	86	0,05
280 JPMorgan Chase & Co, Series KK, 3,650 %, Perpetual *	266	0,15	340 NRG Energy Inc, 144A, 2,450 %, fällig 02/12/2027	324	0,18
100 Kaiser Foundation Hospitals, Series 2021, 2,810 %, fällig 01/06/2041	93	0,05	130 Nuveen LLC, 144A, 4,000 %, fällig 01/11/2028	141	0,08
70 Kaiser Foundation Hospitals, Series 2019, 3,266 %, fällig 01/11/2049	68	0,04	50 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01/04/2040	51	0,03
20 Kaiser Foundation Hospitals, Series 2021, 3,002 %, fällig 01/06/2051	19	0,01	40 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01/04/2060	42	0,02
380 Kimco Realty Corp, 2,250 %, fällig 01/12/2031	351	0,20	130 Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, fällig 15/08/2026	130	0,07
60 Kinder Morgan Energy Partners LP, 7,300 %, fällig 15/08/2033	77	0,04	50 Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, fällig 15/09/2031	62	0,04
100 Kinder Morgan Inc, 5,300 %, fällig 01/12/2034	112	0,06	40 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig 15/09/2036	47	0,03
90 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01/03/2048	100	0,06	50 Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, fällig 15/06/2039	63	0,04
130 KKR Group Finance Co III LLC, 144A, 5,125 %, fällig 01/06/2044	149	0,09	40 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15/04/2046	38	0,02
40 KKR Group Finance Co VII LLC, 144A, 3,625 %, fällig 25/02/2050	38	0,02	100 Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, fällig 15/02/2047	93	0,05
30 KKR Group Finance Co X LLC, 144A, 3,250 %, fällig 15/12/2051	26	0,02	190 Ohio Edison Co, 6,875 %, fällig 15/07/2036	258	0,15
400 Kyndryl Holdings Inc, 144A, 3,150 %, fällig 15/10/2031	363	0,21	20 Oncor Electric Delivery Co LLC, 3,100 %, fällig 15/09/2049	19	0,01
270 Kyndryl Holdings Inc, 144A, 4,100 %, fällig 15/10/2041	230	0,13	460 Oracle Corp, 4,000 %, fällig 15/07/2046	424	0,24
130 Lam Research Corp, 1,900 %, fällig 15/06/2030	122	0,07	80 Otis Worldwide Corp, 2,565 %, fällig 15/02/2030	77	0,04
50 Lam Research Corp, 2,875 %, fällig 15/06/2050	45	0,03	70 Pacific Gas and Electric Co, 1,750 %, fällig 16/06/2022	70	0,04
220 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08/08/2024	217	0,12	130 Pacific Gas and Electric Co, 4,250 %, fällig 01/08/2023	133	0,08
1.070 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25/06/2025	1.031	0,59	100 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01/08/2027	93	0,05
100 Lennox International Inc, 1,700 %, fällig 01/08/2027	96	0,05	190 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01/02/2031	169	0,10
140 Lithia Motors Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/12/2027	143	0,08	10 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01/08/2040	8	–
240 Lithia Motors Inc, 144A, 3,875 %, fällig 01/06/2029	237	0,14	10 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01/08/2050	8	–
320 Lowe's Cos Inc, 1,700 %, fällig 15/10/2030	288	0,16	100 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 5,625 %, fällig 15/10/2027	104	0,06
110 Lowe's Cos Inc, 2,800 %, fällig 15/09/2041	97	0,06	170 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15/02/2028	173	0,10
150 Lowe's Cos Inc, 3,000 %, fällig 15/10/2050	131	0,07	90 PayPal Holdings Inc, 2,300 %, fällig 01/06/2030	86	0,05
40 M&T Bank Corp, 3,500 %, Perpetual *	37	0,02	150 PayPal Holdings Inc, 3,250 %, fällig 01/06/2050	141	0,08
140 Marriott International Inc/MD, 3,600 %, fällig 15/04/2024	144	0,08	150 PepsiCo Inc, 2,625 %, fällig 29/07/2029	152	0,09
190 Mars Inc, 144A, 2,375 %, fällig 16/07/2040	164	0,09	60 Pfizer Inc, 2,550 %, fällig 28/05/2040	55	0,03
270 Marsh & McLennan Cos Inc, 2,375 %, fällig 15/12/2031	255	0,15	480 Philip Morris International Inc, 1,750 %, fällig 01/11/2030	435	0,25

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
380 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig 15/01/2031	351	0,20	230 Verizon Communications Inc, 1,500 %, fällig 18/09/2030	203	0,12
70 Plains All American Pipeline LP, Series B, 6,125 %, Perpetual *	58	0,03	180 Verizon Communications Inc, 2,550 %, fällig 21/03/2031	173	0,10
40 Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700 %, fällig 15/05/2036	46	0,03	680 Verizon Communications Inc, 4,272 %, fällig 15/01/2036	742	0,42
10 Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, fällig 25/03/2030	10	0,01	10 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16/03/2037	12	0,01
360 Procter & Gamble Co/The, 1,200 %, fällig 29/10/2030	326	0,19	100 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig 20/11/2040	87	0,05
200 Prologis LP, 1,250 %, fällig 15/10/2030	177	0,10	150 Verizon Communications Inc, 3,400 %, fällig 22/03/2041	145	0,08
16 Range Resources Corp, 5,875 %, fällig 01/07/2022	16	0,01	60 Verizon Communications Inc, 2,850 %, fällig 03/09/2041	54	0,03
70 Range Resources Corp, 5,000 %, fällig 15/08/2022	70	0,04	40 Verizon Communications Inc, 6,550 %, fällig 15/09/2043	56	0,03
100 Range Resources Corp, 4,875 %, fällig 15/05/2025	102	0,06	60 Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig 15/08/2046	63	0,04
190 Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15/01/2029	208	0,12	70 Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22/03/2050	72	0,04
70 Raymond James Financial Inc, 4,950 %, fällig 15/07/2046	81	0,05	110 Verizon Communications Inc, 2,875 %, fällig 20/11/2050	94	0,05
90 Raymond James Financial Inc, 3,750 %, fällig 01/04/2051	89	0,05	160 Verizon Communications Inc, 3,550 %, fällig 22/03/2051	155	0,09
180 Republic Services Inc, 3,375 %, fällig 15/11/2027	186	0,11	30 Verizon Communications Inc, 2,987 %, fällig 30/10/2056	26	0,01
190 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, fällig 15/10/2026	179	0,10	170 Verizon Communications Inc, 3,000 %, fällig 20/11/2060	142	0,08
70 S&P Global Inc, 1,250 %, fällig 15/08/2030	62	0,04	820 Verizon Communications Inc, 3,700 %, fällig 22/03/2061	783	0,45
30 S&P Global Inc, 3,250 %, fällig 01/12/2049	29	0,02	90 Visa Inc, 2,050 %, fällig 15/04/2030	87	0,05
480 salesforce.com Inc, 1,500 %, fällig 15/07/2028	453	0,26	70 Visa Inc, 2,700 %, fällig 15/04/2040	66	0,04
60 salesforce.com Inc, 1,950 %, fällig 15/07/2031	57	0,03	70 Visa Inc, 3,650 %, fällig 15/09/2047	74	0,04
230 salesforce.com Inc, 2,900 %, fällig 15/07/2051	209	0,12	220 Vontier Corp, 1,800 %, fällig 01/04/2026	206	0,12
90 salesforce.com Inc, 3,050 %, fällig 15/07/2061	82	0,05	450 Vontier Corp, 2,400 %, fällig 01/04/2028	410	0,23
200 San Diego Gas & Electric Co, Series VVV, 1,700 %, fällig 01/10/2030	182	0,10	770 Walmart Inc, 1,800 %, fällig 22/09/2031	724	0,41
230 San Diego Gas & Electric Co, Series RRR, 3,750 %, fällig 01/06/2047	233	0,13	150 Walmart Inc, 2,650 %, fällig 22/09/2051	138	0,08
180 Service Properties Trust, 4,500 %, fällig 15/06/2023	178	0,10	20 Walt Disney Co/The, 6,200 %, fällig 15/12/2034	26	0,01
520 Southern California Edison Co, 2,250 %, fällig 01/06/2030	489	0,28	23 Walt Disney Co/The, 6,400 %, fällig 15/12/2035	31	0,02
150 Southern California Edison Co, Series G, 2,500 %, fällig 01/06/2031	142	0,08	80 Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig 15/11/2037	109	0,06
10 Southern California Edison Co, 4,000 %, fällig 01/04/2047	10	0,01	50 Walt Disney Co/The, 5,400 %, fällig 01/10/2043	63	0,04
160 Southern California Edison Co, Series C, 4,125 %, fällig 01/03/2048	162	0,09	10 Walt Disney Co/The, 4,950 %, fällig 15/10/2045	12	0,01
100 Southern California Edison Co, 3,650 %, fällig 01/02/2050	95	0,05	170 Waste Management Inc, 3,150 %, fällig 15/11/2027	175	0,10
560 Southwest Airlines Co, 4,750 %, fällig 04/05/2023	579	0,33	280 Wells Fargo & Co, 0,805 %, fällig 19/05/2025 *	271	0,15
260 Southwest Airlines Co, 5,250 %, fällig 04/05/2025	281	0,16	110 Wells Fargo & Co, 2,406 %, fällig 30/10/2025 *	110	0,06
70 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01/02/2032	70	0,04	10 Wells Fargo & Co, 3,000 %, fällig 23/10/2026	10	0,01
170 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig 15/01/2032	168	0,10	300 Wells Fargo & Co, 3,196 %, fällig 17/06/2027 *	305	0,17
50 Target Corp, 3,375 %, fällig 15/04/2029	53	0,03	110 Wells Fargo & Co, 3,584 %, fällig 22/05/2028 *	114	0,06
640 TD SYNNEX Corp, 144A, 1,250 %, fällig 09/08/2024	622	0,35	80 Wells Fargo & Co, 3,068 %, fällig 30/04/2041 *	74	0,04
160 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,270 %, fällig 15/05/2047	173	0,10	270 Wells Fargo & Co, 5,375 %, fällig 02/11/2043	324	0,19
10 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 3,300 %, fällig 15/05/2050	9	0,01	200 Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig 07/12/2046	225	0,13
270 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, fällig 15/03/2027	324	0,19	270 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04/04/2051 *	333	0,19
340 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, fällig 15/10/2028	414	0,24	170 Western Midstream Operating LP, 1,844 %, fällig 13/01/2023 *	169	0,10
320 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01/03/2030	307	0,18	230 Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig 01/06/2025	233	0,13
120 Texas Instruments Inc, 2,250 %, fällig 04/09/2029	119	0,07	250 Western Midstream Operating LP, 4,750 %, fällig 15/08/2028	259	0,15
350 Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15/03/2039	382	0,22	80 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15/08/2048	82	0,05
480 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01/07/2038	602	0,34	130 Western Midstream Operating LP, 5,750 %, fällig 01/02/2050	132	0,08
90 Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig 15/06/2039	109	0,06	10 Williams Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15/10/2051	9	0,01
254 Time Warner Entertainment Co LP, 8,375 %, fällig 15/07/2033	347	0,20		107.763	61,52
60 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15/02/2029	56	0,03	<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 148.935 USD)</b>		
260 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15/02/2031	244	0,14		143.416	81,87
70 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15/02/2031	66	0,04	<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 9,07 % (28. Februar 2021: 4,05 %)</b>		
120 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15/11/2031	109	0,06	<b>Bermuda — 0,18 % (28. Februar 2021: 0,17 %)</b>		
560 T-Mobile USA Inc, 144A, 2,700 %, fällig 15/03/2032	527	0,30	330 Bermuda Government International Bond, 144A, 2,375 %, fällig 20/08/2030		
20 T-Mobile USA Inc, 4,375 %, fällig 15/04/2040	21	0,01		314	0,18
180 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15/02/2041	156	0,09	<b>Chile — 0,20 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
150 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15/02/2051	131	0,07	200 Chile Government International Bond, 2,550 %, fällig 27/07/2033		
335 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01/02/2026	395	0,23		182	0,10
460 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,250 %, fällig 01/12/2026	546	0,31	200 Chile Government International Bond, 3,100 %, fällig 07/05/2041		
50 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 4,450 %, fällig 01/08/2042	53	0,03		176	0,10
410 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950 %, fällig 15/05/2050	407	0,23		358	0,20
380 Truist Financial Corp, 1,267 %, fällig 02/03/2027 *	364	0,21	<b>Ghana — 0,09 % (28. Februar 2021: 0,13 %)</b>		
320 Union Pacific Corp, 2,973 %, fällig 16/09/2062	276	0,16	250 Ghana Government International Bond, 144A, 8,627 %, fällig 16/06/2049		
90 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05/02/2070	90	0,05		162	0,09
152 United Airlines 2014-1 Class B Pass Through Trust, Series B, 4,750 %, fällig 11/04/2022	153	0,09	<b>Israel — 0,45 % (28. Februar 2021: 0,43 %)</b>		
225 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875 %, fällig 15/01/2026	230	0,13	360 Israel Government International Bond, 3,250 %, fällig 17/01/2028		
100 United Airlines Holdings Inc, 4,250 %, fällig 01/10/2022	102	0,06		378	0,22
360 UnitedHealth Group Inc, 3,850 %, fällig 15/06/2028	386	0,22	400 Israel Government International Bond, 2,750 %, fällig 03/07/2030		
110 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15/05/2030	104	0,06		407	0,23
120 UnitedHealth Group Inc, 3,500 %, fällig 15/08/2039	123	0,07		785	0,45
130 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15/05/2040	120	0,07	<b>Mexiko — 1,06 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
120 UnitedHealth Group Inc, 4,750 %, fällig 15/07/2045	142	0,08	MXN 17.350 Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18/11/2038		
30 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15/12/2048	35	0,02		880	0,50
			290 Mexico Government International Bond, 3,500 %, fällig 12/02/2034		
				273	0,16
			750 Mexico Government International Bond, 4,280 %, fällig 14/08/2041		
				706	0,40
				1.859	1,06
			<b>Panama — 0,24 % (28. Februar 2021: 0,24 %)</b>		
			470 Panama Government International Bond, 2,252 %, fällig 29/09/2032		
				416	0,24
			<b>Paraguay — 0,15 % (28. Februar 2021: 0,16 %)</b>		
			260 Paraguay Government International Bond, 144A, 5,400 %, fällig 30/03/2050		
				257	0,15

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Fortsetzung)</b>			<b>Organismen für gemeinsame Anlagen — 6,44 % (28. Februar 2021: 5,08 %)</b>		
<b>Peru — 0,05 % (28. Februar 2021: 0,05 %)</b>			11.279 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)		
100 Peruvian Government International Bond, 2,783 %, fällig 23/01/2031	95	0,05	11.279	6,44	
<b>Katar — 0,42 % (28. Februar 2021: 0,39 %)</b>			<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 11.279 USD)</b>		
230 Qatar Government International Bond, 144A, 4,817 %, fällig 14/03/2049	280	0,16	11.279	6,44	
400 Qatar Government International Bond, 144A, 4,400 %, fällig 16/04/2050	462	0,26			
	742	0,42			
<b>Russland — 0,05 % (28. Februar 2021: 0,13 %)</b>			<b>Vorzugsaktien — 0,29 % (28. Februar 2021: 0,26 %)</b>		
RUB 18.730 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23/05/2029 <sup>†</sup>	88	0,05	<b>USA — 0,29 % (28. Februar 2021: 0,26 %)</b>		
<b>Vereinigte Arabische Emirate — 0,49 % (28. Februar 2021: 0,46 %)</b>			– Targa Resources Corp, Series A		
200 Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 3,125 %, fällig 16/04/2030	209	0,12	500	0,29	
230 Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 3,125 %, fällig 30/09/2049	217	0,12			
400 Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 3,875 %, fällig 16/04/2050	430	0,25	500	0,29	
	856	0,49			
<b>USA — 5,69 % (28. Februar 2021: 1,89 %)</b>			<b>Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 483 USD)</b>		
1.070 United States Treasury Note/Bond, 0,875 %, fällig 31/01/2024	1.058	0,60			
80 United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31/12/2026	78	0,04			
1.380 United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31/01/2027	1.364	0,78			
2.500 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/11/2031	2.397	1,37			
540 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/11/2041	517	0,30			
2.700 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/08/2051	2.591	1,48			
500 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/11/2051	467	0,27			
1.460 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/02/2052	1.488	0,85			
	9.960	5,69			
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 16.468 USD)</b>			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 179.989 USD)</b>		
	15.892	9,07	174.022	99,35	
<b>Darlehensanleihen — 0,85 % (28. Februar 2021: 0,98 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,08 % (28. Februar 2021: 1,84 %)</b>		
168 Asplundh Tree Expert LLC, 1,959 %, fällig 04/09/2027 *	166	0,09	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
169 Carnival Corp, 3,750 %, fällig 30/06/2025 *	167	0,10	<b>Futures – 0,12 % (28. Februar 2021: 0,02 %)</b>		
123 CoreCivic Inc, 5,500 %, fällig 18/12/2024 *	123	0,07	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
278 Horizon Therapeutics USA Inc, 2,250 %, fällig 26/02/2028 *	274	0,16	202		
80 Schweitzer-Mauduit International, Inc., 4,500 %, fällig 23/02/2028 *	78	0,04	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
150 SkyMiles IP Ltd, 4,750 %, fällig 16/09/2027 *	157	0,09	174.367		
150 Southwestern Energy, 3,000 %, fällig 08/06/2027 *	150	0,09	<b>Devisenterminkontrakte – (0,99 %) (28. Februar 2021: (0,02 %))</b>		
179 United Airlines Inc, 4,500 %, fällig 14/04/2028 *	178	0,10	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
191 Zebra Buyer LLC, 3,750 %, fällig 22/04/2028 *	190	0,11	(1.739)		
	1.483	0,85	<b>Futures – (0,09 %) (28. Februar 2021: (0,10 %))</b>		
<b>Gesamtdarlehensanleihen (Anschaffungskosten 1.481 USD)</b>			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
			(158)		
<b>Kommunalanleihen — 0,68 % (28. Februar 2021: 0,66 %)</b>			<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
95 Alabama Economic Settlement Authority, 3,163 %, fällig 15/09/2025	97	0,06	(1.897)		
150 American Municipal Power Inc, 7,834 %, fällig 15/02/2041	238	0,14	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
210 Port Authority of New York & New Jersey, 4,458 %, fällig 01/10/2062	252	0,14	172.470		
220 Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 3,006 %, fällig 15/05/2050	215	0,12	2.699		
210 State of California, 7,300 %, fällig 01/10/2039	312	0,18	1,53		
70 State of Illinois, 5,100 %, fällig 01/06/2033	77	0,04	<b>Gesamtvermögen</b>		
	1.191	0,68	\$175.169		
<b>Summe Kommunalanleihen (Anschaffungskosten 1.071 USD)</b>			100,00		

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Verkaufswährung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)		
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 11	Verkauf	EUR 10	\$ –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 1.959	Verkauf	GBP 1.447	18
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 116.303	Verkauf	USD 157.664	(1.620)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 784	Verkauf	USD 896	(17)
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD 882	Verkauf	GBP 651	9
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	GBP 301	Verkauf	USD 408	(5)
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	EUR 1.402	Verkauf	USD 1.587	(11)
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	RUB 20.762	Verkauf	USD 270	(86)
19/04/2022	JP Morgan	Kauf	MXN 12.140	Verkauf	USD 585	3
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD 269	Verkauf	RUB 20.762	85
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	BRL 1.461	Verkauf	USD 251	28
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 3.528 USD)					£	143
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (48) USD)						(1.739)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 3.480 USD)					£	(1.596)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(26)	\$(3.313)	\$ (24)
U.S. 10 Year Ultra Note June 2022	Bank of America Merrill Lynch	1	141	2
U.S. 2 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(30)	(6.457)	(18)
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	252	29.807	154
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	(67)	(10.498)	(116)
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Bank of America Merrill Lynch	21	3.905	46
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 48 USD)				\$ 202
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (197) USD)				(158)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (149) USD)				\$ 44

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Asset-Backed Securities – 3,57 % (28. Februar 2021: 3,47 %)</b>			<b>Frankreich — 0,97 % (28. Februar 2021: 1,05 %)</b>		
260 Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Cfts Ser 2004-R10, Series 2004 R10, Class M6, 2,242 %, fällig 25/11/2034 *	258	1,18	200 BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14/08/2028	213	0,97
117 Ameriquest Mortgage Securities Trust 2006-R1, Series 2006 R1, Class M1, 0,772 %, fällig 25/03/2036 *	117	0,53	<b>Israel — 1,04 % (28. Februar 2021: 1,04 %)</b>		
66 RAMP Series 2006-RZ3 Trust, Series 2006 RZ3, Class M1, 0,537 %, fällig 25/08/2036 *	66	0,30	120 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21/07/2023	118	0,54
100 Saxon Asset Securities Trust 2006-3, Series 2006 3, Class A4, 0,427 %, fällig 25/10/2046 *	92	0,42	120 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01/10/2026	109	0,50
250 Towd Point Mortgage Trust 2017-4, Series 2017 4, Class B2, 144A, 3,424 %, fällig 25/06/2057 *	251	1,14		227	1,04
<b>Summe der vermögensbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 791 USD)</b>			<b>Macau — 0,79 % (28. Februar 2021: 0,94 %)</b>		
	784	3,57	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26/08/2028	175	0,79
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 17,27 % (28. Februar 2021: 24,54 %)</b>			<b>Peru — 0,53 % (28. Februar 2021: 0,57 %)</b>		
100 BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class C, 4,045 %, fällig 15/09/2060 *	100	0,45	100 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08/11/2042	117	0,53
7.888 Benchmark 2018-B7 Mortgage Trust, Series 2018 B7, Class XA, 0,434 %, fällig 15/05/2053 *	177	0,80	<b>Schweiz — 0,11 % (28. Februar 2021: 0,11 %)</b>		
209 BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA, Series 2018 BIOA, Class A, 144A, 0,862 %, fällig 15/03/2037 *	207	0,95	20 Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 15/11/2041	24	0,11
100 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Series 2021 R03, Class 1B1, 144A, 2,799 %, fällig 25/12/2041 *	93	0,42	<b>Großbritannien — 0,35 % (28. Februar 2021: 1,43 %)</b>		
112 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 CO1, Class 1M2, 2,437 %, fällig 25/07/2030 *	113	0,51	40 BAT Capital Corp, 3,557 %, fällig 15/08/2027	40	0,18
100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	99	0,45	40 BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig 15/08/2047	37	0,17
94 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, fällig 01/03/2051	90	0,41		77	0,35
100 Fannie Mae Pool 'CB2764', 2,000 %, fällig 01/02/2052	96	0,44	<b>USA — 20,29 % (28. Februar 2021: 21,63 %)</b>		
374 Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000 %, fällig 01/09/2048	394	1,79	10 Abbott Laboratories, 3,750 %, fällig 30/11/2026	11	0,05
194 Fannie Mae Pool 'FM7740', 2,500 %, fällig 01/06/2051	192	0,87	10 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30/11/2036	12	0,05
98 Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, fällig 01/07/2051	94	0,43	20 Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig 30/11/2046	25	0,11
100 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 01/02/2052	96	0,44	100 AbbVie Inc, 3,600 %, fällig 14/05/2025	103	0,47
254 Fannie Mae Pool 'MA3057', 3,500 %, fällig 01/07/2047	261	1,19	80 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21/11/2029	81	0,37
95 Freddie Mac Pool 'RA5040', 2,000 %, fällig 01/04/2051	91	0,42	20 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21/11/2049	21	0,10
99 Freddie Mac Pool 'RA6507', 2,000 %, fällig 01/12/2051	95	0,43	20 Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15/08/2030	18	0,08
413 Freddie Mac Pool 'SD0176', 3,500 %, fällig 01/12/2049	427	1,94	20 Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15/08/2050	16	0,07
141 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Series 2020 DNA2, Class M2, 144A, 2,037 %, fällig 25/02/2050 *	142	0,65	32 Altria Group Inc, 4,400 %, fällig 14/02/2026	34	0,16
184 Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000 %, fällig 20/05/2050	191	0,87	8 Altria Group Inc, 4,800 %, fällig 14/02/2029	9	0,04
275 Ginnie Mae II Pool 'MA7473', 3,000 %, fällig 20/07/2051	280	1,28	20 Altria Group Inc, 5,800 %, fällig 14/02/2039	22	0,10
100 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000 % ±	98	0,45	30 Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14/02/2049	33	0,15
400 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500 % ±	400	1,82	40 Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03/06/2030	37	0,17
57 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Series 2021 NQ2R, Class A3, 144A, 1,353 %, fällig 25/10/2058 *	56	0,26	50 Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03/06/2050	43	0,20
<b>Gesamtsumme hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 3.875 USD)</b>			<b>30 Anthem Inc, 3,650 %, fällig 01/12/2027</b>		
	3.792	17,27	50 AT&T Inc, 1,650 %, fällig 01/02/2028	47	0,22
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 27,98 % (28. Februar 2021: 31,01 %)</b>			20 AT&T Inc, 3,100 %, fällig 01/02/2043	18	0,08
<b>Australien — 0,30 % (28. Februar 2021: 0,33 %)</b>			10 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15/09/2031	9	0,04
20 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, fällig 30/09/2043	24	0,11	20 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15/01/2049	22	0,10
40 Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, fällig 27/03/2027	42	0,19	40 Boeing Co/The, 4,875 %, fällig 01/05/2025	43	0,19
	66	0,30	50 Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01/05/2030	55	0,25
<b>Belgien — 0,49 % (28. Februar 2021: 0,81 %)</b>			40 Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01/05/2040	47	0,21
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 01/06/2030	42	0,19	50 Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01/05/2050	60	0,27
20 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01/06/2040	21	0,10	40 BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, fällig 04/05/2026	41	0,19
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01/06/2050	44	0,20	20 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06/04/2030	21	0,10
	107	0,49	20 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig 24/02/2050	17	0,08
<b>Brasilien — 1,75 % (28. Februar 2021: 1,62 %)</b>			40 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26/07/2029	42	0,19
200 Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01/02/2029	208	0,95	16 Bristol-Myers Squibb Co, 5,000 %, fällig 15/08/2045	20	0,09
60 Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15/01/2032	53	0,24	260 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01/05/2032	247	1,13
100 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 21/11/2036	123	0,56	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23/07/2025	42	0,19
	384	1,75	80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15/03/2028	84	0,38
<b>Kanada — 0,96 % (28. Februar 2021: 0,99 %)</b>			40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01/04/2038	42	0,19
30 Bank of Montreal, 1,850 %, fällig 01/05/2025	30	0,13	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01/03/2050	39	0,18
20 Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, fällig 11/06/2025	19	0,09	10 Cheniere Energy Partners LP, 144A, 3,250 %, fällig 31/01/2032	9	0,04
20 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30/05/2041	25	0,11	40 Cigna Corp, 4,375 %, fällig 15/10/2028	43	0,20
20 Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,950 %, fällig 23/06/2023	20	0,09	20 Cigna Corp, 4,800 %, fällig 15/08/2038	22	0,10
10 MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01/02/2029	10	0,05	20 Cigna Corp, 4,900 %, fällig 15/12/2048	23	0,10
40 Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig 10/06/2025	39	0,18	150 Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13/09/2025	164	0,75
70 Toronto-Dominion Bank/The, 1,150 %, fällig 12/06/2025	67	0,31	200 Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03/06/2031 *	191	0,87
	210	0,96	10 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15/07/2039	16	0,07
<b>Kolumbien — 0,40 % (28. Februar 2021: 0,49 %)</b>			50 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 23/07/2048	59	0,27
100 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28/05/2045	87	0,40	50 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 15/03/2051	43	0,20
			40 ConocoPhillips, 144A, 4,300 %, fällig 15/08/2028	44	0,20
			10 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig 01/04/2030	10	0,05
			60 Coterra Energy Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15/03/2029	64	0,29
			30 Deere & Co, 3,750 %, fällig 15/04/2050	32	0,15
			150 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15/01/2026	169	0,77
			160 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20/10/2028	167	0,76

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>			<b>Peru — 0,29 % (28. Februar 2021: 0,31 %)</b>		
<b>USA – (Fortsetzung)</b>			50 Peruvian Government International Bond, 6,550 %, fällig 14/03/2037 63 0,29		
40 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15/12/2025	45	0,20	<b>Polen — 0,24 % (28. Februar 2021: 0,25 %)</b>		
40 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15/06/2045	45	0,20	50 Republic of Poland Government International Bond, 4,000 %, fällig 22/01/2024 52 0,24		
20 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01/12/2029	20	0,09	<b>Russland — 0,84 % (28. Februar 2021: 2,34 %)</b>		
10 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01/12/2026	10	0,04	RUB 39.311 Russian Federal Bond – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23/05/2029 ty 184 0,84		
20 Energy Transfer LP, 5,250 %, fällig 15/04/2029	22	0,10	<b>USA — 21,99 % (28. Februar 2021: 27,34 %)</b>		
20 Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig 15/04/2049	23	0,11	20 United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15/10/2024 20 0,09		
20 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15/04/2030	22	0,10	330 United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31/12/2025 314 1,43		
20 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15/04/2050	24	0,11	60 United States Treasury Note/Bond, 0,875 %, fällig 30/06/2026 58 0,26		
150 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15/01/2029	159	0,72	70 United States Treasury Note/Bond, 0,875 %, fällig 30/09/2026 67 0,31		
10 Exelon Corp, 5,625 %, fällig 15/06/2035	12	0,05	470 United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 31/12/2027 440 2,00		
220 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13/11/2030	219	1,00	320 United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31/01/2028 301 1,37		
20 General Motors Co, 5,950 %, fällig 01/04/2049	24	0,11	210 United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 29/02/2028 202 0,92		
40 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15/04/2040	40	0,18	10 United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30/04/2028 10 0,04		
10 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, fällig 23/01/2049 *	10	0,05	340 United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/05/2028 329 1,50		
20 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01/03/2048	22	0,10	10 United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31/08/2028 10 0,04		
40 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08/08/2024	39	0,18	100 United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30/09/2028 96 0,44		
10 MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15/01/2043	11	0,05	320 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31/10/2028 311 1,42		
30 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24/06/2030	27	0,13	10 United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15/08/2030 9 0,04		
110 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20/06/2027	116	0,53	30 United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 15/02/2031 28 0,13		
40 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig 04/05/2025	39	0,18	170 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15/05/2031 167 0,76		
110 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28/04/2026 *	109	0,49	30 United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/08/2031 28 0,13		
70 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01/04/2031 *	72	0,33	20 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/11/2031 19 0,09		
20 MPLX LP, 4,800 %, fällig 15/02/2029	22	0,10	230 United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 15/08/2041 211 0,96		
20 MPLX LP, 5,500 %, fällig 15/02/2049	23	0,10	50 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2049 57 0,26		
20 NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27/03/2050	20	0,09	50 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/08/2049 50 0,23		
40 Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig 15/01/2028	41	0,19	10 United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/05/2050 8 0,04		
20 Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01/05/2050	25	0,11	380 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/08/2050 313 1,42		
20 PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig 01/05/2030	19	0,09	260 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15/11/2050 228 1,04		
20 Philip Morris International Inc, 2,100 %, fällig 01/05/2030	19	0,09	540 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2051 503 2,29		
20 Philip Morris International Inc, 4,500 %, fällig 20/03/2042	21	0,10	630 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15/05/2051 657 2,99		
40 Raytheon Technologies Corp, 2,250 %, fällig 01/07/2030	38	0,17	50 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/08/2051 48 0,22		
10 Raytheon Technologies Corp, 4,500 %, fällig 01/06/2042	11	0,05	370 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/11/2051 345 1,57		
60 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20/09/2025	65	0,30	4.829 21,99		
10 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01/02/2031	10	0,05	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen</b>		
10 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15/02/2026	10	0,04	<b>(Anschaffungskosten 8.298 USD)</b>		
10 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15/02/2029	9	0,04	7.444 33,90		
70 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15/02/2031	66	0,30	<b>Darlehensanleihen — 7,67 % (28. Februar 2021: 10,40 %)</b>		
10 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15/02/2031	9	0,04	69 1011778 BC ULC, 1,959 %, fällig 14/11/2026 * 68 0,31		
20 T-Mobile USA Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15/04/2031	20	0,09	60 Allied Universal Holdco LLC, 4,250 %, fällig 14/05/2028 * 59 0,27		
20 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01/02/2026	24	0,11	10 AmWINS Group, Inc., 3,000 %, fällig 17/02/2028 * 10 0,04		
50 Union Pacific Corp, 2,891 %, fällig 06/04/2036	48	0,22	59 Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 2,750 %, fällig 01/12/2027 * 59 0,27		
40 Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig 20/03/2060	41	0,19	47 Bausch Health Americas Inc, 2,959 %, fällig 27/11/2025 * 46 0,21		
20 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/04/2029	20	0,09	18 Berry Global Inc, 1,876 %, fällig 01/07/2026 * 18 0,08		
40 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15/05/2030	38	0,17	10 Brookfield WEC Holdings Inc., 3,250 %, fällig 01/08/2025 * 10 0,05		
20 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15/05/2040	19	0,08	20 Brown Group Holding LLC, 3,000 %, fällig 07/06/2028 * 20 0,09		
20 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15/08/2049	21	0,09	69 Caesars Resort Collection LLC, 2,959 %, fällig 22/12/2024 * 69 0,31		
40 US Bancorp, 1,450 %, fällig 12/05/2025	39	0,18	47 Change Healthcare Holdings LLC, 3,500 %, fällig 01/03/2024 * 47 0,21		
20 Visa Inc, 2,050 %, fällig 15/04/2030	19	0,09	69 Charter Communications Operating LLC, 1,960 %, fällig 30/04/2025 * 69 0,32		
30 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14/12/2045	35	0,16	50 Citadel Securities, 2,709 %, fällig 27/02/2028 * 49 0,22		
140 Western Midstream Operating LP, 5,750 %, fällig 01/02/2050	143	0,65	10 CSC Holdings LLC, 2,441 %, fällig 15/01/2026 * 10 0,04		
20 Williams Cos Inc/The, 4,850 %, fällig 01/03/2048	22	0,10	10 DCert Buyer, Inc., 4,209 %, fällig 16/10/2026 * 10 0,05		
4.456 20,29			50 Energizer Holdings, Inc., 2,750 %, fällig 16/12/2027 * 49 0,22		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen</b>			<b>(Anschaffungskosten 6.647 USD)</b>		
6.143 27,98			10 FleetCor Technologies Operating Co, LLC, 1,863 %, fällig 22/04/2028 * 10 0,05		
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 33,90 % (28. Februar 2021: 37,30 %)</b>			10 Four Seasons Hotels Ltd, 2,209 %, fällig 30/11/2023 * 10 0,04		
<b>Brasilien — 1,98 % (28. Februar 2021: 1,41 %)</b>			20 Gainwell Acquisition Corp, 4,750 %, fällig 01/10/2027 * 20 0,09		
BRL 706 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000 %, fällig 01/01/2027	131	0,59	69 Genesee & Wyoming Inc, 2,224 %, fällig 30/12/2026 * 68 0,31		
BRL 710 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000 %, fällig 01/01/2031	127	0,58	59 GoDaddy Operating Co, 1,959 %, fällig 15/02/2024 * 58 0,27		
200 Brazilian Government International Bond, 5,000 %, fällig 27/01/2045	178	0,81	65 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 2,104 %, fällig 15/11/2027 * 64 0,29		
436 1,98			10 GVC Holdings Gibraltar Ltd, 3,000 %, fällig 16/03/2027 * 10 0,05		
<b>Indonesien — 2,20 % (28. Februar 2021: 1,38 %)</b>			59 Harbor Freight Tools USA Inc, 0,000 %, fällig 19/10/2027 * 58 0,27		
200 Indonesia Government International Bond, 4,625 %, fällig 15/04/2043	210	0,96	50 Hunter Douglas Inc, 0,000 %, fällig 09/02/2029 * 49 0,22		
IDR 1.145.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR59, 7,000 %, fällig 15/05/2027	85	0,39	29 ICON Luxembourg S.a.r.l., 2,750 %, fällig 01/07/2028 * 29 0,13		
IDR 2.677.000 Indonesia Treasury Bond, Series FR87, 6,500 %, fällig 15/02/2031	187	0,85	9 iHeartCommunications Inc, 3,105 %, fällig 01/05/2026 * 9 0,04		
482 2,20			7 Indigo Merger Sub, Inc., 2,750 %, fällig 01/07/2028 * 7 0,03		
<b>Mexiko — 6,36 % (28. Februar 2021: 4,27 %)</b>			50 Ineos U.S. Petrochemical, 3,250 %, fällig 21/01/2026 * 49 0,22		
MXN 25.890 Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	1.211	5,51	40 Jazz Financing Lux S.a.r.l., 4,000 %, fällig 22/04/2028 * 40 0,18		
200 Mexico Government International Bond, 4,350 %, fällig 15/01/2047	187	0,85	20 Level 3 Parent LLC, 1,959 %, fällig 01/03/2027 * 19 0,09		
1.398 6,36			10 Michaels Cos Inc/The, 5,000 %, fällig 08/04/2028 * 9 0,04		
			60 Nexstar Broadcasting Inc, 2,606 %, fällig 19/09/2026 * 60 0,27		
			20 Quikrete Holdings, Inc., 0,000 %, fällig 11/06/2028 * 20 0,09		
			10 Rackspace Technology Global, Inc, 3,500 %, fällig 09/02/2028 * 10 0,04		
			20 RealPage Inc, 3,750 %, fällig 18/02/2028 * 20 0,09		
			57 Reynolds Consumer Products LLC, 1,959 %, fällig 04/02/2027 * 56 0,26		
			59 Scientific Games International Inc, 2,959 %, fällig 14/08/2024 * 59 0,27		
			60 Sotera Health, 3,250 %, fällig 13/12/2026 * 59 0,27		
			30 Station Casinos LLC, 2,500 %, fällig 08/02/2027 * 29 0,13		
			18 UFC Holdings LLC, 3,500 %, fällig 29/04/2026 * 18 0,08		

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Verträge (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Loan Notes – (Fortsetzung)</b>					
30 United Airlines Inc, 4,500 %, fällig 14/04/2028 *	30	0,14	– U.S. 10 Year June 2022 Call 127,00, fällig 20/05/2022 – Morgan Stanley	(10)	(0,05)
10 Univision Communications Inc, 4,000 %, fällig 24/03/2026 *	10	0,04	– U.S. 10 Year June 2022 Call 130,00, fällig 20/05/2022 – Morgan Stanley	(3)	(0,02)
69 Verscend Holding Corp., 4,209 %, fällig 27/08/2025 *	69	0,32	– U.S. 10 Year May 2022 Call 127,00, fällig 22/04/2022 – Morgan Stanley	(1)	(0,01)
60 Virgin Media Bristol LLC, 2,691 %, fällig 04/01/2028 *	59	0,27	– U.S. 5 Year April 2022 Call 117,75, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(10)	(0,04)
70 Whatabrands LLC, 3,750 %, fällig 21/07/2028 *	69	0,32	– U.S. 5 Year April 2022 Call 118,00, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(12)	(0,06)
15 Zebra Buyer LLC, 3,750 %, fällig 22/04/2028 *	15	0,07	– U.S. 5 Year April 2022 Call 118,25, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(5)	(0,02)
<b>Gesamtdarlehensanleihen (Anschaffungskosten 1.704 USD)</b>	<b>1.685</b>	<b>7,67</b>	– U.S. 5 Year April 2022 Call 118,50, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(1)	(0,01)
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen — 5,54 % (28. Februar 2021: 6,64 %)</b>					
66 Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	1.003	4,57	– U.S. 5 Year April 2022 Call 118,75, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(6)	(0,03)
213 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	213	0,97	– U.S. 5 Year April 2022 Put 117,25, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(2)	(0,01)
<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 1.144 USD)</b>	<b>1.216</b>	<b>5,54</b>	– U.S. 5 Year April 2022 Put 117,50, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(1)	–
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 22.459 USD)</b>					
	<b>21.064</b>	<b>95,93</b>	– U.S. 5 Year April 2022 Put 118,00, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	–	–
			– U.S. Bond April 2022 Call 157,00, fällig 25/03/2022 – Morgan Stanley	(6)	(0,02)
<b>Geschriebene Optionen gesamt (Anschaffungskosten (\$56))</b>					
				(81)	(0,37)
<b>Inflation Swaps — (0,07 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(16)	(0,07)
<b>Zinsswaps – (0,24 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(52)	(0,24)
<b>Devisenterminkontrakte – (0,86 %) (28. Februar 2021: (0,33 %))</b>					
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(189)	(0,86)
<b>Futures — (2,43 %) (28. Februar 2021 — (0,76 %))</b>					
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(533)	(2,43)
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>					
				(871)	(3,97)
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>					
				20.962	95,47
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>					
				996	4,53
<b>Gesamtvermögen</b>					
				\$21.958	100,00
– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.728.000 USD oder 7,87 % des Nettovermögens.					
* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.					
† Illiquide.					
γ Wertpapiere, die nach Jahresende aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen nicht mehr ertragswirksam sind.					
± Anzugebende Wertpapiere.					
<b>ABKÜRZUNGEN:</b>					
REMIC	— Immobilienhypotheken-Anlagekonduit.				
TBA	— Anzukündigen.				
BRL	— Brasilianischer Real				
IDR	— Indonesische Rupiah				
MXN	— Mexikanischer Peso				
RUB	— Russischer Rubel				
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					
	<b>% des Gesamtvermögens</b>				
– Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	77,14				
– Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	7,16				
– Organismen für gemeinsame Anlagen	5,16				
– Finanzderivate	3,27				
– Sonstige Vermögenswerte	7,27				
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>				

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5,000 % – Verkauf	20/12/2026	1.210	\$ 67
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20/12/2026	7.088	104
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 260 USD)				\$ 171
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)				\$ 171

## Zeitplan der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,820 %	04/06/2024	4.094	\$ (52)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,350 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15/02/2028	317	9
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,000 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	03/06/2051	64	–
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,671 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	09/07/2051	175	13
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 330 USD)				\$ 22
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(52)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 330 USD)				\$ (30)

## Zeitplan für Index-Swaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Pay Fixed 0,710 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/05/2027	3.594	\$ 155
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,130 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/08/2028	613	18
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,200 %, Receive Floating USD SOFR Compound	01/11/2028	286	7
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,220 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/08/2028	122	3
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20/11/2026	660	4
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/02/2047	325	15
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,630 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15/05/2047	1.540	35
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,733 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20/10/2031	420	1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Index Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 238
Nicht realisierte Wertminderung von Index-Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				–
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 238

## Zeitplan für Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	USD – CPI Urban Consumers	18/11/2023	570	\$ 9
Morgan Stanley	USD – CPI Urban Consumers	20/10/2026	410	13
Morgan Stanley	USD – CPI Urban Consumers	18/11/2026	570	(5)
Morgan Stanley	USD – CPI Urban Consumers	20/10/2031	410	(11)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 22
Nicht realisierte Wertminderung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(16)
Nettowertsteigerung von Inflation Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				\$ 6

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Verkaufswährung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
11/03/2022	Bank of America Merrill Lynch	Kauf USD 95	Verkauf RUB 7.150	\$ 29
15/03/2022	Morgan Stanley	Kauf USD 132	Verkauf RUB 10.067	39
19/04/2022	BNP Paribas	Kauf IDR 3.089.752	Verkauf USD 213	2
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf USD 322	Verkauf EUR 284	2
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf RUB 41.641	Verkauf USD 540	(173)
19/04/2022	Goldman Sachs	Kauf GBP 244	Verkauf USD 331	(4)
19/04/2022	JP Morgan	Kauf USD 749	Verkauf CNH 4.788	(6)
19/04/2022	JP Morgan	Kauf USD 289	Verkauf MXN 5.990	(1)
19/04/2022	JP Morgan	Kauf AUD 841	Verkauf USD 603	8
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf USD 458	Verkauf CNH 2.935	(5)
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf JPY 91.330	Verkauf USD 789	6
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf CAD 1.620	Verkauf USD 1.273	6
19/04/2022	Morgan Stanley	Kauf BRL 1.464	Verkauf USD 252	28
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 21 USD)				\$ 120
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (73) USD)				(189)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (52) USD)				\$ (69)

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
90 Day Euro\$ December 2022	Morgan Stanley	76	\$ 18.672	\$ (113)
90 Day Euro\$ December 2023	Morgan Stanley	68	16.635	(164)
90 Day Euro\$ June 2023	Morgan Stanley	9	2.203	(30)
90 Day Euro\$ September 2023	Morgan Stanley	2	489	(6)
Australia 10 Year Bond March 2022	Morgan Stanley	5	489	(17)
Euribor 3 Month June 2022	Morgan Stanley	(9)	(2.534)	1
Euribor 3 Month March 2022	Morgan Stanley	(2)	(564)	–
Euro FX Currency March 2022	Morgan Stanley	1	140	(2)
Euro-Bund March 2022	Morgan Stanley	(2)	(375)	12
Euro-Buxl 30 Year Bond March 2022	Morgan Stanley	(1)	(222)	17
Euro-OAT March 2022	Morgan Stanley	2	355	(18)
Mexican Peso Currency March 2022	Morgan Stanley	12	292	8
RUB/USD March 2022	Morgan Stanley	11	242	(117)
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Morgan Stanley	(11)	(1.402)	(10)
U.S. 10 Year Ultra Note June 2022	Morgan Stanley	(5)	(706)	(8)
U.S. 2 Year Note (CBT) June 2022	Morgan Stanley	3	646	1
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Morgan Stanley	159	18.807	97
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Morgan Stanley	(29)	(4.544)	(48)
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Morgan Stanley	23	4.277	55
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 69 USD)				\$ 191
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (168) USD)				(533)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (99) USD)				\$ (342)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 92,11 %</b>					
<b>Australien – 1,25 %</b>					
EUR 100	AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1,625 %, fällig 11/03/2081 *	1,07			
EUR 20	Westpac Banking Corp, 2,668 %, fällig 15/11/2035 *	0,18			
		1,24			
<b>Belgien – 2,46 %</b>					
EUR 100	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3,700 %, fällig 02/04/2040	1,36			
EUR 100	UCB SA, 1,000 %, fällig 30/03/2028	1,10			
		2,46			
<b>Dänemark – 2,14 %</b>					
EUR 200	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig 12/01/2024	2,14			
<b>Finnland – 1,09 %</b>					
EUR 100	Neste Oyj, 0,750 %, fällig 25/03/2028	1,09			
<b>Frankreich – 10,08 %</b>					
EUR 100	AXA SA, 5,125 %, fällig 04/07/2043 *	1,20			
EUR 230	BNP Paribas SA, 144A, 3,052 %, fällig 13/01/2031 *	2,27			
EUR 100	Engie SA, 0,500 %, fällig 24/10/2030	1,05			
EUR 200	GELF Bond Issuer I SA, 1,125 %, fällig 18/07/2029	2,16			
EUR 100	JCDecaux SA, 1,625 %, fällig 07/02/2030	1,10			
EUR 100	Orange SA, 5,000 %, Perpetual *	1,26			
EUR 100	Terega SA, 0,875 %, fällig 17/09/2030	1,04			
		9,95			10,08
<b>Deutschland – 9,38 %</b>					
EUR 200	Allianz SE, 3,200 %, Perpetual *	1,75			
EUR 100	alstria office REIT-AG, 1,500 %, fällig 15/11/2027	1,08			
EUR 60	Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, fällig 15/06/2030	0,84			
EUR 100	Hannover Rueck SE, 1,125 %, fällig 09/10/2039 *	1,03			
EUR 100	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, fällig 26/05/2049 *	1,18			
EUR 100	Sirius Real Estate Ltd, 1,125 %, fällig 22/06/2026	1,08			
EUR 120	Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, fällig 01/10/2024	1,39			
EUR 100	Vonovia SE, 0,750 %, fällig 01/09/2032	1,00			
		9,25			9,38
<b>Irland – 1,44 %</b>					
EUR 150	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30/01/2032	1,44			
<b>Italien – 4,79 %</b>					
EUR 150	Enel Finance International NV, 144A, 6,000 %, fällig 07/10/2039	1,87			
EUR 200	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01/06/2032 *	1,81			
EUR 100	Terna – Rete Elettrica Nazionale, 2,375 %, Perpetual *	1,09			
		4,73			4,79
<b>Niederlande – 4,23 %</b>					
EUR 80	ABN AMRO Bank NV, 1,000 %, fällig 16/04/2025	0,93			
EUR 200	Coöperatieve Rabobank UA, 3,250 %, Perpetual *	2,14			
EUR 100	ING Groep NV, 2,500 %, fällig 15/02/2029 *	1,15			
		4,17			4,23
<b>Portugal – 1,05 %</b>					
EUR 100	EDP – Energias de Portugal SA, 1,875 %, fällig 02/08/2081*	1,05			
<b>Südafrika – 2,18 %</b>					
EUR 200	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10/04/2027	2,18			
<b>Spanien – 1,89 %</b>					
EUR 100	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 1,375 %, fällig 26/01/2032	1,10			
EUR 60	Telefonica Emisiones SA, 7,045 %, fällig 20/06/2036	0,79			
		1,87			1,89
<b>Schweden – 1,14 %</b>					
EUR 100	Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, fällig 02/03/2028 *	1,14			
<b>Schweiz – 4,36 %</b>					
EUR 200	Credit Suisse Group AG, 6,375 %, Perpetual *	2,04			
EUR 200	UBS Group AG, 1,500 %, fällig 30/11/2024	2,32			
		4,30			4,36
<b>Taiwan – 1,94 %</b>					
EUR 200	TSMC Arizona Corp, 3,250 %, fällig 25/10/2051	1,94			
<b>Großbritannien – 13,23 %</b>					
EUR 100	Annington Funding Plc, 1,650 %, fällig 12/07/2024	1,15			
GBP 100	Associated British Foods Plc, 2,500 %, fällig 16/06/2034	1,34			
EUR 100	Barclays Plc, 3,375 %, fällig 02/04/2025 *	1,20			
GBP 100	Barclays Plc, 1,700 %, fällig 03/11/2026 *	1,31			
EUR 200	HSBC Holdings Plc, 4,950 %, fällig 31/03/2030	2,25			
GBP 100	Lloyds Banking Group Plc, 1,985 %, fällig 15/12/2031 *	1,28			
GBP 100	Marks & Spencer Plc, 3,750 %, fällig 19/05/2026	1,34			
		13,23			
<b>Vereinigte Staaten – 29,46 %</b>					
GBP 200	Standard Chartered Plc, 144A, 2,608 %, fällig 12/01/2028 *	1,94			
GBP 100	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500 %, fällig 02/05/2025	1,37			
		1,305			13,23
<b>120 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21/11/2029</b>					
		1,22			1,23
<b>60 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14/11/2048</b>					
		69			0,70
<b>100 Air Lease Corp, 1,875 %, fällig 15/08/2026</b>					
		95			0,96
<b>30 Anthem Inc, 3,650 %, fällig 01/12/2027</b>					
		32			0,32
<b>130 AT&amp;T Inc, 3,500 %, fällig 15/09/2053</b>					
		119			1,21
<b>100 Ball Corp, 1,500 %, fällig 15/03/2027</b>					
		109			1,10
<b>60 Bank of America Corp, 3,550 %, fällig 05/03/2024 *</b>					
		61			0,62
<b>80 Bank of America Corp, 2,676 %, fällig 19/06/2041 *</b>					
		70			0,71
<b>60 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26/07/2029</b>					
		63			0,64
<b>40 Centene Corp, 4,625 %, fällig 15/12/2029</b>					
		41			0,42
<b>60 Cigna Corp, 2,400 %, fällig 15/03/2030</b>					
		57			0,58
<b>60 Cigna Corp, 3,400 %, fällig 15/03/2050</b>					
		55			0,56
<b>60 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15/07/2039</b>					
		94			0,95
<b>50 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 15/03/2051</b>					
		43			0,44
<b>80 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25/03/2048</b>					
		94			0,95
<b>20 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15/06/2045</b>					
		22			0,23
<b>70 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15/02/2078 *</b>					
		65			0,66
<b>100 Equinix Inc, 1,000 %, fällig 15/03/2033</b>					
		98			0,99
<b>30 Exelon Corp, 3,400 %, fällig 15/04/2026</b>					
		31			0,31
<b>70 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,375 %, fällig 27/03/2025</b>					
		84			0,85
<b>80 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22/05/2045</b>					
		96			0,98
<b>80 HCA Inc, 3,500 %, fällig 01/09/2030</b>					
		79			0,80
<b>30 Humana Inc, 3,125 %, fällig 15/08/2029</b>					
		30			0,31
<b>100 Intel Corp, 3,050 %, fällig 12/08/2051</b>					
		91			0,92
<b>100 JPMorgan Chase &amp; Co, 1,090 %, fällig 11/03/2027 *</b>					
		112			1,13
<b>50 Lowe's Cos Inc, 3,000 %, fällig 15/10/2050</b>					
		44			0,44
<b>70 McDonald's Corp, 3,700 %, fällig 30/01/2026</b>					
		74			0,75
<b>120 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17/03/2052</b>					
		115			1,17
<b>30 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15/04/2038</b>					
		31			0,31
<b>90 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig 15/03/2031</b>					
		85			0,86
<b>100 Prologis Euro Finance LLC, 1,000 %, fällig 06/02/2035</b>					
		98			0,99
<b>30 Prudential Financial Inc, 3,000 %, fällig 10/03/2040</b>					
		28			0,29
<b>80 Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15/03/2039</b>					
		87			0,89
<b>60 United Rentals North America Inc, 3,750 %, fällig 15/01/2032</b>					
		57			0,58
<b>130 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16/03/2037</b>					
		155			1,57
<b>100 Wells Fargo &amp; Co, 1,000 %, fällig 02/02/2027</b>					
		110			1,12
<b>60 Wells Fargo &amp; Co, 5,013 %, fällig 04/04/2051 *</b>					
		74			0,75
<b>130 Williams Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15/10/2051</b>					
		116			1,17
		2.906			29,46
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 9.561 USD)</b>					
			9.088		92,11
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 2,87 %</b>					
<b>Vereinigte Staaten – 2,87 %</b>					
EUR 280	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/02/2025	2,87			
		283			2,87
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 286 USD)</b>					
			283		2,87
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,65 %</b>					
EUR 64	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	0,65			
		64			0,65
<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Kosten 64 USD)</b>					
			64		0,65
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 9.911 USD)</b>					
			9.435		95,63
<b>Devisenterminkontrakte – 2,73 %</b>					
<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>					
			270		2,73
<b>Futures – 0,21 %</b>					
<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>					
			21		0,21
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					
			9.726		98,57
<b>Devisenterminkontrakte – (0,26 %)</b>					
<b>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</b>					
			(26)		(0,26)
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>					
			(26)		(0,26)
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>					
			9.700		98,31
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>					
			166		1,69
<b>Gesamtvermögen</b>					
			\$9.866		100,00

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

- Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.209.000 USD oder 12,26 % des Nettovermögens.
- \* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.

	% des Gesamt vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,42
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,64
Finanzderivate	2,93
Sonstige Vermögenswerte	2,01
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### ABKÜRZUNGEN:

- Unbefristet – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.
- EUR – Euro
- GBP – Britische Pfund

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)		
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2.673	Verkauf	BRL	13.679	20
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	73	Verkauf	BRL	390	(2)
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	14.069	Verkauf	USD	2.572	156
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	1	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	36	Verkauf	USD	48	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	86	Verkauf	USD	98	(2)
04/04/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	13.642	Verkauf	USD	2.644	(22)
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	3.987	Verkauf	EUR	3.470	83
18/05/2022	Citi	Kauf	USD	706	Verkauf	GBP	520	8
18/05/2022	Citi	Kauf	GBP	5	Verkauf	USD	7	–
18/05/2022	Citi	Kauf	EUR	17	Verkauf	USD	19	–
18/05/2022	Citi	Kauf	EUR	35	Verkauf	USD	40	–
18/05/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	115	Verkauf	EUR	100	3
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten							\$	270
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten								(26)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten							\$	244

### Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)	
Euro-Bobl March 2022	Morgan Stanley	(8)	\$ (1.183)	6	
Euro-Buxl 30 Year Bond March 2022	Morgan Stanley	(1)	(222)	6	
Long Gilt June 2022	Morgan Stanley	1	165	–	
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Morgan Stanley	3	383	4	
U.S. 5 Year Note (CBT) June 2022	Morgan Stanley	1	118	1	
U.S. Long Bond (CBT) June 2022	Morgan Stanley	2	314	4	
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten				\$	21
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten					–
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten				\$	21

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 7,64 % (28. Februar 2021: 4,07 %)</b>					
<b>Supranational — 7,64 % (28. Februar 2021: 2,19 %)</b>					
RUB 368.000	International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig 22/01/2026	2.130	0,99		
MXN 71.300	International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig 22/01/2026	3.107	1,44		
ZAR 36.500	International Bank for Reconstruction & Development, 6,500 %, fällig 21/01/2027	2.360	1,09		
RUB 349.000	International Bank for Reconstruction & Development, 6,750 %, fällig 21/01/2027	1.955	0,91		
MXN 94.000	International Bank for Reconstruction & Development, 7,250 %, fällig 21/01/2027	4.555	2,11		
BRL 12.660	International Bank for Reconstruction & Development, 9,500 %, fällig 09/02/2029	2.366	1,10		
		16.473	7,64		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 22.153 USD)</b>					
		16.473	7,64		
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 90,20 % (28. Februar 2021: 92,34 %)</b>					
<b>Australien — 8,15 % (28. Februar 2021: 4,66 %)</b>					
AUD 15.500	Australia Government Bond, Series 128, 5,750 %, fällig 15/07/2022	11.495	5,33		
AUD 1.560	New South Wales Treasury Corp, 4,000 %, fällig 20/04/2023	1.177	0,55		
AUD 3.080	Queensland Treasury Corp, Series 23, 144A, 4,250 %, fällig 21/07/2023	2.342	1,09		
AUD 3.250	Western Australian Treasury Corp, Series 23, 6,000 %, fällig 16/10/2023	2.551	1,18		
		17.565	8,15		
<b>Brasilien — 3,35 % (28. Februar 2021: 2,24 %)</b>					
BRL 38.410	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01/01/2025	7.226	3,35		
<b>Chile — 0,74 % (28. Februar 2021: 0,47 %)</b>					
1.690	Chile Government International Bond, 2,450 %, fällig 31/01/2031	1.596	0,74		
<b>Kolumbien — 4,14 % (28. Februar 2021: 4,26 %)</b>					
COP 41.300.000	Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28/04/2028	8.926	4,14		
<b>Frankreich — 4,99 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
EUR 10.150	French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25/11/2031	10.756	4,99		
<b>Malaysia — 4,23 % (28. Februar 2021: 1,46 %)</b>					
MYR 2.270	Malaysia Government Bond, Series 0117, 3,882 %, fällig 10/03/2022	541	0,25		
MYR 20.370	Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480 %, fällig 15/03/2023	4.929	2,29		
MYR 5.550	Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955 %, fällig 15/09/2025	1.362	0,63		
MYR 9.410	Malaysia Government Bond, Series 0417, 3,899 %, fällig 16/11/2027	2.293	1,06		
		9.125	4,23		
<b>Mexiko — 10,64 % (28. Februar 2021: 9,96 %)</b>					
MXN 104.000	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31/05/2029	5.262	2,44		
MXN 140.900	Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18/11/2038	7.143	3,31		
MXN 166.200	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	7.774	3,61		
MXN 57.700	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07/11/2047	2.761	1,28		
		22.940	10,64		
<b>Neuseeland — 4,10 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
NZD 9.400	New Zealand Government Bond, Series 0423, 5,500 %, fällig 15/04/2023	6.613	3,07		
NZD 3.510	New Zealand Government Bond, Series 0551, 2,750 %, fällig 15/05/2051	2.230	1,03		
		8.843	4,10		
<b>Norwegen — 4,30 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
NOK 81.060	Norway Government Bond, Series 475, 144A, 2,000 %, fällig 24/05/2023	9.268	4,30		
<b>Polen — 5,99 % (28. Februar 2021: 0,75 %)</b>					
PLN 54.160	Republic of Poland Government Bond, Series 1023, 4,000 %, fällig 25/10/2023	12.911	5,99		
<b>Südafrika — 4,07 % (28. Februar 2021: 3,53 %)</b>					
ZAR 102.800	Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28/02/2041	4.463	2,07		
ZAR 79.600	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28/02/2048	4.324	2,00		
		8.787	4,07		
<b>Südkorea — 5,42 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
KRW 13.900.000	Korea Treasury Bond, Series 4412, 2,750 %, fällig 10/12/2044	11.689	5,42		
<b>Großbritannien — 5,31 % (28. Februar 2021: 14,73 %)</b>					
GBP 9.500	United Kingdom Gilt, 0,250 %, fällig 31/07/2031	11.455	5,31		
<b>USA — 24,77 % (28. Februar 2021: 46,46 %)</b>					
28.280	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,064 %, fällig 31/01/2023 *	28.293	13,12		
8.240	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023 *	8.256	3,83		
18.070	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/11/2051	16.864	7,82		
		53.413	24,77		
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 213.494 USD)</b>					
		194.500	90,20		
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,92 % (28. Februar 2021: 4,16 %)</b>					
4.135	Goldman Sachs US Liquid Reserves Fund – Institutional Class	4.135	1,92		
<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 4.135 USD)</b>					
		4.135	1,92		
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 239.782 USD)</b>					
		215.108	99,76		
<b>Devisenterminkontrakte – 1,98 % (28. Februar 2021: 1,12 %)</b>					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	4.267	1,98		
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					
		219.375	101,74		
<b>Devisenterminkontrakte – (2,08 %) (28. Februar 2021: (0,74 %))</b>					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(4.493)	(2,08)		
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>					
		(4.493)	(2,08)		
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>					
		214.882	99,66		
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>					
		753	0,34		
<b>Gesamtvermögen</b>					
		\$215.635	100,00		
– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A	Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 11.610.000 USD oder 5,39 % des Nettovermögens.				
*	Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.				
<b>ABKÜRZUNGEN:</b>					
AUD	– Australischer Dollar				
BRL	– Brasilianischer Real				
COP	– Kolumbianer Peso				
EUR	– Euro				
GBP	– Britische Pfund				
KRW	– Südkoreanischer Won				
MXN	– Mexikanischer Peso				
MYR	– Malaysischer Ringgit				
NOK	– Norwegische Krone				
NZD	– Neuseeland-Dollar				
PLN	– Polnischer Zloty				
RUB	– Russischer Rubel				
ZAR	– Südafrika Rand				
<b>% des Gesamtvermögens</b>					
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					
Organismen für gemeinsame Anlagen					
Finanzderivate					
Sonstige Vermögenswerte					
<b>Gesamtvermögen</b>					
100,00					

# Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	EUR	1	\$
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	7	Verkauf	EUR	6	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	46	Verkauf	GBP	35	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	166	Verkauf	USD	222	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	55	Verkauf	USD	63	–
01/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	–	–
01/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	USD	58	Verkauf	GBP	44	–
01/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	GBP	89	Verkauf	USD	119	–
01/03/2022	HSBC	Kauf	USD	1.322	Verkauf	THB	42.700	16
01/03/2022	HSBC	Kauf	THB	42.700	Verkauf	USD	1.282	25
03/03/2022	Barclays	Kauf	USD	535	Verkauf	JPY	62.000	(5)
03/03/2022	JP Morgan	Kauf	USD	14.533	Verkauf	JPY	1.677.000	(56)
03/03/2022	JP Morgan	Kauf	JPY	1.739.000	Verkauf	USD	15.423	(296)
07/03/2022	HSBC	Kauf	AUD	580	Verkauf	USD	416	5
07/03/2022	JP Morgan	Kauf	USD	4.761	Verkauf	AUD	6.690	(99)
07/03/2022	JP Morgan	Kauf	AUD	6.110	Verkauf	USD	4.364	74
09/03/2022	HSBC	Kauf	THB	24.600	Verkauf	USD	725	28
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	AUD	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	591	Verkauf	AUD	950	(27)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	135	Verkauf	AUD	260	(6)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	271	Verkauf	AUD	379	(5)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	AUD	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	350	Verkauf	CAD	443	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	CAD	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	763	Verkauf	CAD	1.112	(20)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	CAD	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	175	Verkauf	CAD	303	(3)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	79	Verkauf	CNY	686	(2)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	CNY	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	CNY	2	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	158	Verkauf	CNY	1.008	(1)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	348	Verkauf	CNY	2.528	(12)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	165	Verkauf	DKK	1.216	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	38	Verkauf	DKK	332	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	DKK	2	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	DKK	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	75	Verkauf	DKK	486	2
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	MXN	542	Verkauf	EUR	20	1
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	MXN	5	Verkauf	EUR	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	–	Verkauf	EUR	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	66	Verkauf	EUR	13	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	95	Verkauf	EUR	65	1
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	18	Verkauf	EUR	12	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	78	Verkauf	EUR	53	2
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	93	Verkauf	EUR	7	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	81.423	Verkauf	EUR	621	12
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	4	Verkauf	EUR	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	808	Verkauf	EUR	6	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	8.377	Verkauf	EUR	7.308	178
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	ILS	51	Verkauf	EUR	12	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	26	Verkauf	EUR	30	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	42	Verkauf	EUR	38	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	EUR	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NOK	76	Verkauf	EUR	6	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNY	5	Verkauf	EUR	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNY	207	Verkauf	EUR	25	1
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	DKK	15	Verkauf	EUR	2	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	3.469	Verkauf	EUR	4.122	36
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	DKK	88	Verkauf	EUR	10	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	ILS	6	Verkauf	GBP	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	209	Verkauf	GBP	2	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	12.227	Verkauf	GBP	81	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.219	Verkauf	GBP	900	16
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	42	Verkauf	GBP	32	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	54	Verkauf	GBP	45	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	2	Verkauf	GBP	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	12	Verkauf	GBP	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	3	Verkauf	GBP	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.310	Verkauf	GBP	1.946	(20)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	8	Verkauf	GBP	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	–	Verkauf	GBP	–	\$
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNY	5	Verkauf	GBP	1	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNY	28	Verkauf	GBP	3	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)		
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	DKK	9	Verkauf	GBP	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NOK	9	Verkauf	GBP	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	DKK	6	Verkauf	GBP	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	MXN	19	Verkauf	GBP	1	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	15	Verkauf	GBP	7	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	MXN	64	Verkauf	GBP	2	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	1	Verkauf	GBP	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	9	Verkauf	GBP	5	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	169	Verkauf	ILS	613	(2)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	ILS	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	77	Verkauf	ILS	246	1
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	39	Verkauf	ILS	167	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	ILS	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	3.416	Verkauf	JPY	392.615	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	JPY	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	JPY	58	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.711	Verkauf	JPY	267.706	(33)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	7.461	Verkauf	JPY	983.292	(185)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	127	Verkauf	MXN	2.624	(1)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	MXN	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	277	Verkauf	MXN	6.571	(9)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	MXN	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	63	Verkauf	MXN	1.787	(2)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	20	Verkauf	NOK	246	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	89	Verkauf	NOK	909	(1)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	NOK	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	NOK	2	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	42	Verkauf	NOK	362	1
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	79	Verkauf	PLN	314	5
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	172	Verkauf	PLN	788	7
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	40	Verkauf	PLN	216	2
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	25	Verkauf	SEK	310	1
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SEK	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	50	Verkauf	SEK	453	2
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	110	Verkauf	SEK	1.135	2
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	77	Verkauf	SGD	104	1
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	39	Verkauf	SGD	70	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SGD	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	169	Verkauf	SGD	259	(2)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	SGD	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	10	Verkauf	USD	14	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	4.167	Verkauf	USD	5.674	(81)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	18.211	Verkauf	USD	20.890	(462)
10/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	EUR	–	Verkauf	DKK	–	–
10/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	EUR	–	Verkauf	MXN	–	–
10/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	EUR	–	Verkauf	NOK	–	–
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	9.620	Verkauf	NOK	86.730	(217)
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	NOK	134.530	Verkauf	USD	14.988	271
10/03/2022	UBS	Kauf	USD	420	Verkauf	NOK	3.700	1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	AUD	1	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	17	Verkauf	EUR	15	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	189	Verkauf	GBP	142	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2.338	Verkauf	GBP	1.723	22
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	741	Verkauf	USD	531	8
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.691	Verkauf	USD	1.933	(37)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	5	Verkauf	USD	6	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	25.142	Verkauf	USD	34.082	(348)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	58	Verkauf	USD	76	–
16/03/2022	Citi	Kauf	USD	7.182	Verkauf	RUB	552.000	2.088
16/03/2022	Citi	Kauf	RUB	209.000	Verkauf	USD	2.785	(856)
21/03/2022	Citi	Kauf	USD	12.306	Verkauf	KRW	14.650.000	127
21/03/2022	Citi	Kauf	KRW	880.000	Verkauf	USD	735	(3)
13/04/2022	Citi	Kauf	PLN	23.260	Verkauf	USD	5.747	(225)
14/04/2022	HSBC	Kauf	SEK	92.700	Verkauf	USD	10.385	(587)
22/04/2022	HSBC	Kauf	CLP	6.250.000	Verkauf	USD	7.520	244
26/04/2022	Citi	Kauf	EUR	6.710	Verkauf	USD	7.618	(78)
26/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD	969	Verkauf	EUR	860	2
26/04/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	17.870	Verkauf	USD	20.287	\$ (206)
29/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD	8.841	Verkauf	COP	35.400.000	(88)
09/05/2022	Citi	Kauf	NZD	5.590	Verkauf	USD	3.708	71
09/05/2022	HSBC	Kauf	PEN	18.900	Verkauf	USD	4.875	85
09/05/2022	HSBC	Kauf	NZD	10.890	Verkauf	USD	7.207	154
09/05/2022	UBS	Kauf	USD	6.671	Verkauf	NZD	9.970	(68)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
13/05/2022	HSBC	Kauf	THB	42.700	Verkauf	USD	1.325	(17)
17/05/2022	HSBC	Kauf	USD	11.085	Verkauf	ZAR	172.400	(14)
23/05/2022	HSBC	Kauf	HUF	2.355.000	Verkauf	USD	7.448	(409)
24/05/2022	Citi	Kauf	USD	22.104	Verkauf	MXN	456.100	183
25/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	10.952	Verkauf	GBP	8.060	140
10/06/2022	HSBC	Kauf	USD	4.536	Verkauf	CAD	5.760	(10)
10/06/2022	HSBC	Kauf	CAD	5.760	Verkauf	USD	4.543	2
22/06/2022	Citi	Kauf	JPY	1.098.000	Verkauf	USD	9.566	14
22/06/2022	JP Morgan	Kauf	JPY	1.611.000	Verkauf	USD	13.996	59
30/06/2022	HSBC	Kauf	CLP	8.610.000	Verkauf	USD	10.213	377
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 4.100 USD)							\$	4.267
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (2.715) USD)								(4.493)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.385 USD)							\$	(226)

# Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Asset-Backed Securities – 1,50 % (28. Februar 2021: 2,16 %)</b>					
2.570	Towd Point Mortgage Trust 2018-3, Series 2018 3, Class A2, 144A, 3,875 %, fällig 25/05/2058 *	0,35	IDR 125.100.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR80, 7,500 %, fällig 15/06/2035	1,22
8.506	Towd Point Mortgage Trust 2018-5, Series 2018 5, Class A1, 144A, 3,250 %, fällig 25/07/2058 *	1,15	IDR 44.200.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR67, 8,750 %, fällig 15/02/2044	0,48
				45.736	6,08
<b>Summe der vermögensbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 11.246 USD)</b>					
		1,50			
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 5,38 % (28. Februar 2021: 8,13 %)</b>					
1.762	Angel Oak Mortgage Trust 2019-6, Series 2019 6, Class A1, 144A, 2,620 %, fällig 25/11/2059 *	0,23	<b>Mexiko – 6,24 % (28. Februar 2021: 4,50 %)</b>		
7.752	Angel Oak Mortgage Trust 2020-1, Series 2020 1, Class A1, 144A, 2,466 %, fällig 25/12/2059 *	1,03	MXN 396.000	Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18/11/2038	2,67
581	Angel Oak Mortgage Trust I LLC2019-2, Series 2019 2, Class A1, 144A, 3,628 %, fällig 25/03/2049 *	0,08	MXN 561.700	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07/11/2047	3,57
11.380	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust, Series 2017 COR2, Class A3, 3,510 %, fällig 10/09/2050	1,58		46.956	6,24
4.950	COMM 2017-PANW Mortgage Trust, Series 2017 PANW, Class D, 144A, 3,935 %, fällig 10/10/2029 *	0,65	<b>Südafrika – 3,96 % (28. Februar 2021: 4,75 %)</b>		
8.350	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust2017-C34, Series 2017 C34, Class A3, 3,276 %, fällig 15/11/2052	1,13	ZAR 548.400	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28/02/2048	3,96
EUR 1.891	Newgate Funding Plc, Series 2007 1X, Class BB, 0,000 %, fällig 01/12/2050 *	0,26			
EUR 2.997	Newgate Funding Plc, Series 2007 2X, Class BB, 0,000 %, fällig 15/12/2050 *	0,42			
<b>Gesamtsumme hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 41.163 USD)</b>					
		5,38			
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen: 19,33 % (28. Februar 2021: 28,98 %)</b>					
<b>Australien – 3,62 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
15.800	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 0,449 %, fällig 07/07/2025 *	2,10	<b>Südkorea – 8,05 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
11.440	National Australia Bank Ltd, 144A, 0,429 %, fällig 12/01/2025 *	1,52	KRW 80.000.000	Korea Treasury Bond, Series 3012, 1,500 %, fällig 10/12/2030	8,05
		3,62	<b>Großbritannien – 1,91 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
<b>Kanada – 6,50 % (28. Februar 2021: 6,07 %)</b>					
17.160	Bank of Montreal, 0,729 %, fällig 10/03/2023 *	2,29	GBP 13.690	United Kingdom Gilt, 0,625 %, fällig 22/10/2050	1,91
15.820	Bank of Nova Scotia/The, 5,805 %, fällig 15/09/2023 *	2,11	<b>USA – 32,83 % (28. Februar 2021: 34,29 %)</b>		
15.770	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,849 %, fällig 17/03/2023 *	2,10	57.020	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,064 %, fällig 31/01/2023 *	7,58
		6,50	75.985	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,064 %, fällig 31/07/2023 *	10,11
			113.765	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023 *	15,14
				247.135	32,83
<b>Mexiko – 0,98 % (28. Februar 2021: 3,17 %)</b>					
8.230	Petroleos Mexicanos, 7,690 %, fällig 23/01/2050	0,98	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 543.000 USD)</b>		
<b>USA – 8,23 % (28. Februar 2021: 18,49 %)</b>					
1.690	Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01/05/2040	0,26		530.717	70,51
4.050	Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01/05/2050	0,64	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,10 % (28. Februar 2021: 5,77 %)</b>		
2.310	Boeing Co/The, 5,930 %, fällig 01/05/2060	0,37	752	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	0,10
13.630	Capital One Financial Corp, 0,740 %, fällig 06/12/2024 *	1,81	<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Kosten 752 USD)</b>		
7.920	Caterpillar Financial Services Corp, 0,200 %, fällig 17/11/2022 *	1,05		752	0,10
1.685	General Motors Co, 6,800 %, fällig 01/10/2027	0,26	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 740.797 USD)</b>		
1.595	General Motors Co, 6,250 %, fällig 02/10/2043	0,26	728.758		96,82
9.130	General Motors Financial Co Inc, 1,250 %, fällig 17/11/2023 *	1,23	<b>Devisenterminkontrakte – 2,92 % (28. Februar 2021: 2,71 %)</b>		
14.690	Goldman Sachs Group Inc/The, 1,214 %, fällig 23/02/2023 *	1,96	<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>		
3.065	Jabil Inc, 3,000 %, fällig 15/01/2031	0,39	21.946		2,92
		8,23	<b>Futures – 0,17 % (28. Februar 2021: 0,07 %)</b>		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 144.636 USD)</b>					
		19,33	<b>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</b>		
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 70,51 % (28. Februar 2021: 54,36 %)</b>					
<b>Brasilien – 5,12 % (28. Februar 2021: 2,99 %)</b>					
BRL 27.200	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN F, 10,000 %, fällig 01/01/2029	0,65	<b>Futures – (0,65 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
BRL 188.210	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN F, 10,000 %, fällig 01/01/2031	4,47	<b>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</b>		
		5,12	<b>Summe – Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
<b>China – 3,16 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
CNY 139.900	China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14/09/2050	3,16	<b>(27.050) (3,60)</b>		
<b>Kolumbien – 3,16 % (28. Februar 2021: 4,10 %)</b>					
COP 52.680.000	Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28/04/2028	1,51	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
COP 64.720.000	Colombian TES, Series B, 7,250 %, fällig 26/10/2050	1,65	724.926		96,31
		3,16	<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		
<b>Indonesien – 6,08 % (28. Februar 2021: 3,73 %)</b>					
IDR 227.500.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15/03/2029	2,42	27.792		3,69
IDR 187.900.000	Indonesia Treasury Bond, Series FR68, 8,375 %, fällig 15/03/2034	1,96	<b>Gesamtnettovermögen</b>		
			\$752.718		100,00

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 53.535.000 USD oder 7,11 % des Nettovermögens.

\* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.

**ABKÜRZUNGEN:**

- BRL – Brasilianischer Real
- CNY – Chinesischer Renminbi
- COP – Kolumbianer Peso
- EUR – Euro
- GBP – Britische Pfund
- IDR – Indonesische Rupiah
- KRW – Südkoreanischer Won
- MXN – Mexikanischer Peso
- ZAR – Südafrika Rand

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

	% des Gesamt vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,69
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,10
Finanzderivate	2,96
Sonstige Vermögenswerte	4,25
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)	
01/03/2022	HSBC	Kauf	USD	23.836	Verkauf	THB	769.800	\$ 277
01/03/2022	HSBC	Kauf	THB	248.900	Verkauf	USD	7.456	161
01/03/2022	JP Morgan	Kauf	THB	520.900	Verkauf	USD	15.581	361
09/03/2022	HSBC	Kauf	THB	79.700	Verkauf	USD	2.349	90
10/03/2022	HSBC	Kauf	USD	54.261	Verkauf	NOK	476.500	215
10/03/2022	HSBC	Kauf	NOK	135.400	Verkauf	USD	15.111	247
10/03/2022	JP Morgan	Kauf	NOK	205.480	Verkauf	USD	22.913	393
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	NOK	341.100	Verkauf	USD	37.954	735
11/03/2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	76.055	Verkauf	CHF	70.030	(348)
11/03/2022	HSBC	Kauf	USD	15.723	Verkauf	CHF	14.510	(107)
11/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	59.597	Verkauf	CHF	54.790	(179)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	15	Verkauf	GBP	11	-
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	1	Verkauf	USD	-	-
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	750.475	Verkauf	USD	537.360	7.858
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	11.235	Verkauf	USD	15.229	(158)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	97.489	Verkauf	USD	111.511	(2.126)
16/03/2022	Citi	Kauf	RUB	2.367.000	Verkauf	USD	30.542	(8.702)
21/03/2022	Citi	Kauf	USD	39.226	Verkauf	KRW	46.680.000	417
21/03/2022	HSBC	Kauf	USD	22.914	Verkauf	CAD	29.100	(47)
21/03/2022	HSBC	Kauf	CAD	29.100	Verkauf	USD	22.742	219
08/04/2022	HSBC	Kauf	USD	14.991	Verkauf	CLP	12.260.000	(270)
08/04/2022	HSBC	Kauf	CLP	66.420.000	Verkauf	USD	79.038	3.642
11/04/2022	Goldman Sachs	Kauf	SEK	342.500	Verkauf	USD	37.857	(1.656)
14/04/2022	HSBC	Kauf	SEK	341.100	Verkauf	USD	38.215	(2.160)
19/04/2022	HSBC	Kauf	USD	23.130	Verkauf	BRL	128.160	(1.408)
19/04/2022	HSBC	Kauf	BRL	174.410	Verkauf	USD	31.618	1.774
25/04/2022	JP Morgan	Kauf	THB	431.100	Verkauf	USD	12.954	242
26/04/2022	Citi	Kauf	USD	2.350	Verkauf	EUR	2.070	24
26/04/2022	Citi	Kauf	PLN	302.180	Verkauf	USD	74.264	(2.591)
26/04/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	66.810	Verkauf	USD	75.850	(772)
26/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	38.029	Verkauf	PLN	151.240	2.156
26/04/2022	Morgan Stanley	Kauf	EUR	34.940	Verkauf	USD	39.814	(550)
28/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD	45.936	Verkauf	IDR	663.820.000	(58)
29/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD	24.269	Verkauf	COP	97.170.000	(243)
04/05/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	45.936	Verkauf	SGD	61.860	313
09/05/2022	Citi	Kauf	NZD	34.550	Verkauf	USD	22.917	436
09/05/2022	HSBC	Kauf	PEN	150.660	Verkauf	USD	38.864	680
09/05/2022	HSBC	Kauf	NZD	33.970	Verkauf	USD	22.481	480
11/05/2022	Citi	Kauf	USD	20.657	Verkauf	KRW	24.800.000	46
16/05/2022	HSBC	Kauf	AUD	31.760	Verkauf	USD	22.800	294
17/05/2022	HSBC	Kauf	USD	30.225	Verkauf	ZAR	470.100	(37)
18/05/2022	HSBC	Kauf	USD	61.571	Verkauf	CNH	393.920	(452)
24/05/2022	Citi	Kauf	USD	47.243	Verkauf	MXN	974.800	391
25/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	38.768	Verkauf	GBP	28.530	494
10/06/2022	HSBC	Kauf	THB	769.800	Verkauf	USD	23.894	(321)
22/06/2022	JP Morgan	Kauf	JPY	4.335.000	Verkauf	USD	37.819	1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 19.726 USD)							\$	21.946
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (4.911) USD)								(22.185)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 14.815 USD)							\$	(239)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nomineller Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
Euro-BTP March 2022	Morgan Stanley	263	\$ 41.623	\$ (2.284)
Euro-Buxl 30 Year Bond March 2022	Morgan Stanley	(163)	(36.147)	(552)
Euro-OAT March 2022	Morgan Stanley	224	39.754	(2.029)
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Morgan Stanley	347	64.520	1.272
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 545 USD)				\$ 1.272
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): -USD)				(4.865)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 545 USD)				\$ (3.593)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 91,17 % (28. Februar 2021: 93,43 %)</b>					
<b>Brasilien — 4,98 % (28. Februar 2021: 11,68 %)</b>					
200 Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, fällig 28/01/2028	196	1,69	30 Entegris Inc, 3,625 %, fällig 01/05/2029	28	0,24
200 Gol Finance SA, 144A, 8,000 %, fällig 30/06/2026	194	1,67	55 Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, fällig 01/10/2029	50	0,43
200 XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01/07/2026	187	1,62	110 GPS Hospitality Holding Co LLC / GPS Finco Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15/08/2028	92	0,79
	577	4,98	150 Haemonetics Corp, 144A, Null-Coupon, fällig 01/03/2026	126	1,09
<b>Kanada — 2,60 % (28. Februar 2021: 3,98 %)</b>					
180 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15/02/2026	180	1,55	100 Harsco Corp, 144A, 5,750 %, fällig 31/07/2027	99	0,85
120 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15/04/2029	122	1,05	175 Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 6,250 %, fällig 15/05/2026	177	1,52
	302	2,60	15 International Game Technology Plc, 144A, 4,125 %, fällig 15/04/2026	15	0,13
<b>Chile — 3,21 % (28. Februar 2021: 1,73 %)</b>					
200 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27/04/2026	186	1,60	50 KB Home, 4,000 %, fällig 15/06/2031	48	0,41
200 Kenbourne Invest SA, 4,700 %, fällig 22/01/2028	186	1,61	95 Level 3 Financing Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/09/2027	92	0,79
	372	3,21	75 Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01/02/2030	74	0,64
<b>Kolumbien — 3,21 % (28. Februar 2021: 1,70 %)</b>					
200 Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 17/01/2027	190	1,63	66 Macy's Retail Holdings LLC, 2,875 %, fällig 15/02/2023	66	0,57
200 SierraCol Energy Andina LLC, 144A, 6,000 %, fällig 15/06/2028	183	1,58	210 Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01/08/2026	215	1,86
	373	3,21	50 Marriott Ownership Resorts Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15/06/2029	47	0,41
<b>Frankreich — 0,88 % (28. Februar 2021: 0,98 %)</b>					
EUR 100 Altice France SA/France, 3,375 %, fällig 15/01/2028	102	0,88	115 Michaels Cos Inc/The, 5,250 %, fällig 01/05/2028	108	0,93
<b>Israel — 2,46 % (28. Februar 2021: 1,28 %)</b>					
145 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 30/03/2031	135	1,16	50 Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, fällig 01/05/2029	44	0,38
165 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01/10/2026	150	1,30	125 MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15/06/2028	120	1,04
	285	2,46	30 ModivCare Escrow Issuer Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01/10/2029	28	0,24
<b>Luxemburg — 1,53 % (28. Februar 2021: 1,63 %)</b>					
200 Altice France Holding SA, 6,000 %, fällig 15/02/2028	178	1,53	120 Mohegan Gaming & Entertainment, 8,000 %, fällig 01/02/2026	122	1,05
<b>Mexiko — 5,19 % (28. Februar 2021: 8,52 %)</b>					
200 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig 15/11/2029	199	1,72	35 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15/09/2025	34	0,29
275 Petroleos Mexicanos, 5,350 %, fällig 12/02/2028	266	2,29	85 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30/09/2026	82	0,70
165 Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28/01/2060	137	1,18	125 Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, fällig 15/02/2027	122	1,05
	602	5,19	105 Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, fällig 01/09/2030	122	1,06
<b>Panama — 1,67 % (28. Februar 2021: 1,76 %)</b>					
200 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31/05/2030	193	1,67	95 Owl Rock Capital Corp, 4,000 %, fällig 30/03/2025	96	0,83
<b>Großbritannien – 5,36 % (28. Februar 2021: 2,11 %)</b>					
245 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 6,750 %, fällig 01/10/2026	248	2,14	45 Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15/02/2028	41	0,35
200 NatWest Group Plc, 4,600 %, Perpetual *	181	1,56	50 Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 5,750 %, fällig 15/01/2029	50	0,43
200 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15/07/2031	192	1,66	105 Scientific Games International Inc, 144A, 8,625 %, fällig 01/07/2025	111	0,96
	621	5,36	75 Scientific Games International Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15/10/2025	76	0,65
<b>USA — 57,01 % (28. Februar 2021: 51,51 %)</b>					
50 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15/02/2026	53	0,46	55 Scientific Games International Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15/05/2028	57	0,49
200 Alcoa Nederland Holding BV, 4,125 %, fällig 31/03/2029	201	1,73	60 Select Medical Corp, 144A, 6,250 %, fällig 15/08/2026	61	0,53
120 Antero Resources Corp, 5,000 %, fällig 01/03/2025	121	1,05	35 Sensata Technologies Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15/02/2030	34	0,29
38 Antero Resources Corp, 144A, 8,375 %, fällig 15/07/2026	42	0,36	90 Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 144A, 4,625 %, fällig 01/03/2029	83	0,72
45 Arconic Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15/02/2028	46	0,40	115 Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15/03/2026	114	0,99
200 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15/08/2027	190	1,64	55 Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01/03/2030	48	0,42
25 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01/10/2030	27	0,23	25 Switch Ltd, 144A, 4,125 %, fällig 15/06/2029	24	0,21
186 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15/04/2025	187	1,61	25 Synaptics Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15/06/2029	24	0,21
95 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15/02/2029	81	0,70	115 Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15/01/2026	122	1,05
45 Bausch Health Cos Inc, 7,250 %, fällig 30/05/2029	39	0,34	35 TEGNA Inc, 4,625 %, fällig 15/03/2028	35	0,30
35 Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig 01/07/2030	35	0,30	75 Tenet Healthcare Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01/06/2029	72	0,63
50 Carrols Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01/07/2029	43	0,37	115 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15/04/2031	113	0,98
50 Carvana Co, 144A, 5,500 %, fällig 15/04/2027	45	0,39	100 Travel + Leisure Co, 144A, 6,625 %, fällig 31/07/2026	107	0,92
110 Central Garden & Pet Co, 4,125 %, fällig 15/10/2030	105	0,90	100 Travel + Leisure Co, 6,000 %, fällig 01/04/2027	105	0,90
145 Central Garden & Pet Co, 4,125 %, fällig 30/04/2031	136	1,17	75 Tronox Inc, 6,500 %, fällig 01/05/2025	78	0,67
120 CITGO Petroleum Corp, 144A, 6,375 %, fällig 15/06/2026	119	1,03	20 Tronox Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01/05/2025	21	0,18
115 Civitas Resources Inc, 7,500 %, fällig 30/04/2026	116	1,00	45 Uber Technologies Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15/01/2028	46	0,40
115 Cleveland-Cliffs Inc, 5,875 %, fällig 01/06/2027	170	1,47	105 Vector Group Ltd, 5,750 %, fällig 01/02/2029	97	0,84
115 CNX Resources Corp, 144A, 6,000 %, fällig 15/01/2029	118	1,02	55 Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15/05/2025	53	0,46
45 CommScope Inc, 6,000 %, fällig 01/03/2026	46	0,40	115 Vishay Intertechnology Inc, 2,250 %, fällig 15/06/2025	115	1,00
35 CommScope Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01/07/2028	33	0,29	60 Vista Outdoor Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15/03/2029	56	0,49
80 Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01/10/2028	76	0,65	75 XHR LP, 144A, 4,875 %, fällig 01/06/2029	73	0,63
35 Consolidated Communications Inc, 6,500 %, fällig 01/10/2028	35	0,30		6.607	57,01
80 Credit Acceptance Corp, 6,625 %, fällig 15/03/2026	83	0,71	<b>Uruguay — 1,00 % (28. Februar 2021: 1,01 %)</b>		
50 Deluxe Corp, 144A, 8,000 %, fällig 01/06/2029	51	0,44	110 Navios South American Logistics Inc / Navios Logistics Finance US Inc, 144A, 10,750 %, fällig 01/07/2025	116	1,00
255 DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15/08/2026	232	2,00	<b>Sambia — 2,07 % (28. Februar 2021: 2,03 %)</b>		
35 Edgewell Personal Care Co, 5,500 %, fällig 01/06/2028	35	0,30	225 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15/10/2027	239	2,07
25 Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig 15/07/2029	23	0,20	<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 10.804 USD)</b>		
				10.567	91,17
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 2,69 % (28. Februar 2021: 3,35 %)</b>					
<b>Brasilien — 2,08 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
BRL 1.300 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000 %, fällig 01/01/2027	241	2,08			
<b>Ukraine — 0,61 % (28. Februar 2021: 1,69 %)</b>					
200 Ukraine Government International Bond, 7,253 %, fällig 15/03/2033	70	0,61			
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 430 USD)</b>					
	311	2,69			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen — 4,64 % (28. Februar 2021: 1,79 %)</b>		
538 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	538	4,64
<b>Gesamte kollektive Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 538 USD)</b>	538	4,64
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 11.772 USD)</b>	11.416	98,50
<b>Credit Default Swaps – 0,84 % (28. Februar 2021: 2,19 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	97	0,84
<b>Devisenterminkontrakte – 0,44 % (28. Februar 2021: 0,43 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	50	0,44
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	11.563	99,78
<b>Credit Default Swaps — (0,10 %) (28. Februar 2021: (0,07 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(12)	(0,10)
<b>Devisenterminkontrakte – (0,18 %) (28. Februar 2021: (0,25 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(20)	(0,18)
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	(32)	(0,28)
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	11.531	99,50
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>	59	0,50
<b>Gesamtvermögen</b>	\$11.590	100,00

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 5.549.000 USD oder 47,90 % des Nettovermögens.

\* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.

### ABKÜRZUNGEN:

Unbefristet – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.

BRL – Brasilianisch Real

EUR – Euro

### Analyse des Gesamtvermögens

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	% des Gesamtvermögens
Organismen für gemeinsame Anlagen	92,46
Finanzderivate	4,57
Sonstige Vermögenswerte	1,25
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Zeitplan für Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	T-Mobile USA Inc, 5,000 % – Verkauf	20/06/2022	335	\$ 5
Citi	iTraxx Europe, 5,000 % – Verkauf	20/12/2026	945	70
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 % – Verkauf	20/06/2022	345	5
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 % – Verkauf	20/12/2025	175	11
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000 % – Verkauf	20/12/2025	180	5
Morgan Stanley	CenturyLink Inc, 1,000 % – Verkauf	20/06/2025	115	(10)
Morgan Stanley	CenturyLink Inc, 1,000 % – Verkauf	20/06/2023	105	(2)
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 % – Verkauf	20/06/2022	280	1
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 % – Verkauf	20/06/2022	185	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 264 USD)				\$ 97
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (8) USD)				(12)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 256 USD)				\$ 85

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Währung	Verkaufswährung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CHF	– Verkauf	\$ –
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	– Verkauf	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	286 Verkauf	364 (3)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	59 Verkauf	85
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CHF	– Verkauf	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	5 Verkauf	9
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	– Verkauf	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	6 Verkauf	4
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	– Verkauf	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	14 Verkauf	17
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	– Verkauf	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	2.703 Verkauf	1.860 45
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	294 Verkauf	171 3
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	– Verkauf	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2 Verkauf	1
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1 Verkauf	1
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CHF	– Verkauf	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	– Verkauf	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	1 Verkauf	10
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	– Verkauf	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	– Verkauf	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	62 Verkauf	85 (1)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	11.651 Verkauf	9.191 2
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	1 Verkauf	1
26/04/2022	Barclays	Kauf	EUR	520 Verkauf	592 (7)
26/04/2022	Citi	Kauf	EUR	490 Verkauf	556 (6)
26/04/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	680 Verkauf	765
25/05/2022	JP Morgan	Kauf	GBP	170 Verkauf	231 (3)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 52 USD)					\$ 50
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (30) USD)					(20)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 22 USD)					\$ 30

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts				
<b>Asset-Backed Securities – 0,18 % (28. Februar 2021: 0,12 %)</b>			<b>Frankreich — 4,79 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>						
425	Towd Point Mortgage Trust 2017-6, Series 2017 6, Class A2, 144A, 3,000 %, fällig 25/10/2057 *	0,18	EUR	11.040	French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25/11/2031	4,79			
<b>Summe der vermögensbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 413 USD)</b>			<b>Malaysia — 4,45 % (28. Februar 2021: 3,66 %)</b>						
428		0,18	MYR	16.330	Malaysia Government Bond, Series 0117, 3,882 %, fällig 10/03/2022	1,59			
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 0,90 % (28. Februar 2021: 0,68 %)</b>			MYR	13.430	Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480 %, fällig 15/03/2023	1,33			
750	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P, Series 2013 375P, Class A, 144A, 3,251 %, fällig 10/05/2035	0,31	MYR	5.595	Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955 %, fällig 15/09/2025	0,56			
470	COMM 2015-3BP Mortgage Trust, Series 2015 3BP, Class A, 144A, 3,178 %, fällig 10/02/2035	0,19	MYR	9.735	Malaysia Government Bond, Series 0417, 3,899 %, fällig 16/11/2027	0,97			
96	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C04, Class 1M2, 5,087 %, fällig 25/11/2024 *	0,04				10,886	4,45		
427	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C05, Class 1M2, 2,387 %, fällig 25/01/2030 *	0,18	<b>Mexiko — 9,09 % (28. Februar 2021: 9,24 %)</b>						
EUR	52	IM Pastor 4 FTA 4, Class A, 0,000 %, fällig 22/03/2044 *	54	0,02	MXN	119.400	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31/05/2029	6,041	2,47
384	STACR Trust 2018-HRP1, Series 2018 HRP1, Class M2, 144A, 1,837 %, fällig 25/04/2043 *	0,16	384	0,16	MXN	124.000	Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18/11/2038	6,286	2,57
<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 2.218 USD)</b>			2.205	0,90	MXN	156.100	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	7,301	2,99
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 18,49 % (28. Februar 2021: 23,72 %)</b>			<b>Neuseeland — 4,01 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>						
<b>Australien — 3,73 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			NZD	10.460	New Zealand Government Bond, Series 0423, 5,500 %, fällig 15/04/2023	7,358	3,01		
5.350	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 0,449 %, fällig 07/07/2025 *	2,19	NZD	3.860	New Zealand Government Bond, Series 0551, 2,750 %, fällig 15/05/2051	2,453	1,00		
3.750	National Australia Bank Ltd, 144A, 0,429 %, fällig 12/01/2025 *	1,54				9,811	4,01		
		3,73	<b>Norwegen — 4,13 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>						
<b>Kanada — 5,72 % (28. Februar 2021: 5,39 %)</b>			NOK	88.220	Norway Government Bond, Series 475, 144A, 2,000 %, fällig 24/05/2023	10,086	4,13		
4.630	Bank of Montreal, 0,729 %, fällig 10/03/2023 *	1,90	<b>Polen — 8,75 % (28. Februar 2021: 1,00 %)</b>						
5.440	Bank of Nova Scotia/The, 0,599 %, fällig 15/09/2023 *	2,23	PLN	89.740	Republic of Poland Government Bond, Series 1023, 4,000 %, fällig 25/10/2023	21,393	8,75		
3.870	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,849 %, fällig 17/03/2023 *	1,59	<b>Russland — 0,17 % (28. Februar 2021: 0,49 %)</b>						
		13,986	5,72	RUB	83.000	Russian Federal Bond – OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10/04/2030 ty	404	0,17	
<b>Mexiko — 0,97 % (28. Februar 2021: 1,62 %)</b>			<b>Südafrika — 4,13 % (28. Februar 2021: 4,75 %)</b>						
2.645	Petroleos Mexicanos, 7,690 %, fällig 23/01/2050	0,97	ZAR	114.000	Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28/02/2041	4,949	2,02		
<b>USA — 8,07 % (28. Februar 2021: 15,29 %)</b>			ZAR	94.800	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28/02/2048	5,150	2,11		
4.410	Athene Global Funding, 144A, 0,750 %, fällig 24/05/2024 *	1,81				10,099	4,13		
630	Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01/05/2040	0,30	<b>Südkorea — 7,17 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>						
1.760	Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01/05/2050	0,86	KRW	16.400.000	Korea Treasury Bond, Series 3106, 2,000 %, fällig 10/06/2031	12,859	5,26		
1.185	Boeing Co/The, 3,950 %, fällig 01/08/2059	0,44	KRW	6.600.000	Korea Treasury Bond, Series 5103, 1,875 %, fällig 10/03/2051	4,666	1,91		
1.160	Boeing Co/The, 5,930 %, fällig 01/05/2060	0,56				17,525	7,17		
4.450	Capital One Financial Corp, 0,740 %, fällig 06/12/2024 *	1,82	<b>Großbritannien — 5,08 % (28. Februar 2021: 14,49 %)</b>						
800	General Motors Co, 6,800 %, fällig 01/10/2027	0,39	GBP	10.300	United Kingdom Gilt, 0,250 %, fällig 31/07/2031	12,420	5,08		
520	General Motors Co, 6,250 %, fällig 02/10/2043	0,26	<b>USA — 6,30 % (28. Februar 2021: 23,73 %)</b>						
3.955	General Motors Financial Co Inc, 1,250 %, fällig 17/11/2023 *	1,63	4.930	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023 *	4,939	2,02			
		19,724	8,07	11.200	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/11/2051	10,453	4,28		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 45.195 USD)</b>			45,195	18,49		15,392	6,30		
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 78,35 % (28. Februar 2021: 70,77 %)</b>			<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 210.909 USD)</b>			191,467	78,35		
<b>Australien — 8,59 % (28. Februar 2021: 2,22 %)</b>			<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,36 % (28. Februar 2021: 5,53 %)</b>						
AUD	20.040	Australia Government Bond, Series 128, 5,750 %, fällig 15/07/2022	14,862	6,08	3.333	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	3,333	1,36	
AUD	1.520	New South Wales Treasury Corp, 4,000 %, fällig 20/04/2023	1,146	0,47	<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 3.333 USD)</b>				
AUD	3.235	Queensland Treasury Corp, Series 23, 144A, 4,250 %, fällig 21/07/2023	2,460	1,01			3,333	1,36	
AUD	3.200	Western Australian Treasury Corp, Series 23, 6,000 %, fällig 16/10/2023	2,512	1,03	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 262.068 USD)</b>				
		20,980	8,59	<b>Devisenterminkontrakte – 1,17 % (28. Februar 2021: 0,49 %)</b>					
<b>Brasilien — 5,18 % (28. Februar 2021: 3,19 %)</b>			<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>			2,854	1,17		
BRL	32.620	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01/01/2027	6,046	2,47	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>				
BRL	9.240	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01/01/2029	1,678	0,69			245,482	100,45	
BRL	9.230	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01/01/2031	1,649	0,68	<b>Devisenterminkontrakte — (1,67 %) (28. Februar 2021: (0,68 %))</b>				
BRL	18.690	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01/01/2033	3,285	1,34	<b>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</b>				
		12,658	5,18	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>					
<b>China — 3,22 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			(4,074)	(1,67)	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>				
CNY	46.300	China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14/09/2050	7,876	3,22			241,408	98,78	
<b>Kolumbien — 3,29 % (28. Februar 2021: 4,48 %)</b>			<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>			2,988	1,22		
COP	13.900.000	Colombian TES, Series B, 6,250 %, fällig 26/11/2025	3,236	1,33	<b>Gesamtvermögen</b>				
COP	22.200.000	Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28/04/2028	4,798	1,96			\$244,396	100,00	
		8,034	3,29						

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

–	Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.	GBP	–	Britische Pfund
		KRW	–	Südkoreanischer Won
144A	Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 28.112.000 USD oder 11,52 % des Nettovermögens.	MXN	–	Mexikanischer Peso
		MYR	–	Malaysischer Ringgit
		NOK	–	Norwegische Krone
*	Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.	NZD	–	Neuseeland-Dollar
†	Illiquide.	PLN	–	Polnischer Zloty
γ	Wertpapiere, die nach Jahresende aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen nicht mehr ertragswirksam sind.	RUB	–	Russischer Rubel
		ZAR	–	Südafrika Rand

### ABKÜRZUNGEN:

AUD	–	Australischer Dollar
BRL	–	Brasilianischer Real
CNY	–	Chinesischer Renminbi
COP	–	Kolumbien Peso
EUR	–	Euro

### Analyse des Gesamtvermögens

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,95
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,34
Finanzderivate	1,14
Sonstige Vermögenswerte	1,57
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Verkaufswährung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)		
03/03/2022	JP Morgan	Kauf	USD 12.269	Verkauf	JPY 1.416.000	\$ (48)
03/03/2022	JP Morgan	Kauf	JPY 1.416.000	Verkauf	USD 12.559	(241)
04/03/2022	HSBC	Kauf	USD 6.782	Verkauf	CLP 5.460.000	(47)
04/03/2022	HSBC	Kauf	CLP 5.460.000	Verkauf	USD 6.432	396
07/03/2022	HSBC	Kauf	USD 1.392	Verkauf	AUD 1.940	(17)
07/03/2022	JP Morgan	Kauf	USD 3.522	Verkauf	AUD 4.960	(81)
07/03/2022	JP Morgan	Kauf	AUD 6.900	Verkauf	USD 4.928	84
09/03/2022	HSBC	Kauf	THB 47.100	Verkauf	USD 1.388	53
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD 364	Verkauf	AUD 340	(1)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 35	Verkauf	AUD 65	(2)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 45	Verkauf	CAD 76	(1)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD 470	Verkauf	CAD 397	5
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD 212	Verkauf	CNY 904	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 20	Verkauf	CNY 174	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 9	Verkauf	DKK 85	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD 101	Verkauf	DKK 435	3
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD 8.962	Verkauf	EUR 5.211	217
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 846	Verkauf	EUR 1.005	9
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD 1.339	Verkauf	GBP 656	25
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD 103	Verkauf	ILS 220	2
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 9	Verkauf	ILS 43	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 433	Verkauf	JPY 67.777	(8)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD 4.589	Verkauf	JPY 351.625	45
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 16	Verkauf	MXN 453	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD 171	Verkauf	MXN 2.349	1
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 6	Verkauf	NOK 62	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP –	Verkauf	NOK 1	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD 56	Verkauf	NOK 324	1
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD 106	Verkauf	PLN 281	5
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 10	Verkauf	PLN 54	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD 68	Verkauf	SEK 406	3
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 6	Verkauf	SEK 78	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 9	Verkauf	SGD 18	–
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD 103	Verkauf	SGD 92	2
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	NZD 11.198	Verkauf	USD 7.476	100
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 1.058	Verkauf	USD 1.439	(20)
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	USD 10.037	Verkauf	NOK 90.490	(226)
10/03/2022	Morgan Stanley	Kauf	NOK 156.050	Verkauf	USD 17.385	315
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 7	Verkauf	GBP 5	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 294	Verkauf	USD 399	(4)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 1	Verkauf	USD 1	–
16/03/2022	Citi	Kauf	RUB 340.000	Verkauf	USD 4.530	(1.393)
21/03/2022	Citi	Kauf	USD 13.767	Verkauf	KRW 16.390.000	141
13/04/2022	Citi	Kauf	PLN 3.600	Verkauf	USD 886	(31)
14/04/2022	HSBC	Kauf	SEK 111.400	Verkauf	USD 12.481	(705)
19/04/2022	HSBC	Kauf	USD 4.797	Verkauf	BRL 26.100	(201)
19/04/2022	HSBC	Kauf	BRL 18.450	Verkauf	USD 3.270	263
22/04/2022	HSBC	Kauf	CLP 12.750.000	Verkauf	USD 15.317	520
26/04/2022	Citi	Kauf	EUR 950	Verkauf	USD 1.079	(11)
26/04/2022	JP Morgan	Kauf	EUR 22.040	Verkauf	USD 25.018	(251)
28/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD 654	Verkauf	IDR 9.450.000	(1)
28/04/2022	JP Morgan	Kauf	IDR 9.450.000	Verkauf	USD 655	\$ (1)
29/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD 8.017	Verkauf	COP 32.100.000	(80)

# Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
		Kauf			Verkauf			
09/05/2022	Citi	Kauf	NZD	7.580	Verkauf	USD	5.028	96
09/05/2022	HSBC	Kauf	NZD	13.000	Verkauf	USD	8.603	184
09/05/2022	UBS	Kauf	USD	7.427	Verkauf	NZD	11.100	(76)
13/05/2022	HSBC	Kauf	THB	34.700	Verkauf	USD	1.049	13
17/05/2022	HSBC	Kauf	USD	10.088	Verkauf	ZAR	156.900	(12)
18/05/2022	HSBC	Kauf	USD	7.462	Verkauf	CNH	47.740	(55)
23/05/2022	HSBC	Kauf	HUF	2.830.000	Verkauf	USD	9.004	(546)
24/05/2022	Citi	Kauf	USD	11.869	Verkauf	MXN	244.900	98
25/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	11.849	Verkauf	GBP	8.720	151
10/06/2022	HSBC	Kauf	USD	7.087	Verkauf	CAD	9.000	(15)
10/06/2022	HSBC	Kauf	CAD	9.000	Verkauf	USD	7.099	3
14/06/2022	Citi	Kauf	USD	3.365	Verkauf	KRW	4.040.000	6
22/06/2022	Citi	Kauf	JPY	1.407.000	Verkauf	USD	12.258	18
22/06/2022	JP Morgan	Kauf	JPY	1.416.000	Verkauf	USD	12.301	52
11/07/2022	HSBC	Kauf	CLP	5.460.000	Verkauf	USD	6.662	43
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	2.703	Verkauf	EUR	1.860	45
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 2.835 USD)							\$	2.854
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (3.975) USD)								(4.074)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.140) USD)							\$	(1.220)

## Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Asset-Backed Securities – 3,20 % (28. Februar 2021: 1,55 %)</b>					
204			14.975		
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006-HE1, Series 2006 HE1, Class M1, 0,772 %, fällig 25/12/2036 *	203	0,01	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Series 2014 LC14, Class D, 144A, 4,586 %, fällig 15/03/2047 *	14.699	0,91
15.360			<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 254.770 USD)</b>		
Towd Point Mortgage Trust 2016-2, Series 2016 2, Class B2, 144A, 3,401 %, fällig 25/08/2055 *	15.493	0,96		252.836	15,72
823			<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 56,53 % (28. Februar 2021: 69,16 %)</b>		
Towd Point Mortgage Trust 2017-4, Series 2017 4, Class A1, 144A, 2,750 %, fällig 25/06/2057 *	827	0,05	<b>Australien — 0,32 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
5.893			5.430		
Towd Point Mortgage Trust 2017-6, Series 2017 6, Class B2, 144A, 3,218 %, fällig 25/10/2057 *	5.836	0,36	NBN Co Ltd, 2,625 %, fällig 05/05/2031	5.210	0,32
17.590			<b>Brasilien — 2,72 % (28. Februar 2021: 2,84 %)</b>		
Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Class B1, 144A, 3,266 %, fällig 25/03/2058 *	17.920	1,12	1.880		
159			Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, fällig 28/01/2028	1.843	0,11
Towd Point Mortgage Trust 2018-3, Series 2018 3, Class A1, 144A, 3,750 %, fällig 25/05/2058 *	163	0,01	4.900		
6.755			B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig 20/09/2031	4.416	0,27
Towd Point Mortgage Trust 2018-3, Series 2018 3, Class B1, 144A, 3,608 %, fällig 25/05/2058 *	6.902	0,43	4.710		
4.155			Banco do Brasil SA/Cayman, 144A, 3,250 %, fällig 30/09/2026	4.531	0,28
Tryon Park CLO Ltd, Series 2013 1A, Class DR, 144A, 6,191 %, fällig 15/04/2029 *	4.143	0,26	1.205		
			BRF SA, 144A, 3,950 %, fällig 22/05/2023	1.224	0,08
			1.015		
			Cemig Geracao e Transmissao SA, 9,250 %, fällig 05/12/2024	1.112	0,07
			1.335		
			Embraer Netherlands Finance BV, 144A, 6,950 %, fällig 17/01/2028	1.392	0,09
			6.745		
			Gol Finance SA, 8,000 %, fällig 30/06/2026	6.530	0,41
			4.380		
			Minerva Luxembourg SA, 144A, 4,375 %, fällig 18/03/2031	4.010	0,25
			6.645		
			Rumo Luxembourg Sarl, 144A, 4,200 %, fällig 18/01/2032	5.872	0,36
			13.775		
			XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01/07/2026	12.887	0,80
				43.817	2,72
			<b>Kanada — 1,85 % (28. Februar 2021: 3,14 %)</b>		
			6.104		
			Air Canada, 144A, 3,875 %, fällig 15/08/2026	5.935	0,37
			8.963		
			Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust, 144A, 5,250 %, fällig 01/04/2029	9.538	0,59
			5.590		
			Antares Holdings LP, 144A, 2,750 %, fällig 15/01/2027	5.214	0,33
			1.110		
			Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,849 %, fällig 17/03/2023 *	1.115	0,07
			7.905		
			Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15/02/2026	7.914	0,49
				29.716	1,85
			<b>Chile: 0,54 % (28. Februar 2021: 0,80 %)</b>		
			6.680		
			ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27/04/2026	6.204	0,39
			2.435		
			Kenbourne Invest SA, 6,875 %, fällig 26/11/2024	2.465	0,15
				8.669	0,54
			<b>China — 0,59 % (28. Februar 2021: 2,15 %)</b>		
			2.830		
			Alibaba Group Holding Ltd, 3,400 %, fällig 06/12/2027	2.875	0,18
			1.060		
			JD.com Inc, 3,375 %, fällig 14/01/2030	1.064	0,07
			390		
			NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 144A, 3,400 %, fällig 01/05/2030	394	0,02
			340		
			Tencent Music Entertainment Group, 2,000 %, fällig 03/09/2030	304	0,02
			1.585		
			Weibo Corp, 3,375 %, fällig 08/07/2030	1.471	0,09
			3.505		
			Xiaomi Best Time International Ltd, 144A, 3,375 %, fällig 29/04/2030	3.383	0,21
				9.491	0,59
			<b>Kolumbien — 0,26 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
			4.420		
			Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 17/01/2027	4.188	0,26
			<b>Deutschland — 0,27 % (28. Februar 2021: 0,07 %)</b>		
			4.485		
			Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A, 0,650 %, fällig 11/03/2024	4.387	0,27
			<b>Israel — 1,42 % (28. Februar 2021: 0,62 %)</b>		
			1.370		
			Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 30/03/2024	1.338	0,08
			4.035		
			Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 30/03/2026	3.843	0,24
			2.590		
			Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig 31/01/2025	2.723	0,17
			5.970		
			Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01/10/2026	5.449	0,34
			1.555		
			Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig 09/05/2027	1.501	0,09
			CHF	7.405	
			Teva Pharmaceutical Finance Netherlands IV BV, 0,500 %, fällig 28/07/2022	7.999	0,50
				22.853	1,42
			<b>Japan — 0,61 % (28. Februar 2021: 0,97 %)</b>		
			9.450		
			Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345 %, fällig 17/09/2027	9.736	0,61
			<b>Luxemburg — 0,74 % (28. Februar 2021: 0,82 %)</b>		
			2.535		
			Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15/08/2029	2.313	0,14
			10.770		
			Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, fällig 15/02/2028	9.558	0,60
				11.871	0,74
			<b>Mexiko — 0,31 % (28. Februar 2021: 3,02 %)</b>		
			5.570		
			Total Play Telecomunicaciones SA de CV, 144A, 6,375 %, fällig 20/09/2028	5.028	0,31



# Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>			<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 40.689 USD)</b>		
<b>USA – (Fortsetzung)</b>			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.570.418 USD)</b>		
5.305 Scientific Games International Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15/10/2025	5.365	0,33	1.522.073 94,65		
890 Seagate HDD Cayman, 4,125 %, fällig 15/01/2031	844	0,05	<b>Credit Default Swaps — 1,41 % (28. Februar 2021: 2,30 %)</b>		
12.350 Sealed Air Corp, 144A, 1,573 %, fällig 15/10/2026	11.636	0,72	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 22.750 1,41		
2.620 Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15/03/2026	2.603	0,16	<b>Devisenterminkontrakte – 0,57 % (28. Februar 2021: 0,44 %)</b>		
2.710 Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15/02/2027	2.469	0,15	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 9.078 0,57		
3.685 Sixth Street Specialty Lending Inc, 2,500 %, fällig 01/08/2026	3.518	0,22	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
6.201 Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC /Sprint Spectrum Co III LLC, 144A, 4,738 %, fällig 20/03/2025	6.389	0,40	1.553.901 96,63		
12.250 Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC /Sprint Spectrum Co III LLC, 144A, 5,152 %, fällig 20/03/2028	13.185	0,82	<b>Devisenterminkontrakte — (1,07 %) (28. Februar 2021: (0,39 %))</b>		
1.220 Stellantis NV, 5,250 %, fällig 15/04/2023	1.263	0,08	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (17.153) (1,07)		
8.710 Tenet Healthcare Corp, 144A, 6,250 %, fällig 01/02/2027	8.967	0,56	<b>Futures – (0,08 %) (28. Februar 2021: (0,08 %))</b>		
4.315 Travel + Leisure Co, 144A, 6,625 %, fällig 31/07/2026	4.612	0,29	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (1.309) (0,08)		
3.000 Twitter Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15/12/2027	2.954	0,18	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
5.340 Univision Communications Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15/02/2025	5.381	0,33	(18.462) (1,15)		
4.080 Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01/06/2027	4.248	0,26	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
14.015 Valero Energy Corp, 3,650 %, fällig 01/12/2051	12.606	0,78	1.535.439 95,48		
6.945 Verizon Communications Inc, 1,450 %, fällig 20/03/2026	6.712	0,42	<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		
7.940 Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15/04/2027	7.941	0,49	72.634 4,52		
3.215 Vishay Intertechnology Inc, 2,250 %, fällig 15/06/2025	3.227	0,20	<b>Gesamtvermögen</b>		
1.070 Vista Outdoor Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15/03/2029	1.005	0,06	\$1.608.073 100,00		
5.870 Vontier Corp, 1,800 %, fällig 01/04/2026	5.491	0,34	– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
5.240 Vontier Corp, 2,400 %, fällig 01/04/2028	4.775	0,30	144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 792.248.000 USD oder 49,26 % des Nettovermögens.		
5.920 Vontier Corp, 2,950 %, fällig 01/04/2031	5.374	0,33	* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.		
2.695 Walgreens Boots Alliance Inc, 4,800 %, fällig 18/11/2044	2.952	0,18			
14.940 Western Digital Corp, 1,500 %, fällig 01/02/2024	14.708	0,91			
1.100 William Carter Co/The, 144A, 5,625 %, fällig 15/03/2027	1.122	0,07			
5.876 Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01/03/2025	5.966	0,37			
	703.775	43,77			
<b>Sambia — 1,03 % (28. Februar 2021: 0,86 %)</b>			<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
15.590 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15/10/2027	16.586	1,03	Unbefristet – Eine Anleihe ohne Fälligkeit. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen einen stetigen Zinsstrom.		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 954.870 USD)</b>			REMIC – Hypothekenanlage.		
	909.027	56,53	BRL – Brasilianischer Real		
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 16,67 % (28. Februar 2021: 5,18 %)</b>			CHF – Schweizer Franken		
<b>Brasilien — 3,08 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			EUR – Euro		
BRL 266.950 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN- 10,000 %, fällig 01/01/2027	49.483	3,08	GBP – Britische Pfund		
<b>Kanada — 0,79 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			MXN – Mexikanischer Peso		
13.035 CPPIB Capital Inc, 144A, 0,500 %, fällig 16/09/2024	12.671	0,79	RUB – Russischer Rubel		
<b>Mexiko — 0,76 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
MXN 254.500 Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07/11/2047	12.180	0,76			
<b>USA — 12,04 % (28. Februar 2021: 2,50 %)</b>			<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
193.335 United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023 *	193.700	12,04	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem regulierten Markt gehandelt werden 86,87		
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 266.812 USD)</b>			Organismen für gemeinsame Anlagen 2,39		
	268.034	16,67	Finanzderivate 1,87		
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,53 % (28. Februar 2021: 7,73 %)</b>			Sonstige Vermögenswerte 8,87		
40.689 United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023 *	40.689	2,53	<b>Gesamtvermögen</b>		
			100,00		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 % – Verkauf	20/06/2022	1.725	\$ 24
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 % – Verkauf	20/12/2023	137.312	6.230
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 % – Verkauf	20/12/2026	76.150	4.237
Citi	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20/06/2025	55.620	739
Citi	iTraxx Europe, 1,000 % – Verkauf	20/12/2024	3.160	50
Citi	iTraxx Europe, 1,000 % – Verkauf	20/06/2025	23.060	391
Citi	iTraxx Europe, 5,000 % – Verkauf	20/12/2026	131.925	9.773
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 % – Verkauf	20/12/2025	3.390	223
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 % – Verkauf	20/06/2026	15.700	794
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 % – Verkauf	20/12/2025	1.605	106
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000 % – Verkauf	20/12/2025	1.605	47
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000 % – Verkauf	20/12/2025	3.495	101
JP Morgan	Liberty Media LLC, 5,000 % – Verkauf	20/06/2022	1.700	19
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 % – Verkauf	20/12/2022	1.925	11
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 % – Verkauf	20/06/2022	715	2
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 % – Verkauf	20/06/2022	1.115	3
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 10.441 USD)				\$ 22.750
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 10.441 USD)				\$ 22.750

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 181	Verkauf	EUR 161	\$ –
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 1	Verkauf	SGD 1	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP –	Verkauf	USD –	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 622	Verkauf	USD 696	1
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD 191	Verkauf	USD 141	–
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 2.304	Verkauf	BRL 11.793	17
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL 11.793	Verkauf	USD 2.156	131
07/03/2022	HSBC	Kauf	AUD 67.090	Verkauf	USD 48.617	117
11/03/2022	Citi	Kauf	USD 5.706	Verkauf	CHF 5.250	(22)
11/03/2022	HSBC	Kauf	CLP 65.485.000	Verkauf	USD 79.795	2.029
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 14	Verkauf	AUD 20	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 16	Verkauf	CHF 14	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 5	Verkauf	CNH 32	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 697	Verkauf	EUR 622	(1)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 12.358	Verkauf	EUR 10.886	145
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD –	Verkauf	GBP –	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 205	Verkauf	GBP 151	2
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 127	Verkauf	SEK 1.190	1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 957	Verkauf	SGD 1.292	5
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK 33.103	Verkauf	USD 3.625	(127)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 457.969	Verkauf	USD 523.767	(9.922)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 161	Verkauf	USD 182	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 41.983	Verkauf	USD 56.913	(586)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CHF 3.892	Verkauf	USD 4.215	33
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD 10.809	Verkauf	USD 7.740	113
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD 74.213	Verkauf	USD 55.189	(447)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CHF 7.475	Verkauf	USD 1.172	10
16/03/2022	Citi	Kauf	USD 1.959	Verkauf	RUB 147.000	602
04/04/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL 11.649	Verkauf	USD 2.257	(18)
19/04/2022	HSBC	Kauf	USD 2.283	Verkauf	BRL 12.880	(183)
25/04/2022	JP Morgan	Kauf	THB 1.095.500	Verkauf	USD 33.081	452
25/04/2022	JP Morgan	Kauf	THB 993.500	Verkauf	USD 30.542	(131)
26/04/2022	Citi	Kauf	USD 45.200	Verkauf	EUR 39.810	463
26/04/2022	HSBC	Kauf	EUR 16.810	Verkauf	USD 19.262	(372)
26/04/2022	JP Morgan	Kauf	EUR 23.000	Verkauf	USD 26.393	(547)
27/04/2022	HSBC	Kauf	USD 47.522	Verkauf	PLN 192.850	1.784
27/04/2022	HSBC	Kauf	PLN 192.850	Verkauf	USD 47.658	(1.919)
09/05/2022	JP Morgan	Kauf	NZD 73.460	Verkauf	USD 49.737	(85)
23/05/2022	HSBC	Kauf	USD 48.481	Verkauf	HUF 15.540.000	2.035
23/05/2022	HSBC	Kauf	HUF 15.540.000	Verkauf	USD 49.238	(2.793)
24/05/2022	Citi	Kauf	USD 13.778	Verkauf	MXN 284.300	114
25/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD 57.930	Verkauf	GBP 42.530	874
25/05/2022	JP Morgan	Kauf	GBP 42.530	Verkauf	USD 56.905	150
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 2.025 USD)						\$ 9.078
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.778) USD)						(17.153)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 247 USD)						\$ (8.075)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nominaler Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Citi	(1.069)	\$(136.231)	\$ (1.309)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 234 USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (379) USD)				(1.309)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (145) USD)				\$ (1.309)

# Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Asset-Backed Securities – 19,58 % (28. Februar 2021: 7,86 %)</b>			<b>Vereinigte Republik Tansania — 0,84 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
2.425	American Credit Acceptance Receivables Trust 2019-3, Series 2019 3, Class F, 144A, 5,420 %, fällig 12/05/2026	4,74	435	HTA Group Ltd/Mauritius, 7,000 %, fällig 18/12/2025	0,84
700	American Credit Acceptance Receivables Trust 2020-4, Series 2020 4, Class F, 144A, 5,220 %, fällig 13/08/2027	1,36	<b>USA — 9,05 % (28. Februar 2021: 10,80 %)</b>		
1.365	Atrium XIV LLC 14A, Class E, 144A, 5,891 %, fällig 23/08/2030 *	2,56	140	CommScope Inc, 8,250 %, fällig 01/03/2027	0,27
1.150	Barings CLO Ltd 2018-II, Series 2018 2X, Class D, 5,791 %, fällig 15/04/2030 *	2,15	315	CommScope Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01/03/2027	0,60
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	1,63	725	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15/08/2026	1,26
1.125	Octagon Investment Partners 37 Ltd, Series 2018 2A, Class D, 144A, 5,658 %, fällig 25/07/2030 *	2,06	450	Freedom Mortgage Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15/04/2025	0,86
720	Regatta XI Funding Ltd, Series 2018 1A, Class E, 144A, 5,741 %, fällig 17/07/2031 *	1,34	795	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01/08/2026	1,55
2.000	Westlake Automobile Receivables Trust 2020-3, Series 2020 3A, Class D, 144A, 1,650 %, fällig 17/02/2026	3,74	505	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15/09/2025	0,93
			365	PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15/11/2029	0,67
			275	Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,250 %, fällig 15/11/2022	0,53
			190	Scientific Games International Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15/03/2026	0,38
			310	Scientific Games International Inc, 8,250 %, fällig 15/03/2026	0,62
			450	Sinclair Television Group Inc, 5,875 %, fällig 15/03/2026	0,85
			270	TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15/03/2026	0,53
					9,05
<b>Gesamtsumme vermögensbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 10.386 USD)</b>			<b>Sambia — 0,65 % (28. Februar 2021: 2,46 %)</b>		
		19,58	341	First Quantum Minerals Ltd, 7,250 %, fällig 01/04/2023	0,65
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere — 56,32 % (28. Februar 2021: 60,22 %)</b>			<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 6.122 USD)</b>		
1.000	Bellemeade Re 2020-2 Ltd, Series 2020 2A, Class M2, 144A, 6,187 %, fällig 26/08/2030 *	1,98			11,46
440	Bellemeade Re 2020-3 Ltd, Series 2020 3A, Class M2, 144A, 5,037 %, fällig 25/10/2030 *	0,86	<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 7,89 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
2.180	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC15, Series 2013 GC15, Class C, 5,175 %, fällig 10/09/2046 *	4,20	<b>China — 2,65 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
1.297	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC17, Series 2013 GC17, Class C, 5,102 %, fällig 10/11/2046 *	2,50	8.160	China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14/09/2050	2,65
460	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Series 2014 GC23, Class D, 144A, 4,482 %, fällig 10/07/2047 *	0,86	<b>USA — 5,24 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
745	COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust, Series 2014 CR18, Class AM, 4,103 %, fällig 15/07/2047	1,46	2.740	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023 *	5,24
570	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 4,287 %, fällig 25/07/2039 *	1,09	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 4.069 USD)</b>		
1.180	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 3,587 %, fällig 25/10/2039 *	2,20			7,89
570	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Class 1B1, 144A, 3,437 %, fällig 25/01/2040 *	1,03	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,67 % (28. Februar 2021: 4,88 %)</b>		
780	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Series 2020 SBT1, Class 2M2, 144A, 3,837 %, fällig 25/02/2040 *	1,56	1.925	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	3,67
565	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C04, Class 2M2C, 3,037 %, fällig 25/11/2029 *	1,11	<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 1.925 USD)</b>		
2.389	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C01, Class 1M2, 2,437 %, fällig 25/07/2030 *	4,61			3,67
1.415	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1B1, 3,937 %, fällig 25/10/2030 *	2,73	<b>Stammaktien — 0,06 % (28. Februar 2021: 4,96 %)</b>		
800	Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Series 2021 MN2, Class M2, 144A, 3,399 %, fällig 25/07/2041 *	1,41	8	Danimer Scientific Inc	0,06
500	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Series 2021 DNA5, Class B1, 144A, 3,099 %, fällig 25/01/2034 *	0,91	<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 534 USD)</b>		
31.200	GS Mortgage Securities Trust 2017-G55, Series 2017 G55, Class XA, 0,843 %, fällig 10/03/2050 *	2,22			0,06
600	IM Pastor 3 FTH 3, Class B, 0,000 %, fällig 22/03/2043 *	0,83	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 52.761 USD)</b>		
500	IM Pastor 4 FTA4, Class B, 0,000 %, fällig 22/03/2044 *	0,67	51.853		98,98
920	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C28, Series 2015 C28, Class C, 4,146 %, fällig 15/10/2048 *	1,73	<b>Credit Default Swaps – 0,29 % (28. Februar 2021: 0,20 %)</b>		
1.082	Landmark Mortgage Securities No 2 Plc 2, Class BC, 0,000 %, fällig 17/06/2039 *	2,17	154		0,29
1.275	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5, Series 2017 5, Class D, 144A, 4,676 %, fällig 10/03/2050 *	2,25	<b>Devisenterminkontrakte – 0,15 % (28. Februar 2021: 0,48 %)</b>		
2.500	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C14, Series 2014 C14, Class A5, 4,064 %, fällig 15/02/2047	4,91	79		0,15
550	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C15, Series 2014 C15, Class D, 144A, 4,897 %, fällig 15/04/2047 *	1,05	<b>Futures – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,08 %)</b>		
2.000	STACR Trust 2018-HRP1, Series 2018 HRP1, Class B1, 144A, 3,937 %, fällig 25/04/2043 *	3,87	86		0,16
645	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Series 2015 C28, Class D, 4,095 %, fällig 15/05/2048 *	1,16	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
53.688	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC22, Series 2015 LC22, Class XA, 0,776 %, fällig 15/09/2058 *	2,37	52.172		99,58
555	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5, Series 2016 NX55, Class C, 4,984 %, fällig 15/01/2059 *	1,10	<b>Devisenterminkontrakte – (0,28 %) (28. Februar 2021: (0,67 %))</b>		
855	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5, Series 2016 NX55, Class D, 4,984 %, fällig 15/01/2059 *	1,63	(145)		(0,28)
985	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Series 2014 LC14, Class D, 144A, 4,586 %, fällig 15/03/2047 *	1,85	<b>Futures – (0,15 %) (28. Februar 2021: (0,15 %))</b>		
			(81)		(0,15)
			<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
			(226)		(0,43)
			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
			51.946		99,15
			<b>Sonstige die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		
			440		0,85
			<b>Gesamtnettovermögen</b>		
			\$52.386		100,00
			– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
			144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 23.220.000 USD oder 44,33 % des Nettovermögens.		
			* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.		
			<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
			REMIC	– Immobilienhypothekenanlage.	
			CNY	– Chinesischer Renminbi	
			EUR	– Euro	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

	% des Gesamt vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,07
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,63
Finanzderivate	0,60
Sonstige Vermögenswerte	1,70
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

## Zeitplan für Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Ablaufdatum	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	T-Mobile USA Inc, 5,000 % – Verkauf	20/06/2022	725	\$ 10
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 % – Verkauf	20/12/2026	2.480	138
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 % – Verkauf	20/06/2022	520	1
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 % – Verkauf	20/12/2022	925	5
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 105 USD)				\$ 154
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 105 USD)				\$ 154

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Verkaufswährung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
11/03/2022	HSBC	Kauf CLP 820.000	Verkauf USD 1.022	\$ 2
14/04/2022	Morgan Stanley	Kauf SEK 4.600	Verkauf USD 506	(20)
19/04/2022	HSBC	Kauf BRL 5.510	Verkauf USD 1.049	7
25/04/2022	Citi	Kauf THB 50.600	Verkauf USD 1.563	(15)
26/04/2022	Citi	Kauf USD 1.737	Verkauf EUR 1.530	18
26/04/2022	UBS	Kauf EUR 450	Verkauf USD 516	(10)
27/04/2022	JP Morgan	Kauf USD 1.013	Verkauf PLN 4.050	52
27/04/2022	UBS	Kauf PLN 4.050	Verkauf USD 1.028	(67)
18/05/2022	HSBC	Kauf USD 1.300	Verkauf CNH 8.320	(9)
19/05/2022	UBS	Kauf CZK 11.200	Verkauf USD 518	(24)
22/06/2022	JP Morgan	Kauf JPY 120.000	Verkauf USD 1.047	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 250 USD)				\$ 79
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (346) USD)				(145)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (96) USD)				\$ (66)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nominaler Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
Euro-Bobl March 2022	Citi	38	\$ 5.618	\$ 27
Euro-Bund March 2022	Citi	(15)	(2.809)	(40)
U.S. 10 Year Note (CBT) June 2022	Citi	(33)	(4.206)	(41)
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Citi	16	2.975	59
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 41 USD)				\$ 86
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (79) USD)				(81)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (38) USD)				\$ 5

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 88,64 % (28. Februar 2021: 91,89 %)</b>					
<b>Brasilien — 5,68 % (28. Februar 2021: 11,97 %)</b>					
200 Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, fällig 28/01/2028	196	1,93	100 GPS Hospitality Holding Co LLC / GPS Finco Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15/08/2028	84	0,82
200 Gol Finance SA, 144A, 8,000 %, fällig 30/06/2026	194	1,91	100 Harsco Corp, 144A, 5,750 %, fällig 31/07/2027	99	0,97
200 XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01/07/2026	187	1,84	170 Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 6,250 %, fällig 15/05/2026	172	1,69
	577	5,68	15 International Game Technology Plc, 144A, 4,125 %, fällig 15/04/2026	15	0,14
<b>Kanada — 2,28 % (28. Februar 2021: 4,59 %)</b>					
120 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15/02/2026	120	1,18	45 KB Home, 4,000 %, fällig 15/06/2031	43	0,43
110 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15/04/2029	112	1,10	95 Level 3 Financing Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/09/2027	92	0,90
	232	2,28	100 Levi Strauss & Co, 144A, 3,500 %, fällig 01/03/2031	93	0,92
<b>Chile — 3,66 % (28. Februar 2021: 1,77 %)</b>					
200 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27/04/2026	186	1,83	200 Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01/02/2030	196	1,93
200 Kenbourne Invest SA, 4,700 %, fällig 22/01/2028	186	1,83	66 Macy's Retail Holdings LLC, 2,875 %, fällig 15/02/2023	66	0,65
	372	3,66	190 Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01/08/2026	195	1,92
<b>Kolumbien — 3,67 % (28. Februar 2021: 1,74 %)</b>					
200 Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 17/01/2027	190	1,87	45 Marriott Ownership Resorts Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15/06/2029	43	0,42
200 SierraCol Energy Andina LLC, 144A, 6,000 %, fällig 15/06/2028	183	1,80	110 Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig 01/05/2028	103	1,01
	373	3,67	115 MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15/06/2028	111	1,09
<b>Frankreich — 1,11 % (28. Februar 2021: 1,11 %)</b>					
EUR 110 Altice France SA/France, 3,375 %, fällig 15/01/2028	113	1,11	30 ModivCare Escrow Issuer Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01/10/2029	28	0,28
<b>Israel — 4,56 % (28. Februar 2021: 2,92 %)</b>					
140 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 30/03/2031	130	1,28	35 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15/09/2025	34	0,33
200 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig 31/01/2025	210	2,07	75 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30/09/2026	72	0,71
135 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01/10/2026	123	1,21	40 Nexstar Media Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01/11/2028	39	0,38
	463	4,56	30 NRG Energy Inc, 6,625 %, fällig 15/01/2027	31	0,30
<b>Italien — 1,08 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
EUR 100 Verde Bidco SpA, 4,625 %, fällig 01/10/2026	110	1,08	125 Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, fällig 15/02/2027	122	1,20
<b>Macau — 1,57 % (28. Februar 2021: 1,72 %)</b>					
200 Studio City Finance Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15/01/2029	159	1,57	105 Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, fällig 01/09/2030	122	1,20
<b>Mexiko — 5,70 % (28. Februar 2021: 8,57 %)</b>					
200 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig 15/11/2029	199	1,95	100 Par Pharmaceutical Inc, 7,500 %, fällig 01/04/2027	100	0,99
265 Petroleos Mexicanos, 5,350 %, fällig 12/02/2028	256	2,52	45 Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15/02/2028	41	0,40
150 Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28/01/2060	124	1,23	50 Scientific Games International Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15/10/2025	51	0,50
	579	5,70	45 Select Medical Corp, 144A, 6,250 %, fällig 15/08/2026	46	0,45
<b>Panama — 1,90 % (28. Februar 2021: 1,80 %)</b>					
200 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31/05/2030	193	1,90	30 Sensata Technologies Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15/02/2030	29	0,29
<b>Großbritannien — 3,48 % (28. Februar 2021: 1,41 %)</b>					
160 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 6,750 %, fällig 01/10/2026	162	1,59	90 Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 144A, 4,625 %, fällig 01/03/2029	84	0,82
200 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15/07/2031	192	1,89	25 Switch Ltd, 144A, 4,125 %, fällig 15/06/2029	24	0,24
	354	3,48	25 Synaptics Inc, 4,000 %, fällig 15/06/2029	24	0,24
<b>USA — 50,72 % (28. Februar 2021: 51,44 %)</b>					
45 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15/02/2026	48	0,47	110 Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15/01/2026	116	1,14
200 Alcoa Nederland Holding BV, 4,125 %, fällig 31/03/2029	201	1,98	70 Tenet Healthcare Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01/06/2029	68	0,67
100 AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5,625 %, fällig 20/05/2024	102	1,00	115 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15/04/2031	113	1,12
35 Antero Resources Corp, 144A, 8,375 %, fällig 15/07/2026	38	0,38	100 Travel + Leisure Co, 6,000 %, fällig 01/04/2027	105	1,03
45 Arconic Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15/02/2028	46	0,45	90 Tronox Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01/05/2025	94	0,92
200 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 4,125 %, fällig 15/08/2026	194	1,91	90 Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01/06/2027	94	0,92
25 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01/10/2030	27	0,27	100 Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 01/02/2029	92	0,91
84 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15/04/2025	84	0,83	95 Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15/04/2027	95	0,93
65 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15/02/2029	56	0,55	110 Vishay Intertechnology Inc, 2,250 %, fällig 15/06/2025	110	1,09
45 Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,250 %, fällig 30/05/2029	39	0,39	60 Vista Outdoor Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15/03/2029	56	0,55
35 Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig 01/07/2030	35	0,35	90 WR Grace Holdings LLC, 144A, 4,875 %, fällig 15/06/2027	90	0,89
135 Central Garden & Pet Co, 4,125 %, fällig 30/04/2031	126	1,24	65 XHR LP, 144A, 4,875 %, fällig 01/06/2029	63	0,62
120 CITGO Petroleum Corp, 144A, 6,375 %, fällig 15/06/2026	119	1,17		5,155	50,72
17 Cleveland-Cliffs Inc, 9,875 %, fällig 17/10/2025	19	0,19	<b>Uruguay — 1,14 % (28. Februar 2021: 1,03 %)</b>		
115 CNX Resources Corp, 144A, 6,000 %, fällig 15/01/2029	118	1,16	40 Navios South American Logistics Inc / Navios Logistics Finance US Inc, 144A, 10,750 %, fällig 01/07/2025	42	0,41
45 CommScope Inc, 6,000 %, fällig 01/03/2026	46	0,45	70 Navios South American Logistics Inc / Navios Logistics Finance US Inc, 10,750 %, fällig 01/07/2025	74	0,73
80 Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01/10/2028	76	0,75		116	1,14
35 Consolidated Communications Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01/10/2028	35	0,34	<b>Sambia — 2,09 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
70 Credit Acceptance Corp, 6,625 %, fällig 15/03/2026	72	0,71	200 First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 15/10/2027	213	2,09
45 Deluxe Corp, 144A, 8,000 %, fällig 01/06/2029	46	0,45	<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 9.235 USD)</b>		
35 Edgewell Personal Care Co, 5,500 %, fällig 01/06/2028	35	0,35	9,009 88,64		
25 Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig 15/07/2029	23	0,23	<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 2,70 % (28. Februar 2021: 3,43 %)</b>		
90 Embarras Corp, 7,995 %, fällig 01/06/2036	89	0,88	<b>Brasilien — 2,01 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
110 Encompass Health Corp, 4,500 %, fällig 01/02/2028	107	1,05	BRL 1.100 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN F, 10,000 %, fällig 01/01/2027	204	2,01
50 Entegris Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15/04/2028	49	0,48	<b>Ukraine — 0,69 % (28. Februar 2021: 1,73 %)</b>		
25 Entegris Inc, 3,625 %, fällig 01/05/2029	24	0,23	200 Ukraine Government International Bond, 7,253 %, fällig 15/03/2033	70	0,69
50 Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, fällig 01/10/2029	46	0,45	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 395 USD)</b>		
			274 2,70		
			<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 8,68 % (28. Februar 2021: 3,65 %)</b>		
			882 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	882	8,68
			<b>Gesamte kollektive Kapitalanlagen (Kosten 882 USD)</b>		
			882 8,68		
			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 10.512 USD)</b>		
			10,165 100,02		
			<b>Credit Default Swaps – 0,78 % (28. Februar 2021: 1,90 %)</b>		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
			80	0,78	
			<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,23 %)</b>		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
			–	–	
			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
			10,245 100,80		
			<b>Credit Default Swaps — (0,11 %) (28. Februar 2021: (0,07 %))</b>		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
			(12)	(0,11)	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Devisenterminkontrakte — (1,93 %) (28. Februar 2021: (0,25 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(196)	(1,93)
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(208)</b>	<b>(2,04)</b>
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>10.037</b>	<b>98,76</b>
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>	<b>126</b>	<b>1,24</b>
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>\$10.163</b>	<b>100,00</b>

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 4.528.000 USD oder 44,52 % des Nettovermögens.

### ABKÜRZUNGEN:

BRL – Brasilianisch Real  
EUR – Euro

	% des Gesamt vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	89,14
Organismen für gemeinsame Anlagen	8,47
Finanzderivate	0,77
Sonstige Vermögenswerte	1,62
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Zeitplan für Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominaler Betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	T-Mobile USA Inc, 5,000 % – Verkauf	20/06/2022	130	\$ 2
Citi	iTraxx Europe, 5,000 % – Verkauf	20/12/2026	845	63
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 % – Verkauf	20/06/2022	185	3
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 % – Verkauf	20/12/2025	170	11
Morgan Stanley	CenturyLink Inc, 1,000 % – Verkauf	20/06/2025	115	(10)
Morgan Stanley	CenturyLink Inc, 1,000 % – Verkauf	20/06/2023	105	
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 % – Verkauf	20/12/2022	205	1
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 % – Verkauf	20/06/2022	165	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 223 USD)				\$ 80
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): (8) USD)				(12)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2021 (in Tsd.): 215 USD)				\$ 68

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Währung	Verkauf	Verkaufswährung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	63	Verkauf	CAD 91 \$ (2)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	269	Verkauf	EUR 240 –
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	7	Verkauf	EUR 8 –
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	3	Verkauf	EUR 2 –
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	243	Verkauf	GBP 205 (2)
10/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	7.007	Verkauf	USD 8.038 (178)
26/04/2022	Barclays	Kauf	EUR	460	Verkauf	USD 523 (6)
26/04/2022	Citi	Kauf	EUR	430	Verkauf	USD 488 (5)
26/04/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	700	Verkauf	USD 787 –
25/05/2022	JP Morgan	Kauf	GBP	160	Verkauf	USD 218 (3)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 27 USD)						\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (29) USD)						(196)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (2) USD)						\$ (196)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 16,70 % (28. Februar 2021: 17,02 %)</b>			<b>USA — 9,65 % (28. Februar 2021: 21,12 %)</b>		
<b>Australien — 3,75 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			2.060 United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,064 %, fällig 31/07/2023 *		
2.190 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 0,449 %, fällig 07/07/2025 *	2.191	2,11	7.980 United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023 *	7.995	7,67
1.710 National Australia Bank Ltd, 144A, 0,429 %, fällig 12/01/2025 *	1.711	1,64		10.058	9,65
	3.902	3,75	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 86.924 USD)</b>		
<b>Kanada — 3,79 % (28. Februar 2021: 3,43 %)</b>			79.243 76,03		
2.110 Bank of Nova Scotia/The, 0,599 %, fällig 15/09/2023 *	2.115	2,03	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen — 4,07 % (28. Februar 2021: 4,23 %)</b>		
1.830 Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,849 %, fällig 17/03/2023 *	1.838	1,76	377 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class		
	3.953	3,79	30 Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund – LM Class US\$ Accumulating		
<b>Mexiko – 0,96 % (28. Februar 2021: 1,73 %)</b>			3.871 3,71		
1.115 Petroleos Mexicanos, 7,690 %, fällig 23/01/2050	1.004	0,96	<b>Gesamtsumme kollektiver Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 3.876 USD)</b>		
<b>USA — 8,20 % (28. Februar 2021: 10,48 %)</b>			4.248 4,07		
1.790 Athene Global Funding, 144A, 0,750 %, fällig 24/05/2024 *	1.792	1,72	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 108.093 USD)</b>		
320 Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01/05/2040	373	0,36	100.896 96,80		
480 Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01/05/2050	571	0,55	<b>Devisenterminkontrakte — 3,38 % (28. Februar 2021: 1,35 %)</b>		
410 Boeing Co/The, 5,930 %, fällig 01/05/2060	488	0,47	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
1.920 Capital One Financial Corp, 0,740 %, fällig 06/12/2024 *	1.921	1,84	3.520 3,38		
1.400 Caterpillar Financial Services Corp, 0,200 %, fällig 17/11/2022 *	1.400	1,34	<b>Futures — 1,11 % (28. Februar 2021: 0,25 %)</b>		
350 General Motors Co, 6,800 %, fällig 01/10/2027	413	0,40	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
225 General Motors Co, 6,250 %, fällig 02/10/2043	274	0,26	1.151 1,11		
1.310 Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 0,619 %, fällig 13/01/2023 *	1.314	1,26	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	8.546	8,20	105.567 101,29		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 17.293 USD)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – (4,37 % (28. Februar 2021: (0,48 %)))</b>		
	17.405	16,70	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 76,03 % (28. Februar 2021: 72,51 %)</b>			(4.556) (4,37)		
<b>Brasilien — 10,36 % (28. Februar 2021: 5,93 %)</b>			<b>Futures – (1,37 % (28. Februar 2021: (0,30 %)))</b>		
BRL 33.880 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01/01/2029	6.152	5,90	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
BRL 26.000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01/01/2031	4.645	4,46	(1.426) (1,37)		
	10.797	10,36	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
<b>Kolumbien — 3,21 % (28. Februar 2021: 3,97 %)</b>			(5.982) (5,74)		
COP 15.500.000 Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28/04/2028	3.350	3,21	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
<b>Tschechische Republik — 4,86 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			99.585 95,55		
CZK 128.300 Czech Republic Government Bond, Series 138, 1,750 %, fällig 23/06/2032	5.060	4,86	<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		
<b>Malaysia — 3,74 % (28. Februar 2021: 3,84 %)</b>			4.646 4,45		
MYR 6.730 Malaysia Government Bond, Series 0117, 3,882 %, fällig 10/03/2022	1.604	1,54	<b>Gesamtnettovermögen</b>		
MYR 3.470 Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480 %, fällig 15/03/2023	839	0,80	\$104.231 100,00		
MYR 1.730 Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955 %, fällig 15/09/2025	425	0,41	– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
MYR 4.240 Malaysia Government Bond, Series 0417, 3,899 %, fällig 16/11/2027	1.033	0,99	144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 7.008.000 USD oder 6,73 % des Nettovermögens.		
	3.901	3,74	* Sicherheit mit variablem Tarif. Der ausgewiesene Zinssatz spiegelt den am 28. Februar 2022 geltenden Zinssatz wider.		
<b>Mexiko — 17,20 % (28. Februar 2021: 17,67 %)</b>			† Illiquide.		
MXN 51.400 Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31/05/2029	2.600	2,49	‡ Sicherheiten, die nach Jahresende aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen nicht mehr ertragswirksam sind.		
MXN 50.500 Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18/11/2038	2.560	2,46			
MXN 218.400 Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	10.216	9,80			
MXN 53.300 Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07/11/2047	2.551	2,45			
	17.927	17,20			
<b>Polen — 9,67 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
PLN 51.750 Republic of Poland Government Bond, Series 0432, 1,750 %, fällig 25/04/2032	10.076	9,67			
<b>Russland — 0,98 % (28. Februar 2021: 2,65 %)</b>					
RUB 209.000 Russian Federal Bond—OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10/04/2030 †	1.017	0,98			
<b>Südafrika — 9,44 % (28. Februar 2021: 8,74 %)</b>					
ZAR 43.600 Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28/02/2041	1.893	1,82			
ZAR 146.300 Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28/02/2048	7.948	7,62			
	9.841	9,44			
<b>Südkorea — 6,92 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
KRW 6.760.000 Korea Treasury Bond, Series 3106, 2,000 %, fällig 10/06/2031	5.300	5,08			
KRW 2.710.000 Korea Treasury Bond, Series 5103, 1,875 %, fällig 10/03/2051	1.916	1,84			
	7.216	6,92			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
03/03/2022	JP Morgan	Kauf	USD	9.115	Verkauf	JPY	1.052.000	\$ (36)
03/03/2022	JP Morgan	Kauf	JPY	1.052.000	Verkauf	USD	9.330	(179)
04/03/2022	HSBC	Kauf	USD	10.955	Verkauf	CLP	8.820.000	(75)
04/03/2022	HSBC	Kauf	CLP	8.820.000	Verkauf	USD	10.338	692
07/03/2022	HSBC	Kauf	AUD	10.210	Verkauf	USD	7.269	147
08/03/2022	HSBC	Kauf	CAD	9.190	Verkauf	USD	7.263	(12)
09/03/2022	HSBC	Kauf	THB	35.300	Verkauf	USD	1.041	40
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	5	Verkauf	USD	7	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	145.488	Verkauf	USD	104.174	1.523
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	5.558	Verkauf	USD	4.133	(32)
16/03/2022	Citi	Kauf	RUB	848.000	Verkauf	USD	10.985	(3.161)
11/04/2022	HSBC	Kauf	SEK	3.500	Verkauf	USD	371	(2)
11/04/2022	JP Morgan	Kauf	SEK	93.300	Verkauf	USD	10.219	(358)
13/04/2022	Citi	Kauf	USD	9.961	Verkauf	PLN	40.070	448
13/04/2022	Citi	Kauf	PLN	40.070	Verkauf	USD	9.922	(409)
19/04/2022	HSBC	Kauf	USD	2.311	Verkauf	BRL	12.850	(149)
19/04/2022	HSBC	Kauf	BRL	12.850	Verkauf	USD	2.277	183
25/04/2022	JP Morgan	Kauf	THB	75.400	Verkauf	USD	2.265	43
26/04/2022	Citi	Kauf	USD	2.112	Verkauf	EUR	1.860	22
26/04/2022	JP Morgan	Kauf	EUR	4.760	Verkauf	USD	5.456	(108)
29/04/2022	JP Morgan	Kauf	USD	3.414	Verkauf	COP	13.670.000	(34)
09/05/2022	Citi	Kauf	NZD	4.910	Verkauf	USD	3.257	62
17/05/2022	HSBC	Kauf	USD	1.042	Verkauf	ZAR	16.200	(1)
19/05/2022	JP Morgan	Kauf	USD	5.201	Verkauf	CZK	112.300	239
24/05/2022	Citi	Kauf	USD	1.183	Verkauf	MXN	24.400	10
14/06/2022	Citi	Kauf	USD	1.774	Verkauf	KRW	2.130.000	3
22/06/2022	JP Morgan	Kauf	JPY	1.052.000	Verkauf	USD	9.139	39
11/07/2022	HSBC	Kauf	CLP	8.820.000	Verkauf	USD	10.761	69
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 5.291 USD)								\$ 3.520
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.896) USD)								(4.556)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 3.395 USD)								\$ (1.036)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nominaler Wert	Nominaler Wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
Euro-BTP March 2022	Morgan Stanley	72	\$11.395	\$ (622)
Euro-Buxl 30 Year Bond March 2022	Morgan Stanley	(55)	(12.197)	1.151
Euro-OAT March 2022	Morgan Stanley	31	5.502	(281)
U.S. Ultra Bond (CBT) June 2022	Morgan Stanley	(144)	(26.775)	(523)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 998 USD)				\$ 1.151
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.176) USD)				(1.426)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (178) USD)				\$ (275)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen — 4,24 % (28. Februar 2021: 2,93 %)</b>			<b>Ingenieurwesen und Bauwesen — 0,53 % (28. Februar 2021: 0,56 %)</b>		
	79	3,65		11	0,53
	13	0,59			
<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 93 USD)</b>			<b>Lebensmittel — 1,88 % (28. Februar 2021: 0,83 %)</b>		
	92	4,24		22	0,99
<b>Stammaktien — 98,48 % (28. Februar 2021: 98,33 %)</b>				4	0,18
<b>Banken — 22,10 % (28. Februar 2021: 19,00 %)</b>				15	0,71
				41	1,88
	101	4,63	<b>Gesundheitsdienstleistungen — 9,44 % (28. Februar 2021: 2,96 %)</b>		
	5	0,24		69	3,15
	4	0,17		57	2,62
	67	3,07		26	1,18
	21	0,98		54	2,49
	2	0,07		206	9,44
	13	0,58	<b>Bauherren — 1,66 % (28. Februar 2021: 4,54 %)</b>		
	93	4,29		11	0,50
	64	2,96		25	1,16
	2	0,11		36	1,66
	9	0,40	<b>Wohnausstattung — 0,85 % (28. Februar 2021: 0,31 %)</b>		
	3	0,13		18	0,85
	10	0,48	<b>Versicherungen — 8,03 % (28. Februar 2021: 3,54 %)</b>		
	51	2,34		25	1,12
	24	1,10		40	1,85
	12	0,55		5	0,24
	481	22,10		5	0,20
<b>Biotechnologie — 2,90 % (28. Februar 2021: 6,09 %)</b>				7	0,32
				37	1,70
	14	0,67		13	0,59
	26	1,18		4	0,16
	23	1,05		5	0,23
	63	2,90		1	0,06
<b>Baumaterialien — 2,73 % (28. Februar 2021: 2,11 %)</b>				14	0,64
				—	0,01
	15	0,68		2	0,10
	45	2,05		11	0,52
	60	2,73		6	0,28
<b>Chemikalien — 1,45 % (28. Februar 2021: 5,90 %)</b>				—	0,01
				175	8,03
	32	1,45	<b>Eisen/Stahl — 7,45 % (28. Februar 2021: 0,17 %)</b>		
<b>Kommerzielle Dienstleistungen — 0,24 % (28. Februar 2021: 3,06 %)</b>				102	4,69
				60	2,76
	5	0,24		162	7,45
<b>Computer — 2,37 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			<b>Maschinen – Bauwesen und Bergbau – 1,19 % (28. Februar 2021: 1,48 %)</b>		
				26	1,19
	27	1,23	<b>Medien — 2,20 % (28. Februar 2021: 2,04 %)</b>		
	25	1,14		11	0,48
	52	2,37		25	1,16
<b>Kosmetik und Körperpflege — 2,00 % (28. Februar 2021: 1,11 %)</b>				12	0,56
				48	2,20
	44	2,00	<b>Öl und Gas — 0,94 % (28. Februar 2021: 0,57 %)</b>		
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 5,87 % (28. Februar 2021: 11,42 %)</b>				20	0,94
			<b>Arzneimittel — 7,05 % (28. Februar 2021: 3,11 %)</b>		
	4	0,17		102	4,71
	22	1,01		27	1,22
	6	0,29		7	0,31
	3	0,15		18	0,81
	33	1,51		154	7,05
	8	0,38	<b>Pipelines — 0,53 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
	4	0,19		12	0,53
	1	0,03	<b>Einzelhandel — 8,29 % (28. Februar 2021: 1,80 %)</b>		
	10	0,44		33	1,51
	7	0,33		17	0,78
	30	1,37		51	2,32
	128	5,87		36	1,66
<b>Elektrisch — 4,34 % (28. Februar 2021: 2,31 %)</b>				4	0,20
				18	0,84
	5	0,24		21	0,98
	3	0,13		180	8,29
	36	1,67	<b>Software – 1,48 % (28. Februar 2021: 1,88 %)</b>		
	6	0,28		32	1,48
	8	0,38			
	16	0,75			
	20	0,89			
	94	4,34			
<b>Elektrische Komponenten und Ausrüstung — 0,07 % (28. Februar 2021: 0,05 %)</b>					
	1	0,07			
<b>Elektronik — 1,42 % (28. Februar 2021: 0,71 %)</b>					
	23	1,07			
	8	0,35			
	31	1,42			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Telekommunikation — 1,47 % (28. Februar 2021: 1,76 %)</b>		
1 AT&T Inc	13	0,61
– Verizon Communications Inc	19	0,86
	32	1,47
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 1.839 USD)</b>		
	2.144	98,48
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.932 USD)</b>		
	2.236	102,72
<b>Devisenterminkontrakte – 0,02 % (28. Februar 2021: 0,17 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1	0,02
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	2.237	102,74
<b>Devisenterminkontrakte – (1,32 %) (28. Februar 2021: (0,02 %))</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(29)	(1,32)
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
	(29)	(1,32)
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
	2.208	101,42
<b>Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten</b>		
	(31)	(1,42)
<b>Gesamtnettovermögen</b>		
	\$2.177	100,00

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

### ABKÜRZUNGEN:

ETF – Exchange Traded Fund.  
COP – Kolumbien Peso

	% des Gesamt vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,71
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,11
Finanzderivate	0,04
Sonstige Vermögenswerte	0,14
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)			
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	53	Verkauf	EUR	47	\$	1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.322	Verkauf	USD	1.512		(29)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 3 USD)								\$	1
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)									(29)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 3 USD)								\$	(28)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Legg Mason ClearBridge Value Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts				
<b>Stammaktien — 96,99 % (28. Februar 2021: 94,72 %)</b>			<b>Internet — 5,54 % (28. Februar 2021: 3,96 %)</b>						
<b>Luft- und Raumfahrt und Verteidigung — 1,43 % (28. Februar 2021: 1,97 %)</b>			6 Alphabet Inc						
EUR	101	Safran SA	12.776	1,43	17.284	1,94			
<b>Bekleidung — 0,92 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			41 Meta Platforms Inc 'A'			8.574	0,96		
		122 Capri Holdings Ltd	8.238	0,92	205 TripAdvisor Inc	5.211	0,58		
<b>Autohersteller — 1,26 % (28. Februar 2021: 1,25 %)</b>			510 Uber Technologies Inc			18.361	2,06		
		241 General Motors Co	11.235	1,26		49.430	5,54		
<b>Autoteile und -ausrüstung — 0,46 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			<b>Unterkunft — 2,61 % (28. Februar 2021: 3,21 %)</b>						
		263 Goodyear Tire & Rubber Co/The	4.068	0,46	874 Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR			8.750	0,98
<b>Banken — 12,59 % (28. Februar 2021: 9,77 %)</b>			327 MGM Resorts International			14.493	1,63		
		665 Bank of America Corp	29.368	3,29		23.243	2,61		
		292 Bank of New York Mellon Corp/The	15.502	1,74	<b>Maschinen – Bauwesen und Bergbau – 0,20 % (28. Februar 2021: 1,14 %)</b>				
		22 Goldman Sachs Group Inc/The	7.582	0,85	16 Oshkosh Corp			1.825	0,20
		74 Signature Bank/New York NY	25.531	2,86	<b>Maschinen – diversifiziert – 1,08 % (28. Februar 2021: 2,19 %)</b>				
		644 Wells Fargo & Co	34.343	3,85	670 CNH Industrial NV			9.598	1,08
			112.326	12,59	<b>Bergbau — 2,86 % (28. Februar 2021: 3,39 %)</b>				
<b>Getränke – 1,10 % (28. Februar 2021: 1,24 %)</b>			544 Freeport-McMoRan Inc			25.551	2,86		
		45 Constellation Brands Inc 'A'	9.807	1,10	<b>Sonstige Fertigung — 2,31 % (28. Februar 2021: 0,64 %)</b>				
<b>Biotechnologie — 5,27 % (28. Februar 2021: 2,71 %)</b>			216 General Electric Co			20.594	2,31		
		18 Biogen Inc	3.697	0,42	<b>Öl und Gas — 9,93 % (28. Februar 2021: 7,67 %)</b>				
		188 BioMarin Pharmaceutical Inc	14.661	1,64	357 Devon Energy Corp			21.246	2,38
		222 Gilead Sciences Inc	13.439	1,51	1.008 EQT Corp			23.323	2,61
		66 Vertex Pharmaceuticals Inc	15.176	1,70	131 Pioneer Natural Resources Co			31.288	3,51
			46.973	5,27	253 TotalEnergies SE ADR			12.770	1,43
<b>Chemikalien — 0,75 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			356 Schlumberger NV			13.976	1,57		
EUR	40	Air Liquide SA	6.664	0,75	<b>Öl- und Gasdienstleistungen — 1,57 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>				
<b>Kommerzielle Dienstleistungen — 1,85 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			395 Bloomin' Brands Inc			9.710	1,09		
		85 GXO Logistics Inc	7.162	0,80	<b>Arzneimittel — 3,33 % (28. Februar 2021: 5,74 %)</b>				
		86 Quanta Services Inc	9.363	1,05	131 AbbVie Inc			19.314	2,17
			16.525	1,85	44 Cigna Corp			10.367	1,16
<b>Computer — 2,20 % (28. Februar 2021: 1,98 %)</b>			29.681			3,33			
		577 DXC Technology Co	19.638	2,20	<b>Pipelines — 2,08 % (28. Februar 2021: 0,46 %)</b>				
<b>Kosmetik und Körperpflege — 1,61 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			430 Enbridge Inc			18.552	2,08		
		1.566 Coty Inc 'A'	14.349	1,61	<b>Immobilien — 0,94 % (28. Februar 2021: 0,93 %)</b>				
<b>Vertrieb und Großhandel – 0,94 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			88 Howard Hughes Corp/The			8.402	0,94		
JPY	799	Marubeni Corp	8.397	0,94	<b>Einzelhandel — 1,09 % (28. Februar 2021: 3,99 %)</b>				
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 5,81 % (28. Februar 2021: 6,02 %)</b>			395 Bloomin' Brands Inc			9.710	1,09		
		196 Charles Schwab Corp/The	16.587	1,86	<b>Software – 4,85 % (28. Februar 2021: 2,85 %)</b>				
		333 OneMain Holdings Inc	16.954	1,90	130 Fiserv Inc			12.725	1,43
		428 Synchrony Financial	18.306	2,05	206 Oracle Corp			15.640	1,75
			51.847	5,81	75 Splunk Inc			8.855	0,99
<b>Elektrisch — 3,02 % (28. Februar 2021: 3,02 %)</b>			51 VMware Inc			6.032	0,68		
		694 AES Corp/The	14.736	1,65	43.252			4,85	
		534 Vistra Corp	12.195	1,37	<b>Telekommunikation — 3,09 % (28. Februar 2021: 2,30 %)</b>				
			26.931	3,02	285 Cisco Systems Inc/Delaware			15.884	1,78
<b>Energie – Alternative Quellen – 1,74 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			95 T-Mobile US Inc			11.702	1,31		
		58 Enphase Energy Inc	9.631	1,08	27.586			3,09	
		436 Fluence Energy Inc	5.891	0,66	<b>Transport — 0,74 % (28. Februar 2021: 1,23 %)</b>				
			15.522	1,74	91 XPO Logistics Inc			6.640	0,74
<b>Gesundheitsprodukte — 3,40 % (28. Februar 2021: 1,44 %)</b>			865.370			96,99			
		132 Medtronic Plc	13.827	1,55	<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 736.107 USD)</b>				
		130 Zimmer Biomet Holdings Inc	16.538	1,85	<b>Vorzugsaktien — 0,90 % (28. Februar 2021: 1,60 %)</b>				
			30.365	3,40	<b>Autohersteller — 0,90 % (28. Februar 2021: 1,60 %)</b>				
<b>Gesundheitsdienstleistungen — 2,15 % (28. Februar 2021: 1,51 %)</b>			8.019			0,90			
		40 UnitedHealth Group Inc	19.210	2,15	<b>Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 8.314 USD)</b>				
<b>Holdinggesellschaften – Diversifiziert – 0,32 % (28. Februar 2021: 0,60 %)</b>			8.019			0,90			
		283 East Resources Acquisition Co	2.840	0,32	<b>Immobilienfonds — 0,94 % (28. Februar 2021: 0,60 %)</b>				
<b>Wohnenrichtungen — 1,18 % (28. Februar 2021: 1,61 %)</b>			8.399			0,94			
		103 Sony Group Corp ADR	10.556	1,18	<b>REITS — 0,94 % (28. Februar 2021: 0,60 %)</b>				
<b>Versicherungen — 6,77 % (28. Februar 2021: 6,75 %)</b>			61 Simon Property Group Inc			8.399	0,94		
		535 American International Group Inc	32.769	3,67	<b>Gesamtsumme Immobilien-Investmentfonds (Anschaffungskosten 7.575 USD)</b>				
		610 Equitable Holdings Inc	19.936	2,23	8.399			0,94	
		277 Unum Group	7.731	0,87	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 751.996 USD)</b>				
			60.436	6,77	881.788			98,83	
			14			–			
			881.802			98,83			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason ClearBridge Value Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Devisenterminkontrakte – (0,07 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(641)	(0,07)
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(641)</b>	<b>(0,07)</b>
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>881.161</b>	<b>98,76</b>
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>	<b>11.077</b>	<b>1,24</b>
<b>Gesamtnettvermögen</b>	<b>\$892.238</b>	<b>100,00</b>

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

### ABKÜRZUNGEN:

ADR	– Amerikanische Hinterlegungsstelle.
EUR	– Euro
JPY	– Japanischer Yen

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,56
Finanzderivate	0,00
Sonstige Vermögenswerte	1,44
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Verkaufswährung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)		
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 24	Verkauf	EUR 21	\$ –
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 10	Verkauf	SGD 14	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 1	Verkauf	USD 1	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 66	Verkauf	USD 74	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 1.339	Verkauf	EUR 1.182	13
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD –	Verkauf	EUR –	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 139	Verkauf	SGD 187	1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD 3.163	Verkauf	USD 2.353	(19)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 28.798	Verkauf	USD 32.932	(621)
15/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	SGD 196	Verkauf	USD 146	(1)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)						\$ 14
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1) USD)						(641)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1) USD)						\$ (627)

# Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Stammaktien — 95,93 % (28. Februar 2021: 97,69 %)</b>			<b>Unterkunft — 0,16 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
<b>Autohersteller — 0,60 % (28. Februar 2021: 0,57 %)</b>			2 Marriott International Inc/MD	336	0,16
28 General Motors Co	1.292	0,60	<b>Medien — 2,92 % (28. Februar 2021: 4,98 %)</b>		
<b>Banken — 6,86 % (28. Februar 2021: 6,02 %)</b>			86 Comcast Corp	4.017	1,88
100 Bank of America Corp	4.402	2,06	15 Walt Disney Co/The	2.224	1,04
51 JPMorgan Chase & Co	7.185	3,37		6.241	2,92
1 SVB Financial Group	880	0,41	<b>Sonstige Fertigung — 0,57 % (28. Februar 2021: 0,55 %)</b>		
12 Truist Financial Corp	754	0,35	8 Eaton Corp Plc	1.207	0,57
25 US Bancorp	1.416	0,67	<b>Öl und Gas — 1,62 % (28. Februar 2021: 1,84 %)</b>		
	14.637	6,86	14 Pioneer Natural Resources Co	3.453	1,62
<b>Getränke — 2,50 % (28. Februar 2021: 1,89 %)</b>			<b>Verpackungen und Behälter — 0,90 % (28. Februar 2021: 0,65 %)</b>		
40 Coca-Cola Co/The	2.498	1,17	21 Ball Corp	1.921	0,90
17 PepsiCo Inc	2.837	1,33	<b>Arzneimittel — 6,90 % (28. Februar 2021: 6,60 %)</b>		
	5.335	2,50	6 Becton Dickinson and Co	1.683	0,79
<b>Baumaterialien — 0,61 % (28. Februar 2021: 0,64 %)</b>			7 Eli Lilly & Co	1.708	0,80
7 Vulcan Materials Co	1.302	0,61	29 Johnson & Johnson	4.777	2,24
<b>Chemikalien — 4,36 % (28. Februar 2021: 5,74 %)</b>			50 Merck & Co Inc	3.811	1,78
12 Air Products & Chemicals Inc	2.787	1,31	59 Pfizer Inc	2.761	1,29
9 Ecolab Inc	1.506	0,70		14.740	6,90
25 PPG Industries Inc	3.383	1,58	<b>Pipelines — 0,51 % (28. Februar 2021: 0,46 %)</b>		
6 Sherwin-Williams Co/The	1.642	0,77	62 Kinder Morgan Inc	1.087	0,51
	9.318	4,36	<b>Einzelhandel — 4,29 % (28. Februar 2021: 4,21 %)</b>		
<b>Kommerzielle Dienstleistungen — 1,69 % (28. Februar 2021: 1,58 %)</b>			18 Home Depot Inc/The	5.756	2,69
18 Automatic Data Processing Inc	3.605	1,69	52 TJX Cos Inc/The	3.412	1,60
<b>Computer — 6,40 % (28. Februar 2021: 6,85 %)</b>				9.168	4,29
83 Apple Inc	13.658	6,40	<b>Halbleiter — 1,45 % (28. Februar 2021: 2,04 %)</b>		
<b>Kosmetik und Körperpflege — 1,48 % (28. Februar 2021: 1,41 %)</b>			4 ASML Holding NV	2.333	1,10
20 Procter & Gamble Co/The	3.152	1,48	4 Texas Instruments Inc	753	0,35
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 4,04 % (28. Februar 2021: 4,21 %)</b>				3.086	1,45
7 CME Group Inc	1.678	0,79	<b>Software — 11,76 % (28. Februar 2021: 12,01 %)</b>		
12 Intercontinental Exchange Inc	1.547	0,72	6 Adobe Inc	2.978	1,39
25 Visa Inc 'A'	5.398	2,53	15 Fidelity National Information Services Inc	1.461	0,68
	8.623	4,04	58 Microsoft Corp	17.393	8,15
<b>Elektrisch — 0,77 % (28. Februar 2021: 0,65 %)</b>			24 Oracle Corp	1.851	0,87
10 NextEra Energy Inc	780	0,37	7 salesforce.com Inc	1.431	0,67
6 Sempra Energy	854	0,40		25.114	11,76
	1.634	0,77	<b>Telekommunikation — 3,33 % (28. Februar 2021: 2,79 %)</b>		
<b>Elektronik — 2,16 % (28. Februar 2021: 2,51 %)</b>			12 Arista Networks Inc	1.504	0,70
24 Honeywell International Inc	4.606	2,16	35 Cisco Systems Inc/Delaware	1.928	0,90
<b>Energie – Alternative Quellen – 0,48 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			14 T-Mobile US Inc	1.711	0,80
6 Enphase Energy Inc	1.021	0,48	37 Verizon Communications Inc	1.977	0,93
<b>Umweltkontrolle — 1,43 % (28. Februar 2021: 1,04 %)</b>				7.120	3,33
21 Waste Management Inc	3.056	1,43	<b>Transport — 2,75 % (28. Februar 2021: 2,68 %)</b>		
<b>Lebensmittel — 0,99 % (28. Februar 2021: 0,83 %)</b>			16 Canadian Pacific Railway Ltd	1.127	0,53
32 Mondelez International Inc	2.111	0,99	4 Union Pacific Corp	1.058	0,49
<b>Gesundheitsprodukte — 2,88 % (28. Februar 2021: 3,89 %)</b>			18 United Parcel Service Inc 'B'	3.690	1,73
9 Medtronic Plc	923	0,43		5.875	2,75
1 Stryker Corp	334	0,16	<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 140.774 USD)</b>	204.806	95,93
9 Thermo Fisher Scientific Inc	4.900	2,29	<b>Immobilienfonds — 1,25 % (28. Februar 2021: 1,31 %)</b>		
	6.157	2,88	REITS — 1,25 % (28. Februar 2021: 1,31 %)		
<b>Gesundheitsdienstleistungen — 2,83 % (28. Februar 2021: 2,20 %)</b>			12 American Tower Corp	2.664	1,25
13 UnitedHealth Group Inc	6.053	2,83	<b>Immobilien-Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten 1.871 USD)</b>	2.664	1,25
<b>Bauherren — 0,75 % (28. Februar 2021: 0,59 %)</b>			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 142.645 USD)</b>	207.470	97,18
30 Toll Brothers Inc	1.602	0,75	<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
<b>Versicherungen — 6,35 % (28. Februar 2021: 5,58 %)</b>			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	–	–
– Berkshire Hathaway Inc	6.270	2,94	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	207.470	97,18
14 Hartford Financial Services Group Inc/The	986	0,46	<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
10 Progressive Corp/The	1.043	0,49	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	–	–
31 Travelers Cos Inc/The	5.266	2,46	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	–	–
	13.565	6,35	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	207.470	97,18
<b>Internet — 10,60 % (28. Februar 2021: 11,37 %)</b>			<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>	6.010	2,82
2 Alphabet Inc	6.357	2,98	<b>Gesamtnettovermögen</b>	\$213.480	100,00
2 Alphabet Inc 'A'	5.974	2,80			
3 Amazon.com Inc	7.877	3,69			
11 Meta Platforms Inc 'A'	2.416	1,13			
	22.624	10,60			
<b>Eisen/Stahl — 0,99 % (28. Februar 2021: 0,86 %)</b>					
68 ArcelorMittal SA	2.107	0,99			

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

# Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	<b>% des Gesamt vermögens</b>
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	91,89
Sonstige Vermögenswerte	8,11
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)	
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–	\$	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	USD	1		–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): USD–)								\$	–
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): USD–)									–
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): USD–)								\$	–

## Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Stammaktien — 97,57 % (28. Februar 2021: 98,47 %)</b>			<b>Transport — 2,84 % (28. Februar 2021: 2,23 %)</b>		
<b>Bekleidung — 1,68 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			240 United Parcel Service Inc 'B'		
219 NIKE Inc	29.862	1,68	50.393	2,84	
<b>Autoteile und -ausrüstung — 1,54 % (28. Februar 2021: 1,83 %)</b>			<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 1.212.100 USD)</b>		
211 Aptiv Plc	27.263	1,54	1.729.670	97,57	
<b>Getränke — 1,63 % (28. Februar 2021: 2,37 %)</b>			<b>Immobilien-Investmentfonds — 1,51 % (28. Februar 2021: 1,52 %)</b>		
342 Monster Beverage Corp	28.909	1,63	<b>REITS — 1,51 % (28. Februar 2021: 1,52 %)</b>		
<b>Biotechnologie — 0,58 % (28. Februar 2021: 3,50 %)</b>			38 Equinix Inc		
132 BioMarin Pharmaceutical Inc	10.284	0,58	26.662	1,51	
<b>Kommerzielle Dienstleistungen — 3,83 % (28. Februar 2021: 1,78 %)</b>			<b>Summe Immobilieninvestmentfonds (Anschaffungskosten 17.067 USD)</b>		
258 PayPal Holdings Inc	28.864	1,63	26.662	1,51	
104 S&P Global Inc	38.978	2,20	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.229.167 USD)</b>		
	67.842	3,83	1.756.332	99,08	
<b>Computer — 4,50 % (28. Februar 2021: 4,74 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte — 0,26 % (28. Februar 2021: 0,06 %)</b>		
483 Apple Inc	79.745	4,50	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Vertrieb und Großhandel — 2,08 % (28. Februar 2021: 1,72 %)</b>			4.603		
77 WW Grainger Inc	36.893	2,08	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 4,64 % (28. Februar 2021: 4,74 %)</b>			1.760.935		
381 Visa Inc 'A'	82.227	4,64	<b>Devisenterminkontrakte — (0,10 %) (28. Februar 2021: (0,13 %))</b>		
<b>Elektronik — 1,97 % (28. Februar 2021: 2,12 %)</b>			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
184 Honeywell International Inc	34.975	1,97	(1.709)		
<b>Gesundheitsprodukte — 6,23 % (28. Februar 2021: 3,95 %)</b>			<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
360 Alcon Inc	27.748	1,57	(1.709)		
98 Intuitive Surgical Inc	28.574	1,61	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
100 Thermo Fisher Scientific Inc	54.128	3,05	1.759.226		
	110.450	6,23	<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		
<b>Gesundheitsdienstleistungen — 3,99 % (28. Februar 2021: 3,29 %)</b>			13.469		
149 UnitedHealth Group Inc	70.679	3,99	<b>Gesamtvermögen</b>		
<b>Internet — 23,84 % (28. Februar 2021: 22,03 %)</b>			\$1.772.695		
54 Amazon.com Inc	166.419	9,39	100,00		
11 Booking Holdings Inc	23.858	1,35	– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
376 Meta Platforms Inc 'A'	79.370	4,48	<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
103 Netflix Inc	40.470	2,28	ADR – Amerikanische Hinterlegungsstelle.		
109 Palo Alto Networks Inc	64.806	3,65	<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
142 Sea Ltd ADR	20.667	1,16	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
752 Uber Technologies Inc	27.111	1,53	Finanzderivate		
	422.701	23,84	Sonstige Vermögenswerte		
<b>Medien — 1,62 % (28. Februar 2021: 3,52 %)</b>			<b>Gesamtvermögen</b>		
193 Walt Disney Co/The	28.721	1,62	100,00		
<b>Sonstige Fertigung — 1,67 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
192 Eaton Corp Plc	29.618	1,67			
<b>Arzneimittel — 3,43 % (28. Februar 2021: 2,44 %)</b>					
390 CVS Health Corp	40.372	2,28			
49 Dexcom Inc	20.363	1,15			
	60.735	3,43			
<b>Einzelhandel — 4,67 % (28. Februar 2021: 7,53 %)</b>					
131 Advance Auto Parts Inc	26.826	1,51			
14 Home Depot Inc/The	4.395	0,25			
131 Tractor Supply Co	26.593	1,50			
67 Ulta Beauty Inc	24.938	1,41			
	82.752	4,67			
<b>Halbleiter — 6,96 % (28. Februar 2021: 9,60 %)</b>					
36 ASML Holding NV	23.811	1,34			
334 NVIDIA Corp	81.327	4,59			
96 NXP Semiconductors NV	18.174	1,03			
	123.312	6,96			
<b>Software — 19,87 % (28. Februar 2021: 19,68 %)</b>					
115 Adobe Inc	53.889	3,04			
115 Atlassian Corp Plc	35.185	1,98			
164 Fidelity National Information Services Inc	15.579	0,88			
370 Microsoft Corp	110.612	6,24			
286 salesforce.com Inc	60.285	3,40			
195 Splunk Inc	23.070	1,30			
291 UiPath Inc	10.109	0,57			
156 Unity Software Inc	16.600	0,94			
118 Workday Inc 'A'	26.980	1,52			
	352.309	19,87			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)		
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	556	Verkauf	EUR	495	\$ (1)
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	103	Verkauf	GBP	77	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	436	Verkauf	USD	488	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	11	Verkauf	USD	13	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	15	Verkauf	USD	20	–
02/03/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	7.000	Verkauf	USD	1.401	(43)
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	15.443	Verkauf	BRL	81.719	(406)
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	58.798	Verkauf	BRL	300.635	490
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	363.401	Verkauf	USD	66.547	3.933
03/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	BRL	18.952	Verkauf	USD	3.568	108
07/03/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	13.000	Verkauf	USD	2.541	(22)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	4.415	Verkauf	EUR	3.891	48
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	115	Verkauf	EUR	103	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	36.571	Verkauf	USD	41.829	(795)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	442	Verkauf	USD	496	1
04/04/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	3.866	Verkauf	BRL	20.000	23
04/04/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	283.921	Verkauf	USD	55.012	(442)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.202 USD)							\$	4.603
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (2.409) USD)								(1.709)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1.207) USD)							\$	2.894

# Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Stammaktien — 99,69 % (28. Februar 2021: 99,88 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
<b>Biotechnologie — 14,56 % (28. Februar 2021: 16,26 %)</b>				536.584	99,71
85 Biogen Inc	18.005	3,34	<b>Devisenterminkontrakte – (0,02 %) (28. Februar 2021: (0,01 %))</b>		
88 Guardant Health Inc	5.800	1,08	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (123) (0,02)		
218 ImmunoGen Inc	1.229	0,23	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
253 Ionis Pharmaceuticals Inc	8.432	1,57	(123) (0,02)		
90 Ultragenyx Pharmaceutical Inc	6.027	1,12	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
169 Vertex Pharmaceuticals Inc	38.866	7,22	536.461 99,69		
	78.359	14,56	<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		
<b>Baumaterialien — 2,69 % (28. Februar 2021: 1,70 %)</b>			1.698 0,31		
223 Johnson Controls International plc	14.489	2,69	<b>Gesamtvermögen</b>		
<b>Computer — 7,53 % (28. Februar 2021: 5,92 %)</b>			\$538.159 100,00		
75 CrowdStrike Holdings Inc	14.644	2,72	– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
189 Seagate Technology Holdings Plc	19.440	3,61	<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
126 Western Digital Corp	6.438	1,20	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 98,65		
	40.522	7,53	Finanzderivate 0,22		
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 0,50 % (28. Februar 2021: 0,29 %)</b>			Sonstige Vermögenswerte 1,33		
33 Cohen & Steers Inc	2.708	0,50	<b>Gesamtvermögen</b>		
<b>Elektronik — 6,74 % (28. Februar 2021: 4,51 %)</b>			100,00		
255 TE Connectivity Ltd	36.286	6,74			
<b>Unterhaltung — 4,52 % (28. Februar 2021: 3,87 %)</b>					
138 Madison Square Garden Entertainment Corp	10.820	2,01			
78 Madison Square Garden Sports Corp	13.489	2,51			
	24.309	4,52			
<b>Gesundheitsprodukte — 2,03 % (28. Februar 2021: 0,62 %)</b>					
45 10X Genomics Inc	3.696	0,69			
27 Insulet Corp	7.218	1,34			
	10.914	2,03			
<b>Gesundheitsdienstleistungen — 8,72 % (28. Februar 2021: 3,83 %)</b>					
27 Charles River Laboratories International Inc	7.977	1,48			
82 UnitedHealth Group Inc	38.950	7,24			
	46.927	8,72			
<b>Wohneinrichtungen — 1,41 % (28. Februar 2021: 1,34 %)</b>					
101 Dolby Laboratories Inc 'A'	7.557	1,41			
<b>Internet — 10,96 % (28. Februar 2021: 7,85 %)</b>					
60 Etsy Inc	9.234	1,72			
168 Lyft Inc	6.535	1,21			
96 Match Group Inc	10.663	1,98			
54 Meta Platforms Inc 'A'	11.492	2,13			
593 Twitter Inc	21.071	3,92			
	58.995	10,96			
<b>Medien — 17,93 % (28. Februar 2021: 26,56 %)</b>					
226 AMC Networks Inc	9.374	1,74			
750 Comcast Corp	35.070	6,52			
311 Discovery Inc	8.721	1,62			
376 Discovery Inc	10.512	1,95			
59 Liberty Broadband Corp	8.599	1,60			
59 Liberty Broadband Corp	8.662	1,61			
118 Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	7.189	1,34			
166 Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	8.368	1,55			
	96.495	17,93			
<b>Arzneimittel — 1,04 % (28. Februar 2021: 3,19 %)</b>					
38 AbbVie Inc	5.569	1,04			
<b>Halbleiter — 11,73 % (28. Februar 2021: 9,67 %)</b>					
64 Broadcom Inc	37.412	6,95			
251 Wolfspeed Inc	25.723	4,78			
	63.135	11,73			
<b>Software – 9,33 % (28. Februar 2021: 11,42 %)</b>					
84 Autodesk Inc	18.541	3,45			
28 Cerence Inc	1.024	0,19			
80 DocuSign Inc 'A'	9.491	1,76			
43 Doximity Inc	2.607	0,49			
28 HubSpot Inc	14.500	2,69			
38 Unity Software Inc	4.043	0,75			
	50.206	9,33			
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 371.834 USD)</b>			536.471 99,69		
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 371.834 USD)</b>			536.471 99,69		
<b>Devisenterminkontrakte – 0,02 % (28. Februar 2021: 0,02 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			113 0,02		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)			
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	AUD	–	\$	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	3	Verkauf	EUR	3		–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	11	Verkauf	USD	11		–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–		–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.167	Verkauf	USD	1.563		2
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	408	Verkauf	AUD	565		(5)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	CHF	4		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	40	Verkauf	CNH	254		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	46	Verkauf	CNH	290		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	114	Verkauf	EUR	101		1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	3	Verkauf	EUR	3		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	43	Verkauf	GBP	32		1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	77	Verkauf	PLN	311		3
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	SEK	14		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	336	Verkauf	SGD	453		2
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	8.616	Verkauf	USD	1.351		11
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	362	Verkauf	USD	57		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	890	Verkauf	USD	1.017		(19)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	37	Verkauf	USD	41		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	510	Verkauf	USD	692		(7)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	22	Verkauf	USD	29		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	133	Verkauf	USD	98		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	206	Verkauf	USD	49		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	216	Verkauf	USD	24		(1)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	3.428	Verkauf	USD	2.551		(22)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CHF	59	Verkauf	USD	64		1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	9	Verkauf	USD	1		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	4.885	Verkauf	USD	1.231		(69)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	8.574	Verkauf	USD	6.138		92
15/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	USD	4	Verkauf	EUR	3		–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 141 USD)							\$		113
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (32) USD)									(123)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 109 USD)							\$		(10)

# Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Stammaktien — 74,41 % (28. Februar 2021: 68,97 %)</b>			<b>Private Equity — 1,72 % (28. Februar 2021: 1,70 %)</b>		
<b>Luft- und Raumfahrt und Verteidigung — 1,75 % (28. Februar 2021: 1,44 %)</b>			6 Blackstone Inc 744 1,72		
7 Raytheon Technologies Corp 760 1,75			<b>Halbleiter — 6,30 % (28. Februar 2021: 9,21 %)</b>		
<b>Banken — 3,47 % (28. Februar 2021: 3,62 %)</b>			– ASML Holding NV 288 0,67		
19 Bank of America Corp 841 1,94			8 Intel Corp 398 0,92		
5 JPMorgan Chase & Co 660 1,53			2 NXP Semiconductors NV 390 0,90		
1.501 3,47			7 QUALCOMM Inc 1.139 2,63		
<b>Getränke — 1,71 % (28. Februar 2021: 1,01 %)</b>			2 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR 243 0,56		
12 Coca-Cola Co/The 739 1,71			2 Texas Instruments Inc 269 0,62		
<b>Biotechnologie — 1,13 % (28. Februar 2021: 1,28 %)</b>			2.727 6,30		
2 Amgen Inc 488 1,13			<b>Software — 9,22 % (28. Februar 2021: 7,47 %)</b>		
<b>Chemikalien — 2,08 % (28. Februar 2021: 2,07 %)</b>			6 Activision Blizzard Inc 504 1,17		
2 Air Products & Chemicals Inc 377 0,87			8 Microsoft Corp 2.520 5,82		
13 Huntsman Corp 525 1,21			9 Oracle Corp 679 1,57		
902 2,08			2 Paychex Inc 287 0,66		
<b>Computer — 6,60 % (28. Februar 2021: 6,00 %)</b>			3.990 9,22		
17 Apple Inc 2.858 6,60			<b>Telekommunikation — 2,88 % (28. Februar 2021: 0,25 %)</b>		
<b>Kosmetik und Körperpflege — 1,58 % (28. Februar 2021: 1,43 %)</b>			12 Cisco Systems Inc/Delaware 681 1,58		
4 Procter & Gamble Co/The 682 1,58			11 Verizon Communications Inc 564 1,30		
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 3,57 % (28. Februar 2021: 2,12 %)</b>			1.245 2,88		
3 Apollo Global Management Inc 210 0,49			<b>Transport — 0,74 % (28. Februar 2021: 2,29 %)</b>		
35 Blue Owl Capital Inc 'A' 436 1,01			2 United Parcel Service Inc 'B' 323 0,74		
1 CME Group Inc 352 0,81			<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 21.700 USD)</b>		
4 Intercontinental Exchange Inc 548 1,26			32.203 74,41		
1.546 3,57			<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 1,93 % (28. Februar 2021: 2,57 %)</b>		
<b>Elektrisch — 3,22 % (28. Februar 2021: 3,92 %)</b>			<b>Fluggesellschaften — 1,43 % (28. Februar 2021: 1,90 %)</b>		
4 Brookfield Renewable Corporation 153 0,35			460 American Airlines Group Inc, 6,500 %, fällig 01/07/2025 621 1,43		
19 Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP 686 1,59			<b>Freizeit — 0,50 % (28. Februar 2021: 0,67 %)</b>		
4 NextEra Energy Inc 325 0,75			167 Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,250 %, fällig 15/06/2023 215 0,50		
2 Sempra Energy 229 0,53			<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 671 USD)</b>		
1.393 3,22			836 1,93		
<b>Elektrische Komponenten und Ausrüstung — 0,94 % (28. Februar 2021: 0,99 %)</b>			<b>Vorzugsaktien — 13,76 % (28. Februar 2021: 15,84 %)</b>		
4 Emerson Electric Co 406 0,94			<b>Autoteile und -ausrüstung — 1,18 % (28. Februar 2021: 1,58 %)</b>		
<b>Elektronik — 0,49 % (28. Februar 2021: 1,66 %)</b>			4 Aptiv Plc, Series A 512 1,18		
1 TE Connectivity Ltd 213 0,49			<b>Elektrisch — 2,51 % (28. Februar 2021: 2,68 %)</b>		
<b>Energie — Alternative Quellen — 0,92 % (28. Februar 2021: 0,92 %)</b>			10 DTE Energy Co 526 1,22		
5 NextEra Energy Partners LP 398 0,92			11 NextEra Energy Inc 559 1,29		
<b>Hand-/Maschinenwerkzeuge — 1,81 % (28. Februar 2021: 2,25 %)</b>			1.085 2,51		
5 Stanley Black & Decker Inc 782 1,81			<b>Gas — 0,96 % (28. Februar 2021: 0,41 %)</b>		
<b>Haushaltsprodukte und -ware — 0,90 % (28. Februar 2021: 1,06 %)</b>			4 South Jersey Industries Inc 266 0,62		
3 Kimberly-Clark Corp 390 0,90			3 Spire Inc, Series A 149 0,34		
<b>Versicherungen — 1,32 % (28. Februar 2021: 0,80 %)</b>			415 0,96		
2 Chubb Ltd 329 0,76			<b>Gesundheitsprodukte — 1,88 % (28. Februar 2021: 1,96 %)</b>		
2 Progressive Corp/The 244 0,56			1 Boston Scientific Corp, Series A 145 0,34		
573 1,32			– Danaher Corp, Series A 668 1,54		
<b>Internet — 0,92 % (28. Februar 2021: 0,71 %)</b>			813 1,88		
14 NortonLifeLock Inc 397 0,92			<b>Medien — 1,05 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
<b>Investmentgesellschaften — 3,58 % (28. Februar 2021: 3,79 %)</b>			9 Paramount Global, Series A 456 1,05		
9 Ares Capital Corp 189 0,44			<b>Private Equity — 2,41 % (28. Februar 2021: 2,50 %)</b>		
29 Barings BDC Inc 311 0,72			14 KKR & Co Inc, Series C 1.042 2,41		
28 Trinity Capital Inc 489 1,13			<b>Halbleiter — 3,77 % (28. Februar 2021: 6,22 %)</b>		
34 TriplePoint Venture Growth BDC Corp 559 1,29			1 Broadcom Inc, Series A 1.631 3,77		
1.548 3,58			<b>Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 4.372 USD)</b>		
<b>Maschinen — diversifiziert — 1,26 % (28. Februar 2021: 1,49 %)</b>			5.954 13,76		
7 Otis Worldwide Corp 545 1,26			<b>Immobilien-Investmentfonds — 7,43 % (28. Februar 2021: 8,34 %)</b>		
<b>Arzneimittel — 5,07 % (28. Februar 2021: 5,49 %)</b>			<b>REITS — 7,43 % (28. Februar 2021: 8,34 %)</b>		
3 Johnson & Johnson 525 1,22			4 Alexandria Real Estate Equities Inc 675 1,56		
10 Merck & Co Inc 780 1,80			2 American Tower Corp 508 1,17		
19 Pfizer Inc 887 2,05			6 Apartment Income REIT Corp 316 0,73		
2.192 5,07			1 Crown Castle International Corp 207 0,48		
<b>Pipelines — 11,23 % (28. Februar 2021: 6,00 %)</b>			1 Duke Realty Corp 73 0,17		
7 DT Midstream Inc 348 0,80			1 Equinix Inc 407 0,94		
18 Enbridge Inc 782 1,81			3 Equity LifeStyle Properties Inc 207 0,48		
59 Equitrans Midstream Corp 378 0,87			5 Gaming and Leisure Properties Inc 209 0,48		
37 Kinder Morgan Inc 646 1,49			2 Prologis Inc 283 0,65		
6 ONEOK Inc 375 0,87			1 SBA Communications Corp 'A' 214 0,50		
62 Plains GP Holdings LP 'A' 706 1,63			3 Weyerhaeuser Co 118 0,27		
29 Rattler Midstream LP, MLP # 403 0,93			3.217 7,43		
10 TC Energy Corp 513 1,19			<b>Immobilien-Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten 2.298 USD)</b>		
23 Williams Cos Inc/The 710 1,64			3.217 7,43		
4.861 11,23			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten USD 29.041)</b>		
			42.210 97,53		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	
<b>Devisenterminkontrakte – 0,05 % (28. Februar 2021: 0,04 %)</b>			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	20	0,05	
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>42.230</b>	<b>97,58</b>	
<b>Devisenterminkontrakte – (0,09 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(38)	(0,09)	
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>	<b>(38)</b>	<b>(0,09)</b>	
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>42.192</b>	<b>97,49</b>	
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>	<b>1.087</b>	<b>2,51</b>	
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>\$43.279</b>	<b>100,00</b>	

  

	% des Gesamt vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,54
Finanzderivate	0,05
Sonstige Vermögenswerte	3,41
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

# Master Limited Partnership.

**ABKÜRZUNGEN:**

ADR – Amerikanische Hinterlegungsstelle.

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)			
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	36	Verkauf	SGD	48	\$	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	42	Verkauf	AUD	58		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf	CNH	28		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	58	Verkauf	EUR	51		1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	9	Verkauf	SGD	12		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.542	Verkauf	USD	1.764		(33)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	802	Verkauf	USD	126		1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	1.646	Verkauf	USD	1.178		18
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	656	Verkauf	USD	488		(5)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 16 USD)							\$		20
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (2) USD)									(38)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 14 USD)							\$		(18)

# Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Stammaktien — 100,01 % (28. Februar 2021: 97,17 %)</b>			<b>Maschinen – diversifiziert – 1,51 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
<b>Bekleidung — 1,63 % (28. Februar 2021: 1,75 %)</b>			67 Deere & Co 24.117 1,51		
191 NIKE Inc 26.012 1,63			<b>Medien — 3,15 % (28. Februar 2021: 4,59 %)</b>		
<b>Autoteile und -ausrüstung — 1,33 % (28. Februar 2021: 2,12 %)</b>			316 Comcast Corp 14.759 0,92		
165 Aptiv Plc 21.302 1,33			240 Walt Disney Co/The 35.659 2,23		
<b>Banken — 6,68 % (28. Februar 2021: 6,68 %)</b>			50.418 3,15		
1.041 Bank of America Corp 45.990 2,88			<b>Sonstige Fertigung — 3,51 % (28. Februar 2021: 2,19 %)</b>		
165 First Republic Bank/CA 28.506 1,78			187 Eaton Corp Plc 28.896 1,81		
357 Morgan Stanley 32.365 2,02			177 Trane Technologies Plc 27.243 1,70		
106.861 6,68			56.139 3,51		
<b>Biotechnologie — 3,26 % (28. Februar 2021: 5,16 %)</b>			<b>Verpackungen und Behälter – 2,10 % (28. Februar 2021: 2,15 %)</b>		
288 BioMarin Pharmaceutical Inc 22.453 1,40			374 Ball Corp 33.552 2,10		
492 Gilead Sciences Inc 29.725 1,86			<b>Arzneimittel — 2,62 % (28. Februar 2021: 3,63 %)</b>		
52.178 3,26			405 CVS Health Corp 41.935 2,62		
<b>Baumaterialien — 1,47 % (28. Februar 2021: 1,87 %)</b>			<b>Einzelhandel — 6,37 % (28. Februar 2021: 4,14 %)</b>		
257 Trex Co Inc 23.578 1,47			78 Costco Wholesale Corp 40.669 2,54		
<b>Chemikalien — 1,19 % (28. Februar 2021: 1,54 %)</b>			113 Home Depot Inc/The 35.644 2,23		
108 Ecolab Inc 19.038 1,19			176 Williams-Sonoma Inc 25.520 1,60		
<b>Kommerzielle Dienstleistungen — 0,97 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			101.833 6,37		
393 Progyny Inc 15.460 0,97			<b>Halbleiter — 3,87 % (28. Februar 2021: 2,07 %)</b>		
<b>Computer — 5,47 % (28. Februar 2021: 5,49 %)</b>			479 Intel Corp 22.860 1,43		
530 Apple Inc 87.428 5,47			26 Lam Research Corp 14.594 0,91		
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 5,28 % (28. Februar 2021: 5,28 %)</b>			391 ON Semiconductor Corp 24.497 1,53		
32 BlackRock Inc 23.421 1,47			61.951 3,87		
367 Charles Schwab Corp/The 31.010 1,94			<b>Software – 11,51 % (28. Februar 2021: 11,99 %)</b>		
139 Visa Inc 'A' 29.950 1,87			370 Microsoft Corp 110.659 6,92		
84.381 5,28			121 salesforce.com Inc 25.411 1,59		
<b>Elektrisch — 3,15 % (28. Februar 2021: 3,33 %)</b>			82 Synopsys Inc 25.522 1,60		
696 Brookfield Renewable Corporation 25.992 1,62			98 Workday Inc 'A' 22.455 1,40		
313 NextEra Energy Inc 24.456 1,53			184.047 11,51		
50.448 3,15			<b>Telekommunikation — 1,92 % (28. Februar 2021: 1,36 %)</b>		
<b>Elektronik — 3,84 % (28. Februar 2021: 4,24 %)</b>			551 Cisco Systems Inc/Delaware 30.762 1,92		
168 Keysight Technologies Inc 26.475 1,65			<b>Spielzeug, Spiele und Hobbys – 1,92 % (28. Februar 2021: 1,71 %)</b>		
246 TE Connectivity Ltd 34.966 2,19			316 Hasbro Inc 30.650 1,92		
61.441 3,84			<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 1.530.054 USD)</b>		
<b>Energie – Alternative Quellen — 2,25 % (28. Februar 2021: 4,94 %)</b>			1.599.483 100,01		
96 Enphase Energy Inc 16.007 1,00			<b>Immobilien-Investmentfonds — 1,22 % (28. Februar 2021: 1,33 %)</b>		
63 SolarEdge Technologies Inc 20.060 1,25			<b>REITS — 1,22 % (28. Februar 2021: 1,33 %)</b>		
36.067 2,25			28 Equinix Inc 19.507 1,22		
<b>Lebensmittel — 3,77 % (28. Februar 2021: 1,67 %)</b>			<b>Summe Immobilien-Investmentfonds (Anschaffungskosten 19.951 USD)</b>		
705 Hain Celestial Group Inc/The 25.662 1,61			19.507 1,22		
364 McCormick & Co Inc/MD 34.606 2,16			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.550.005 USD)</b>		
60.268 3,77			1.618.990 101,23		
<b>Hand-/Maschinenwerkzeuge – 2,14 % (28. Februar 2021: 2,05 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2021: 0,27 %)</b>		
214 Regal Rexnord Corp 34.286 2,14			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 145 0,01		
<b>Gesundheitsprodukte — 5,71 % (28. Februar 2021: 2,05 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
68 Cooper Cos Inc/The 27.716 1,73			1.619.135 101,24		
122 Danaher Corp 33.423 2,09			<b>Devisenterminkontrakte – (0,13 %) (28. Februar 2021: (0,01 %))</b>		
55 Thermo Fisher Scientific Inc 30.122 1,89			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (2.099) (0,13)		
91.261 5,71			<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
<b>Gesundheitsdienstleistungen — 2,93 % (28. Februar 2021: 2,31 %)</b>			(2.099) (0,13)		
98 UnitedHealth Group Inc 46.820 2,93			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
<b>Versicherungen — 3,99 % (28. Februar 2021: 3,66 %)</b>			1.617.036 101,11		
446 Hartford Financial Services Group Inc/The 30.990 1,94			<b>Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten</b>		
310 Progressive Corp/The 32.764 2,05			(17.721) (1,11)		
63.754 3,99			<b>Gesamtnettovermögen</b>		
<b>Internet — 4,21 % (28. Februar 2021: 1,80 %)</b>			\$1.599.315 100,00		
12 Amazon.com Inc 38.069 2,38					
14 Booking Holdings Inc 29.315 1,83					
67.384 4,21					
<b>Unterkunft — 2,26 % (28. Februar 2021: 2,14 %)</b>					
212 Marriott International Inc/MD 36.112 2,26					

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

	% des Gesamtvermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	99,59
Finanzderivate	0,01
Sonstige Vermögenswerte	0,40
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)			
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	264	Verkauf	EUR	236	\$	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.222	Verkauf	GBP	912		(2)
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SEK	1		–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	432	Verkauf	USD	580		1
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	35	Verkauf	USD	39		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	5.048	Verkauf	EUR	4.456		47
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	39	Verkauf	EUR	35		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	6.307	Verkauf	GBP	4.648		72
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	290	Verkauf	GBP	216		(1)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	56.528	Verkauf	USD	64.642		(1.218)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.328	Verkauf	USD	2.599		12
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	2.341	Verkauf	USD	3.130		13
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	62.724	Verkauf	USD	85.033		(874)
15/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	–		–
15/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	USD	26	Verkauf	GBP	19		–
15/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	EUR	345	Verkauf	USD	391		(4)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.741 USD)							\$	145	
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (45) USD)									(2.099)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 1.696 USD)							\$	(1.954)	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Stammaktien — 89,23 % (28. Februar 2021: 97,85 %)</b>			<b>USA — 51,62 % (28. Februar 2021: 52,44 %)</b>		
<b>Australien — 0,45 % (28. Februar 2021: 0,77 %)</b>			– Accenture Plc 'A'		
AUD	4 Ansell Ltd	73	0,45	143	0,89
<b>Kanada — 4,08 % (28. Februar 2021: 2,27 %)</b>			– Alphabet Inc 'A'		
CAD	1 Canadian Imperial Bank of Commerce	122	0,76	432	2,70
	2 Canadian Pacific Railway Ltd	162	1,01	384	2,40
CAD	– Constellation Software Inc/Canada	168	1,05	– Amazon.com Inc	662
CAD	2 Thomson Reuters Corp	201	1,26	4 Apple Inc	123
		653	4,08	– Atlassian Corp Plc	271
<b>China — 0,31 % (28. Februar 2021: 2,70 %)</b>			8 Avantar Inc		
	1 Zai Lab Ltd ADR	49	0,31	3 Bank of America Corp	143
<b>Frankreich — 5,56 % (28. Februar 2021: 2,21 %)</b>			18 Coty Inc 'A'		
EUR	1 Air Liquide SA	222	1,39	– Dexcom Inc	161
EUR	4 BNP Paribas SA	216	1,35	1 DocuSign Inc 'A'	73
EUR	2 Dassault Systemes SE	93	0,58	1 Elastic NV	114
EUR	1 EssilorLuxottica SA	141	0,88	1 Fidelity National Information Services Inc	103
EUR	1 L'Oreal SA	218	1,36	1 Insulet Corp	138
		890	5,56	2 Intel Corp	75
<b>Deutschland — 1,66 % (28. Februar 2021: 3,72 %)</b>			1 Intercontinental Exchange Inc		
EUR	– adidas AG	116	0,72	6 Kroger Co/The	262
EUR	1 Deutsche Boerse AG	149	0,94	2 Marriott International Inc/MD	279
		265	1,66	3 Marvell Technology Inc	193
<b>Hongkong — 1,51 % (28. Februar 2021: 1,79 %)</b>			2 Microsoft Corp		
HKD	23 AIA Group Ltd	242	1,51	– Netflix Inc	621
<b>Irland — 2,20 % (28. Februar 2021: 0,76 %)</b>			1 NVIDIA Corp		
	3 CRH Plc ADR	156	0,97	1 Old Dominion Freight Line Inc	270
	1 ICON Plc	197	1,23	2 Pinterest Inc	48
		353	2,20	1 Procter & Gamble Co/The	153
<b>Israel — 0,84 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			2 Progressive Corp/The		
	1 Nice Ltd ADR	134	0,84	2 Raymond James Financial Inc	232
<b>Italien — 1,15 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			1 S&P Global Inc		
EUR	72 Intesa Sanpaolo SpA	185	1,15	– salesforce.com Inc	90
<b>Japan — 2,92 % (28. Februar 2021: 6,55 %)</b>			2 Sensient Technologies Corp		
JPY	– Hoya Corp	–	–	– Tesla Inc	192
JPY	– Keyence Corp	164	1,02	– Thermo Fisher Scientific Inc	198
JPY	4 Olympus Corp	84	0,53	3 TJX Cos Inc/The	212
JPY	3 Recruit Holdings Co Ltd	129	0,80	1 T-Mobile US Inc	84
JPY	2 Shiseido Co Ltd	90	0,57	– Ultra Beauty Inc	171
		467	2,92	1 Union Pacific Corp	360
<b>Niederlande — 1,59 % (28. Februar 2021: 2,67 %)</b>			1 United Parcel Service Inc 'B'		
EUR	– Argenx SE ADR	73	0,46	1 United Rentals Inc	278
EUR	– ASML Holding NV	181	1,13	– UnitedHealth Group Inc	198
		254	1,59	1 Waste Management Inc	216
<b>Portugal — 1,31 % (28. Februar 2021: 1,28 %)</b>			– Workday Inc 'A'		
EUR	43 EDP — Energias de Portugal SA	210	1,31		87
<b>Südkorea — 0,70 % (28. Februar 2021: 1,54 %)</b>			8.269		
KRW	2 Samsung Electronics Co Ltd	112	0,70	14.292	89,23
<b>Spanien — 0,73 % (28. Februar 2021: 2,43 %)</b>			<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 13.074 USD)</b>		
EUR	2 Amadeus IT Group SA	117	0,73		
<b>Schweden — 2,21 % (28. Februar 2021: 1,39 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
SEK	3 Atlas Copco AB	179	1,11	14.292	89,23
	– Atlas Copco AB ADR	12	0,08		
SEK	8 Sandvik AB	163	1,02		
		354	2,21		
<b>Schweiz — 4,34 % (28. Februar 2021: 3,69 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
CHF	2 Alcon Inc	145	0,90	14.292	89,23
CHF	2 Nestle SA	324	2,03		
	2 TE Connectivity Ltd	226	1,41		
		695	4,34		
<b>Taiwan — 1,72 % (28. Februar 2021: 1,81 %)</b>			<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		
	3 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	276	1,72	1.726	10,77
<b>Großbritannien — 4,33 % (28. Februar 2021: 5,61 %)</b>			<b>Gesamtnettovermögen</b>		
GBP	2 Diageo Plc ADR	332	2,07	\$16.018	100,00
GBP	15 Dr. Martens Plc	58	0,36		
GBP	2 London Stock Exchange Group Plc	190	1,19		
GBP	17 Rentokil Initial Plc	114	0,71		
		694	4,33		

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

**ABKÜRZUNGEN:**

ADR	– Amerikanische Hinterlegungsstelle.
AUD	– Australischer Dollar
CAD	– Kanadischer Dollar
CHF	– Schweizer Franken
EUR	– Euro
GBP	– Britische Pfund
HKD	– Hongkong-Dollar
JPY	– Japanischer Yen
KRW	– Südkoreanischer Gewinner
SEK	– Schwedische Krona

**Analyse des Gesamtvermögens**

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	89,04
Sonstige Vermögenswerte	10,96

**Gesamtvermögen** 100,00

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts
<b>Stammaktien — 90,15 % (28. Februar 2021: 94,46 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – (0,07 %) (28. Februar 2021: (0,09 %))</b>		
<b>Australien — 1,90 % (28. Februar 2021: 7,31 %)</b>			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (438) (0,07)		
AUD 1.549	Transurban Group	12,746	1,90		
<b>Kanada — 8,49 % (28. Februar 2021: 3,14 %)</b>			<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b> (438) (0,07)		
CAD 515	Enbridge Inc	19,847	2,95		
CAD 789	Gibson Energy Inc	13,754	2,05		
CAD 773	Pembina Pipeline Corp	23,418	3,49		
		57,019	8,49		
<b>Frankreich — 9,99 % (28. Februar 2021: 13,21 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b> 651,055 96,97		
132	Eiffage SA	11,968	1,78		
2.421	Getlink SE	35,208	5,25		
213	Vinci SA	19,872	2,96		
		67,048	9,99		
<b>Italien — 2,55 % (28. Februar 2021: 7,02 %)</b>			<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b> 20,369 3,03		
2.346	Terna — Rete Elettrica Nazionale	17,105	2,55		
<b>Japan — 3,05 % (28. Februar 2021: 2,10 %)</b>			<b>Gesamtnettvermögen</b> € 671,424 100,00		
JPY 386	East Japan Railway Co	20,475	3,05		
<b>Portugal — 2,60 % (28. Februar 2021: 2,15 %)</b>			– Als „–“ bezeichnete Beträge betragen entweder 0 €, weniger als 1.000 €, weniger als 1.000 Aktien oder weniger als 0,01 %.		
4.011	EDP — Energias de Portugal SA	17,460	2,60		
<b>Spanien — 11,97 % (28. Februar 2021: 9,62 %)</b>			144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 37.759.000 EUR bzw. 5,62 % des Nettovermögens.		
131	Aena SME SA, 144A	19,128	2,85		
462	Cellnex Telecom SA, 144A	18,631	2,77		
981	Ferrovial SA	23,833	3,55		
1.854	Iberdrola SA	18,768	2,80		
		80,360	11,97		
<b>Großbritannien — 7,75 % (28. Februar 2021: 5,22 %)</b>			<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
GBP 837	National Grid Plc	11,288	1,68	AUD – Australischer Dollar	
GBP 388	Severn Trent Plc	13,297	1,98	CAD – Kanadischer Dollar	
GBP 1.356	SSE Plc	27,440	4,09	GBP – Britische Pfund	
		52,025	7,75	JPY – Japanischer Yen	
				USD – US-Dollar	
<b>USA — 41,85 % (28. Februar 2021: 41,63 %)</b>			<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
USD 24	CenterPoint Energy Inc	593	0,09	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 95,88	
USD 543	CenterPoint Energy Inc	13,235	1,97	Finanzderivate 0,47	
USD 180	Cheniere Energy Inc	21,351	3,18	Sonstige Vermögenswerte 3,65	
USD 16	Cheniere Energy Inc	1,908	0,28	<b>Gesamtvermögen</b> 100,00	
USD 11	Cleanway Energy Inc 'C'	313	0,05		
USD 288	Cleanway Energy Inc 'C'	8,579	1,28		
USD 17	CMS Energy Corp	960	0,14		
USD 370	CMS Energy Corp	21,106	3,14		
USD 284	Constellation Energy Corp	11,641	1,73		
USD 793	CSX Corp	23,986	3,57		
USD 278	CSX Corp	8,415	1,25		
USD 191	Dominion Energy Inc	13,557	2,02		
USD 161	Entergy Corp	15,096	2,25		
USD 627	Exelon Corp	23,810	3,54		
USD 106	NextEra Energy Inc	7,430	1,11		
USD 281	NextEra Energy Inc	19,609	2,92		
USD 1.158	PG&E Corp	11,740	1,75		
USD 19	Public Service Enterprise Group Inc	1,092	0,16		
USD 422	Public Service Enterprise Group Inc	24,389	3,63		
USD 34	Southern Co/The	1,991	0,30		
USD 232	Southern Co/The	13,417	2,00		
USD 127	Union Pacific Corp	27,789	4,14		
USD 7	Union Pacific Corp	1,457	0,22		
USD 187	Williams Cos Inc/The	5,218	0,78		
USD 84	Williams Cos Inc/The	2,336	0,35		
		281,018	41,85		
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 536.763 EUR)</b>			605,256 90,15		
<b>Immobilienfonds — 6,41 % (28. Februar 2021: 5,96 %)</b>			<b>USA — 6,41 % (28. Februar 2021: 5,96 %)</b>		
USD 4	American Tower Corp	756	0,11		
USD 86	American Tower Corp	17,453	2,60		
USD 3	Crown Castle International Corp	497	0,08		
USD 75	Crown Castle International Corp	11,099	1,65		
USD 49	SBA Communications Corp 'A'	13,237	1,97		
		43,042	6,41		
<b>Immobilien-Investmentfonds insgesamt (Anschaffungskosten 43.250 EUR)</b>			43,042 6,41		
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 580.013 EUR)</b>			648,298 96,56		
<b>Devisenterminkontrakte – 0,48 % (28. Februar 2021: 0,04 %)</b>			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 3,195 0,48		
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>			651,493 97,04		

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)		
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	AUD	–	
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	257	Verkauf	EUR	170	
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	39	Verkauf	EUR	35	
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	90	Verkauf	EUR	107	
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	470	Verkauf	EUR	419	
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.716	Verkauf	GBP	1.437	
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	25	Verkauf	USD	28	
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	113	Verkauf	USD	126	
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	5.422	Verkauf	BRL	30.969	
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	168	Verkauf	BRL	1.013	
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	31.982	Verkauf	EUR	5.182	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	39	Verkauf	AUD	62	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	93	Verkauf	CNH	681	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	665	Verkauf	EUR	788	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	126	Verkauf	EUR	113	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	113.039	Verkauf	EUR	98.846	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	8.695	Verkauf	EUR	5.445	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	53.662	Verkauf	EUR	7.362	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	6.529	Verkauf	EUR	4.245	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	51	Verkauf	SGD	78	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	170	Verkauf	SGD	257	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	419	Verkauf	USD	469	
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.172	Verkauf	USD	2.464	
15/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	SGD	2	Verkauf	EUR	2	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	299	Verkauf	AUD	477	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	367	Verkauf	AUD	694	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	1.472	Verkauf	AUD	1.618	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	75	Verkauf	CAD	69	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2.240	Verkauf	CAD	2.857	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.436	Verkauf	CAD	4.953	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.850	Verkauf	CAD	3.186	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	16.814	Verkauf	CAD	186	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	4.791	Verkauf	EUR	5.714	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	24.366	Verkauf	EUR	16.884	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	5.019	Verkauf	EUR	38	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	23	Verkauf	EUR	14	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	665	Verkauf	EUR	591	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.323	Verkauf	EUR	1.585	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	879	Verkauf	GBP	650	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.637	Verkauf	GBP	1.374	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	6.633	Verkauf	GBP	42	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	6.299	Verkauf	GBP	3.656	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	30	Verkauf	GBP	16	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	452	Verkauf	GBP	378	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	502	Verkauf	JPY	65.790	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	2.354	Verkauf	JPY	214.101	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	106	Verkauf	JPY	9.503	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	604	Verkauf	JPY	94.418	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	401	Verkauf	USD	449	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.308	Verkauf	USD	1.749	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	7.366	Verkauf	USD	8.365	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	38.123	Verkauf	USD	29.963	
23/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	8.176	Verkauf	USD	11.070	
04/04/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	30.626	Verkauf	EUR	5.313	
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 230 EUR)							€	3.195
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (558) EUR)								(438)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (328) EUR)							€	2.757

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Stammaktien — 95,07 % (28. Februar 2021: 96,36 %)</b>			<b>Vorzugsaktien — 1,57 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
<b>Brasilien — 14,71 % (28. Februar 2021: 13,56 %)</b>			<b>Brasilien — 1,57 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
BRL	43	3,67	BRL	10	1,57
BRL	15	3,22	<b>Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 42 USD)</b>		
BRL	27	1,27	<b>Immobilienfonds — 3,43 % (28. Februar 2021: 3,70 %)</b>		
BRL	16	2,91	<b>Mexiko — 3,43 % (28. Februar 2021: 3,70 %)</b>		
BRL	31	3,64	MXN	74	3,43
	392	14,71	<b>Summe Immobilien-Investmentfonds (Anschaffungskosten 67 USD)</b>		
<b>China — 27,29 % (28. Februar 2021: 24,76 %)</b>			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 2.649 USD)</b>		
HKD	37	2,86		2.667	100,07
HKD	110	2,34	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
HKD	16	2,76		2.667	100,07
HKD	36	3,01	<b>Devisenterminkontrakte – (1,14 %) (28. Februar 2021: 0,15 %)</b>		
HKD	508	2,21	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
HKD	2	1,25		(30)	(1,14)
HKD	56	2,83	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
HKD	60	2,41		(30)	(1,14)
CNH	58	1,96	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
HKD	60	2,27		2.637	98,93
HKD	176	3,39	<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		
	727	27,29		28	1,07
<b>Indien — 19,68 % (28. Februar 2021: 26,53 %)</b>			<b>Gesamtnettovermögen</b>		
INR	12	3,68		\$2.665	100,00
INR	6	1,78	– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
INR	16	2,33	144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 134.000 USD oder 5,02 % des Nettovermögens.		
INR	20	3,44	<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
INR	10	1,13	BRL	–	Brasilianisch Real
INR	17	1,16	CNH	–	Chinesischer Renminbi
INR	59	6,16	HKD	–	Hongkong-Dollar
	525	19,68	IDR	–	Indonesische Rupiah
<b>Indonesien — 4,32 % (28. Februar 2021: 4,20 %)</b>			INR	–	Indische Rupie
IDR	487	4,32	MXN	–	Mexikanischer Peso
<b>Malaysia — 4,65 % (28. Februar 2021: 5,36 %)</b>			MYR	–	Malaysischer Ringgit
MYR	85	4,65	PHP	–	Philippin Peso
<b>Mexiko — 15,19 % (28. Februar 2021: 11,78 %)</b>			THB	–	Thai Baht
MXN	27	0,94	<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
MXN	42	2,81	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
MXN	9	2,50		97,02	
MXN	8	4,33	Sonstige Vermögenswerte		
MXN	2	1,78		2,98	
MXN	68	2,83	<b>Gesamtvermögen</b>		
	405	15,19		100,00	
<b>Nigeria — 1,13 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
	3	1,13			
<b>Philippinen — 7,06 % (28. Februar 2021: 5,91 %)</b>					
PHP	31	4,81			
PHP	793	2,25			
	188	7,06			
<b>Thailand — 1,04 % (28. Februar 2021: 2,53 %)</b>					
THB	14	1,04			
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 2.540 USD)</b>					
	2.534	95,07			

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Verkaufswährung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 54	\$ –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 1.390	(30)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 4 USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)				(30)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 4 USD)				\$ (30)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts			
<b>Stammaktien – 90,89 %</b>								
<b>Australien – 9,51 %</b>								
AUD	730	3,07	112	7.287	4,20			
AUD	1.455	3,99	–	23	0,01			
AUD	460	2,45	63	4.108	2,37			
			–	108	0,01			
			71	2.236	1,29			
			16	487	0,28			
	16.494	9,51		44.182	25,48			
<b>Brasilien – 3,30 %</b>								
BRL	921	1,22	<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 154.712 USD)</b>					
BRL	615	2,08		157.598	90,89			
		3,30	<b>Immobilien-Investmentfonds – 3,77 %</b>					
<b>Kanada – 13,00 %</b>								
CAD	33	1,34	<b>Mexiko – 0,97 %</b>					
CAD	70	1,89	MXN	1.371	0,97			
CAD	113	2,81	<b>Vereinigte Staaten – 2,80 %</b>					
CAD	201	2,27	29	4.825	2,79			
CAD	189	3,71	–	22	0,01			
CAD	32	0,98		4.847	2,80			
	22.541	13,00	<b>Summe Immobilien-Investmentfonds (Anschaffungskosten 7.443 USD)</b>					
<b>Frankreich – 4,86 %</b>								
EUR	42	0,26	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 162.155 USD)</b>					
EUR	293	2,76		164.133	94,66			
EUR	30	1,84	<b>Devisenterminkontrakte – 0,05 %</b>					
	8.422	4,86	<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>					
<b>Italien – 4,00 %</b>								
EUR	1.251	4,00		82	0,05			
<b>Mexiko – 3,57 %</b>								
MXN	277	2,34	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					
MXN	99	1,23		164.215	94,71			
	6.192	3,57	<b>Devisenterminkontrakte – (0,19 %)</b>					
<b>Portugal – 2,59 %</b>								
EUR	921	2,59	<b>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</b>					
<b>Spanien – 13,05 %</b>								
EUR	33	3,11		(332)	(0,19)			
EUR	179	2,18	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>					
EUR	114	1,79		(332)	(0,19)			
EUR	616	4,03	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>					
EUR	170	1,94		163.883	94,52			
	22.630	13,05	<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>					
<b>Vereinigtes Königreich – 11,53 %</b>								
GBP	567	4,94		9.511	5,48			
GBP	357	4,68	<b>Gesamtvermögen</b>					
GBP	231	1,91		\$173.394	100,00			
	19.993	11,53	<b>–</b>					
<b>Vereinigte Staaten – 25,48 %</b>								
119	4.459	2,57	Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
192	6.404	3,69	144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 5.385.000 USD oder 3,11 % des Nettovermögens.					
1	28	0,02	<b>ABKÜRZUNGEN:</b>					
–	10	0,01	AUD – Australischer Dollar					
72	3.330	1,92	BRL – Brasilianischer Real					
–	8	0,01	CAD – Kanadischer Dollar					
46	4.800	2,77	EUR – Euro					
125	5.242	3,02	GBP – Britische Pfund					
73	5.726	3,30	MXN – Mexikanischer Peso					
–	12	0,01						
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>								
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden								
Finanzderivate								
Sonstige Vermögenswerte								
<b>Gesamtvermögen</b>								

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Verkaufswährung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD 14	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 1	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 19	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 2	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 16	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD –	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 107	1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 4.180	(92)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH 1.966	3
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD 7.542	78
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD 37.367	(237)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 218	(3)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten				\$ 82
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten				(332)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten				\$ (250)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen — 4,57 % (28. Februar 2021: 7,12 %)</b>			68 Korn Ferry		
41.913 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)			177 TrueBlue Inc		
	41.913	4,57		4.502	0,49
<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 41.913 USD)</b>			31.006		
	41.913	4,57	<b>Computer — 0,62 % (28. Februar 2021: 0,62 %)</b>		
<b>Stammaktien — 95,20 % (28. Februar 2021: 86,40 %)</b>			505 Confallgnt Inc		
<b>Werbung — 0,09 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			211 SecureWorks Corp		
275 Marin Software Inc				2.462	0,27
	851	0,09		3.243	0,35
<b>Luft- und Raumfahrt und Verteidigung — 4,91 % (28. Februar 2021: 1,97 %)</b>			5.705		
159 AAR Corp			<b>Vertrieb und Großhandel — 3,50 % (28. Februar 2021: 1,14 %)</b>		
28 Aerojet Rocketdyne Holdings Inc			377 Hudson Technologies Inc		
405 Astronics Corp			190 KAR Auction Services Inc		
105 Barnes Group Inc			460 Manitex International Inc		
122 Ducommun Inc			201 Resideo Technologies Inc		
101 Hexcel Corp			210 Univar Solutions Inc		
115 Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'			125 VSE Corp		
326 Triumph Group Inc			50 WESCO International Inc		
	8.147	0,89		6.036	0,66
	44.954	4,91		32.094	3,50
<b>Fluggesellschaften — 1,43 % (28. Februar 2021: 2,33 %)</b>			<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 1,48 % (28. Februar 2021: 3,23 %)</b>		
66 Alaska Air Group Inc			139 Air Lease Corp 'A'		
8 Allegiant Travel Co			89 B Riley Financial Inc		
336 JetBlue Airways Corp			52 Moelis & Co 'A'		
648 Mesa Air Group Inc				5.795	0,63
	2.825	0,31		5.271	0,58
	13.109	1,43		2.509	0,27
<b>Bekleidung — 1,44 % (28. Februar 2021: 0,94 %)</b>			13.575		
418 Fossil Group Inc			<b>Elektrische Komponenten und Ausrüstung — 0,32 % (28. Februar 2021: 0,39 %)</b>		
80 Rocky Brands Inc			79 Insteel Industries Inc		
97 Skechers USA Inc				2.931	0,32
	4.479	0,49	<b>Elektronik — 5,13 % (28. Februar 2021: 4,06 %)</b>		
	13.224	1,44	77 Advanced Energy Industries Inc		
<b>Autohersteller — 0,64 % (28. Februar 2021: 0,55 %)</b>			419 Applied Optoelectronics Inc		
344 Wabash National Corp			125 Avnet Inc		
	5.856	0,64	118 Benchmark Electronics Inc		
<b>Autoteile und -ausrüstung — 3,05 % (28. Februar 2021: 2,93 %)</b>			236 Comtech Telecommunications Corp		
469 Commercial Vehicle Group Inc			299 GoPro Inc 'A'		
264 Dana Inc			99 Identiv Inc		
446 Garrett Motion Inc			257 IntriCon Corp		
115 Goodyear Tire & Rubber Co/The			273 Knowles Corp		
67 Meritor Inc			275 Stoneridge Inc		
525 Modine Manufacturing Co			230 Vishay Intertechnology Inc		
131 Shyft Group Inc/The				4.423	0,48
834 Westport Fuel Systems Inc				47.039	5,13
	1.330	0,14	<b>Ingenieurwesen und Bauwesen — 2,83 % (28. Februar 2021: 2,60 %)</b>		
	27.968	3,05	112 Arcosa Inc		
<b>Banken — 2,27 % (28. Februar 2021: 2,45 %)</b>			32 Comfort Systems USA Inc		
126 BayCom Corp			447 Concrete Pumping Holdings Inc		
152 First Foundation Inc			139 Construction Partners Inc 'A'		
171 Hilltop Holdings Inc			347 Limbach Holdings Inc		
147 Seacoast Banking Corp of Florida			290 Mistras Group Inc		
23 Walker & Dunlop Inc			346 Orion Group Holdings Inc †		
	3.200	0,35	168 Primoris Services Corp		
	20.744	2,27		4.420	0,48
<b>Biotechnologie — 0,27 % (28. Februar 2021: 0,42 %)</b>			25.920		
59 Emergent BioSolutions Inc			<b>Umweltkontrolle — 0,48 % (28. Februar 2021: 0,54 %)</b>		
	2.449	0,27	158 Heritage-Crystal Clean Inc		
<b>Baumaterialien — 2,09 % (28. Februar 2021: 3,78 %)</b>			<b>Lebensmittel — 0,80 % (28. Februar 2021: 0,90 %)</b>		
94 Apogee Enterprises Inc			88 Calavo Growers Inc		
35 Gibraltar Industries Inc			82 Healthcare Services Group Inc		
205 Griffon Corp			152 Krispy Kreme Inc		
192 JELD-WEN Holding Inc				3.762	0,41
286 LSI Industries Inc				1.293	0,14
99 PGT Innovations Inc				2.261	0,25
	2.135	0,23		7.316	0,80
	19.183	2,09	<b>Forstprodukte und Papier — 0,43 % (28. Februar 2021: 0,21 %)</b>		
<b>Chemikalien — 2,35 % (28. Februar 2021: 4,15 %)</b>			287 Glatfelter Corp		
93 AdvanSix Inc			20 Hurco Cos Inc		
127 American Vanguard Corp			282 Luxfer Holdings Plc		
155 Huntsman Corp				681	0,07
47 Intrepid Potash Inc				4.915	0,54
113 Tronox Holdings Plc				5.596	0,61
248 Unifi Inc					
	4.660	0,51	<b>Gesundheitsprodukte — 1,26 % (28. Februar 2021: 3,35 %)</b>		
	21.510	2,35	706 Accury Inc		
<b>Kommerzielle Dienstleistungen — 3,39 % (28. Februar 2021: 3,13 %)</b>			296 Bioventus Inc		
42 Adtalem Global Education Inc			57 Orthofix Medical Inc		
260 American Public Education Inc			139 Varex Imaging Corp		
225 Arlo Technologies Inc				2.454	0,27
236 Cross Country Healthcare Inc				3.855	0,42
102 Evercel Inc				1.940	0,21
88 Heidrick & Struggles International Inc				3.284	0,36
27 Herc Holdings Inc				11.533	1,26
	4.340	0,47	<b>Gesundheitsdienstleistungen — 0,97 % (28. Februar 2021: 2,81 %)</b>		
408 ATI Physical Therapy Inc			802		
243 Community Health Systems Inc			408		
200 Innovage Holding Corp			2.556		
75 RadNet Inc			983		
114 Select Medical Holdings Corp			1.858		
			2.644		
			8.843		
			0,97		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Bauherren — 2,73 % (28. Februar 2021: 3,20 %)</b>			<b>Sonstige Fertigung — 3,11 % (28. Februar 2021: 2,29 %)</b>		
162 Beazer Homes USA Inc	2.652	0,29	57 EnPro Industries Inc	6.336	0,69
6 Cavco Industries Inc	1.674	0,18	50 Fabrinet	4.987	0,54
46 Century Communities Inc	2.944	0,32	171 Haynes International Inc	6.280	0,69
591 Horizon Global Corp	3.130	0,34	323 LSB Industries Inc	5.587	0,61
19 LGI Homes Inc	2.377	0,26	185 Trinity Industries Inc	5.335	0,58
54 Skyline Champion Corp	3.631	0,40		28.525	3,11
93 Taylor Morrison Home Corp 'A'	2.735	0,30	<b>Büro- und Geschäftsausstattung – 0,42 % (28. Februar 2021: 0,52 %)</b>		
56 Toll Brothers Inc	3.044	0,33	780 Pitney Bowes Inc	3.882	0,42
127 Tri Pointe Homes Inc	2.834	0,31	<b>Büroausstattung — 0,84 % (28. Februar 2021: 0,48 %)</b>		
	25.021	2,73	276 Interface Inc 'A'	3.590	0,39
<b>Wohnausstattung — 0,99 % (28. Februar 2021: 0,40 %)</b>			335 Steelcase Inc	4.079	0,45
143 MillerKnoll Inc	5.552	0,61		7.669	0,84
387 VIA Optronics AG ADR	3.511	0,38	<b>Öl und Gas — 2,84 % (28. Februar 2021: 1,13 %)</b>		
	9.063	0,99	CAD		
<b>Haushaltsprodukte und -ware – 0,77 % (28. Februar 2021: 0,27 %)</b>			638 Baytex Energy Corp	2.913	0,32
47 Central Garden & Pet Co 'A'	2.055	0,22	60 Chesapeake Energy Corp	4.641	0,51
54 Spectrum Brands Holdings Inc	5.017	0,55	423 Earthstone Energy Inc 'A'	5.493	0,60
	7.072	0,77	455 Mammoth Energy Services Inc	680	0,07
<b>Versicherungen — 1,24 % (28. Februar 2021: 3,41 %)</b>			103 Matador Resources Co	5.100	0,56
98 Brighthouse Financial Inc	5.119	0,56	102 Northern Oil and Gas Inc	2.545	0,28
175 Old Republic International Corp	4.614	0,51	334 Southwestern Energy Co	1.666	0,18
23 Stewart Information Services Corp	1.582	0,17	332 Treco Resources	2.964	0,32
	11.315	1,24		26.002	2,84
<b>Internet — 1,82 % (28. Februar 2021: 0,98 %)</b>			<b>Öl- und Gasdienstleistungen — 0,99 % (28. Februar 2021: 0,40 %)</b>		
152 Cars.com Inc	2.463	0,27	256 Archrock Inc	2.138	0,23
1.007 comScore Inc	2.642	0,29	97 DMC Global Inc	2.837	0,31
344 DHI Group Inc	1.949	0,21	408 Matrix Service Co	2.830	0,31
102 Overstock.com Inc	5.793	0,63	132 Ranger Energy Services Inc	1.265	0,14
336 QuinStreet Inc	3.787	0,42		9.070	0,99
	16.634	1,82	<b>Verpackungen und Behälter – 0,50 % (28. Februar 2021: 0,26 %)</b>		
<b>Eisen/Stahl — 2,81 % (28. Februar 2021: 1,71 %)</b>			140 TriMas Corp	4.574	0,50
313 Allegheny Technologies Inc	8.048	0,88	<b>Arzneimittel — 1,65 % (28. Februar 2021: 1,78 %)</b>		
158 Carpenter Technology Corp	6.080	0,66	56 Covetrus Inc	984	0,10
245 Cleveland-Cliffs Inc	5.473	0,60	135 Option Care Health Inc	3.464	0,38
159 Commercial Metals Co	6.133	0,67	155 Organon & Co	5.776	0,63
	25.734	2,81	112 Owens & Minor Inc	4.930	0,54
<b>Unterkunft — 0,61 % (28. Februar 2021: 0,08 %)</b>				15.154	1,65
138 Century Casinos Inc	1.702	0,19	<b>Immobilien — 0,43 % (28. Februar 2021: 0,28 %)</b>		
214 Marcus Corp/The	3.886	0,42	217 Realogy Holdings Corp	3.938	0,43
	5.588	0,61	<b>Einzelhandel — 8,23 % (28. Februar 2021: 4,65 %)</b>		
<b>Maschinen – Bauwesen und Bergbau – 0,65 % (28. Februar 2021: 0,55 %)</b>			28 Asbury Automotive Group Inc	5.474	0,60
642 Babcock & Wilcox Enterprises Inc	4.509	0,49	448 Barnes & Noble Education Inc	2.453	0,27
38 Hyster-Yale Materials Handling Inc	1.459	0,16	92 Bed Bath & Beyond Inc	1.557	0,17
	5.968	0,65	74 BlueLinx Holdings Inc	6.641	0,72
<b>Maschinen – diversifiziert – 1,67 % (28. Februar 2021: 0,92 %)</b>			148 Caleres Inc	3.081	0,34
166 CIRCOR International Inc	4.467	0,49	401 Carrols Restaurant Group Inc	1.062	0,12
133 Ichor Holdings Ltd	4.674	0,51	570 Chico's FAS Inc	2.684	0,29
329 Intevac Inc	1.698	0,18	241 Conn's Inc	4.430	0,48
697 NN Inc	1.806	0,20	314 Designer Brands Inc	4.092	0,45
193 Power Solutions International Inc	578	0,06	12 Dillard's Inc	3.012	0,33
174 Twin Disc Inc	2.081	0,23	494 Express Inc	2.354	0,26
	15.304	1,67	150 Guess? Inc	3.278	0,36
<b>Medien — 1,23 % (28. Februar 2021: 0,12 %)</b>			310 iMedia Brands Inc	2.106	0,23
536 Entravision Communications Corp	3.428	0,37	175 J Jill Inc	2.789	0,30
155 Houghton Mifflin Harcourt Co	3.241	0,35	317 JOANN Inc	3.596	0,39
152 Thryv Holdings Inc	4.628	0,51	192 Kirkland's Inc	2.661	0,29
	11.297	1,23	258 LL Flooring Holdings Inc	4.150	0,45
<b>Metallfabrikation und Hardware — 1,84 % (28. Februar 2021: 0,69 %)</b>			255 Noodles & Co 'A'	1.748	0,19
211 Northwest Pipe Co	6.021	0,66	134 Nordstrom Inc	2.785	0,30
95 Olympic Steel Inc	2.539	0,28	446 Regis Corp	809	0,09
126 Park-Ohio Holdings Corp	1.990	0,22	138 Ruth's Hospitality Group Inc	3.431	0,37
347 TimkenSteel Corp	6.256	0,68	59 Sonic Automotive Inc 'A'	3.164	0,35
	16.806	1,84	117 Sportsman's Warehouse Holdings Inc	1.331	0,15
<b>Bergbau — 2,28 % (28. Februar 2021: 1,81 %)</b>			355 Vera Bradley Inc	2.687	0,29
272 Century Aluminum Co	6.435	0,70	76 Victoria's Secret & Co	4.059	0,44
510 Coeur Mining Inc	2.188	0,24		75.434	8,23
708 Ferroglobe Plc	5.547	0,61	<b>Spar- und Darlehenszahlungen – 0,52 % (28. Februar 2021: 0,17 %)</b>		
129 Livent Corp	3.038	0,33	87 Axos Financial Inc	4.787	0,52
CAD	3.642	0,40	<b>Halbleiter — 5,12 % (28. Februar 2021: 5,31 %)</b>		
	20.850	2,28	62 Alpha & Omega Semiconductor Ltd	3.336	0,36
			231 Amkor Technology Inc	5.230	0,57
			338 Armetech Systems Inc	3.533	0,39
			174 CoHu Inc	5.417	0,59
			140 CTS Corp	5.306	0,58

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
112 FormFactor Inc	4.546	0,50	<b>Immobilienfonds — 2,12 % (28. Februar 2021: 3,37 %)</b>		
83 Kulicke & Soffa Industries Inc	4.318	0,47	<b>REITS — 2,12 % (28. Februar 2021: 3,37 %)</b>		
35 Onto Innovation Inc	3.059	0,33	182 Alexander & Baldwin Inc	4.072	0,44
120 Ultra Clean Holdings Inc	5.486	0,60	275 Braemar Hotels & Resorts Inc	1.645	0,18
234 Veeco Instruments Inc	6.691	0,73	140 Chatham Lodging Trust	1.919	0,21
	46.922	5,12	331 Macerich Co/The	5.055	0,55
			24 Ryman Hospitality Properties Inc	2.157	0,24
			274 Tanger Factory Outlet Centers Inc	4.561	0,50
				19.409	2,12
<b>Software – 2,90 % (28. Februar 2021: 3,77 %)</b>			<b>Gesamtsumme Immobilien-Investmentfonds</b>		
303 Avaya Holdings Corp	4.169	0,46	<b>(Anschaffungskosten 17.076 USD)</b>		
154 Avid Technology Inc	4.854	0,53		19.409	2,12
311 Digi International Inc	6.240	0,68	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten</b>		
106 Ebix Inc	3.143	0,34	<b>Anlagen (Kosten 889.923 USD)</b>		
383 Immersion Corp	2.037	0,22		933.530	101,89
384 Kaleyra Inc	2.968	0,32	<b>Devisenterminkontrakte – 0,16 % (28. Februar 2021: 0,04 %)</b>		
147 ON24 Inc	2.277	0,25	<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>		
781 Zovio Inc 'A'	875	0,10		1.468	0,16
	26.563	2,90	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten</b>		
			<b>finanziellen Vermögenswerte</b>		
				934.998	102,05
<b>Telekommunikation — 5,02 % (28. Februar 2021: 3,94 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – (0,20 %) (28. Februar 2021: (0,05 %))</b>		
305 A10 Networks Inc	4.348	0,47	<b>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</b>		
284 ADTRAN Inc	5.837	0,64		(1.791)	(0,20)
162 Aviat Networks Inc	4.590	0,50	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete</b>		
578 CalAmp Corp	4.086	0,45	<b>finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
127 Cambium Networks Corp	3.539	0,39		(1.791)	(0,20)
441 Ceragon Networks Ltd	983	0,11	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten</b>		
370 DZS Inc	5.359	0,58	<b>finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
167 Frequency Electronics Inc	1.550	0,17		933.207	101,85
370 Infinera Corp	3.410	0,37	<b>Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten</b>		
36 InterDigital Inc	2.315	0,25		(16.998)	(1,85)
164 Ooma Inc	2.739	0,30	<b>Gesamtvermögen</b>		
521 PCTEL Inc	2.549	0,28		\$916.209	100,00
248 Sierra Wireless Inc	4.681	0,51			
	45.986	5,02			
			– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
<b>Textilien — 0,13 % (28. Februar 2021: 0,08 %)</b>			† Illiquide.		
297 Dixie Group Inc/The	1.221	0,13	<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
			ADR – Amerikanische Hinterlegungsstelle.		
<b>Transport — 3,50 % (28. Februar 2021: 2,37 %)</b>					
591 Ardmore Shipping Corp	2.596	0,28			
53 Atlas Air Worldwide Holdings Inc	4.147	0,45			
284 Daseke Inc	3.562	0,39			
343 Diana Shipping Inc	1.710	0,19			
320 Dorian LPG Ltd	4.407	0,48			
59 Hub Group Inc 'A'	4.998	0,54			
322 Navigator Holdings Ltd	3.360	0,37			
339 Radiant Logistics Inc	2.344	0,26			
207 Scorpio Tankers Inc	3.592	0,39			
297 US Xpress Enterprises Inc	1.342	0,15			
	32.058	3,50			
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 830.934 USD)</b>	872.208	95,20			

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Währung	Quantität	Verkaufswährung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)			
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	AUD	3	\$	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	470	Verkauf	EUR	419	–	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	17	Verkauf	GBP	13	–	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	SGD	6	–	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	630	Verkauf	USD	706	–	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	13	Verkauf	USD	16	–	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	150	Verkauf	USD	203	–	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	7	Verkauf	USD	5	–	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	251	Verkauf	USD	185	–	–
02/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	223	Verkauf	USD	160	–	2
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.861	Verkauf	BRL	10.113	–	(101)
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	17.857	Verkauf	BRL	91.293	–	152
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	97.761	Verkauf	USD	17.903	–	1.057
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	2.000	Verkauf	USD	400	–	(13)
03/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	BRL	3.646	Verkauf	USD	686	–	21
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	626	Verkauf	AUD	873	–	(7)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	82	Verkauf	CNH	518	–	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	76	Verkauf	CNH	481	–	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	14.272	Verkauf	EUR	12.653	–	75
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	142	Verkauf	EUR	127	–	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	35	Verkauf	GBP	26	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Zeitplan für Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)		
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	174	Verkauf	PLN	710	5
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	16	Verkauf	SEK	152	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.185	Verkauf	SGD	1.602	4
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.050	Verkauf	USD	2.288	10
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	45.732	Verkauf	USD	52.292	(980)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	680	Verkauf	USD	108	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	21.885	Verkauf	USD	5.517	(310)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	35	Verkauf	USD	47	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	15.536	Verkauf	USD	2.436	20
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	991	Verkauf	USD	235	1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	943	Verkauf	USD	103	(4)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	36	Verkauf	USD	4	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.580	Verkauf	USD	1.162	3
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	35.439	Verkauf	USD	26.367	(228)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	786	Verkauf	USD	1.065	(11)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	10.631	Verkauf	USD	7.611	113
04/04/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	774	Verkauf	BRL	4.000	5
04/04/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	87.069	Verkauf	USD	16.872	(137)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 503 USD)							\$	1,468
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (611) USD)								(1.791)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (108) USD)							\$	(323)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen — 3,45 % (28. Februar 2021: 3,34 %)</b>			<b>Maschinen – diversifiziert – 3,41 % (28. Februar 2021: 4,18 %)</b>		
10 iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	1.556	1,77	31 Colfax Corp	1.243	1,41
1.480 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	1.480	1,68	9 Kadant Inc	1.753	2,00
<b>Gesamte kollektive Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 3.068 USD)</b>	<b>3.036</b>	<b>3,45</b>		<b>2.996</b>	<b>3,41</b>
<b>Stammaktien — 97,15 % (28. Februar 2021: 95,57 %)</b>			<b>Metallfabriken und Hardware – 0,53 % (28. Februar 2021: 1,06 %)</b>		
<b>Bekleidung — 1,62 % (28. Februar 2021: 2,22 %)</b>			<b>Sonstige Fertigung — 4,62 % (28. Februar 2021: 5,33 %)</b>		
62 Wolverine World Wide Inc	1.421	1,62	16 Northwest Pipe Co	466	0,53
<b>Autoteile und -ausrüstung – 4,77 % (28. Februar 2021: 5,32 %)</b>			<b>Öl- und Gasdienstleistungen — 1,92 % (28. Februar 2021: 2,88 %)</b>		
36 Gentex Corp	1.095	1,25	CAD 166 Pason Systems Inc	1.692	1,92
35 Meritor Inc	1.261	1,43	<b>Verpackungen und Behälter — 0,56 % (28. Februar 2021: 0,55 %)</b>		
59 Miller Industries Inc/TN	1.835	2,09	7 UFP Technologies Inc	492	0,56
	4.191	4,77	<b>Arzneimittel — 3,26 % (28. Februar 2021: 0,48 %)</b>		
<b>Baumaterialien — 4,76 % (28. Februar 2021: 4,64 %)</b>			<b>Immobilien — 3,72 % (28. Februar 2021: 3,23 %)</b>		
21 Gibraltar Industries Inc	1.032	1,17	112 Kennedy-Wilson Holdings Inc	2.478	2,82
15 Louisiana-Pacific Corp	1.065	1,21	16 Marcus & Millichap Inc	793	0,90
23 Patrick Industries Inc	1.667	1,90		<b>3.271</b>	<b>3,72</b>
CAD 13 Stella-Jones Inc	418	0,48	<b>Einzelhandel — 1,67 % (28. Februar 2021: 0,78 %)</b>		
	4.182	4,76	37 Movado Group Inc	1.470	1,67
<b>Chemikalien — 3,30 % (28. Februar 2021: 1,89 %)</b>			<b>Halbleiter — 10,20 % (28. Februar 2021: 10,27 %)</b>		
24 Innospec Inc	2.291	2,61	4 CMC Materials Inc	779	0,88
3 Quaker Chemical Corp	608	0,69	72 CoHu Inc	2.232	2,54
	2.899	3,30	42 Kulicke & Soffa Industries Inc	2.212	2,52
<b>Kommerzielle Dienstleistungen — 9,47 % (28. Februar 2021: 9,16 %)</b>			<b>Software – 6,42 % (28. Februar 2021: 3,68 %)</b>		
120 Computer Task Group Inc	1.109	1,26	32 Avid Technology Inc	994	1,13
34 Forrester Research Inc	1.761	2,00	9 Consensus Cloud Solutions Inc	487	0,55
40 Heidrick & Struggles International Inc	1.728	1,97	46 Simulations Plus Inc	1.800	2,05
34 Korn Ferry	2.236	2,54	24 Ziff Davis Inc	2.369	2,69
32 Vectrus Inc	1.493	1,70		<b>5.650</b>	<b>6,42</b>
	8.327	9,47	<b>Transport — 2,01 % (28. Februar 2021: 2,72 %)</b>		
<b>Computer — 1,00 % (28. Februar 2021: 3,34 %)</b>			<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 79.557 USD)</b>		
8 Insight Enterprises Inc	877	1,00	11 Landstar System Inc	1.772	2,01
<b>Kosmetik und Körperpflege — 2,01 % (28. Februar 2021: 2,25 %)</b>			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 82.625 USD)</b>		
19 Inter Parfums Inc	1.772	2,01		<b>88.460</b>	<b>100,60</b>
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 5,50 % (28. Februar 2021: 6,81 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
44 Air Lease Corp 'A'	1.853	2,11	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
29 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	1.108	1,26		1	–
9 Houlihan Lokey Inc 'A'	876	1,00	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
29 Lazard Ltd 'A'	998	1,13		<b>88.461</b>	<b>100,60</b>
	4.835	5,50	<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
<b>Elektrische Komponenten und Ausrüstung — 0,63 % (28. Februar 2021: 0,83 %)</b>			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
34 nLight Inc	557	0,63		(5)	–
<b>Elektronik — 5,29 % (28. Februar 2021: 6,45 %)</b>			<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
25 FARO Technologies Inc	1.347	1,53		(5)	–
73 Kimball Electronics Inc	1.264	1,44	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
51 Vishay Intertechnology Inc	975	1,11		<b>88.456</b>	<b>100,60</b>
34 Vishay Precision Group Inc	1.065	1,21	<b>Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten</b>		
	4.651	5,29		<b>(521)</b>	<b>(0,60)</b>
<b>Ingenieurwesen und Bauwesen – 3,64 % (28. Februar 2021: 2,61 %)</b>			<b>Gesamtvermögen</b>		
43 Arcosa Inc	2.252	2,56		<b>\$87.935</b>	<b>100,00</b>
67 Great Lakes Dredge & Dock Corp	945	1,08	– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
	3.197	3,64	<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
<b>Gesundheitsprodukte — 4,64 % (28. Februar 2021: 3,73 %)</b>			ETF – Exchange Traded Fund.		
2 Bio-Techne Corp	998	1,13	CAD – Kanadischer Dollar		
85 Meridian Bioscience Inc	2.145	2,44	<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		
34 Natus Medical Inc	939	1,07	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
	4.082	4,64	Organismen für gemeinsame Anlagen		
<b>Bauherren — 1,60 % (28. Februar 2021: 2,30 %)</b>			Finanzderivate		
6 LCI Industries	691	0,79	Sonstige Vermögenswerte		
11 Skyline Champion Corp	713	0,81	<b>Gesamtvermögen</b>		
	1.404	1,60	<b>100,00</b>		
<b>Versicherungen — 4,13 % (28. Februar 2021: 2,44 %)</b>					
18 RLI Corp	1.857	2,11			
2 White Mountains Insurance Group Ltd	1.772	2,02			
	3.629	4,13			
<b>Internet — 1,67 % (28. Februar 2021: 1,00 %)</b>					
82 ChannelAdvisor Corp	1.471	1,67			
<b>Freizeit — 2,40 % (28. Februar 2021: 2,74 %)</b>					
74 MasterCraft Boat Holdings Inc	2.114	2,40			
<b>Unterkunft — 2,40 % (28. Februar 2021: 1,39 %)</b>					
171 Century Casinos Inc	2.108	2,40			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)	
		Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	–	\$	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	–	\$	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	55	Verkauf	EUR	48		1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	7	Verkauf	SEK	63		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	–	Verkauf	USD	–		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	71	Verkauf	USD	8		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	5	Verkauf	USD	6		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	199	Verkauf	USD	227		(5)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 3 USD)								\$	1
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (3) USD)									(5)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)								\$	(4)

Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,09 %</b>					
140 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)		140		3,09	
<b>Gesamte kollektive Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 140 USD)</b>					
		140		3,09	
<b>Stammaktien — 97,25 %</b>					
<b>Australien – 6,94 %</b>					
AUD	59 Bravura Solutions Ltd	72		1,58	
AUD	27 Hansen Technologies Ltd	95		2,10	
AUD	16 IPH Ltd	96		2,11	
AUD	7 Technology One Ltd	52		1,15	
		315		6,94	
<b>Brasilien – 1,10 %</b>					
BRL	22 Odontoprev SA	50		1,10	
<b>Kanada – 1,45 %</b>					
CAD	1 Altus Group Ltd/Canada	33		0,73	
	1 Ritchie Bros Auctioneers Inc	33		0,72	
		66		1,45	
<b>Deutschland — 1,77 %</b>					
EUR –	New Work SE	80		1,77	
<b>Italien — 4,05 %</b>					
EUR	2 Carel Industries SpA, 144A	57		1,26	
EUR –	DiaSorin SpA	51		1,11	
EUR	8 GVS SpA, 144A	76		1,68	
		184		4,05	
<b>Japan — 11,32 %</b>					
JPY	1 As One Corp	48		1,07	
JPY	2 BML Inc	70		1,53	
JPY	2 Comture Corp	49		1,08	
JPY	2 Fukui Computer Holdings Inc	58		1,27	
JPY	1 Meitec Corp	77		1,69	
JPY	2 OBIC Business Consultants Co Ltd	70		1,54	
JPY	4 TKC Corp	95		2,11	
JPY	3 USS Co Ltd	46		1,03	
		513		11,32	
<b>Niederlande – 2,75 %</b>					
EUR	— IMCD NV	55		1,22	
EUR	12 Marel hf, 144A	70		1,53	
		125		2,75	
<b>Polen – 1,37 %</b>					
PLN	4 Asseco Poland SA	62		1,37	
<b>Singapur – 2,74 %</b>					
	2 Kulicke & Soffa Industries Inc	79		1,75	
GBP	1 XP Power Ltd	45		0,99	
		124		2,74	
<b>Schweden — 2,99 %</b>					
SEK	6 Alimak Group AB, 144A	72		1,58	
SEK	11 Karnov Group AB	64		1,41	
		136		2,99	
<b>Schweiz — 1,96 %</b>					
CHF –	Kardex Holding AG	44		0,97	
CHF	1 VZ Holding AG	45		0,99	
		89		1,96	
<b>Vereinigtes Königreich – 10,02 %</b>					
GBP –	Croda International Plc	44		0,96	
GBP	1 Diploma Plc	52		1,15	
GBP	5 DiscoverIE Group Plc	52		1,15	
GBP	28 Learning Technologies Group Plc	66		1,46	
GBP	4 Marlowe Plc	45		1,00	
GBP	14 Restore Plc	85		1,86	
GBP –	Spirax-Sarco Engineering Plc	57		1,27	
GBP	2 Victrex Plc	53		1,17	
		454		10,02	
<b>Vereinigte Staaten — 48,79 %</b>					
	1 Arcosa Inc	65		1,43	
	2 Avid Technology Inc	60		1,33	
	1 Brunswick Corp/DE	84		1,86	
	– CMC Materials Inc	27		0,61	
	1 Cognex Corp	44		0,97	
	– Colliers International Group Inc	61		1,34	
	1 Dolby Laboratories Inc 'A'	41		0,90	
	1 Dorman Products Inc	61		1,35	
	1 ESCO Technologies Inc	45		0,98	
	– FirstService Corporation	47		1,04	
	2 FormFactor Inc	71		1,56	
	1 Forrester Research Inc	77		1,69	
	1 Forward Air Corp	81		1,79	
	2 Gentex Corp	59		1,31	
	1 Haemonetics Corp	60		1,32	
	– Houlihan Lokey Inc 'A'	35		0,77	
	1 Innospec Inc	97		2,15	
	– Inter Parfums Inc	46		1,01	
	1 John Bean Technologies Corp	63		1,40	
	– Kadant Inc	69		1,52	
	4 Kennedy-Wilson Holdings Inc	99		2,19	
	1 Landstar System Inc	80		1,77	
	– LCI Industries	45		0,99	
	1 Lincoln Electric Holdings Inc	71		1,57	
	– Littelfuse Inc	31		0,68	
	1 LKQ Corp	42		0,92	
	1 Marcus & Millichap Inc	43		0,95	
	1 Meridian Bioscience Inc	35		0,77	
	1 MKS Instruments Inc	87		1,92	
	– Morningstar Inc	59		1,29	
	– Quaker Chemical Corp	69		1,52	
	1 Ralph Lauren Corp 'A'	93		2,05	
	1 SEI Investments Co	73		1,62	
	1 UFP Industries Inc	71		1,57	
	– Valmont Industries Inc	53		1,16	
	1 Ziff Davis Inc	68		1,49	
		2.212		48,79	
		4.410		97,25	
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 4.893 USD)</b>					
		4.410		97,25	
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					
		4.550		100,34	
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten</b>					
		4.550		100,34	
<b>Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten</b>					
		(16)		(0,34)	
<b>Gesamtes Nettovermögen in USD</b>					
		4.534		100,00	
– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 275.000 USD oder 6,05 % des Nettovermögens.					
<b>ABKÜRZUNGEN:</b>					
AUD	– Australischer Dollar				
BRL	– Brasilianisch Real				
CAD	– Kanadischer Dollar				
CHF	– Schweizer Franken				
EUR	– Euro				
GBP	– Britische Pfund				
JPY	– Japanischer Yen				
PLN	– Polnischer Zloty				
SEK	– Schwedische Krona				
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden				96,63	
Finanzderivate				3,07	
Sonstige Vermögenswerte				0,30	
<b>Gesamtvermögen</b>				<b>100,00</b>	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Franklin MV European Equity Growth and Income Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Nettoinventarwerts	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Nettoinventarwerts
<b>Stammaktien — 97,09 % (28. Februar 2021: 98,10 %)</b>					
<b>Australien — 2,12 % (28. Februar 2021: 2,84 %)</b>					
GBP	9 Rio Tinto Plc	602	2,12		
<b>Belgien — 2,90 % (28. Februar 2021: 1,82 %)</b>					
	7 Ageas SA/NV	300	1,06		
	6 Etablissements Franz Colruyt NV	224	0,79		
	10 Telenet Group Holding NV	298	1,05		
		822	2,90		
<b>Brasilien — 1,22 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
NOK	8 Yara International ASA	345	1,22		
<b>Dänemark — 4,87 % (28. Februar 2021: 6,08 %)</b>					
DKK	2 Coloplast A/S	318	1,12		
DKK	9 Novo Nordisk A/S	837	2,96		
DKK	3 SimCorp A/S	224	0,79		
		1.379	4,87		
<b>Finnland — 4,90 % (28. Februar 2021: 4,52 %)</b>					
	11 Kesko Oyj	287	1,01		
	5 Kone Oyj 'B'	286	1,01		
SEK	28 Nordea Bank Abp	271	0,96		
	7 Orion Oyj	294	1,04		
	8 Valmet Oyj	250	0,88		
		1.388	4,90		
<b>Frankreich — 10,57 % (28. Februar 2021: 9,51 %)</b>					
	23 Carrefour SA	411	1,45		
	5a Cie de Saint-Gobain	265	0,94		
	26 Eutelsat Communications SA	253	0,89		
	38 Orange SA	413	1,46		
	5 Publicis Groupe SA	290	1,02		
	8 Sanofi	699	2,47		
	3 SEB SA	337	1,19		
	3 Vinci SA	326	1,15		
		2.994	10,57		
<b>Deutschland — 8,40 % (28. Februar 2021: 11,28 %)</b>					
	3 Allianz SE	549	1,94		
	9 Deutsche Post AG	413	1,46		
	1 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	303	1,07		
	6 SAP SE	612	2,16		
	10 TAG Immobilien AG	230	0,81		
	112 Telefonica Deutschland Holding AG	272	0,96		
		2.379	8,40		
<b>Jordanien — 0,99 % (28. Februar 2021: 1,01 %)</b>					
GBP	11 Hikma Pharmaceuticals Plc	281	0,99		
<b>Niederlande — 6,33 % (28. Februar 2021: 3,56 %)</b>					
	1 ASML Holding NV	298	1,05		
	16 Koninklijke Ahold Delhaize NV	447	1,58		
	104 Koninklijke KPN NV	316	1,12		
	8 NN Group NV	330	1,16		
	4 Wolters Kluwer NV	404	1,42		
		1.795	6,33		
<b>Norwegen — 1,16 % (28. Februar 2021: 1,33 %)</b>					
NOK	25 Telenor ASA	329	1,16		
<b>Portugal — 0,83 % (28. Februar 2021: 1,08 %)</b>					
	24 Galp Energia SGPS SA	235	0,83		
<b>Russland — 0,45 % (28. Februar 2021: 1,89 %)</b>					
GBP	54 Evraz Plc	93	0,33		
RUB	23 Rospadskaya OJSC	34	0,12		
		127	0,45		
<b>Spanien — 4,52 % (28. Februar 2021: 4,84 %)</b>					
	20 Enagas SA	378	1,33		
	12 Endesa SA	229	0,81		
	23 Red Electrica Corp SA	397	1,40		
	65 Telefonica SA	278	0,98		
		1.282	4,52		
<b>Schweden — 4,71 % (28. Februar 2021: 4,31 %)</b>					
SEK	13 Electrolux AB	208	0,73		
SEK	25 Securitas AB	272	0,96		
SEK	37 Skandinaviska Enskilda Banken AB	382	1,35		
SEK	27 Swedish Match AB	173	0,61		
SEK	37 Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	300	1,06		
		1.335	4,71		
<b>Schweiz — 17,09 % (28. Februar 2021: 20,27 %)</b>					
CHF	5 Banque Cantonale Vaudoise	352	1,24		
CHF	6 Galenica AG, 144A	350	1,24		
CHF	1 Kuehne + Nagel International AG	316	1,11		
CHF	4 Logitech International SA	274	0,97		
CHF	8 Nestle SA	912	3,22		
CHF	11 Novartis AG	854	3,01		
CHF	3 PSP Swiss Property AG	318	1,12		
CHF	3 Roche Holding AG	1.067	3,77		
CHF	SGS SA	401	1,41		
		4.844	17,09		
<b>Großbritannien — 24,43 % (28. Februar 2021: 20,05 %)</b>					
GBP	10 Admiral Group Plc	362	1,28		
GBP	54 BAE Systems Plc	462	1,63		
GBP	19 BHP Group Ltd	579	2,04		
GBP	77 BP Plc	334	1,18		
GBP	10 British American Tobacco Plc	410	1,44		
GBP	13 Bunzl Plc	444	1,57		
GBP	4 DCC Plc	280	0,99		
GBP	115 Direct Line Insurance Group Plc	408	1,44		
GBP	31 GlaxoSmithKline Plc	582	2,05		
GBP	20 Hargreaves Lansdown Plc	270	0,95		
GBP	37 IG Group Holdings Plc	348	1,23		
GBP	16 Imperial Brands Plc	317	1,12		
GBP	98 J Sainsbury Plc	322	1,14		
GBP	95 Kingfisher Plc	345	1,22		
GBP	10 Persimmon Plc	273	0,96		
GBP	38 Sage Group Plc/The	320	1,13		
GBP	10 Unilever Plc	451	1,59		
GBP	265 Vodafone Group Plc	415	1,47		
		6.922	24,43		
<b>USA — 1,60 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
CHF	5 Swiss Re AG	453	1,60		
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 27.363 €)</b>					
		27.512	97,09		
<b>Vorzugsaktien — 1,14 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
<b>Deutschland — 1,14 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>					
	2 Volkswagen AG	322	1,14		
<b>Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 402 €)</b>					
		322	1,14		
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 27.765 €)</b>					
		27.834	98,23		
<b>Devisenterminkontrakte – 0,57 % (28. Februar 2021: 0,02 %)</b>					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	162	0,57		
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					
		27.996	98,80		
<b>Devisenterminkontrakte – (0,08 %) (28. Februar 2021: (0,04 %))</b>					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(23)	(0,08)		
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>					
		(23)	(0,08)		
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>					
		27.973	98,72		
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>					
		364	1,28		
<b>Gesamtnettovermögen</b>					
		€ 28.337	100,00		
– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A	Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 350.000 EUR bzw. 1,24 % des Nettovermögens.				
∞	Sicherheit wird nach Treu und Glauben vom Bewertungsausschuss oder nach dessen Ermessen zum beizulegenden Zeitwert bewertet.				
<b>ABKÜRZUNGEN:</b>					
CHF	– Schweizer Franken				
DKK	– Dänische Krone				
GBP	– Britische Pfund				
NOK	– Norwegische Krone				
RUB	– Russischer Rubel				
SEK	– Schwedische Krone				
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					
Finanzderivate					
Sonstige Vermögenswerte					
<b>Gesamtvermögen</b>					
%					
<b>Gesamtvermögen</b>					
%					
<b>Gesamtvermögen</b>					
%					

# Franklin MV European Equity Growth and Income Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)	
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	46	Verkauf	EUR	41	€	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	43	Verkauf	AUD	68		(1)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	6	Verkauf	CNH	41		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	6.456	Verkauf	EUR	5.646		109
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	441	Verkauf	EUR	289		1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	2.310	Verkauf	EUR	509		(19)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	1.150	Verkauf	EUR	158		5
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	2.224	Verkauf	EUR	1.392		47
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	22	Verkauf	PLN	100		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	67	Verkauf	SGD	102		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	98	Verkauf	USD	109		–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	280	Verkauf	USD	317		(3)
15/03/2022	Deutsche Bank	Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	–		–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 7 EUR)								€	162
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (15) EUR)									(23)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (8) EUR)								€	139

## Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts
<b>Stammaktien — 98,26 % (28. Februar 2021: 97,28 %)</b>					
<b>Australien — 6,56 % (28. Februar 2021: 4,66 %)</b>					
AUD	127 Aurizon Holdings Ltd	325	1,26		
AUD	7 JB Hi-Fi Ltd	234	0,90		
AUD	32 McMillan Shakespeare Ltd	278	1,07		
AUD	119 Orora Ltd	321	1,24		
AUD	5 Rio Tinto Ltd	438	1,69		
AUD	4 Sonic Healthcare Ltd	102	0,40		
		1.698	6,56		
<b>China — 32,86 % (28. Februar 2021: 34,16 %)</b>					
HKD	1.100 Bank of China Ltd	428	1,65		
HKD	557 Bank of Communications Co Ltd	381	1,47		
HKD	900 CGN Power Co Ltd, 144A	255	0,98		
HKD	510 China CITIC Bank Corp Ltd	239	0,93		
HKD	574 China Communications Services Corp Ltd	315	1,22		
HKD	800 China Construction Bank Corp	600	2,32		
HKD	200 China Medical System Holdings Ltd	356	1,38		
HKD	81 China Pacific Insurance Group Co Ltd	226	0,87		
HKD	450 China Railway Group Ltd	264	1,02		
HKD	143 China Shenhua Energy Co Ltd	395	1,52		
HKD	200 CITIC Ltd	233	0,90		
HKD	950 CITIC Telecom International Holdings Ltd	337	1,30		
HKD	725 Dali Foods Group Co Ltd, 144A	383	1,48		
HKD	127 EEKA Fashion Holdings Ltd	205	0,79		
HKD	365 Far East Horizon Ltd	312	1,20		
HKD	338 Fu Shou Yuan International Group Ltd	250	0,97		
HKD	54 Hengan International Group Co Ltd	286	1,11		
HKD	110 Lenovo Group Ltd	122	0,47		
HKD	40 Longfor Group Holdings Ltd, 144A	214	0,83		
HKD	600 PetroChina Co Ltd	321	1,24		
HKD	370 PICC Property & Casualty Co Ltd	390	1,51		
HKD	480 Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	394	1,52		
HKD	503 Sinopec Engineering Group Co Ltd	240	0,93		
HKD	166 Tingyi Cayman Islands Holding Corp	367	1,42		
HKD	344 Uni-President China Holdings Ltd	358	1,38		
HKD	325 Yueshi Property Co Ltd	325	1,25		
HKD	500 Yueshi Transport Infrastructure Ltd	310	1,20		
		8.506	32,86		
<b>Hongkong — 7,79 % (28. Februar 2021: 10,61 %)</b>					
HKD	42 AIA Group Ltd	437	1,69		
HKD	39 CLP Holdings Ltd	397	1,53		
HKD	1.026 Giordano International Ltd †	209	0,81		
HKD	81 Hysan Development Co Ltd	238	0,92		
HKD	68 Luk Fook Holdings International Ltd	180	0,70		
HKD	271 Stella International Holdings Ltd †	273	1,05		
HKD	34 Vtech Holdings Ltd	283	1,09		
		2.017	7,79		
<b>Indien — 7,59 % (28. Februar 2021: 7,41 %)</b>					
INR	28 Infosys Ltd	628	2,43		
INR	974 NHPC Ltd	355	1,37		
INR	135 Power Grid Corp of India Ltd	374	1,44		
INR	182 REC Ltd	297	1,15		
INR	61 Vedanta Ltd	310	1,20		
		1.964	7,59		
<b>Indonesien — 2,89 % (28. Februar 2021: 2,29 %)</b>					
IDR	761 Indofood Sukses Makmur Tbk PT	330	1,27		
IDR	1.387 Telkom Indonesia Persero Tbk PT	418	1,62		
		748	2,89		
<b>Malaysia — 3,07 % (28. Februar 2021: 2,93 %)</b>					
MYR	1.389 Astro Malaysia Holdings Bhd	329	1,27		
MYR	75 Malayan Banking Bhd	157	0,61		
MYR	220 RHB Bank Bhd	308	1,19		
		794	3,07		
<b>Pakistan — 0,72 % (28. Februar 2021: 0,78 %)</b>					
PKR	208 MCB Bank Ltd	185	0,72		
<b>Philippinen — 1,40 % (28. Februar 2021: 2,11 %)</b>					
PHP	517 Aboitiz Power Corp	362	1,40		
<b>Singapur — 1,05 % (28. Februar 2021: 0,86 %)</b>					
SGD	17 Jardine Cycle & Carriage Ltd	273	1,05		
<b>Südkorea — 14,32 % (28. Februar 2021: 12,32 %)</b>					
KRW	10 GS Retail Co Ltd	230	0,89		
KRW	8 KB Financial Group Inc	370	1,43		
KRW	25 KT Corp ADR	335	1,29		
KRW	5 KT&G Corp	345	1,33		
KRW	30 LG Uplus Corp	326	1,26		
KRW	1 POSCO	190	0,74		
KRW	22 Samsung Electronics Co Ltd	1.351	5,22		
				3.706	14,32
<b>Taiwan — 18,84 % (28. Februar 2021: 18,14 %)</b>					
TWD	220 Asia Cement Corp	356	1,38		
TWD	14 Asustek Computer Inc	187	0,72		
TWD	51 Chicony Electronics Co Ltd	164	0,64		
TWD	350 CTBC Financial Holding Co Ltd	342	1,32		
TWD	260 Kindom Development Co Ltd	347	1,34		
TWD	160 Lite-On Technology Corp	393	1,52		
TWD	30 Micro-Star International Co Ltd	169	0,65		
TWD	58 Pacific Hospital Supply Co Ltd	151	0,58		
TWD	14 Poya International Co Ltd	210	0,81		
TWD	13 Realtek Semiconductor Corp	214	0,83		
TWD	350 SinoPac Financial Holdings Co Ltd	215	0,83		
TWD	80 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.719	6,64		
TWD	170 Uni-President Enterprises Corp	409	1,58		
				4.876	18,84
<b>Thailand — 1,17 % (28. Februar 2021: 1,01 %)</b>					
THB	101 Tisco Financial Group PCL, NVDR	302	1,17		
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 25.626 USD)</b>					
		25.431	98,26		
<b>Immobilienfonds — 1,80 % (28. Februar 2021: 1,45 %)</b>					
<b>Australien — 1,09 % (28. Februar 2021: 0,87 %)</b>					
AUD	76 Charter Hall Long Wale REIT	283	1,09		
<b>Hongkong — 0,71 % (28. Februar 2021: 0,58 %)</b>					
HKD	194 Fortune Real Estate Investment Trust	183	0,71		
<b>Summe Immobilien-Investmentfonds (Anschaffungskosten 511 USD)</b>					
		466	1,80		
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 26.137 USD)</b>					
		25.897	100,06		
<b>Devisenterminkontrakte – 0,13 % (28. Februar 2021: 0,13 %)</b>					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	34	0,13		
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					
		25.931	100,19		
<b>Devisenterminkontrakte – (0,54 %) (28. Februar 2021: (0,09 %))</b>					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(139)	(0,54)		
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>					
		(139)	(0,54)		
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>					
		25.792	99,65		
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>					
		91	0,35		
<b>Gesamnettovermögen</b>					
		\$25.883	100,00		
– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.246.000 USD oder 4,81 % des Nettovermögens.					
† Illiquide.					
<b>ABKÜRZUNGEN:</b>					
ADR	– Amerikanische Hinterlegungsstelle.				
NVDR	– Non Voting Depository Receipt.				
AUD	– Australischer Dollar				
HKD	– Hongkong-Dollar				
IDR	– Indonesische Rupiah				
INR	– Indische Rupie				
KRW	– Südkoreanischer Gewinner				
MYR	– Malaysischer Ringgit				
PHP	– Philippin Peso				
PKR	– Pakistanische Rupie				
SGD	– Singapur-Dollar				
THB	– Thai Baht				
TWD	– Taiwanesischer Dollar				
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					
Finanzderivate					
Sonstige Vermögenswerte					
<b>Gesamtvermögen</b>					
100,00					

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	CNH	8	\$ –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	46	Verkauf	USD	34	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	9.768	Verkauf	USD	2.462	(139)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	1.444	Verkauf	USD	227	2
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	2.954	Verkauf	USD	2.114	32
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 43 USD)								\$ 34
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (29) USD)								(139)
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 14 USD)								\$ (105)

# Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>μ</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$
<b>Stammaktien — 0,00 % (28. Februar 2021: 97,68 %)</b>	
<b>Griechenland — 0,00 % (28. Februar 2021: 0,66 %)</b>	
EUR 1 FF Group †	-
<b>Hongkong — 0,00 % (28. Februar 2021: 0,67 %)</b>	
HKD 38 Hanergy Mobile Energy Holding Group Co Ltd †	-
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 44 USD)</b>	-
<b>Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten</b>	-
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>\$ -</b>
-	Beträge, die als „-“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
†	Illiquide.
μ	Mit Wirkung vom 14. April 2021 hat der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>μ</sup> den Handel eingestellt.
<b>ABKÜRZUNGEN:</b>	
EUR	- Euro
HKD	- Hongkong-Dollar
	<b>% des Gesamt vermögens</b>
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	<b>100,00</b>
Sonstige Vermögenswerte	100,00
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

<sup>μ</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 8,18 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			<b>USA — 50,36 % (28. Februar 2021: 40,71 %)</b>		
6 iShares MSCI ACWI ETF – ETF	587	4,69	1 3M Co	134	1,07
3 iShares MSCI EAFE ETF – ETF	220	1,75	2 AbbVie Inc	229	1,83
1 SPDR S&P 500 ETF Trust – ETF	218	1,74	3 Altria Group Inc	143	1,14
<b>Gesamtsumme der kollektiven Kapitalanlagen (Anschaffungskosten 1.033 USD)</b>			<b>1 American Financial Group Inc/OH</b>		
	1.025	8,18	1 Amgen Inc	149	1,19
<b>Stammaktien — 90,46 % (28. Februar 2021: 94,92 %)</b>			<b>7 AT&amp;T Inc</b>		
<b>Australien — 2,25 % (28. Februar 2021: 2,47 %)</b>			<b>3 Bristol-Myers Squibb Co</b>		
AUD 47 Aurizon Holdings Ltd	119	0,95	– Broadcom Inc	203	1,62
AUD 2 Rio Tinto Ltd	164	1,30	3 Cardinal Health Inc	157	1,25
	283	2,25	1 Caterpillar Inc	131	1,05
<b>Österreich — 0,97 % (28. Februar 2021: 1,28 %)</b>			<b>4 Cisco Systems Inc/Delaware</b>		
EUR 3 Oesterreichische Post AG	122	0,97	1 Clorox Co/The	102	0,81
<b>Kanada — 1,21 % (28. Februar 2021: 2,75 %)</b>			<b>1 Cummins Inc</b>		
CAD 1 Canadian Imperial Bank of Commerce	152	1,21	2 CVS Health Corp	171	1,36
<b>China — 3,94 % (28. Februar 2021: 4,24 %)</b>			<b>5 Flowers Foods Inc</b>		
HKD 266 China Petroleum & Chemical Corp	132	1,06	2 General Mills Inc	121	0,97
HKD 50 Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	104	0,83	3 Gilead Sciences Inc	158	1,26
HKD 91 CITIC Ltd	106	0,84	6 H&R Block Inc	156	1,25
HKD 185 Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	152	1,21	1 Hershey Co/The	172	1,37
	494	3,94	8 Hewlett Packard Enterprise Co	124	0,99
<b>Finnland — 1,00 % (28. Februar 2021: 0,86 %)</b>			<b>1 Home Depot Inc/The</b>		
EUR 3 Orion Oyj	125	1,00	5 HP Inc	158	1,26
<b>Frankreich — 2,69 % (28. Februar 2021: 1,37 %)</b>			<b>4 Intel Corp</b>		
EUR 13 Orange SA	159	1,27	1 International Business Machines Corp	153	1,22
EUR 2 Sanofi	178	1,42	3 International Paper Co	113	0,90
	337	2,69	1 J M Smucker Co/The	135	1,07
<b>Hongkong — 0,97 % (28. Februar 2021: 2,03 %)</b>			<b>1 Johnson &amp; Johnson</b>		
HKD 12 CLP Holdings Ltd	122	0,97	4 Juniper Networks Inc	135	1,08
<b>Japan — 8,08 % (28. Februar 2021: 10,96 %)</b>			<b>4 Kroger Co/The</b>		
JPY 1 Daito Trust Construction Co Ltd	111	0,88	– Lockheed Martin Corp	197	1,57
JPY 5 KDDI Corp	169	1,35	2 Merck & Co Inc	161	1,28
JPY 16 Marubeni Corp	166	1,32	1 Microsoft Corp	179	1,43
JPY 16 Mitsubishi Chemical Holdings Corp	114	0,91	Northrop Grumman Corp	186	1,48
JPY — Nintendo Co Ltd	152	1,21	4 Pfizer Inc	178	1,42
JPY 6 Nippon Telegraph & Telephone Corp	167	1,33	1 Swiss Re AG	142	1,13
JPY 11 SoftBank Corp	135	1,08	1 Target Corp	136	1,08
	1.014	8,08	1 Texas Instruments Inc	145	1,15
<b>Malaysia — 0,77 % (28. Februar 2021: 1,59 %)</b>			<b>1 United Parcel Service Inc 'B'</b>		
MYR 46 Malayan Banking Bhd	96	0,77	3 Walgreens Boots Alliance Inc	143	1,14
<b>Niederlande — 1,18 % (28. Februar 2021: 1,00 %)</b>			<b>1 Walmart Inc</b>		
EUR 5 Koninklijke Ahold Delhaize NV	148	1,18		155	1,24
<b>Russland — 0,16 % (28. Februar 2021: 0,87 %)</b>			<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 9.900 USD)</b>		
8 Gazprom PJSC ADR	20	0,16		11.347	90,46
<b>Spanien — 2,92 % (28. Februar 2021: 3,81 %)</b>			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 10.933 USD)</b>		
EUR 5 Enagas SA	108	0,86		12.372	98,64
EUR 5 Endesa SA	115	0,92	<b>Devisenterminkontrakte – 0,06 % (28. Februar 2021: 0,04 %)</b>		
EUR 7 Red Electrica Corp SA	143	1,14	<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>		
	366	2,92		7	0,06
<b>Schweiz — 2,15 % (28. Februar 2021: 3,72 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
CHF 1 Logitech International SA	90	0,72		12.379	98,70
CHF 1 Roche Holding AG	180	1,43	<b>Devisenterminkontrakte – (0,01 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
	270	2,15	<b>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</b>		
<b>Taiwan — 7,47 % (28. Februar 2021: 6,29 %)</b>			<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
TWD 77 Asia Cement Corp	124	0,99		(1)	(0,01)
TWD 9 Asustek Computer Inc	120	0,96	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
TWD 99 King Yuan Electronics Co Ltd	156	1,25		12.378	98,69
TWD 54 Lite-On Technology Corp	133	1,06	<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		
TWD 35 Quanta Computer Inc	117	0,93		165	1,31
TWD 39 Radiant Opto-Electronics Corp	141	1,12	<b>Gesamtes Nettovermögen in USD</b>		
TWD 13 Simplo Technology Co Ltd	146	1,16		12.543	100,00
	937	7,47	– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
<b>Türkei — 0,90 % (28. Februar 2021: 0,87 %)</b>			144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 152.000 USD oder 1,21 % des Nettovermögens.		
TRY 50 Ereğli Demir ve Çelik Fabrikaları TAS	113	0,90	<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
<b>Großbritannien — 3,44 % (28. Februar 2021: 3,66 %)</b>			ADR – Amerikanische Hinterlegungsstelle.		
GBP 39 Direct Line Insurance Group Plc	157	1,25	ETF – Börsengehandelter Fonds.		
GBP 7 GlaxoSmithKline Plc	154	1,22	SPDR – Standard & Poor's Depository Receipts.		
GBP 6 Imperial Brands Plc	121	0,97	AUD – Australischer Dollar		
	432	3,44	CAD – Kanadischer Dollar		
			CHF – Schweizer Franken		
			EUR – Euro		
			GBP – Britische Pfund		
			HKD – Hongkong-Dollar		
			JPY – Japanischer Yen		
			MYR – Malaysischer Ringgit		
			PROBIEREN – Türkische Lira		
			TWD – Taiwanesischer Dollar		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

	% des Gesamt vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	83,16
Organismen für gemeinsame Anlagen	7,51
Finanzderivate	0,05
Sonstige Vermögenswerte	9,28
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)			Verkaufswährung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	16	Verkauf	AUD	22	\$ –
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	SGD	5	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	77	Verkauf	USD	57	(1)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	649	Verkauf	USD	465	7
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 5 USD)								\$ 7
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)								(1)
Nettowerwertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 5 USD)								\$ 6

# Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	
<b>Stammaktien — 95,93 % (28. Februar 2021: 96,27 %)</b>			
<b>China — 33,22 % (28. Februar 2021: 37,92 %)</b>			
HKD	45 Alibaba Group Holding Ltd	596	3,70
HKD	416 CSPC Pharmaceutical Group Ltd	492	3,05
HKD	36 ENN Energy Holdings Ltd	519	3,22
HKD	350 Guangdong Investment Ltd	471	2,92
HKD	2 JD.com Inc † 54		0,33
HKD	152 Minth Group Ltd	549	3,41
HKD	57 Ping An Insurance Group Co of China Ltd	438	2,72
HKD	25 Shenzhou International Group Holdings Ltd	413	2,56
HKD	20 Tencent Holdings Ltd	1.079	6,70
HKD	184 Tongcheng Travel Holdings Ltd	343	2,13
HKD	212 TravelSky Technology Ltd	400	2,48
		5.354	33,22
<b>Hongkong — 11,51 % (28. Februar 2021: 8,84 %)</b>			
HKD	69 AIA Group Ltd	715	4,44
	10 Jardine Matheson Holdings Ltd	596	3,70
HKD	33 Techtronic Industries Co Ltd	545	3,37
		1.856	11,51
<b>Indien — 11,79 % (28. Februar 2021: 12,58 %)</b>			
INR	42 HDFC Bank Ltd	806	5,00
INR	16 Hero MotoCorp Ltd	524	3,25
INR	12 Tata Consultancy Services Ltd	571	3,54
		1.901	11,79
<b>Indonesien — 2,24 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>			
IDR	1.199 Telkom Indonesia Persero Tbk PT	362	2,24
<b>Singapur — 12,02 % (28. Februar 2021: 8,92 %)</b>			
SGD	186 Singapore Technologies Engineering Ltd	526	3,27
SGD	41 United Overseas Bank Ltd	916	5,68
SGD	38 Venture Corp Ltd	495	3,07
		1.937	12,02
<b>Südkorea — 13,49 % (28. Februar 2021: 17,83 %)</b>			
KRW	1 LG Chem Ltd	393	2,44
KRW	1 LG Energy Solution	285	1,77
KRW –	LG Household & Health Care Ltd	326	2,02
KRW	5 Orion Corp/Republic of Korea	358	2,22
KRW	13 Samsung Electronics Co Ltd	812	5,04
		2.174	13,49
<b>Taiwan — 11,66 % (28. Februar 2021: 10,18 %)</b>			
TWD	53 Feng TAY Enterprise Co Ltd	397	2,46
TWD	69 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.482	9,20
		1.879	11,66
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 16.740 USD)</b>		15.463	95,93
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		15.463	95,93
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		15.463	95,93
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		655	4,07
<b>Gesamtvermögen</b>		\$16.118	100,00

– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

† Illiquide.

#### ABKÜRZUNGEN:

HKD	– Hongkong-Dollar
IDR	– Indonesische Rupiah
INR	– Indische Rupie
KRW	– Südkoreanischer Gewinner
SGD	– Singapur-Dollar
TWD	– Taiwanesischer Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,35
Sonstige Vermögenswerte	4,65
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Stammaktien — 100,64 % (28. Februar 2021: 94,80 %)</b>					
<b>Australien — 2,97 % (28. Februar 2021: 2,74 %)</b>					
AUD	26 CSL Ltd	5,028	2,97		
<b>China — 5,85 % (28. Februar 2021: 9,84 %)</b>					
HKD	4 JD.com Inc †	137	0,08		
HKD	77 Tencent Holdings Ltd	4.135	2,44		
HKD	682 Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	5.639	3,33		
		9.911	5,85		
<b>Dänemark — 3,01 % (28. Februar 2021: 2,76 %)</b>					
DKK	34 Coloplast A/S	5,093	3,01		
<b>Frankreich — 7,01 % (28. Februar 2021: 5,86 %)</b>					
EUR	7 Kering SA	5,150	3,04		
EUR	17 L'Oreal SA	6,722	3,97		
		11.872	7,01		
<b>Deutschland — 2,13 % (28. Februar 2021: 2,85 %)</b>					
EUR	15 adidas AG	3,608	2,13		
<b>Hongkong — 2,86 % (28. Februar 2021: 3,16 %)</b>					
HKD	465 AIA Group Ltd	4,836	2,86		
<b>Irland — 7,96 % (28. Februar 2021: 6,00 %)</b>					
EUR	37 Kerry Group Plc	4,369	2,58		
EUR	93 Kingspan Group Plc	9,109	5,38		
		13.478	7,96		
<b>Italien — 7,27 % (28. Februar 2021: 6,43 %)</b>					
EUR	26 Ferrari NV	5,518	3,26		
EUR	113 Moncler SpA	6,792	4,01		
		12.310	7,27		
<b>Schweden — 10,75 % (28. Februar 2021: 9,66 %)</b>					
SEK	200 Assa Abloy AB	5,261	3,10		
SEK	131 Atlas Copco AB	6,692	3,95		
SEK	464 Hexagon AB	6,262	3,70		
		18.215	10,75		
<b>Taiwan — 6,21 % (28. Februar 2021: 5,85 %)</b>					
TWD	490 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	10,526	6,21		
<b>Großbritannien — 6,55 % (28. Februar 2021: 4,06 %)</b>					
GBP	236 Dr. Martens Plc	889	0,52		
158	Farfetch Ltd	3,012	1,78		
25	Linde Plc	7,192	4,25		
		11.093	6,55		
<b>USA — 38,07 % (28. Februar 2021: 35,59 %)</b>					
12	Adobe Inc	5,383	3,18		
17	ANSYS Inc	5,475	3,23		
20	Autodesk Inc	4,461	2,63		
16	Illumina Inc	5,147	3,04		
30	Masimo Corp	4,732	2,80		
18	Mastercard Inc	6,502	3,84		
32	Microsoft Corp	9,606	5,67		
41	NVIDIA Corp	9,964	5,88		
32	ResMed Inc	7,811	4,61		
24	Veeva Systems Inc 'A'	5,407	3,19		
		64.488	38,07		
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 179.861 USD)</b>				170.458	100,64
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 179.861 USD)</b>				170.458	100,64
<b>Devisenterminkontrakte – (1,25 % (28. Februar 2021: 0,03 %))</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				197	0,12
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>				170.655	100,76
<b>Devisenterminkontrakte – (1,25 % (28. Februar 2021: 0,00 %))</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				(2.114)	(1,25)
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>				(2.114)	(1,25)
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>				168.541	99,51
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>				840	0,49
<b>Gesamtvermögen</b>				\$169.381	100,00
– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 5.639.000 USD oder 3,33 % des Nettovermögens.					
† Illiquide					
<b>ABKÜRZUNGEN:</b>					
AUD – Australischer Dollar					
DKK – Dänische Krone					
EUR – Euro					
GBP – Britische Pfund					
HKD – Hongkong-Dollar					
SEK – Schwedische Krone					
TWD – Taiwanesischer Dollar					
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>				<b>% des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden				88,12	
Finanzderivate				0,10	
Sonstige Vermögenswerte				11,78	
<b>Gesamtvermögen</b>				100,00	

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Verkaufswährung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)		
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 513	Verkauf	EUR 458	\$ (1)
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 1	Verkauf	GBP 1	–
01/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 13.418	Verkauf	USD 15.029	15
01/03/2022	Canadian Imperial Bank of Commerce	Kauf	USD 922	Verkauf	SEK 8.774	(5)
01/03/2022	State Street Bank & Trust Co	Kauf	USD 374	Verkauf	AUD 519	(3)
01/03/2022	State Street Bank & Trust Co	Kauf	USD 2.037	Verkauf	EUR 1.822	(6)
01/03/2022	State Street Bank & Trust Co	Kauf	USD 1.084	Verkauf	HKD 8.465	1
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 13.416	Verkauf	EUR 11.811	163
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 15.034	Verkauf	EUR 13.418	(21)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 330	Verkauf	GBP 246	3
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 60	Verkauf	USD 80	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 95.730	Verkauf	USD 109.461	(2.051)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 2.019	Verkauf	USD 2.737	(27)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 2.935	Verkauf	USD 3.278	15
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 36 USD)					\$ 197	
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – USD)					(2.114)	
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 36 USD)					\$ (1.917)	

<sup>^</sup> 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

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Netto- inventar- werts			
<b>Stammaktien — 54,78 % (28. Februar 2021: 53,23 %)</b>			<b>Indien — 5,04 % (28. Februar 2021: 3,61 %)</b>					
<b>Australien — 11,72 % (28. Februar 2021: 15,32 %)</b>			<b>Indonesien — 1,31 % (28. Februar 2021: 2,32 %)</b>					
AUD	142 AGL Energy Ltd	777	2,78	INR	285 Embassy Office Parks REIT	1.408	5,04	
AUD	99 APA Group	725	2,60	<b>Neuseeland — 1,31 % (28. Februar 2021: 2,32 %)</b>				
AUD	267 Aurizon Holdings Ltd	683	2,44	NZD	494 Kivi Property Group Ltd	365	1,31	
AUD	118 Transurban Group	1.089	3,90	<b>Singapur — 9,97 % (28. Februar 2021: 10,39 %)</b>				
		3.274	11,72	SGD	688 CapitaLand Integrated Commercial Trust	1.073	3,84	
<b>China — 11,69 % (28. Februar 2021: 7,49 %)</b>			SGD	412 Frasers Centrepoint Trust	687	2,46		
HKD	260 China Merchants Port Holdings Co Ltd	490	1,75	SGD	220 Keppel DC REIT	355	1,27	
HKD	3.946 China Tower Corp Ltd, 144A	458	1,64	SGD	355 Mapletree Industrial Trust	671	2,40	
HKD	1.116 Guangdong Investment Ltd	1.500	5,37			2.786	9,97	
HKD	1.318 Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	818	2,93	<b>Summe Immobilien-Investmentfonds (Anschaffungskosten 11.921 USD)</b>				
		3.266	11,69			12.311	44,07	
<b>Hongkong — 6,17 % (28. Februar 2021: 7,41 %)</b>			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 26.714 USD)</b>					
HKD	95 CLP Holdings Ltd	962	3,44			27.613	98,85	
HKD	413 HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	407	1,46	<b>Devisenterminkontrakte – 0,04 % (28. Februar 2021: 0,01 %)</b>				
HKD	79 Wharf Real Estate Investment Co Ltd	355	1,27	<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>				
		1.724	6,17			11	0,04	
<b>Indien — 8,08 % (28. Februar 2021: 7,87 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					
INR	2.841 NHPC Ltd	1.034	3,70			27.624	98,89	
INR	441 Power Grid Corp of India Ltd	1.223	4,38	<b>Devisenterminkontrakte – (0,04 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>				
		2.257	8,08	<b>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</b>				
<b>Malaysia — 2,53 % (28. Februar 2021: 4,32 %)</b>						(10)	(0,04)	
MYR	56 Petronas Gas Bhd	231	0,82	<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>				
MYR	509 Westports Holdings Bhd	477	1,71			(10)	(0,04)	
		708	2,53	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>				
<b>Neuseeland — 2,83 % (28. Februar 2021: 1,88 %)</b>						320	1,15	
NZD	143 Contact Energy Ltd	789	2,83	<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>				
<b>Philippinen — 3,60 % (28. Februar 2021: 2,12 %)</b>						27.614	98,85	
PHP	140 Manila Electric Co	1.005	3,60	<b>Gesamtes Nettovermögen in USD</b>				
<b>Singapur — 3,43 % (28. Februar 2021: 3,69 %)</b>						27.934	100,00	
SGD	608 Ascendas India Trust	533	1,91	– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.				
SGD	601 NetLink NBN Trust	425	1,52	144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 458.000 USD oder 1,64 % des Nettovermögens.				
		958	3,43	<b>ABKÜRZUNGEN:</b>				
<b>Thailand — 4,73 % (28. Februar 2021: 3,13 %)</b>			AUD	– Australischer Dollar				
THB	3.048 Digital Telecommunications Infrastructure Fund	1.321	4,73	HKD	– Hongkong-Dollar			
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 14.793 USD)</b>			INR	– Indische Rupie				
		15.302	54,78	MYR	– Malaysischer Ringgit			
<b>Immobilienfonds — 44,07 % (28. Februar 2021: 45,81 %)</b>			NZD	– Neuseeländischer Dollar				
<b>Australien — 21,10 % (28. Februar 2021: 19,08 %)</b>			PHP	– Philippin Peso				
AUD	128 Charter Hall Long Wale REIT	478	1,71	SGD	– Singapur-Dollar			
AUD	387 Charter Hall Retail REIT	1.179	4,22	THB	– Thai Baht			
AUD	162 GPT Group/The	577	2,07					
AUD	460 Scentre Group	1.020	3,65					
AUD	328 Shopping Centres Australasia Property Group	692	2,48					
AUD	161 Stockland	489	1,75					
AUD	932 Vicinity Centres	1.213	4,34					
AUD	125 Waypoint REIT Ltd	246	0,88					
		5.894	21,10					
<b>Hongkong — 6,65 % (28. Februar 2021: 10,41 %)</b>			<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>					
HKD	659 Fortune Real Estate Investment Trust	620	2,22	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden				
HKD	153 Link REIT	1.238	4,43	Finanzderivate				
		1.858	6,65	Sonstige Vermögenswerte				
			<b>Gesamtvermögen</b>					
			100,00					

# Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)		Verkaufswährung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)		
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	132	Verkauf	AUD	184	\$ (1)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	CNH	–	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	CNH	–	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD	39	Verkauf	SGD	53	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.424	Verkauf	USD	1.059	(9)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	–	Verkauf	USD	–	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	8	Verkauf	USD	1	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	1.121	Verkauf	USD	804	11
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	14	Verkauf	USD	10	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 3 USD)							\$	11
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): (1) USD)								(10)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): 2 USD)							\$	1

# Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup>

Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Stammaktien — 99,59 % (28. Februar 2021: 98,03 %)</b>		
<b>Brasilien — 5,07 % (28. Februar 2021: 2,97 %)</b>		
BRL	223 B3 SA –Brasil Bolsa Balcao	630 1,32
BRL	214 Cosan SA	877 1,83
BRL	144 Odontoprev SA	322 0,67
BRL	105 WEG SA	598 1,25
		2.427 5,07
<b>Chile — 1,89 % (28. Februar 2021: 1,38 %)</b>		
GBP	45 Antofagasta Plc	906 1,89
<b>China — 28,01 % (28. Februar 2021: 37,67 %)</b>		
HKD	53 Alibaba Group Holding Ltd	695 1,45
	9 Alibaba Group Holding Ltd ADR	967 2,02
HKD	198 Brilliance China Automotive Holdings Ltd †	68 0,14
HKD	100 China Merchants Bank Co Ltd	843 1,76
CNH	14 Contemporary Ampere Technology Co Ltd	1.191 2,49
HKD	3 JD.com Inc †	103 0,22
	12 JD.com Inc ADR	883 1,85
HKD	52 Meituan 'B', 144A	1.164 2,43
HKD	134 Minth Group Ltd	484 1,01
CNH	199 Ping An Bank Co Ltd	497 1,04
HKD	140 Ping An Insurance Group Co of China Ltd	1.085 2,27
EUR	7 Prosus NV	446 0,93
HKD	137 Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	550 1,15
HKD	64 Tencent Holdings Ltd	3.438 7,19
CNH	50 Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	544 1,14
HKD	242 Xinyi Solar Holdings Ltd	440 0,92
		13.398 28,01
<b>Hongkong — 2,35 % (28. Februar 2021: 2,21 %)</b>		
HKD	108 AIA Group Ltd	1.123 2,35
<b>Ungarn — 2,09 % (28. Februar 2021: 1,90 %)</b>		
HUF	26 OTP Bank Nyrt	998 2,09
<b>Indien — 17,91 % (28. Februar 2021: 10,67 %)</b>		
INR	23 Asian Paints Ltd	964 2,01
INR	53 HDFC Bank Ltd	1.010 2,11
INR	143 ICICI Bank Ltd	1.413 2,95
INR	31 Kotak Mahindra Bank Ltd	759 1,59
INR	9 Maruti Suzuki India Ltd	988 2,07
INR	39 Reliance Industries Ltd	1.219 2,55
INR	44 Titan Co Ltd	1.500 3,13
INR	8 UltraTech Cement Ltd 716	1.500 3,13
		8.569 17,91
<b>Indonesien — 2,98 % (28. Februar 2021: 2,17 %)</b>		
IDR	2.805 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	898 1,88
IDR	1.744 Telkom Indonesia Persero Tbk PT	526 1,10
		1.424 2,98
<b>Mexiko – 0,77 % (28. Februar 2021: 0,57 %)</b>		
MXN	144 Orbia Advance Corp SAB de CV	368 0,77
<b>Peru — 1,37 % (28. Februar 2021: 1,54 %)</b>		
	4 Credicorp Ltd	655 1,37
<b>Philippinen — 0,42 % (28. Februar 2021: 0,38 %)</b>		
PHP	171 Robinsons Retail Holdings Inc	203 0,42
<b>Russland — 0,52 % (28. Februar 2021: 2,96 %)</b>		
	9 LUKOIL PJSC ADR	165 0,35
	9 TCS Group Holding Plc GDR	82 0,17
		247 0,52
<b>Saudi-Arabien — 2,36 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
SAR	21 Al Rajhi Bank	911 1,90
EUR	4 Delivery Hero SE, 144A	218 0,46
		1.129 2,36

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% des Nettoinventarwerts
<b>Südkorea — 18,76 % (28. Februar 2021: 17,49 %)</b>		
KRW	2 LG Chem Ltd	998 2,08
KRW	– LG Energy Solution	114 0,24
KRW	– LG Household & Health Care Ltd	373 0,78
KRW	3 NAVER Corp	818 1,71
KRW	70 Samsung Electronics Co Ltd	4.236 8,86
KRW	2 Samsung SDI Co Ltd	721 1,51
KRW	16 SK Hynix Inc	1.712 3,58
		8.972 18,76
<b>Taiwan — 14,15 % (28. Februar 2021: 12,86 %)</b>		
TWD	62 Delta Electronics Inc	552 1,15
TWD	46 Globalwafers Co Ltd	1.137 2,38
	3 Sea Ltd ADR	441 0,92
TWD	216 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	4.640 9,70
		6.770 14,15
<b>USA — 0,94 % (28. Februar 2021: 2,82 %)</b>		
	2 EPAM Systems Inc	450 0,94
		47.639 99,59
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 49.194 USD)</b>		
		47.639 99,59
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
		47.639 99,59
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
		47.639 99,59
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		
		199 0,41
<b>Gesamtvermögen</b>		\$47.838 100,00
– Beträge, die als „–“ bezeichnet werden, betragen entweder 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
144A Wertpapiere, die gemäß Regel 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung von der Registrierung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.382.000 USD oder 2,89 % des Nettovermögens.		
† Illiquide.		
∞ Sicherheit wird nach Treu und Glauben vom Bewertungsausschuss oder nach dessen Ermessen zum beizulegenden Zeitwert bewertet.		
<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
ADR	– Amerikanische Hinterlegungsstelle.	
GDR	– Globaler Beleg der Verwahrstelle.	
BRL	– Brasilianisch Real	
CNH	– Chinesischer Renminbi	
EUR	– Euro	
GBP	– Britische Pfund	
HKD	– Hongkong-Dollar	
HUF	– Ungarischer Forint	
IDR	– Indonesische Rupiah	
INR	– Indische Rupie	
KRW	– Südkoreanischer Gewinner	
MXN	– Mexikanischer Peso	
PHP	– Philippin Peso	
SAR	– Saudi-Arabien Riyal	
TWD	– Taiwanesischer Dollar	
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>		<b>% des Gesamtvermögens</b>
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		98,14
Sonstige Vermögenswerte		1,86
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup>

## Anlageportfolio zum 28. Februar 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts
<b>Stammaktien — 99,66 % (28. Februar 2021: 97,24 %)</b>		
<b>Dänemark — 4,42 % (28. Februar 2021: 2,82 %)</b>		
DKK 292 Ambu A/S 'B'	4.728	1,56
DKK 64 Coloplast A/S	8.689	2,86
	13.417	4,42
<b>Frankreich — 18,59 % (28. Februar 2021: 17,33 %)</b>		
291 Dassault Systemes SE	12.537	4,13
29 Kering SA	17.957	5,91
37 L'Oreal SA	13.216	4,35
37 Sartorius Stedim Biotech	12.736	4,20
	56.446	18,59
<b>Deutschland — 11,97 % (28. Februar 2021: 16,60 %)</b>		
50 adidas AG	10.643	3,51
451 Infineon Technologies AG	13.863	4,57
150 Nemetschek SE	11.823	3,89
	36.329	11,97
<b>Irland — 7,86 % (28. Februar 2021: 6,44 %)</b>		
82 Kerry Group Plc	8.698	2,86
174 Kingspan Group Plc	15.178	5,00
	23.876	7,86
<b>Italien — 11,91 % (28. Februar 2021: 13,12 %)</b>		
110 Ferrari NV	21.203	6,98
280 Moncler SpA	14.966	4,93
	36.169	11,91
<b>Niederlande — 9,59 % (28. Februar 2021: 8,97 %)</b>		
49 ASML Holding NV	29.108	9,59
<b>Schweden — 13,96 % (28. Februar 2021: 13,31 %)</b>		
SEK 576 Assa Abloy AB	13.509	4,45
SEK 292 Atlas Copco AB	13.331	4,39
SEK 1.290 Hexagon AB	15.536	5,12
	42.376	13,96
<b>Schweiz — 3,91 % (28. Februar 2021: 5,47 %)</b>		
CHF 10 Partners Group Holding AG	11.864	3,91
<b>Großbritannien — 11,91 % (28. Februar 2021: 4,67 %)</b>		
772 Allfunds Group Plc	7.898	2,60
GBP 1.162 Dr. Martens Plc	3.897	1,28
USD 214 Farfetch Ltd	3.629	1,20
52 Linde Plc	13.568	4,47

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% des Netto- inventar- werts
GBP 1.304 Oxford Nanopore Technologies Plc	7.155	2,36
	36.147	11,91
<b>USA — 5,54 % (28. Februar 2021: 6,76 %)</b>		
USD 13 Mettler-Toledo International Inc	16.819	5,54
<b>Stammaktien insgesamt (Anschaffungskosten 323.568 €)</b>	302.551	99,66
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 323.568 €)</b>		
	302.551	99,66
<b>Devisenterminkontrakte – 0,09 % (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	281	0,09
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	302.832	99,75
<b>Devisenterminkontrakte – (0,02 %) (28. Februar 2021: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(69)	(0,02)
<b>Summe - Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten</b>		
	(69)	(0,02)
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
	302.763	99,73
<b>Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen</b>		
	827	0,27
<b>Gesamtvermögen</b>		
	€303.590	100,00

– Als „–“ bezeichnete Beträge betragen entweder 0 €, weniger als 1.000 €, weniger als 1.000 Aktien oder weniger als 0,01 %.

**ABKÜRZUNGEN:**

CHF	– Schweizer Franken
DKK	– Dänische Krone
GBP	– Britische Pfund
SEK	– Schwedische Krone
USD	– US-Dollar

	% des Gesamt- vermögens
<b>Analyse des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	99,34
Finanzderivate	0,09
Sonstige Vermögenswerte	0,57
<b>Gesamtvermögen</b>	100,00

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währung kaufen (in Tsd.)	Währung verkaufen (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Abschreibung) von Verträgen (in Tsd.)	
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 3.323	Verkauf BRL 18.976	€ 41
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 593	Verkauf BRL 3.573	(25)
03/03/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL 22.548	Verkauf EUR 3.662	237
04/03/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL 500	Verkauf EUR 88	(1)
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 2	Verkauf EUR 2	–
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	USD 94	Verkauf EUR 82	2
15/03/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 9	Verkauf USD 9	–
04/04/2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 87	Verkauf BRL 500	1
04/04/2022	BNY Mellon	Kauf	BRL 18.513	Verkauf EUR 3.212	(43)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – EUR)				\$ 281	
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – EUR)				(69)	
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2021 (in Tsd.): – EUR)				\$ 212	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

## Bilanz

(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	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 1	\$ 1	\$ 16	\$ 611	\$ 20.859	\$ 43.021	€ 1.027	€ 4.405
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	–	–	4.462	3.468	18.123	10.044	2.338	1.119
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	939.444	910.476	234.866	322.429	1.477.772	1.733.256	146.614	105.074
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	280	46	–	–
Optionen	–	–	58	125	383	787	–	–
Swapkontrakte	–	–	2.494	4.060	11.755	17.737	72	217
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	12	3.409	1.679	59	42
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	726	270	5.952	2.931	567	855
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	2.086	10.194	14.432	45.144	3	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	153	806	948	3.754	–	–
Zins- und sonstige Ertragsforderungen	313	1.135	1.348	1.562	8.588	9.724	1.156	842
Dividendenforderungen	–	–	3	3	8	12	28	26
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	1	–
<b>Gesamtumlaufvermögen</b>	<b>939.758</b>	<b>911.612</b>	<b>246.212</b>	<b>343.540</b>	<b>1.562.509</b>	<b>1.868.135</b>	<b>151.865</b>	<b>112.580</b>
<b>KURZFRISTIGE PASSIVA</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	659	–	1.199	5	–	–
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	–	–	2.642	4.191	2.114	5.760	508	361
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Optionen	–	–	229	354	1.476	1.931	3	31
Swapkontrakte	–	–	421	247	3.508	1.290	743	105
Swaptions	–	–	–	–	258	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	50	–	7.304	2.446	569	187
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	1.522	949	8.964	5.784	590	509
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen (Erläuterung 2)	19.972	28.840	5.654	38.192	44.980	179.021	1	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	6	6	55	50	48	57	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	55	22	141	185	668	802	2	3
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	22	21	17	18	78	81	10	7
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	16	20	31	53	1	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	1.814	119	3.508	23.242	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	379	393	86	85	283	245	52	54
<b>Verbindlichkeiten (ohne Nettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)</b>	<b>20.434</b>	<b>29.282</b>	<b>13.306</b>	<b>44.410</b>	<b>74.419</b>	<b>220.717</b>	<b>2.479</b>	<b>1.257</b>
<b>Gesamtvermögen, das Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist</b>	<b>\$ 919.324</b>	<b>\$ 882.330</b>	<b>\$ 232.906</b>	<b>\$ 299.130</b>	<b>\$ 1.488.090</b>	<b>\$ 1.647.418</b>	<b>€ 149.386</b>	<b>€ 111.323</b>
(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 5.997	\$ 1.647	\$ 14	\$ 14	\$ 17	\$ 16	\$ 776	\$ 1.409
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	168	225	–	–	–	–	993	536
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	75.783	102.709	–	–	–	–	57.903	47.327
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	26	56
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	193	158	–	–	–	–	353	175
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	51	52	–	–	–	–	315	281
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	466	1.252	–	–	–	–	1	446
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	37	262	–	–	–	–	–	–
Zins- und sonstige Ertragsforderungen	846	978	–	–	–	–	214	168
Dividendenforderungen	5	7	–	–	–	–	–	1
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	1	–
<b>Gesamtumlaufvermögen</b>	<b>83.546</b>	<b>107.290</b>	<b>14</b>	<b>14</b>	<b>17</b>	<b>16</b>	<b>60.582</b>	<b>50.399</b>
<b>KURZFRISTIGE PASSIVA</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	1	–	–	–	–	–	7
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Optionen	51	52	–	–	–	–	181	144
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	2	13
Swaptions	–	–	–	–	–	–	286	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	139	76	–	–	–	–	298	119
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	236	104
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen (Erläuterung 2)	158	3.209	–	–	–	–	–	1.156
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	29	28	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	72	89	–	–	–	–	9	6
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	9	9	5	5	2	2	7	6
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	8	7	–	–	–	–	1	1
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	1.011	1.152	–	1	–	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	91	105	9	8	15	14	37	45
<b>Verbindlichkeiten (ohne Nettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)</b>	<b>1.568</b>	<b>4.728</b>	<b>14</b>	<b>14</b>	<b>17</b>	<b>16</b>	<b>1.057</b>	<b>1.601</b>
<b>Gesamtvermögen, das Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist</b>	<b>\$ 81.978</b>	<b>\$ 102.562</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 59.525</b>	<b>\$ 48.798</b>

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	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
\$ 2.087 5	\$ 493 55	\$ 14.249 3.447	\$ 37.188 2.397	\$ 5 1.156	\$ 85 613	\$ 3.396 318	\$ 405 145	\$ 459 88	\$ 314 35
50.718	26.004	283.356 89	610.246 115 213	255.876	222.241	37.277	22.292	27.090	39.436
-	-	-	-	-	-	9	8	9	9
-	-	-	-	112	39	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	3	4.595	9.596	-	28	155	62	-	6
-	58	104	1.115	47	-	-	77	1	65
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
167	26	1.435	585	4.839	1.331	-	-	-	660
170	20	23	137	347	1.168	-	1	-	-
707	323	2.987	5.789	3.416	2.425	460	229	347	426
-	-	-	-	2	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>53.855</b>	<b>26.982</b>	<b>310.285</b>	<b>667.381</b>	<b>265.800</b>	<b>227.931</b>	<b>41.615</b>	<b>23.219</b>	<b>27.994</b>	<b>40.951</b>
-	3	-	2.161	578	-	-	-	-	-
-	-	330	654	190	45	127	96	-	-
-	-	-	-	-	-	6	14	-	3
-	-	657	-	19	26	8	12	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
29	-	2.265	2.105	41	1	174	13	39	5
-	50	1.281	501	72	85	89	-	27	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
214	393	42	3.263	341	8.157	-	199	-	669
16	11	28	36	59	57	3	4	-	-
49	23	114	160	119	109	18	24	1	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
24	21	20	34	18	14	19	17	6	5
5	-	7	11	9	9	1	-	-	-
488	-	2.408	2.346	5.179	212	10	14	44	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
38	48	164	179	75	89	42	57	29	36
<b>863</b>	<b>549</b>	<b>7.316</b>	<b>11.450</b>	<b>6.700</b>	<b>8.804</b>	<b>497</b>	<b>450</b>	<b>146</b>	<b>718</b>
<b>\$ 52.992</b>	<b>\$ 26.433</b>	<b>\$ 302.969</b>	<b>\$ 655.931</b>	<b>\$ 259.100</b>	<b>\$ 219.127</b>	<b>\$ 41.118</b>	<b>\$ 22.769</b>	<b>\$ 27.848</b>	<b>\$ 40.233</b>
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	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
\$ 3.674 2.793	\$ 443 2.328	\$ 3.114 1.944	\$ 3.354 4.175	\$ 3.512 4.353	\$ 5.680 1.911	\$ 418 1.374	\$ 398 1.924	€ 4.275 223	€ 8.537 -
492.770	620.688	445.353	504.382	199.783 314	282.688 415	74.454	81.267	32.770	45.985
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.755	-	-	-	142	531	-	-	-	252
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
378	310	4.176	7.530	1.797	1.652	827	110	8	4
-	-	2.194	1.417	837	1.236	437	128	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
120	-	5.009	-	3.851	3.757	3	129	-	-
122	7.311	392	3.116	2	45	4	97	-	-
6.174	7.501	2.276	2.542	1.218	1.841	800	792	431	593
2	9	4	9	41	55	9	7	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>513.788</b>	<b>638.590</b>	<b>464.462</b>	<b>526.525</b>	<b>215.850</b>	<b>299.811</b>	<b>78.326</b>	<b>84.852</b>	<b>37.707</b>	<b>55.371</b>
-	489	161	7	5	-	9	77	-	1
-	350	1.642	134	777	1.231	339	11	-	61
-	-	-	-	8	81	-	-	-	-
-	-	-	1.036	1.508	-	393	636	-	-
594	948	4.645	1.529	1.907	1.236	116	193	66	109
1.113	1.195	181	6	1.170	742	44	147	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
120	3.989	5.838	4.084	3.922	9.895	3	999	140	554
7	8	-	-	-	-	-	-	-	-
241	324	137	144	32	56	2	2	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
30	33	26	27	15	17	9	7	5	5
19	30	10	9	-	-	-	-	-	-
1.467	3.431	7.487	771	3.467	-	5	-	-	246
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
403	884	86	79	91	261	53	55	48	50
<b>3.994</b>	<b>11.681</b>	<b>20.213</b>	<b>7.826</b>	<b>12.902</b>	<b>13.519</b>	<b>973</b>	<b>2.127</b>	<b>259</b>	<b>1.026</b>
<b>\$ 509.794</b>	<b>\$ 626.909</b>	<b>\$ 444.249</b>	<b>\$ 518.699</b>	<b>\$ 202.948</b>	<b>\$ 286.292</b>	<b>\$ 77.353</b>	<b>\$ 82.725</b>	<b>€ 37.448</b>	<b>€ 54.345</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund <sup>^</sup>	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
	<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 104.039	\$ 154.233	\$ 30	\$ 31	\$ 9.344	\$ 18.081	\$ –	\$ 42
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	717.419	539.919	–	–	4.542	3.043	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	3.826.412	6.127.577	–	–	358.203	1.047.405	–	–
Verpfändete Anlagen	–	8.834	–	–	–	–	–	–
Optionen	28.173	31.628	–	–	382	868	–	–
Swapkontrakte	227.706	633.939	–	–	207	7.272	–	–
Swaptions	7	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	112.006	90.962	–	–	5.345	22.104	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	213.705	117.968	–	–	774	2.034	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	9.667	–	–	–	2.208	3.832	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	7.091	28.771	–	–	2	326	–	–
Zins- und sonstige Ertragsforderungen	54.650	78.282	–	–	3.647	9.183	–	–
Dividendenforderungen	3	26	–	–	9	31	–	–
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	1.002	–	–	–
<b>Gesamtumlaufvermögen</b>	<b>5.300.878</b>	<b>7.812.139</b>	<b>30</b>	<b>31</b>	<b>385.665</b>	<b>1.114.179</b>	<b>–</b>	<b>42</b>
<b>KURZFRISTIGE PASSIVA</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	101.514	138.953	–	–	–	90	–	–
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	266.033	520.034	–	–	836	3.962	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Optionen	127.700	33.532	–	–	177	920	–	–
Swapkontrakte	239.384	30.745	–	–	572	1.784	–	–
Swaptions	528	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	98.156	39.458	–	–	7.240	949	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	237.864	194.870	–	–	2.239	2.125	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen (Erläuterung 2)	14.790	146.253	–	–	2.415	22.201	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	4.149	6.299	–	–	27	21	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	243	341	5	5	22	52	–	5
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	279	407	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	23.005	48.497	–	–	61	47	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	3.399	6.670	25	26	177	170	–	37
<b>Verbindlichkeiten (ohne Nettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)</b>	<b>1.117.044</b>	<b>1.166.059</b>	<b>30</b>	<b>31</b>	<b>13.766</b>	<b>32.321</b>	<b>–</b>	<b>42</b>
<b>Gesamtnettovermögen, das Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist</b>	<b>\$ 4.183.834</b>	<b>\$ 6.646.080</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 371.899</b>	<b>\$ 1.081.858</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>
	<b>Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup> €</b>		<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund</b>		<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>		<b>Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup></b>	
	<b>Stand: 28. Februar 2022</b>	<b>Stand: 28. Februar 2021</b>	<b>Stand: 28. Februar 2022</b>	<b>Stand: 28. Februar 2021</b>	<b>Stand: 28. Februar 2022</b>	<b>Stand: 28. Februar 2021</b>	<b>Stand: 28. Februar 2022</b>	<b>Stand: 28. Februar 2021</b>
<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 47	\$ –	\$ 210	\$ 672	\$ 13.991	\$ 669	\$ –	\$ 60
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	43	–	101	61	14.317	7.455	22	15
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	9.435	–	215.108	370.018	728.758	724.287	11.416	11.887
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	97	264
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	270	–	4.267	4.100	21.946	19.726	50	52
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	21	–	–	–	1.272	545	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	230	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	163	497	3	–	–	–
Zins- und sonstige Ertragsforderungen	94	–	1.992	2.665	4.812	5.221	179	198
Dividendenforderungen	2	–	754	723	319	483	1	–
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	13	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Gesamtumlaufvermögen</b>	<b>9.925</b>	<b>–</b>	<b>222.825</b>	<b>378.736</b>	<b>785.418</b>	<b>758.386</b>	<b>11.765</b>	<b>12.476</b>
<b>KURZFRISTIGE PASSIVA</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	3	2.340	13	18.219	1	–
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	5	–	1.190	3.610	5.014	5.485	90	128
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	12	8
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	26	–	4.493	2.715	22.185	4.911	20	30
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	4.865	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	230	–	–	–	–	198
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	124	235	150	246	2	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	5	–	16	26	42	37	5	4
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	18	26	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	638	940	–	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	23	–	478	937	431	814	45	49
<b>Verbindlichkeiten (ohne Nettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)</b>	<b>59</b>	<b>–</b>	<b>7.190</b>	<b>10.829</b>	<b>32.700</b>	<b>29.712</b>	<b>175</b>	<b>417</b>
<b>Gesamtnettovermögen, das Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist</b>	<b>\$ 9.866</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 215.635</b>	<b>\$ 367.907</b>	<b>\$ 752.718</b>	<b>\$ 728.674</b>	<b>\$ 11.590</b>	<b>\$ 12.059</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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^		Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^u	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
\$ 1.313	\$ 94	\$ 112	\$ 26.279	£ 2.378	£ 1.020	\$ 293	\$ 43	\$ 222	\$ 200
3.553	3.431	6.058	2.510	154	121	564	862	1.344	453
1.054.614	1.085.315	1.283.066	973.160	70.140	74.495	174.022	188.791	21.064	25.159
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.058	109	1.296	-	-	-	-	16	453	590
2.784	-	-	-	-	-	-	-	-	-
203	962	-	9	8	49	143	3.528	120	21
502	-	1.640	1.252	59	38	202	48	191	69
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	55.814	60.507	-	-	788	570	15	315
-	23.825	-	-	-	-	-	-	-	-
2.369	2.676	3.603	2.644	982	1.067	1.417	1.455	126	128
3	7	1	8	3	3	2	2	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	7	41
1	-	2	-	-	-	-	-	-	-
<b>1.066.400</b>	<b>1.116.419</b>	<b>1.351.592</b>	<b>1.066.369</b>	<b>73.724</b>	<b>76.793</b>	<b>177.431</b>	<b>195.315</b>	<b>23.547</b>	<b>26.979</b>
-	30	189	3	-	-	10	-	-	-
380	-	2.408	196	-	-	280	4	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	81	11
592	1.514	-	332	-	-	-	-	68	-
1.269	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3.513	862	14	-	35	-	1.739	48	189	73
2.083	492	666	1.278	10	65	158	197	533	168
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	4.008	200.768	240.947	-	-	-	3.394	661	4.493
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
255	332	-	1	-	-	5	10	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
56	52	60	40	7	5	13	12	17	4
2	8	-	-	-	-	-	1	-	-
-	3.681	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
309	278	207	156	39	38	57	53	40	37
<b>8.459</b>	<b>11.257</b>	<b>204.312</b>	<b>242.953</b>	<b>91</b>	<b>108</b>	<b>2.262</b>	<b>3.719</b>	<b>1.589</b>	<b>4.786</b>
<b>\$ 1.057.941</b>	<b>\$ 1.105.162</b>	<b>\$ 1.147.280</b>	<b>\$ 823.416</b>	<b>£ 73.633</b>	<b>£ 76.685</b>	<b>\$ 175.169</b>	<b>\$ 191.596</b>	<b>\$ 21.958</b>	<b>\$ 22.193</b>
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^	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
\$ 420	\$ 1.441	\$ 246	\$ 85.706	\$ 3	\$ 6.012	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
351	6.695	-	75	14.599	4.340	571	384	20	26
242.628	590.514	-	-	1.522.073	427.083	51.853	51.652	10.165	11.653
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	22.750	10.441	154	105	80	223
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2.854	2.835	-	926	9.078	2.025	79	250	-	27
-	-	-	-	-	234	86	41	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	256	-	-	120.110	1.738	-	456	-	-
3	88	-	-	2.047	4.987	-	155	-	-
2.266	4.805	-	47	14.572	4.085	335	399	149	179
866	658	-	6	10	4	-	13	-	-
-	-	7	6	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	7	-	-	-	-	-
<b>249.388</b>	<b>607.292</b>	<b>253</b>	<b>86.766</b>	<b>1.705.249</b>	<b>460.949</b>	<b>53.078</b>	<b>53.455</b>	<b>10.414</b>	<b>12.108</b>
4	10.267	-	5.108	10.850	-	325	750	-	-
610	5.780	-	90	2.390	3.823	20	120	-	49
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	12	8
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4.074	3.975	-	1.932	17.153	1.778	145	346	196	29
-	723	-	-	1.309	379	81	79	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	61.079	1.070	-	-	-	198
-	-	-	-	37	16	-	-	-	-
119	188	-	-	998	272	46	38	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
17	35	-	8	83	22	7	10	5	3
1	1	-	-	107	32	1	1	-	-
1	111	-	79.242	3.099	188	-	12	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
166	491	253	386	71	84	67	79	38	47
<b>4.992</b>	<b>21.571</b>	<b>253</b>	<b>86.766</b>	<b>97.176</b>	<b>7.664</b>	<b>692</b>	<b>1.435</b>	<b>251</b>	<b>334</b>
<b>\$ 244.396</b>	<b>\$ 585.721</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 1.608.073</b>	<b>\$ 453.285</b>	<b>\$ 52.386</b>	<b>\$ 52.020</b>	<b>\$ 10.163</b>	<b>\$ 11.774</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Value Fund	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ –	\$ 16	\$ 1.406	\$ 7.852	\$ –	\$ 1	\$ 10.821	\$ 11.359
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	–	–	2.861	11.245	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	–	–	100.896	366.879	2.236	1.903	881.788	493.419
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	3.520	5.291	1	3	14	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	1.151	998	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	508	–	–	–	304	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	871	4.692
Zins- und sonstige Ertragsforderungen	–	–	1.093	4.080	–	–	–	–
Dividendenforderungen	–	–	50	1	1	1	887	109
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	2	7	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Gesamtumlaufvermögen</b>	<b>–</b>	<b>16</b>	<b>111.485</b>	<b>396.346</b>	<b>2.240</b>	<b>1.915</b>	<b>894.685</b>	<b>509.579</b>
<b>KURZFRISTIGE PASSIVA</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	2	–	–	–	1	–
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	–	–	630	1.037	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2)								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	4.556	1.896	29	–	641	1
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	1.426	1.176	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	508	–	–	–	304	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	5	19	–	–	567	281
Zahlbare Erfolgssprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	3	3	12	24	5	4	67	36
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	56	19
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	5	–	–	701	55
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	13	115	893	29	32	110	102
<b>Verbindlichkeiten (ohne Nettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)</b>	<b>–</b>	<b>16</b>	<b>7.254</b>	<b>5.050</b>	<b>63</b>	<b>36</b>	<b>2.447</b>	<b>494</b>
<b>Gesamtnettovermögen, das Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 104.231</b>	<b>\$ 391.296</b>	<b>\$ 2.177</b>	<b>\$ 1.879</b>	<b>\$ 892.238</b>	<b>\$ 509.085</b>
			<b>Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund</b>	<b>Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund</b>	<b>Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund<sup>^</sup></b>	<b>Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup></b>		
(in Tsd.)	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 6.591	\$ 3.461	\$ 1.384	\$ 1.728	\$ 2	\$ 3.086	\$ 246	\$ 216
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	536.471	789.786	42.210	37.033	1.618.990	635.560	14.292	10.927
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	113	141	20	16	145	1.741	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	445	–	–	–	1.602	–	–	278
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	111	367	36	–	4.006	5.155	1.500	–
Zins- und sonstige Ertragsforderungen	–	–	6	6	–	–	–	–
Dividendenforderungen	83	175	65	62	840	542	13	10
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	1	–	–	–
<b>Gesamtumlaufvermögen</b>	<b>543.814</b>	<b>793.930</b>	<b>43.721</b>	<b>38.845</b>	<b>1.625.586</b>	<b>646.084</b>	<b>16.051</b>	<b>11.431</b>
<b>KURZFRISTIGE PASSIVA</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	397	1.096	–	–	8.610	2	–	1
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2)								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	123	32	38	2	2.099	45	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen (Erläuterung 2)	2.179	–	207	–	1.602	–	–	313
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	391	546	38	31	694	246	7	4
Zahlbare Erfolgssprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	61	64	8	7	106	33	6	4
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	50	71	5	3	108	27	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	2.136	1.082	100	61	12.990	482	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	318	341	46	52	62	25	20	20
<b>Verbindlichkeiten (ohne Nettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)</b>	<b>5.655</b>	<b>3.232</b>	<b>442</b>	<b>156</b>	<b>26.271</b>	<b>860</b>	<b>33</b>	<b>342</b>
<b>Gesamtnettovermögen, das Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist</b>	<b>\$ 538.159</b>	<b>\$ 790.698</b>	<b>\$ 43.279</b>	<b>\$ 38.689</b>	<b>\$ 1.599.315</b>	<b>\$ 645.224</b>	<b>\$ 16.018</b>	<b>\$ 11.089</b>

Legg Mason ClearBridge Growth Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
\$ 58	\$ 74	\$ 57	\$ 57	\$ 1	\$ 28	\$ 18.115	\$ 2.979	\$ 30.686	\$ 20.383
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	207.470	203.955	1.756.332	1.810.957
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	4.603	1.202
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	6.645	-
-	-	-	-	-	-	3	45	2.327	8.722
-	-	-	-	-	-	-	-	-	1
-	-	-	-	-	-	193	192	1.081	1.268
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>58</b>	<b>74</b>	<b>57</b>	<b>57</b>	<b>1</b>	<b>28</b>	<b>225.781</b>	<b>207.171</b>	<b>1.801.674</b>	<b>1.842.533</b>
-	-	-	-	-	-	-	4	1	6.848
-	-	-	-	-	-	-	-	4.240	620
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	1.709	2.409
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	199	1.938	2.660
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	196	184	1.137	1.186
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	5	4	-	2	23	19	158	142
-	-	-	-	-	-	31	27	148	159
29	44	-	-	-	-	11.979	655	19.322	17.184
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
29	30	52	53	1	26	72	75	326	273
<b>58</b>	<b>74</b>	<b>57</b>	<b>57</b>	<b>1</b>	<b>28</b>	<b>12.301</b>	<b>1.163</b>	<b>28.979</b>	<b>31.481</b>
<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 213.480</b>	<b>\$ 206.008</b>	<b>\$ 1.772.695</b>	<b>\$ 1.811.052</b>
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
€ 13.373	€ 21.227	\$ 75	\$ 99	\$ 6.456	\$ -	\$ 93	\$ 26.924	\$ 12	\$ 848
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
648.298	607.551	2.667	2.726	164.133	-	933.530	1.248.814	88.460	90.103
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3.195	230	-	4	82	-	1.468	503	1	3
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
961	28.556	-	27	3.945	-	13.964	3.301	293	475
8.689	783	-	-	1.113	-	1.026	30.654	35	1.465
-	-	-	-	-	-	-	29	-	-
1.626	1.545	7	1	725	-	323	371	10	34
-	-	-	4	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>676.142</b>	<b>659.892</b>	<b>2.749</b>	<b>2.861</b>	<b>176.454</b>	<b>-</b>	<b>950.404</b>	<b>1.310.596</b>	<b>88.811</b>	<b>92.928</b>
2	6	-	-	14	-	56	8	341	-
340	250	-	-	-	-	1.170	1.310	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
438	558	30	-	332	-	1.791	611	5	3
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.204	50.148	-	69	2.075	-	14.230	12.581	99	1.554
-	1.725	-	-	-	-	-	-	-	-
549	457	2	-	186	-	747	963	91	91
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
53	50	5	4	14	-	68	71	12	9
69	50	-	-	42	-	130	164	15	15
1.968	1.534	-	-	368	-	15.803	5.816	249	94
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
95	101	47	63	29	-	200	202	64	66
<b>4.718</b>	<b>54.879</b>	<b>84</b>	<b>136</b>	<b>3.060</b>	<b>-</b>	<b>34.195</b>	<b>21.726</b>	<b>876</b>	<b>1.832</b>
<b>€ 671.424</b>	<b>€ 605.013</b>	<b>\$ 2.665</b>	<b>\$ 2.725</b>	<b>\$ 173.394</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 916.209</b>	<b>\$ 1.288.870</b>	<b>\$ 87.935</b>	<b>\$ 91.096</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>Δ</sup>		Legg Mason PCM US Equity Fund <sup>Δ</sup>		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund		Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ –	\$ –	\$ 23	\$ 23	€ 304	€ 181	\$ 69	\$ 1.094
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	4.550	–	–	–	27.834	33.006	25.897	30.642
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	162	7	34	43
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	6	–	–	–	52	–	539	234
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	52	2	3	–
Zins- und sonstige Ertragsforderungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	3	–	–	–	172	450	123	136
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	5	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Gesamtumlaufvermögen</b>	<b>4.564</b>	<b>–</b>	<b>23</b>	<b>23</b>	<b>28.576</b>	<b>33.646</b>	<b>26.665</b>	<b>32.149</b>
<b>KURZFRISTIGE PASSIVA</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	182	482
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	23	15	139	29
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen (Erläuterung 2)	5	–	–	–	51	–	214	55
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	29	29	30	36
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	4	–	–	–	5	6	8	7
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	3	1	5	3
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	49	120	20	285
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	21	–	23	23	79	107	184	215
<b>Verbindlichkeiten (ohne Nettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)</b>	<b>30</b>	<b>–</b>	<b>23</b>	<b>23</b>	<b>239</b>	<b>278</b>	<b>782</b>	<b>1.112</b>
<b>Gesamtnettovermögen, das Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist</b>	<b>\$ 4.534</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>€ 28.337</b>	<b>€ 33.368</b>	<b>\$ 25.883</b>	<b>\$ 31.037</b>

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund <sup>Δ</sup>		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>Δ</sup>		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund <sup>Δ</sup>		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund <sup>Δ</sup>	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 28	\$ 30	€ 76	€ 3.508	\$ 51	\$ 51	\$ 61	\$ 119
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	–	–	–	798	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
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 (Erläuterung 2)	–	–	–	819	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Zins- und sonstige Ertragsforderungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	–	–	–	44	–	–	–	–
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Gesamtumlaufvermögen</b>	<b>28</b>	<b>30</b>	<b>76</b>	<b>42.130</b>	<b>51</b>	<b>51</b>	<b>61</b>	<b>119</b>
<b>KURZFRISTIGE PASSIVA</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	–	33	–	–	–	–
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
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 (Erläuterung 2)	–	–	–	589	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	53	–	–	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	3	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	4	5	3	11	–	–	3	3
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	3	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	235	51	51	38	96
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	7	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	6	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	24	25	70	72	–	–	20	20
<b>Verbindlichkeiten (ohne Nettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)</b>	<b>28</b>	<b>30</b>	<b>76</b>	<b>1.787</b>	<b>51</b>	<b>51</b>	<b>61</b>	<b>119</b>
<b>Gesamtnettovermögen, das Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>€ –</b>	<b>€ 40.343</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^		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^	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
\$ 60	\$ 60	\$ 56	\$ 178 18	\$ 132	\$ 38	¥ 97.595	¥ 90.733	\$ 702	\$ 2.907
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	14.646	12.372	12.688	-	-	15.463	77.091
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	13	7	5	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	1.100	-	-	-	-	447
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	19	34	34	-	-	52	207
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
60	60	56	14.874	13.645	12.765	97.595	90.733	16.217	80.652
-	-	-	-	5	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	1	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	1.033	-	-	-	-	104
-	-	-	-	-	-	-	-	-	313
-	-	-	-	12	11	-	-	12	58
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	5	6	5	-	-	11	11
59	59	1	-	-	1	-	-	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	1	55	130	45	63	97.595	90.733	76	85
60	60	56	135	1.102	80	97.595	90.733	99	572
\$ -	\$ -	\$ -	\$ 14.739	\$ 12.543	\$ 12.685	¥ -	¥ -	\$ 16.118	\$ 80.080
Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund		Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund^	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
¥ -	¥ 1.340	\$ 1.270	\$ 5.338	\$ 433	\$ 196	\$ 836	\$ 762	\$ -	\$ 22
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	170.458	98.926	27.613	26.321	47.639	40.978	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	197	36	11	3	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	19.017	-	141	-	-	49	-	-
-	-	2.453	103	-	1	10	242	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	46	28	197	178	56	105	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	1.340	193.441	104.431	28.395	26.699	48.541	42.136	-	22
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	2.114	-	10	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	6.577	-	280	-	-	98	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	105	34	19	17	36	26	-	-
-	76	17	10	6	4	9	7	-	2
-	-	12	2	5	3	2	2	-	-
-	-	15.197	-	-	-	443	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	1.264	38	36	141	98	213	202	-	20
-	1.340	24.060	82	461	123	703	335	-	22
¥ -	¥ -	\$ 169.381	\$ 104.349	\$ 27.934	\$ 26.576	\$ 47.838	\$ 41.801	\$ -	\$ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Global Funds Plc	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	€ 1.581	€ 3.107	\$ 295.765	\$ 530.282
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	–	–	808.667	610.869
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):				
Anlagen	302.551	108.300	22.173.582	24.320.640
Verpfändete Anlagen	–	–	683	9.410
Optionen	–	–	29.019	33.641
Swapkontrakte	–	–	276.166	675.948
Swaptions	–	–	2.791	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	281	–	186.626	178.667
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	230.923	131.917
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Differenzkontrakten	–	–	–	93
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	86	–	269.885	171.451
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	26	–	35.931	127.759
Zins- und sonstige Ertragsforderungen	–	–	124.101	154.736
Dividendenforderungen	36	34	8.925	8.075
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	34	58
Sonstige Vermögenswerte	–	–	1.015	–
<b>Gesamtumlaufvermögen</b>	<b>304.561</b>	<b>111.441</b>	<b>24.444.113</b>	<b>26.953.546</b>
<b>KURZFRISTIGE PASSIVA</b>				
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	125.131	186.999
Marginkonten und eingeschränkte Barmittel (Anmerkung 8)	–	–	294.640	559.727
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2)				
Optionen	–	–	129.683	36.896
Swapkontrakte	–	–	248.273	37.765
Swaptions	–	–	2.055	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	69	–	191.714	72.200
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	266.598	211.755
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	594
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen (Erläuterung 2)	86	–	394.100	784.346
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	288	2.667
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	99	30	12.569	14.011
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	3	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	34	20	1.654	1.585
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	2	–	1.208	1.177
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	662	–	136.182	192.552
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	9
Dividende zahlbar	–	–	–	7
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	19	20	11.337	17.484
<b>Verbindlichkeiten (ohne Nettovermögen, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)</b>	<b>971</b>	<b>70</b>	<b>1.815.435</b>	<b>2.119.774</b>
<b>Gesamtnettovermögen, das Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zum beizulegenden Zeitwert zuzurechnen ist</b>	<b>€ 303.590</b>	<b>€ 111.371</b>	<b>\$ 22.628.678</b>	<b>\$ 24.833.772</b>

Die mit „–“ gekennzeichneten Beträge betragen entweder 0 USD/0 EUR/0 ¥/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 ¥/1.000 GBP

Die Euro-Zahlen 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, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup>, Der Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup> und der Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup> wurden in US-Dollar in der Gesamtsumme für die Legg Mason Global Funds Plc für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 zum USD/EUR-Abschlusskurs von 0 umgerechnet.8919 (28. Februar 2021: 0.8288).

Die Yen-Beträge für den Legg Mason Congruix Japan Equity Fund<sup>^</sup> und den Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> wurden in US-Dollar umgerechnet, und zwar in der Gesamtsumme für die Legg Mason Global Funds Plc für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 zum USD/JPY-Abschlusskurs von 114.9650 (28. Februar 2021: 106.5950).

Die britischen Pfund-Zahlen für den Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup> wurden in US-Dollar in der Gesamtsumme für die Legg Mason Global Funds Plc für das am 28. Februar 2022 zu Ende gegangene Geschäftsjahr zum USD/GBP-Abschlusskurs von 0,7454 umgerechnet (28. Februar 2021: 0,7178).

μ Mit Wirkung vom 14. April 2021 hat der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup> den Handel eingestellt.

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

β Mit Wirkung zum 1. Juni 2021 stellte der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

ð Mit Wirkung zum 1. Dezember 2021 begann der Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup> mit dem Handel.

ϵ Mit Wirkung zum 10. Januar 2022 begann der Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup> mit dem Handel.

<sup>^</sup> Nicht für den Verkauf an die Öffentlichkeit in Hongkong zugelassen. Die mit „–“ gekennzeichneten Beträge betragen entweder 0 USD/0 EUR/0 ¥/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 ¥/1.000 GBP

Im Namen des Vorstands

Direktor

Direktor

16. Juni 2022

# Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2022			28. Februar 2021			29. Februar 2020		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
<b>Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 131.265	1.197	109,62	\$ 153.935	1.404	109,61	\$ 158.319	1.445	109,56
Klasse A USD, ausschüttend (D)	640.232	640.245	1,00	624.449	624.463	1,00	745.435	745.135	1,00
Klasse B USD, thesaurierend	73	1	104,91	73	1	104,90	221	2	104,87
Klasse B USD, ausschüttend (D)	–	–	–	300	300	1,00	–	–	–
Klasse C USD, thesaurierend	5.317	51	103,69	5.098	49	103,68	5.263	51	103,67
Klasse C USD, ausschüttend (D)	140	140	1,00	235	235	1,00	374	374	1,00
Klasse X USD, ausschüttend (D)	141.538	141.540	1,00	97.422	97.424	1,00	86.585	86.583	1,00
Klasse A (G) USD, thesaurierend	488	4	109,85	491	4	109,84	499	5	109,79
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	264	264	1,00	285	285	1,00	404	404	1,00
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	7	7	1,00	42	42	1,00	144	144	1,00
<b>Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 35.416	245	144,44	\$ 47.716	316	151,06	\$ 73.304	497	147,58
Klasse A USD, ausschüttend (D)	80.771	775	104,18	87.128	789	110,48	141.618	1.294	109,46
Klasse B USD, ausschüttend (D)	–	–	–	104,24	–	–	–	–	–
Klasse C USD, thesaurierend	8.586	64	133,90	14.666	104	140,75	9.868	71	138,19
Klasse C USD, ausschüttend (D)	3.580	34	104,21	8.392	76	110,52	5.715	52	109,49
Klasse E USD, thesaurierend	2.222	22	99,25	5.613	54	104,43	1.348	13	102,63
Klasse F USD, thesaurierend	58.355	445	131,23	84.508	619	136,50	43.800	330	132,62
Klasse F USD, ausschüttend (D)	14.031	137	102,43	19.500	179	108,64	7.147	66	107,62
Klasse X USD, thesaurierend	2.384	21	114,69	4.213	35	119,38	3.239	28	116,08
Klasse X USD, ausschüttend (D)	298	3	101,33	341	3	107,49	476	4	106,50
Klasse Premier USD, thesaurierend	19.841	173	114,85	21.197	178	119,17	27.203	236	115,50
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.570	22	105,86	4.329	32	110,80	1.155	10	108,78
Klasse LM USD, thesaurierend	3.558	37	97,13	–	–	–	–	–	–
Klasse GA USD, thesaurierend	1.232	9	142,64	1.462	10	148,76	1.449	10	144,93
Klasse GE USD, thesaurierend	60	–	133,11	63	–	139,67	83	1	136,88
<b>Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 122.223	748	163,35	\$ 199.266	1.165	171,09	\$ 168.516	1.006	167,57
Klasse A USD, ausschüttend (D)	47.095	412	114,18	55.980	461	121,54	51.550	426	121,11
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	7.597	79	95,64	29.227	282	103,46	1.524	15	105,04
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	6.011	89	93,32	1.749	22	101,27	5.306	78	103,86
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.452	12	104,74	9.308	70	110,74	5.446	45	109,90
Klasse B USD, ausschüttend (D)	86	1	114,12	218	2	121,48	195	2	120,93
Klasse C USD, thesaurierend	23.167	156	148,35	36.691	235	156,16	23.443	153	153,71
Klasse C USD, ausschüttend (D)	10.764	94	114,99	14.460	118	122,39	11.847	97	121,97
Klasse E USD, thesaurierend	21.829	180	121,50	40.138	314	128,02	23.217	184	126,14
Klasse F USD, thesaurierend	675.110	5.237	128,91	448.724	3.348	134,01	459.375	3.526	130,28
Klasse F USD, ausschüttend (D)	11.889	111	107,08	15.158	133	113,97	9.964	88	113,58
Klasse X USD, thesaurierend	8.356	70	119,85	29.448	236	124,81	42.091	346	121,54
Klasse X USD, ausschüttend (D)	5.357	54	99,58	4.093	39	106,00	1.655	16	105,63
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.903	26	98,90	17.281	138	103,98	3.117	28	102,61
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	–	–	–	421	4	97,03	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	491.421	3.179	154,57	658.972	4.111	160,28	598.264	3.849	155,43
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	2.929	27	108,14	1.627	14	115,10	51.121	445	114,80
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	22.936	185	110,65	79.619	570	115,80	71.846	572	113,82
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	22.527	242	93,11	–	–	–	–	–	–
Klasse LM EUR, thesaurierend	1.726	12	125,79	2.000	14	120,86	2.404	17	127,75
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	27	–	150,84	73	–	156,34	27	–	152,63
Klasse A (G) USD, thesaurierend	200	1	165,90	209	1	173,50	923	5	169,67
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1.106	10	115,07	1.267	10	122,48	1.340	11	122,06
Klasse B (G) Ausschüttende USD (D)	4	–	115,09	4	–	122,50	4	–	122,07
Klasse L (G) USD, thesaurierend	234	2	154,01	246	2	161,87	247	2	159,09
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1.141	10	115,09	1.239	10	122,50	1.221	10	122,08
<b>Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund</b>									
Klasse A USD, ausschüttend (D)	€ 50	–	117,82	€ 258	2	132,74	€ 236	2	120,04
Klasse A EUR, ausschüttend (D)	1.190	11	108,97	1.293	11	114,08	1.353	12	112,77
Klasse C USD, ausschüttend (D)	65	1	117,09	162	1	132,39	161	1	120,34
Klasse F EUR, ausschüttend (Q)	1	–	124,95	1	–	130,68	1	–	129,00
Klasse Premier EUR, thesaurierend	1.825	17	106,44	1.181	11	110,48	868	8	108,30
Klasse LM EUR, thesaurierend	145.011	1.317	110,07	106.972	939	113,90	119.975	1.078	111,32
Klasse GA EUR, thesaurierend	741	6	132,69	907	7	138,44	976	7	136,40
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	391	3	120,65	431	3	126,21	441	4	124,82
Klasse GE EUR, thesaurierend	112	1	123,83	118	1	129,98	117	1	128,83
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 23.402	144	162,96	\$ 7.428	46	161,04	\$ 3.640	24	148,98
Klasse A USD, ausschüttend (D)	7.876	90	87,34	3.027	34	89,16	3.560	41	86,11
Klasse A USD, ausschüttend (M)	252	3	92,27	194	2	94,22	259	3	90,97
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	207	2	91,74	323	3	95,63	370	4	93,51
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	30	–	89,13	33	–	93,23	66	1	92,19
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.481	9	142,92	817	5	142,45	893	6	133,53
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	452	38	92,09	461	38	95,29	519	43	93,64
Klasse B USD, thesaurierend	13	1	156,15	28	–	154,71	110	1	143,50
Klasse B USD, ausschüttend (D)	64	1	87,30	99	1	89,14	93	1	86,09
Klasse C USD, thesaurierend	7.053	47	151,17	3.374	22	150,15	1.275	9	139,60
Klasse C USD, ausschüttend (D)	4.005	46	87,30	1.842	21	89,13	2.201	26	86,08
Klasse F USD, thesaurierend	3.094	29	108,26	2.234	21	106,56	1.425	15	98,18
Klasse Premier USD, thesaurierend	1	–	98,57	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	1	–	97,46	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	268	2	115,77	–	–	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend	757	5	161,24	748	5	159,33	845	6	147,53
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	3.274	37	88,89	4.507	50	90,76	4.741	54	87,65
Klasse B (G) Ausschüttende USD (D)	5	–	88,98	5	–	90,85	5	–	87,75
Klasse L (G) USD, thesaurierend	890	6	149,79	884	6	148,76	885	6	138,43
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	135	2	88,90	161	2	90,76	154	2	87,65
<b>Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 12.161	74	165,33	\$ 17.681	103	172,05	\$ 23.852	144	165,19
Klasse A USD, ausschüttend (D)	15.078	137	109,94	30.274	258	117,46	43.654	376	116,09
Klasse A USD, ausschüttend (M)	2.287	25	93,16	2.766	28	99,54	3.272	33	98,40
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	879	10	86,54	1.188	13	94,09	1.462	15	95,21
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	4.100	26	142,38	7.761	43	149,53	7.931	49	145,60
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	3.395	38	79,05	4.956	48	85,25	5.568	59	85,46
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	252	3	67,69	337	4	73,99	491	6	75,18
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	581	5	91,73	655	5	98,21	740	6	98,15
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	110	10	84,03	119	10	90,69	121	10	92,23
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.033	1.563	0,90	989	1.353	0,97	1.035	1.455	0,99
Klasse B USD, thesaurierend	–	–	–	34	–	161,33	33	–	155,29
Klasse B USD, ausschüttend (D)	531	5	109,92	506	4	117,46	710	6	116,11
Klasse C USD, thesaurierend	6.780	45	149,55	8.648	55	156,41	10.470	69	150,92
Klasse C USD, ausschüttend (D)	10.758	98	109,90	12.439	106	117,45	16.220	140	116,08
Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	451	9	788,67	1.219	21	882,77	1.549	26	925,46
Klasse E USD, thesaurierend	1.505	11	131,41	1.995	14	137,57	2.669	20	132,88
Klasse E USD, ausschüttend (D)	661	7	91,53	784	8	97,82	811	8	96,67
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	125	1	106,18	268	2	112,17	603	5	109,90
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	36	–	80,64	42	–	86,96	50	1	87,17
Klasse F USD, thesaurierend	\$ 20.347	133	153,16	\$ 20.252	128	158,42	\$ 3.602	24	151,20

## Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2022			28. Februar 2021			29. Februar 2020		
	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:
<b>Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund (Fortsetzung)</b>									
Klasse F USD, ausschüttend (D)	5.501	60	91,53	7.007	72	97,83	11.793	122	96,70
Klasse X USD, ausschüttend (D)	1.399	15	91,68	2.769	28	97,99	3.241	33	96,85
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	76	1	87,81	85	1	94,05	117	1	93,98
Klasse Premier USD, thesaurierend	44.980	243	185,22	53.511	280	191,11	121.997	670	181,95
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	12.098	106	113,85	8.814	72	121,64	21.905	182	120,24
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	3.442	28	111,13	1.972	15	115,93	1.842	16	112,25
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	4.740	30	141,32	5.709	32	147,15	5.982	38	142,07
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	69	1	76,38	80	1	82,36	78	1	82,56
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	49.523	266	138,99	67.295	336	143,71	64.023	361	138,31
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	2.899	24	88,49	25.240	191	94,73	48.664	401	94,69
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	205	2	77,65	185	2	83,56	1.129	10	83,96
Klasse Premier GBP ausschüttend (Q) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	43	–	90,86
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	3.664	121	127,30	7.095	203	131,13	7.472	233	125,91
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	93.108	1.251	102,46	80.077	947	109,85	71.162	994	109,92
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	148	1	145,04	283.119	1.361	149,34	249.697	1.360	143,15
<b>Legg Mason Western Asset US High Yield Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 25.055	129	194,84	\$ 22.041	113	194,57	\$ 21.792	122	178,18
Klasse A USD, ausschüttend (D)	34.889	446	78,15	34.730	428	81,22	36.152	465	77,78
Klasse A USD, ausschüttend (M)	2.271	24	94,27	1.568	16	97,97	1.572	17	93,82
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	2.424	30	81,29	7.832	91	85,88	993	12	83,46
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1.414	16	79,66	1.543	15	83,50	1.376	15	81,10
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	–	–	93,84	–	–	–	–	–	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	520	907	0,78	548	891	0,82	412	715	0,80
Klasse B USD, thesaurierend	338	2	192,79	104	1	193,00	13	–	177,18
Klasse B USD, ausschüttend (D)	106	1	78,17	90	1	81,26	1.040	13	77,81
Klasse C USD, thesaurierend	3.170	17	185,96	3.766	20	186,64	4.137	24	171,77
Klasse C USD, ausschüttend (D)	2.748	35	78,16	2.914	36	81,24	3.987	51	77,80
Klasse E USD, thesaurierend	3.837	22	175,71	3.706	21	176,53	3.752	23	162,63
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1.106	11	97,67	1.123	11	101,51	2.765	28	97,22
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	413	3	105,40	319	2	106,80	272	2	99,79
Klasse F USD, thesaurierend	7.467	42	178,39	6.330	36	177,08	1.514	9	161,20
Klasse F USD, ausschüttend (D)	226	2	93,01	42	–	96,61	1.048	11	92,72
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	2	–	109,71	1	–	101,04
Klasse Premier USD, thesaurierend	101.736	549	185,21	67.635	369	183,40	34.426	207	166,53
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	1	–	111,69	972	6	110,82	822	6	101,84
Klasse LM USD, thesaurierend	45.730	232	197,50	45.078	232	194,69	25.201	143	176,00
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	23.015	267	86,21	15.196	170	89,59	24.780	289	85,79
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	51	–	113,46	130	1	112,05	11	–	102,83
Klasse A (G) USD, thesaurierend	211	1	199,51	238	1	198,94	294	2	181,91
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1.243	16	77,53	1.335	17	80,58	1.537	20	77,17
Klasse L (G) USD, thesaurierend	185	1	185,19	186	1	185,59	190	1	170,55
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	795	10	77,52	827	10	80,57	922	12	77,16
Klasse GF USD, thesaurierend	149	1	177,45	148	1	176,59	184	1	161,15
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 5.371	32	170,12	\$ 8.296	44	186,70	\$ 3.616	21	176,11
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1.415	14	99,47	2.117	19	111,90	2.213	20	108,56
Klasse A USD, ausschüttend (M)	908	10	89,94	1.147	11	101,20	1.277	13	98,18
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	10	–	67,72	65	1	77,88	–	–	17,54
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	219	2	127,14	295	2	140,72	135	1	134,44
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	293	4	67,99	397	4	77,14	427	5	75,79
Klasse A GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	44	–	84,50	52	–	95,23	46	–	93,14
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	9	17	0,70	5	8	0,80	88	152	0,81
Klasse C USD, thesaurierend	243	2	154,50	410	2	170,41	386	2	161,54
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1.023	10	99,42	1.548	14	111,85	1.874	17	108,51
Klasse E USD, ausschüttend (D)	413	5	84,99	732	8	95,61	1.960	21	92,78
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	10	–	88,88	12	–	99,00	11	–	95,37
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	15	–	75,92	69	1	86,16	21	–	84,67
Klasse F USD, thesaurierend	67	–	151,93	98	1	165,41	173	1	155,02
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	15	–	82,01	17	–	92,43	16	–	90,40
Klasse Premier USD, thesaurierend	93	1	93,44	101	1	101,47	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.097	15	123,82	3.388	21	135,63	1.504	11	128,44
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	79	1	73,50	46	–	82,85	21	–	81,06
Ausschüttende LM-Klasse in USD (M) (abgesichert)	25.470	288	88,50	–	–	–	–	–	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend	494	3	178,03	750	4	194,69	787	4	183,30
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	814	9	89,17	995	10	100,32	1.183	12	97,32
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1.125	7	165,24	1.236	7	181,62	1.275	7	171,85
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	891	10	89,14	993	10	100,29	1.782	18	97,31
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 24	–	106,83	\$ 1	–	119,07	\$ 1	–	113,96
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1	–	90,49	1	–	103,39	1	–	100,73
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	5	–	89,98	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.928	18	94,23	559	4	104,70	381	3	99,71
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	25.890	286	90,51	39.672	384	103,43	42.161	418	100,79
<b>Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 8.812	49	178,94	\$ 10.843	58	186,88	\$ 10.569	61	173,88
Klasse A USD, ausschüttend (D)	7.374	101	72,88	9.793	124	78,92	11.164	147	76,09
Klasse A USD, ausschüttend (M)	11.065	137	80,65	13.355	153	87,32	15.940	189	84,19
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	10.681	145	73,86	7.846	97	81,26	4.200	52	80,29
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	7.679	122	86,67	9.349	127	95,70	9.438	151	95,88
Klasse A EUR, thesaurierend	2.029	16	113,76	2.039	15	110,41	2.491	20	112,26
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	65	1	74,80	637	6	81,71	555	6	79,97
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2.177	4.140	0,71	10.208	17.351	0,78	2.293	4.095	0,78
Klasse B USD, thesaurierend	72	–	175,72	75	–	183,97	99	1	171,60
Klasse B USD, ausschüttend (D)	201	3	72,72	341	4	78,75	337	4	75,93
Klasse C USD, thesaurierend	1.483	9	170,46	1.663	9	178,91	1.734	10	167,29
Klasse C USD, ausschüttend (D)	2.962	41	72,56	4.827	61	78,57	6.063	80	75,76
Klasse E USD, thesaurierend	1.249	8	156,17	1.086	7	164,08	1.334	9	153,60
Klasse E USD, ausschüttend (D)	207	2	89,34	224	2	96,74	3	–	93,27
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	111	1	102,81
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	18	–	74,28	20	–	81,17	38	–	79,37
Klasse F USD, thesaurierend	2.036	13	161,10	396	2	167,08	538	3	154,40
Klasse F USD, ausschüttend (D)	965	11	84,81	912	10	91,86	940	11	88,59
Klasse X USD, ausschüttend (D)	5.807	61	95,06	3.840	37	102,93	2.799	28	99,23
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	4.406	43	77,04	3.119	27	83,60	1.914	18	81,56
Klasse Premier USD, thesaurierend	6.086	29	212,96	14.056	64	220,31	24.054	118	203,09
Premier-Klasse, ausschüttend USD (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	1.975	23	85,33
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.770	12	126,57	1.829	11	132,11	2.507	18	123,53
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	35	–	83,77	39	–	90,91	35	–	88,70
Klasse A (G) USD, thesaurierend	2.374	13	182,46	2.521	13	190,27	2.469	14	176,79
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1.240	17	72,88	2.197	28	78,93	2.316	30	76,10
Klasse L (G) USD, thesaurierend	507	3	169,39	605	3	177,52	638	4	165,78
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	678	9	72,89	742	9	78,93	919	12	76,11

## Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2022			28. Februar 2021			29. Februar 2020		
	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:
<b>Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 3.549	23	155,66	\$ 1.881	13	149,48	\$ 1.774	12	143,51
Klasse A USD, ausschüttend (A)	4.844	36	133,96	5.428	42	128,65	6.067	48	125,31
Klasse B USD, thesaurierend	28	-	108,80	59	1	104,74	57	1	100,82
Klasse C USD, thesaurierend	93	1	99,75	-	-	-	71	1	105,91
Klasse C USD, ausschüttend (A)	843	6	130,28	511	4	125,73	505	4	122,44
Klasse F USD, thesaurierend	29	-	100,15	-	-	-	-	-	-
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	7.094	63	100,66	-	-	-	-	-	-
Klasse LM USD, thesaurierend	42.980	369	116,57	40.849	369	110,79	38.826	369	105,30
Klasse A (G) USD, thesaurierend	5	-	163,47	5	-	156,66	5	-	150,09
Klasse A (G) Ausschüttende USD (A)	45	-	130,79	51	-	125,55	57	-	122,31
Klasse L (G) USD, thesaurierend	-	-	-	-	-	-	132	1	140,44
Klasse L (G) Ausschüttende USD (A)	15	-	120,50	14	-	116,06	14	-	113,02
<b>Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 39.106	241	162,46	\$ 44.824	269	166,82	\$ 52.900	329	160,69
Klasse A USD, ausschüttend (D)	6.592	61	108,04	7.638	67	113,74	10.398	92	112,49
Klasse A USD, ausschüttend (M)	12.847	129	99,50	20.694	198	104,75	27.023	261	103,60
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	45.247	604	74,94	81.474	1.015	80,31	68.262	841	81,14
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	21.798	356	84,24	33.416	480	90,52	31.171	520	92,03
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	330	3	98,04	840	8	101,76	350	3	99,57
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	5.325	405	83,16	8.143	592	89,20	17.638	1.366	90,13
Klasse A EUR, thesaurierend	2.698	11	228,02	4.757	18	217,73	5.202	21	229,25
Klasse A EUR, ausschüttend (abgesichert)	1.734	14	107,09	2.884	22	110,91	2.203	18	108,23
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	541	4	115,43	665	5	113,12	679	5	122,98
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	10.989	951	90,29	23.309	1.882	96,06	20.206	1.614	97,57
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1.296	1.162	1,51	1.649	1.416	1,55	1.809	1.679	1,50
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2.389	4.143	0,78	3.984	6.341	0,84	2.115	3.466	0,85
Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	940	1.545	0,82	987	1.514	0,87	3.251	4.919	0,92
Klasse B USD, thesaurierend	62	-	156,90	64	-	161,52	113	1	155,97
Klasse B USD, ausschüttend (D)	19	-	107,96	112	1	113,66	137	1	112,42
Klasse C USD, thesaurierend	1.697	11	151,27	2.210	14	156,11	2.515	17	151,12
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1.306	12	108,06	2.241	20	113,77	2.867	25	113,53
Klasse E USD, thesaurierend	704	5	130,59	906	7	134,91	557	4	130,72
Klasse E USD, ausschüttend (D)	199	2	99,32	237	2	104,56	230	2	103,42
Klasse F USD, thesaurierend	2.699	18	148,29	11.537	76	151,67	6.703	46	145,51
Klasse F USD, ausschüttend (D)	654	7	99,38	689	7	104,62	500	5	103,47
Klasse X USD, thesaurierend	221	2	110,48	7.895	70	112,93	299	3	99,72
Klasse X USD, ausschüttend (M)	3.705	39	95,65	3.672	36	100,69	2.490	25	99,59
Klasse X EUR, thesaurierend	-	-	-	570	5	98,39	-	-	-
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	268	2	99,36	297	2	102,39	-	-	-
Klasse Premier USD, thesaurierend	72.450	409	177,15	80.687	446	180,73	50.697	293	172,96
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	-	-	-	170	2	100,83	88	1	111,82
Klasse Premier EUR, thesaurierend	130.405	732	158,82	130.921	721	150,58	121.577	699	157,51
Klasse Premier EUR, ausschüttend (abgesichert)	8.686	65	119,68	6.424	43	123,15	5.180	39	119,39
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	77.670	678	102,12	83.139	688	100,09	80.602	671	108,84
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M)	12.221	102	107,28	12.865	102	104,95	12.724	102	113,45
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M)	92	1	111,51	225	1	112,95	169	1	121,21
Klasse LM USD, thesaurierend	43.801	230	190,55	46.784	242	193,24	43.279	235	183,83
LM-Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	1.103	10	96,42	-	-	-	-	-	-
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 22.239	176	126,60	\$ 32.132	247	130,34	\$ 1.468	12	127,36
Klasse A USD, ausschüttend (M)	6.851	64	106,79	10.545	96	109,95	554	5	107,64
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	9.882	91	96,55	12.195	101	100,26	693	6	99,10
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	22.680	2.221	96,73	312	26	100,13	-	-	-
Klasse A SEK ausschüttend (M) (abgesichert)	1	-	96,70	1	-	100,01	-	-	-
Klasse B USD, thesaurierend	-	-	-	335	3	110,43	328	3	108,17
Klasse C USD, thesaurierend	8.415	71	118,83	5.301	43	122,95	700	6	120,73
Klasse C USD, ausschüttend (M)	519	5	105,71	416	4	109,37	302	3	107,42
Klasse E USD, thesaurierend	3.238	29	111,98	3.972	34	115,98	491	4	114,00
Klasse E USD, ausschüttend (D)	4.983	49	101,56	5.448	52	105,19	1.152	11	103,39
Klasse F USD, thesaurierend	7.631	60	126,78	13.216	102	130,00	194	2	126,52
Klasse F USD, ausschüttend (D)	1.596	16	97,66	100	1	100,48	-	-	-
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	9.247	85	96,86	2.968	25	100,14	-	-	-
Klasse Premier USD, thesaurierend	27.247	197	138,22	23.015	163	141,38	1.996	15	137,25
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	31.220	274	101,73	37.172	294	104,95	3.172	28	103,06
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	189	2	94,28	514	4	97,87	191	2	96,94
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	2	-	130,72	54	-	133,95	118	1	130,96
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1.278	9	101,92	2.453	17	105,05	1.951	15	103,56
Ausschüttende Klasse S USD (M) Plus (e)	10.106	100	101,50	22.076	211	104,79	12.698	123	102,93
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	55	1	97,58	-	-	-	-	-	-
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	3.050	29	93,27	4.128	35	97,13	3.330	31	96,54
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	262.829	2.023	96,86	340.795	2.442	100,19	247.197	1.945	99,11
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	10.991	155	97,63	-	-	-	-	-	-
Ausschüttende AUD der Klasse S (M) (abgesichert) Plus (e)	-	-	-	1.551	20	99,63	-	-	-
<b>Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>A</sup></b>									
Klasse A USD, ausschüttend (A)	\$ 1	-	102,91	\$ 1	-	107,12	\$ 57	1	107,42
Klasse X USD, thesaurierend	2.746	24	115,64	173	1	119,24	102	1	117,22
Klasse Premier USD, thesaurierend	42.779	273	156,86	119.487	741	161,26	97.723	618	158,05
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	39.201	315	110,84	44.983	324	114,96	57.901	460	114,12
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	3	-	96,15	-	-	-	-	-	-
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert)	6.128	84	101,57	10.056	126	110,51	4.962	73	108,94
Klasse LM USD, thesaurierend	4.122	37	109,96	3.845	34	112,59	2.954	27	109,91
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.442	23	95,23	-	-	-	-	-	-
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	105.526	1.177	113,65	107.747	1.177	116,50	100.259	1.177	114,34
<b>Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>A</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 3.171	22	142,04	\$ 1.759	12	149,41	\$ 3.147	22	143,70
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	408	3	124,74	663	4	132,35	547	4	129,02
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	53	1	94,35	-	-	-	-	-	-
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	63	1	94,58	-	-	-	-	-	-
Klasse LM USD, thesaurierend	69.126	411	168,26	75.669	432	174,98	75.467	454	166,28
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	4.532	43	93,68	4.634	39	98,28	-	-	-
<b>Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund</b>									
Klasse A EUR, ausschüttend (D)	€ 48	-	96,68	€ 50	-	101,58	€ 259	3	101,31
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	6	-	97,70	-	-	-	-	-	-
Klasse Premier EUR, thesaurierend	-	-	-	-	-	-	670	6	103,79
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	-	-	-	-	-	-	211	2	101,71
Klasse LM EUR, thesaurierend	37.393	205	182,42	45.868	248	184,67	46.826	266	176,36
Klasse LM EUR, ausschüttend (Q)	-	-	-	8.426	82	102,24	9.137	90	102,03
<b>Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>A</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 788.243	5.937	132,77	\$ 1.113.975	7.721	144,28	\$ 1.259.519	8.988	140,13
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	200.496	2.254	88,97	306.584	3.054	100,39	440.689	4.332	101,73
Klasse A USD, ausschüttend (S)	41.551	408	101,94	69.201	610	113,39	110.113	970	113,49

# Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2022			28. Februar 2021			29. Februar 2020		
	Gesamt-NI-W (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NI-W/Anteil:	Gesamt-NI-W (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NI-W/Anteil:	Gesamt-NI-W (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NI-W/Anteil:
<b>Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup> (Fortsetzung)</b>									
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	\$ 1.348	19	98,55	\$ 3.476	42	107,62	\$ 7.586	110	106,03
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	25.043	395	87,37	47.368	621	99,08	58.259	878	101,85
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	17.146	142	110,87	24.026	179	121,93	25.222	202	120,46
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	1.234	55	141,25	2.098	91	149,98	2.269	110	143,52
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	4.928	302	103,16	5.411	309	113,75	5.228	321	113,54
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	364.733	2.837	114,66	527.701	3.474	125,91	677.301	4.946	124,04
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	7.824	73	96,24	11.415	95	99,74	16.676	137	110,46
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	8.555	89	85,34	15.400	131	97,33	32.274	292	100,01
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	7.304	70	93,13	13.660	108	104,74	27.380	233	106,28
Klasse A GBP, thesaurierend	508	3	142,50	679	3	149,10	557	3	157,36
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	22.692	141	120,28	80.106	438	131,16	100.877	605	130,06
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	14.437	130	82,55	24.353	187	93,46	35.547	289	95,88
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	80	7	86,91	821	65	98,41	839	65	101,12
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus (e)	4	–	–	–	–	–	5	–	–
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	3.282	297	104,81	65.000	4.774	114,96	63.521	5.375	100,35
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	23.139	24.857	1,26	23.348	22.675	1,37	41.277	42.863	1,34
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	39.579	61.771	0,87	64.576	87.738	0,98	98.354	137.007	1,00
Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus (e)	34	50	0,92	–	–	–	–	–	–
Klasse B USD, thesaurierend	126	1	119,54	564	4	130,23	551	4	126,80
Klasse C USD, thesaurierend	49.624	416	119,34	77.546	595	130,34	86.190	678	127,22
Klasse C USD, ausschüttend (S)	5.973	59	100,90	8.547	76	112,24	11.422	102	112,29
Klasse A JPY ausschüttend (M) Plus (e)	179	2	8.945,99	202	2	9.360,01	205	2	9.597,54
Klasse A NOK, thesaurierend (abgesichert)	7.423	687	95,32	3.335	278	103,89	1.340	122	103,16
Klasse E USD, thesaurierend	20.437	174	117,72	35.437	275	128,70	44.635	355	125,75
Klasse E USD, ausschüttend (S)	2.115	21	100,63	2.926	26	111,93	4.480	40	111,97
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	4.390	38	102,88	9.964	73	113,66	11.825	95	112,62
Klasse F USD, thesaurierend	126.827	1.003	126,44	179.479	1.311	136,86	197.803	1.494	132,39
Klasse F USD, ausschüttend (S)	11.450	111	103,26	11.942	104	114,87	16.560	144	115,00
Klasse X USD, thesaurierend	189.669	1.415	134,04	266.393	1.838	144,94	288.619	2.061	140,07
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	37.367	397	94,07	55.862	529	105,61	69.812	656	106,49
Klasse X USD, ausschüttend (S)	20.429	201	101,60	26.356	233	113,02	32.868	290	113,15
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)	28.117	225	114,39	38.488	280	125,16	39.146	307	123,05
Klasse X EUR, thesaurierend	5.023	30	151,60	18.964	103	152,32	23.044	130	160,90
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	155.230	1.158	119,51	239.226	1.518	130,58	246.582	1.745	127,98
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	11.901	120	88,55	16.549	137	99,76	26.698	236	102,51
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	6.919	68	90,25	8.524	70	101,14	8.629	77	102,14
Klasse X GBP, thesaurierend	1.576	8	147,89	4.753	22	154,01	8.782	42	161,72
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	78.246	462	126,27	123.193	646	136,98	131.924	768	134,02
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	6.852	58	88,04	9.661	70	99,15	10.745	83	101,20
Klasse X SGD, thesaurierend (abgesichert)	5.057	5.222	1,31	5.456	5.119	1,42	4.288	4.324	1,38
Klasse Premier USD, thesaurierend	318.448	2.274	140,05	687.346	4.546	151,21	886.628	6.077	145,91
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	55.952	552	101,36	100.741	893	112,76	119.928	1.062	112,91
Klasse Premier AUD, thesaurierend (abgesichert)	2.277	30	103,71	4.895	57	112,53	3.930	55	110,16
Klasse Premier AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	44.269	608	100,20	56.082	650	112,06	47.810	643	114,07
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	132.553	4.300	158,82	171.166	5.814	165,00	211.643	5.879	160,99
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	17.535	147	109,37	23.377	178	119,50	22.667	186	117,33
Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)	2.440	25	89,64	2.231	20	101,00	11.898	112	102,79
Klasse Premier EUR, thesaurierend	32.676	185	157,68	40.171	210	158,22	23.876	130	166,92
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	627.086	4.760	117,49	792.826	5.126	128,18	809.243	5.844	125,44
Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	24.197	235	91,74	116.650	937	103,20	73.703	637	104,73
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	86.494	543	118,83	276.937	1.544	128,72	351.520	2.180	125,75
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	145.729	1.261	86,13	366.571	2.716	96,89	371.070	2.931	98,75
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	76.911	797	11.091,23	96.121	851	12.036,16	105.369	969	11.734,52
Klasse Premier JPY, ausschüttend (S) (abgesichert)	7.912	100	9.096,56	9.547	100	10.176,83	9.538	100	10.288,34
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	1.546	63	102,28	4.054	137	110,55	5.195	189	107,64
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	50	4	109,26	211	15	119,05	5.575	458	116,90
Klasse S USD, thesaurierend	12.078	83	144,73	15.089	97	155,64	30.464	204	149,59
Klasse S USD, thesaurierend (abgesichert)	177.135	1.238	127,65	238.793	1.427	138,74	208.694	1.398	135,24
Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	70.133	1.008	95,77	99.146	1.203	107,10	67.660	952	109,05
Klasse LM EUR, thesaurierend	1.323	9	135,18	1.561	10	134,29	1.904	12	140,27
<b>Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 125	1	115,42	\$ 25	–	117,40	\$ 25	–	114,29
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	48	1	90,27	–	–	96,28	–	–	98,10
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	28	–	103,30	–	–	106,04	–	–	104,59
Klasse C USD, thesaurierend	1	–	114,76	–	–	116,81	–	–	113,85
Klasse E USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	–	–	113,85
Klasse F USD, thesaurierend	56	–	119,42	57	–	120,73	8.552	73	116,83
Klasse X CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)	48	1	82,74	51	1	88,00	50	1	90,14
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	3.644	31	105,47	6.928	53	107,41	4.855	42	105,11
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	597	5	91,91	739	5	97,54	893	7	99,94
Klasse S USD, thesaurierend	1.777	18	98,92	1.837	18	99,62	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	21.698	190	102,11	22.329	178	103,76	14.536	130	101,34
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	35.151	253	103,53	30.991	213	104,46	25.563	196	101,65
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	101.230	1.230	113,36	93.024	1.060	114,07	51.649	716	110,67
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	40.071	347	102,86	34.648	276	104,10	30.112	269	101,27
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	146.379	860	126,95	891.195	5.014	127,59	735.665	4.640	123,66
S Klasse CHF Ausschüttend (A)	21.046	200	96,50	–	–	–	–	–	–
<b>Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup></b>									
Klasse A HKD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	\$ 77	1	99,23
Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)	645	6	98,36	956	8	98,05	2.112	18	105,72
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	423	5	83,76	470	5	86,54	3.486	32	97,58
Klasse D USD, thesaurierend	14.316	133	107,68	23.854	224	106,44	39.063	344	113,53
Klasse D USD, ausschüttend (M)	1.638	18	90,09	24.978	271	92,27	8.939	87	103,00
Klasse D USD ausschüttend (M) Plus	247	3	84,29	9.749	110	88,49	2.008	20	100,38
Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)	1.415	13	99,34	1.956	18	98,68	1.433	13	106,07
Klasse M GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	697	6	86,63	743	6	88,90	1.021	8	99,50
Klasse F USD, thesaurierend	419	4	110,41	445	4	108,97	571	5	116,05
Klasse M USD, thesaurierend	643	7	98,42	1.412	15	96,69	742	7	102,57
Klasse M USD, ausschüttend (M)	787	9	89,71	1.669	18	91,89	1.819	18	102,57
Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.052	9	102,04	61	1	101,10	60	1	108,31
Klasse Premier USD, thesaurierend	263.425	1.941	135,74	279.362	2.098	133,17	776.683	5.509	140,98
Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)	10.212	112	91,28	12.555	134	93,74	16.447	157	104,69
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	153.236	1.121	121,86	234.526	1.612	120,58	464.987	3.266	128,97
Klasse Premier EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert)	16.884	179	84,35	26.899	255	87,43	29.216	269	98,57
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	12.070	106	84,77	11.514	94	87,60	42.436	337	98,09
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	53.024	500	12.194,36	56.345	500	12.014,65	–	–	–
Klasse LM USD, thesaurierend	526.808	3.728	141,30	417.668	3.031	137,79	529.928	3.654	145,01
<b>Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup></b>									
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$ 10	–	86,27	\$ 11	–	91,69	\$ 10	–	95,11
Klasse Premier USD, thesaurierend	–	–	–	1.822	18	103,98	1.681	16	103,59
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	717	6	100,06	3.460	28	103,96	2.222	20	104,74
Klasse LM USD, thesaurierend	1.146.553	10.359	110,68	818.123	7.199	113,64	1.072.652	9.503	112,87

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2022			28. Februar 2021			29. Februar 2020		
	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:
<b>Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>▲</sup></b>									
Klasse A GBP, thesaurierend	£ 1	–	111,82	£ 1	–	117,41	£ 1	–	115,54
Klasse Premier GBP, thesaurierend	1	–	95,37	–	–	–	–	–	–
Klasse LM GBP, thesaurierend	73.631	637	115,68	76.684	637	120,47	113.271	964	117,55
<b>Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>▲</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 644	5	122,84	\$ 9.524	75	127,66	\$ 7.621	63	121,93
Klasse Premier USD, thesaurierend	19.025	171	111,27	15.160	132	114,85	17.437	160	108,98
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	870	7	111,34	1.377	10	115,94	964	8	111,57
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	154.630	951	121,21	165.535	951	124,94	97.696	638	119,44
<b>Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>▲</sup></b>									
Ausschüttende LM-Klasse in USD (Q)	\$ 21.958	244	90,04	\$ 22.193	226	98,11	\$ –	–	–
<b>Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>▲</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 10	–	95,97	\$ –	–	–	\$ –	–	–
Klasse F USD, thesaurierend	10	–	96,01	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	2.401	25	96,05	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	2.664	142	96,96	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	47	–	95,97	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	47	–	96,05	–	–	–	–	–	–
Klasse S USD, thesaurierend	4.640	48	96,06	–	–	–	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	47	–	95,98	–	–	–	–	–	–
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 12.568	87	144,07	\$ 19.033	122	155,92	\$ 21.756	146	148,61
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1.099	12	91,71	1.610	16	100,20	2.356	24	96,74
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	–	–	–	293	3	99,20	290	3	97,99
Klasse A USD, ausschüttend (S)	22.007	196	112,29	25.630	209	122,72	56.954	478	119,08
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	526	10	69,92	766	13	78,08	1.328	26	78,13
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.075	11	83,44	645	6	91,29	711	7	88,46
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	25.053	152	146,74	42.849	232	153,27	58.026	343	153,41
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	583	7	72,27	874	9	80,04	779	9	79,60
Klasse A EUR, ausschüttend (S)	49	–	89,08	55	1	90,48	71	1	95,98
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	7.052	63	99,31	10.173	80	104,76	11.798	100	106,75
Klasse A GBP, thesaurierend	102	1	96,89	110	1	100,97	105	1	104,56
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	254	2	77,41	395	3	84,89	455	4	83,23
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	4.647	32	108,33	6.577	42	113,52	7.154	48	115,60
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	4	–	97,23
Klasse A SGD, thesaurierend	68	93	0,99	131	165	1,06	503	663	1,06
Klasse B USD, thesaurierend	23	–	130,86	51	–	141,97	72	1	135,65
Klasse B USD, ausschüttend (S)	107	1	112,23	203	2	122,66	265	2	119,04
Klasse C USD, thesaurierend	450	4	126,35	1.083	8	137,44	1.169	9	131,64
Klasse C USD, ausschüttend (S)	1.099	10	111,77	2.046	17	122,16	3.205	27	118,50
Klasse E USD, thesaurierend	625	6	96,47	1.301	12	105,04	1.604	16	100,71
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	22	–	93,60	20	–	91,24
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	737	6	104,63	1.480	11	109,94	2.347	19	110,69
Klasse F USD, thesaurierend	1.023	10	102,33	1.047	9	110,31	2.992	29	104,72
Klasse F USD, ausschüttend (S)	202	2	82,84	159	2	90,55	152	2	87,87
Klasse R USD, ausschüttend (S)	–	–	–	–	–	–	75	1	87,79
Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	38	–	89,48	123	1	93,71	224	2	95,33
Klasse X USD, thesaurierend	3.321	32	102,61	3.376	31	110,50	10.989	105	104,79
Klasse X USD, ausschüttend (S)	234	3	83,25	321	4	91,00	384	4	88,31
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	104	1	90,83	422	4	98,90	2.500	24	95,33
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	1.203	11	99,63	1.445	12	103,54	1.389	12	103,13
Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	528	5	87,56	1.065	10	92,37	1.367	13	94,19
Klasse X GBP, thesaurierend	26.213	167	117,12	29.863	176	121,47	54.671	341	125,23
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	18.737	152	91,79	26.554	192	99,19	40.952	334	95,53
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	250	2	104,00	449	3	107,37	5.529	40	106,92
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)	11.372	111	76,08	21.758	187	83,45	31.695	300	82,35
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	6.464	53	91,37	11.879	118	95,74	38.786	310	97,59
Klasse Premier USD, thesaurierend	26.070	219	119,20	46.937	366	128,17	190.725	1.572	121,36
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	922	11	85,89	1.119	12	93,89	10.374	114	91,12
Klasse Premier EUR, thesaurierend	4.125	25	145,57	5.368	31	145,47	18.781	113	150,75
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	81	1	88,25	39.291	339	95,96	46.941	460	92,39
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	11.130	79	125,02	37.310	238	129,75	97.818	686	129,15
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	4	–	93,51	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	270	3	76,76	573	5	84,17	52.009	491	82,58
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1.663	13	98,46	2.457	17	103,16	18.765	139	105,35
Klasse LM USD, thesaurierend	3.162	31	101,78	4.363	40	108,78	3.398	33	102,39
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	20.395	173	118,09	12.901	107	120,78	129.179	1.096	117,88
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>▲</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 938	8	119,84	\$ 959	8	123,34	\$ 23.730	210	113,18
Klasse A USD, ausschüttend (A)	149	2	96,69	224	2	100,65	11.264	119	94,63
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	386	4	97,53	424	3	101,30	614	6	94,35
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	–	–	94,46	–	–	96,72	–	–	89,90
Klasse A SGD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1.133	1.555	1,01
Klasse C USD, thesaurierend	124	1	104,34	129	1	107,92	119	1	99,56
Klasse E USD, thesaurierend	172	2	103,51	179	2	107,17	292	3	98,96
Klasse E USD, ausschüttend (A)	24	–	97,84	324	3	101,84	367	4	95,78
Klasse F USD, thesaurierend	807	7	110,36	827	7	113,12	956	9	103,42
Klasse F USD, ausschüttend (A)	–	–	–	34	–	99,33	32	–	93,50
Klasse X USD, thesaurierend	189	2	101,78	66	1	104,28	60	1	95,29
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	3.499	25	104,13	3.088	21	106,90	2.676	21	98,72
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	154	1	89,35	279	2	93,36	179	2	87,55
Klasse Premier USD, thesaurierend	85.918	750	114,56	67.943	580	117,19	108.776	1.017	106,93
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	169	2	95,36	158	2	99,26	7.764	83	93,55
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	77.402	623	110,83	89.753	650	114,42	109.195	934	105,85
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	29.738	330	80,37	38.828	381	84,42	55.318	621	80,63
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	11.162	96	86,74	12.113	96	90,60	24.931	229	85,01
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	176	15	98,11	145	15	90,82
Klasse Premier SGD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	134.176	151.908	1,18	192.557	248.517	1,08
Klasse LM USD, thesaurierend	5.265	44	120,62	10.675	87	122,30	9.654	87	110,59
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	536.622	4.944	149,45	368.319	3.149	152,00	284.841	3.149	138,84
<b>Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund<sup>▲</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 207	2	121,94	\$ 21	–	126,05	\$ 64	1	113,97
Klasse A USD, ausschüttend (D)	103	1	92,91	112	1	101,27	86	1	97,18
Klasse Premier USD, thesaurierend	1	–	150,00	564	4	153,88	687	5	138,24
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	102	1	146,92	108	1	148,84	21	–	137,59
Klasse S CAD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	11.177	100	141,96	11.254	100	143,52	9.798	100	131,78
<b>Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 3.382	28	122,37	\$ 3.277	25	131,11	\$ 18.015	152	118,20
Klasse A USD, ausschüttend (M)	702	7	106,98	686	6	116,22	12.442	117	106,78
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1	–	90,11	1	–	97,56	7	–	89,51

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2022			28. Februar 2021			29. Februar 2020		
	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:
<b>Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund – (Fortsetzung)</b>									
Klasse A SGD, thesaurierend	\$ 51	67	1,04	\$ 155	188	1,10	\$ –	–	–
Klasse C USD, thesaurierend	1.096	10	112,05	1.354	11	120,64	1.366	12	109,31
Klasse E USD, thesaurierend	347	3	109,74	633	5	118,29	684	6	107,28
Klasse F USD, thesaurierend	3.090	29	106,72	3.833	34	113,88	2.307	23	102,27
Klasse F USD, ausschüttend (M)	280	3	91,69	1.198	12	99,61	843	9	91,51
Klasse X USD, thesaurierend	308	3	111,42	329	3	118,78	295	3	106,56
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	382	3	82,76	79	1	90,21	57	1	84,27
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	1.209	9	101,85	824	6	106,09	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	207.613	1.610	128,99	338.663	2.467	137,30	291.302	2.369	122,99
Klasse Premier USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	–	–	–	897	7	124,58	2.323	20	115,68
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	2.282	17	97,27	3.143	22	101,31	2.968	24	97,71
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	6.513	59	161,81	6.794	57	164,79	17.450	180	155,06
Klasse LM EUR, thesaurierend	5.010	37	119,82	5.719	40	117,77	6.753	53	114,60
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	12.130	95	189,36	218.136	1.575	191,70	192.120	1.714	179,29
<b>Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund<sup>A</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	\$ 1.307	13	101,20
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	5	–	100,01
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	71.037	1.000	109,05
Klasse BW LM GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	241.581	1.311	143,76
Klasse BW LM GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	734.473	5.183	110,52
Klasse BW Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	269.871	2.289	106,82
Klasse BW Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	165.634	855	151,16
Klasse BW Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	49.823	351	110,77
Klasse BW Premier USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	123,72
Klasse BW Premier USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	32.198	304	105,91
Klasse X USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	6	–	106,45
Klasse Premier USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	24.873	238	104,50
Premier-Klasse, ausschüttend USD (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	5	–	100,72
<b>Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 227.926	1.582	144,04	\$ 81.165	548	148,11	\$ 4.938	37	134,03
Klasse A USD, ausschüttend (A)	2.423	24	99,14	1.351	13	103,79	–	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (D)	28.700	297	96,74	13.849	136	102,16	–	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	67.038	726	92,32	1.071	11	99,70	–	–	–
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	163.878	1.695	96,70	63.441	613	103,50	5.733	59	97,92
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	3.500	50	95,72	–	–	–	–	–	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) Plus (abgesichert)	4.288	63	93,28	–	–	–	–	–	–
Klasse A CNH Ausschüttende (M) Abgesicherte Plus	1.169	80	92,59	–	–	–	–	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend	1	–	104,69	1	–	100,09	–	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	49.951	401	111,20	19.226	138	115,37	5.590	48	106,04
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	33.645	306	98,11	22.787	180	105,03	17.384	159	98,81
Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3.108	30	93,01	–	–	–	–	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	38.905	407	85,23	34.495	311	92,06	12.205	125	88,46
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3.289	26	93,28	–	–	–	–	–	–
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	8.329	69	90,60	4.651	34	97,19	646	5	93,04
Klasse A HKD, thesaurierend	766	63	95,68	–	–	–	–	–	–
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	17.554	1.474	93,06	–	–	–	–	–	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	49.398	66.538	1,01	17.338	21.270	1,09	275	368	1,04
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	3.914	5.723	0,93	223	299	0,99	–	–	–
Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	8.763	12.594	0,94	149	198	1,01	–	–	–
Klasse C USD, thesaurierend	39.688	394	100,69	2.104	20	104,06	–	–	–
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1.454	15	95,00	447	4	100,31	30	–	107,57
Klasse E USD, thesaurierend	35.222	323	109,15	14.474	128	112,91	–	–	–
Klasse E USD, ausschüttend (D)	567	6	94,73	64	1	100,01	–	–	–
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	5.373	44	108,08	1.809	13	112,81	1	–	104,20
Klasse F USD, thesaurierend	40.863	402	101,56	3.755	36	103,97	–	–	–
Klasse F USD, ausschüttend (D)	6.875	65	105,62	1.807	16	111,52	1.100	11	104,12
Klasse X USD, thesaurierend	14.895	145	102,71	313	3	105,03	–	–	–
Klasse X USD, ausschüttend (D)	147	1	106,01	141	1	111,95	234	2	104,54
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	25.931	257	100,74	8.793	82	107,23	244	2	100,87
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)	1.173	11	95,30	–	–	–	–	–	–
Klasse X CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)	3.019	29	95,94	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend	1.281	11	104,50	1.012	8	99,34	–	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	36.681	340	96,16	81	1	99,21	–	–	–
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	22.675	227	89,18	22.878	198	95,80	3.478	34	91,55
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	9.746	76	94,97	3.347	24	101,32	1.328	11	96,49
Klasse Premier USD, thesaurierend	82.954	817	101,55	2.094	20	103,69	–	–	–
Premier-Klasse, ausschüttend USD (M) Plus (e)	21.157	205	102,96	3.130	29	109,42	931	9	102,80
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	141.515	1.022	123,47	15.687	102	127,20	667	5	116,01
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	42.876	423	90,45	6.553	56	97,01	1.139	11	92,58
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	2.311	18	95,62	373	3	101,87	204	2	96,85
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	3.339	256	123,61	18.380	1.222	127,05	4.256	353	115,90
Klasse S USD, thesaurierend	188.113	1.790	105,08	27.021	252	107,09	–	–	–
S Klasse USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	262	3	94,61	–	–	–	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	70.922	555	114,04	20.156	142	117,25	3.648	31	106,82
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	6.325	55	101,98	6.314	48	109,17	4.188	36	104,02
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1.909	14	98,90	1.920	13	105,14	2.609	20	99,77
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	7.573	79	95,27	–	–	–	–	–	–
Klasse LM AUD, ausschüttend (Q) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	201	3	104,41
LM-Klasse Euro ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	44.361	418	94,65	–	–	–	–	–	–
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	30.076	220	101,96	30.817	213	103,78	–	–	–
<b>Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>A</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 12.217	108	113,34	\$ 14.059	125	112,29	\$ 508	4	117,05
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	3	–	100,53	5	–	106,09
Klasse X USD, ausschüttend (M)	1	–	98,28	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	36.297	305	119,13	24.883	212	117,27	28.965	238	121,46
Klasse LM USD, thesaurierend	3.871	30	129,83	11.098	88	126,33	11.363	88	129,35
Klasse S BRL, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	1.977	103	107,73	2.544	103	110,61
<b>Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>A</sup></b>									
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$ 86	1	87,94	\$ 12	–	97,50	\$ 11	–	93,91
Klasse S EUR, ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)	10.077	100	89,87	11.762	100	97,48	10.523	100	95,32
<b>Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>A</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 10	–	92,02	\$ 10	–	100,31	\$ 10	–	94,12
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	3.880	5.726	0,92	5.272	7.003	1,00	3.745	5.470	0,95
Klasse X USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	102,35	–	95,26
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	6	–	73,57	–	–	–	84,13	–	83,96
Klasse Premier USD, thesaurierend	–	–	–	14.917	145	102,76	16.992	178	95,49
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	96,41	–	91,11
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	100.335	1.460	94,63	371.056	4.740	101,74	295.192	4.740	95,60
Klasse LM SGD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	66.108	96.043	0,96

## Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2022			28. Februar 2021			29. Februar 2020		
	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:
<b>Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>A</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 141	1	196,64	\$ 21	–	171,02	\$ 153	1	126,81
Klasse Premier USD, thesaurierend	589	3	208,48	508	3	179,61	373	3	131,92
Klasse Premier GBP, thesaurierend	3	–	98,53	–	–	–	–	–	–
Klasse S USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1.857	16	115,54
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.444	7	188,84	1.350	7	164,09	918	7	122,03
<b>Legg Mason ClearBridge Value Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 121.303	732	165,63	\$ 11.396	78	147,02	\$ 13.068	125	104,51
Klasse A USD, ausschüttend (A)	34.995	111	314,69	25.305	91	279,33	21.259	107	198,56
Klasse A EUR, thesaurierend	8.899	43	186,70	766	4	154,30	20	2	119,85
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	82	–	158,13	35	–	142,06	23	–	102,60
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	23	–	220,87	20	–	189,53	28	–	146,53
Klasse A SGD, thesaurierend	4.372	4.254	1,39	2.399	2.627	1,22	1.818	2.801	0,90
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	2.375	1.214	2,65	398	225	2,36	140	114	1,70
Klasse C USD, thesaurierend	9.512	57	167,70	693	5	149,60	868	8	106,87
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2.695	9	285,43	1.548	6	254,63	2.185	12	181,90
Klasse E USD, thesaurierend	2.907	27	106,16	–	–	–	–	–	–
Klasse F USD, thesaurierend	24.053	73	328,39	2.411	8	289,75	1.780	9	204,74
Klasse F USD, ausschüttend (A)	2.818	16	181,76	304	2	160,78	158	1	114,09
Klasse X USD, ausschüttend (A)	15.344	67	227,42	25.887	129	201,13	1.437	10	142,77
Klasse X EUR, thesaurierend	5.094	37	121,64	540	4	99,74	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	506.317	1.704	297,07	398.734	1.528	261,00	282.618	1.539	183,65
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	482	2	203,29	52	–	179,63	90	1	127,72
Klasse Premier EUR, thesaurierend	105.810	388	243,25	38.597	161	198,65	139	1	153,40
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	31.343	267	104,79	–	–	–	–	–	–
Ausschüttende LM-Klasse in USD (A)	13.814	132	104,99	–	–	–	–	–	–
<b>Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 38.354	126	303,63	\$ 31.487	116	271,85	\$ 31.070	141	219,93
Klasse A USD, ausschüttend (A)	12.540	41	303,41	12.287	45	271,66	12.343	56	219,77
Klasse A EUR, thesaurierend	862	2	396,80	927	2	330,04	2.785	9	291,79
Klasse B USD, thesaurierend	55	–	275,31	227	1	247,74	543	3	201,41
Klasse B USD, ausschüttend (A)	549	2	281,93	676	3	253,69	931	5	206,25
Klasse C USD, thesaurierend	16.457	60	275,27	15.828	64	247,70	16.745	83	201,39
Klasse C USD, ausschüttend (A)	20.120	71	281,84	19.398	76	253,62	17.974	87	206,19
Klasse E USD, thesaurierend	22.561	70	320,04	19.773	68	288,70	14.773	63	235,31
Klasse E USD, ausschüttend (A)	1.177	4	320,22	1.062	4	288,87	837	4	235,45
Klasse F USD, thesaurierend	26.406	93	283,88	24.575	97	252,65	16.642	82	203,18
Klasse F USD, ausschüttend (A)	4.282	11	376,97	3.588	11	335,67	2.634	10	270,97
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1.684	7	243,72	1.913	9	217,01	3.494	20	175,20
Klasse X EUR, thesaurierend	286	1	302,61	252	1	250,22	101	–	219,79
Klasse Premier USD, thesaurierend	10.891	28	390,01	5.971	17	345,82	12.704	46	277,08
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	3.421	8	455,60	3.359	8	405,51	3.398	10	327,66
Klasse Premier EUR, thesaurierend	12.422	25	435,74	32.007	74	358,89	29.678	85	314,83
Klasse LM USD, thesaurierend	25.866	121	213,40	16.734	89	188,04	11.152	74	149,73
Klasse LM EUR, thesaurierend	2.519	10	216,39	2.988	14	177,19	3.257	19	154,24
Klasse A (G) USD, thesaurierend	4.429	14	318,04	4.259	15	283,76	3.815	17	228,77
Klasse B (G) USD, thesaurierend	5	–	294,80	–	–	264,48	–	–	214,43
Klasse L (G) USD, thesaurierend	2.964	10	295,32	3.315	13	264,81	3.789	18	214,55
Klasse GA USD, thesaurierend	4.570	14	319,45	4.253	15	285,51	3.739	16	230,57
Klasse GA EUR, thesaurierend	401	1	409,60	381	1	340,21	309	1	300,28
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	530	1	408,46	2	–	339,19	599	2	299,34
Klasse GE USD, thesaurierend	119	–	294,80	107	–	265,46	116	1	215,98
Klasse GE EUR, thesaurierend	10	–	377,75	9	–	316,10	7	–	281,04
<b>Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 275.982	640	431,31	\$ 270.968	669	404,79	\$ 224.061	747	300,13
Klasse A USD, ausschüttend (A)	40.436	94	431,51	44.968	111	404,97	37.898	126	300,28
Klasse A EUR, thesaurierend	91.461	132	618,12	101.712	156	539,07	91.081	189	436,94
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	7.277	29	225,03	10.652	41	213,55	8.053	45	160,52
Klasse B USD, thesaurierend	182	–	394,51	286	1	372,10	347	1	277,28
Klasse B USD, ausschüttend (A)	158	–	400,54	153	–	377,79	130	–	281,51
Klasse C USD, thesaurierend	27.505	70	394,65	29.420	79	372,23	20.993	76	277,37
Klasse C USD, ausschüttend (A)	14.390	36	400,61	14.406	38	377,86	13.344	47	281,56
Klasse E USD, thesaurierend	13.185	56	234,24	13.376	60	221,49	18.161	110	165,46
Klasse E USD, ausschüttend (A)	195	1	227,17	543	3	214,81	1.182	7	160,46
Klasse F USD, thesaurierend	152.031	648	234,47	127.217	582	218,74	106.377	660	161,22
Klasse F USD, ausschüttend (A)	25.793	110	233,98	23.530	108	218,27	22.217	138	160,88
Klasse U USD, thesaurierend	283.702	1.606	176,60	279.870	1.707	163,97	225.116	1.872	120,28
Klasse U USD, ausschüttend (Q)	–	–	–	1	–	100,36	–	–	–
Klasse U EUR, thesaurierend	89.392	411	193,77	78.474	389	167,22	135.651	917	130,01
Klasse X USD, thesaurierend	39.088	149	262,44	37.103	152	244,77	52.159	289	180,36
Klasse X EUR, thesaurierend	1.009	5	182,92	2.519	13	158,78	4.274	30	127,99
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	6.550	29	203,10	22.281	96	191,59	16.764	106	143,04
Klasse X GBP, thesaurierend	8.173	23	262,72	11.471	35	235,79	14.274	59	189,02
Klasse Premier USD, thesaurierend	269.653	975	276,47	343.437	1.337	256,95	281.696	1.493	188,68
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	7.854	60	130,46	6.075	50	121,25	4.428	50	89,08
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	52.354	1.465	184,08	40.126	1.361	165,25	6.587	237	124,16
Klasse Premier EUR, thesaurierend	122.774	471	232,38	151.313	625	200,76	56.380	317	161,08
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	24.290	96	225,88	24.183	94	212,30	44.911	257	158,02
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	3.905	28	125,70	3.028	23	108,63	1.408	15	87,28
Klasse Premier GBP, thesaurierend	87.385	245	265,81	76.820	232	237,99	51.320	211	190,00
Klasse LM USD, thesaurierend	103.953	407	255,58	73.392	311	236,06	62.981	366	172,27
Klasse LM EUR, thesaurierend	581	2	259,13	715	3	222,40	793	4	177,44
Klasse A (G) USD, thesaurierend	9.838	22	450,72	9.623	23	421,52	7.718	25	311,46
Klasse L (G) USD, thesaurierend	11.883	28	418,46	11.773	30	393,31	9.129	31	292,06
Klasse GA USD, thesaurierend	1.696	3	534,19	1.599	3	500,44	1.300	4	370,39
Klasse GA EUR, thesaurierend	20	–	607,83	18	–	529,17	273	1	427,98
<b>Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 82.146	347	236,91	\$ 112.488	409	274,96	\$ 111.269	570	195,16
Klasse A USD, ausschüttend (A)	20.870	88	237,06	26.846	98	275,13	25.352	130	195,28
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	5.832	45	179,96	15.024	92	211,12	10.783	107	154,79
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	60	–	124,19	72	–	146,13	23	2	105,17
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	1.388	52	161,19	649	23	183,04	442	24	128,59
Klasse A EUR, thesaurierend	9.335	24	341,16	13.920	31	367,91	16.599	53	285,66
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	671	4	167,18	1.685	7	196,27	32.233	207	141,21
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	15	–	120,90	19	–	141,97	12	–	102,11
Klasse A GBP, thesaurierend	476	2	167,01	876	3	186,61	734	4	143,96
Klasse A HKD, thesaurierend	276	15	142,49	319	15	164,15	2.112	140	117,18
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	22	1	173,54	33	1	204,05	28	2	149,31
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	2.297	1.598	1,95	3.193	1.878	2,27	1.839	1.573	1,63
Klasse B USD, thesaurierend	267	1	229,61	834	3	267,82	873	5	191,03
Klasse B USD, ausschüttend (A)	558	3	220,02	1.297	5	256,63	1.556	8	183,06
Klasse C USD, thesaurierend	9.131	40	229,54	11.861	44	267,74	10.458	55	190,98
Klasse C USD, ausschüttend (A)	12.112	55	220,03	16.444	64	256,64	16.594	91	183,06
Klasse E USD, thesaurierend	11.574	51	227,78	13.783	52	266,35	14.611	77	190,46
Klasse E USD, ausschüttend (A)	1.239	5	227,82	1.448	5	266,39	1.105	6	190,49
Klasse E EUR thesaurierend	10	–	86,39	–	–	–	–	–	–
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	157	1	141,17	254	1	167,02	212	2	121,05
Klasse F USD, thesaurierend	11.191	42	265,05	15.332	50	305,78	13.095	61	215,74
Klasse F USD, ausschüttend (A)	2.748	10	265,24	2.523	8	306,00	1.734	8	215,89

## Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2022			28. Februar 2021			29. Februar 2020		
	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:
<b>Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund – (Fortsetzung)</b>									
Klasse X USD, thesaurierend	\$ 5.160	27	190,19	\$ 8.992	41	219,30	\$ 13.156	85	154,65
Klasse X USD, ausschüttend (A)	877	4	211,39	1.284	5	243,75	1.785	10	171,89
Klasse X EUR, thesaurierend	1.090	5	194,53	1.245	5	208,45	811	5	160,66
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	78	–	139,60	202	–	162,89	2.729	21	116,41
Klasse X GBP, thesaurierend	18.219	60	226,58	34.880	100	251,61	33.635	136	192,88
Klasse Premier USD, thesaurierend	238.793	754	316,67	362.817	997	363,87	438.890	1.716	255,71
Klasse Premier EUR, thesaurierend	3.121	8	330,46	4.163	10	352,84	2.859	10	271,11
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	458	3	120,60
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	12	–	311,48	14	–	332,81	10	–	256,58
Klasse Premier GBP, thesaurierend	303	2	124,41	190	1	137,65	653	5	105,23
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	672	3	147,39	1.187	5	170,27	11.997	77	122,01
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	68.221	181	281,04	100.113	231	311,15	147.586	482	238,61
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	1.142	33	146,83	1.336	30	169,20	764	25	120,98
Klasse LM EUR, thesaurierend	727	4	172,45	932	4	182,94	967	6	139,65
Klasse A (G) USD, thesaurierend	18.973	76	248,75	23.544	82	287,69	18.912	93	203,48
Klasse B (G) USD, thesaurierend	7	–	231,00	8	–	268,49	12	–	190,84
Klasse L (G) USD, thesaurierend	8.113	35	230,95	10.510	39	268,44	8.451	44	190,81
Klasse GA EUR, thesaurierend	147	–	359,23	173	–	386,56	125	–	299,18
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	70	–	357,88	81	–	385,09	57	–	298,04
Klasse GE USD, thesaurierend	69	–	290,04	81	–	338,37	58	–	241,40
Klasse GE EUR, thesaurierend	40	–	330,96	46	–	358,81	33	–	279,78
<b>Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 13.299	87	152,81	\$ 11.278	85	132,81	\$ 10.649	89	119,27
Klasse A USD, ausschüttend (A)	95	1	119,93	82	1	105,63	246	3	97,73
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	2.042	22	92,06	2.309	28	83,55	3.497	44	78,72
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	128	1	110,21	115	1	98,95	106	1	91,54
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	1.216	10	118,47	1.116	11	104,39	1.147	12	95,83
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.166	19	85,71	1.266	21	78,42	1.562	31	76,44
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	124	8	93,35	95	7	84,96	83	7	80,47
Klasse A EUR, thesaurierend	150	1	134,68	125	1	108,79	119	1	106,77
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.262	9	119,24	1.150	9	104,85	208	2	95,62
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	366	4	90,31	358	4	82,05	308	4	77,11
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	790	67	92,60	697	65	83,45	1.442	142	79,05
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	483	735	0,89	156	257	0,81	232	419	0,77
Klasse B USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	13	–	105,60
Klasse B USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	13	–	97,20
Klasse C USD, thesaurierend	972	7	145,53	724	6	127,12	1.232	11	114,73
Klasse C USD, ausschüttend (A)	246	2	119,46	219	2	105,27	255	3	97,21
Klasse C USD, ausschüttend (Q)	81	1	109,98	72	1	96,92	65	1	88,93
Klasse F USD, thesaurierend	20.648	143	144,58	18.703	150	124,91	18.346	165	111,50
Klasse F EUR, thesaurierend	61	–	140,68	52	–	112,95	47	–	110,19
Klasse F EUR, ausschüttend (A)	88	1	116,98	78	1	95,69	72	1	96,98
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	34	–	103,38	90	1	95,04
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	62	1	109,21	60	1	98,61	52	1	92,10
<b>Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 48.817	304	160,43	\$ 5.832	40	146,35	\$ –	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (A)	10.463	42	251,52	1.827	8	229,43	340	2	166,89
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	49.413	198	223,06	11.129	45	205,65	175	1	151,88
Klasse A SEK, thesaurierend	66.724	4.656	135,75	65.440	5.012	110,24	1	–	92,29
Klasse F USD, thesaurierend	6.403	39	162,19	2.693	18	147,06	–	–	–
Klasse X USD, thesaurierend	20.266	149	135,66	8.802	72	123,01	–	–	–
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1.622	6	261,15	745	3	236,80	1.525	9	171,27
Klasse X EUR, thesaurierend	927	7	114,04	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.823	7	231,69	2.081	8	212,45	154	1	155,97
Klasse X GBP, thesaurierend	237.295	635	278,51	28.773	85	243,38	5.475	22	191,19
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	2.436	13	141,45	4.373	24	128,91	864	7	95,14
Klasse Premier USD, thesaurierend	167.377	1.146	146,09	63.369	480	132,00	–	–	–
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	35.826	136	262,86	4.771	20	238,06	348	2	172,11
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.203	8	237,15	63	–	216,57	313	2	158,43
Klasse Premier GBP, thesaurierend	4.987	12	300,59	686	2	261,26	1.003	4	204,63
Klasse S USD, thesaurierend	601.256	3.203	187,69	197.075	1.164	169,25	19.697	162	121,55
Klasse S EUR, thesaurierend	56.873	354	143,34	25.552	176	120,17	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	7.774	50	139,69	391	3	127,30	–	–	–
Klasse S GBP, thesaurierend	161.607	823	146,43	137.242	774	127,22	16.095	126	99,30
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	78.117	395	147,25	79.258	426	133,44	2.887	23	97,74
Klasse S GBP, ausschüttend (M)	15.238	79	144,37	5.122	29	126,04	795	6	99,14
Klasse LM EUR, thesaurierend	21.868	173	112,61	–	–	–	–	–	–
<b>Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 754	5	150,84	\$ 768	5	153,62	\$ 672	6	111,79
Klasse Premier USD, thesaurierend	15.264	98	156,48	10.321	65	157,77	7.791	69	113,68
<b>Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^</b>									
Klasse A USD, aufgelaufen 30.452 €	2.723	12,54	653	71	11,16	98	10	10,73	
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	49.791	3.885	14,37	33.140	3.397	11,77	77.350	6.985	12,22
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	47.028	4.911	10,74	42.617	5.678	9,06	43.130	4.863	9,79
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	3.039	242	14,09	2.622	252	12,54	3.305	302	12,07
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	5.707	853	10,33	1.380	248	8,74	231	40	9,69
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	7.660	5.083	10,67	3.391	2.946	9,00	2.664	2.106	9,74
Klasse A EUR, thesaurierend	73.628	5.290	13,92	63.844	5.563	11,48	98.029	8.146	12,03
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	5.029	436	11,54	1.500	150	9,98	867	86	10,02
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	2.624	210	12,47	2.565	244	10,52	1.324	117	11,33
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	4.158	6.018	1,05	1.432	2.599	0,89	915	1.455	0,97
Klasse C USD, thesaurierend	3.683	342	12,08	234	26	10,80	257	27	10,40
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)	646	53	13,66	719	77	11,25	588	55	11,74
Klasse E USD, thesaurierend	8.126	646	14,10	3.205	307	12,61	1.638	148	12,20
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)	904	90	11,26	–	–	–	–	–	–
Klasse F USD, thesaurierend	1.537	135	12,77	1.008	108	11,27	1.066	109	10,75
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)	1.840	144	14,34	1.447	149	11,68	3.011	276	12,05
Klasse X USD, thesaurierend	67	6	12,46	490	54	10,96	425	45	10,43
Klasse X USD, ausschüttend (A)	447	40	12,62	350	38	11,10	376	39	10,66
Klasse X EUR, thesaurierend	26.937	1.910	14,10	30.951	2.686	11,52	50.974	4.257	11,97
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	2.536	218	11,65	49	5	9,74	358	36	10,02
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	1.489	108	11,53	407	36	9,85	130	11	10,31
Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert)	810	67	10,15	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	11.876	820	16,23	4.064	344	14,25	4.491	367	13,51
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	5.511	1.828	17,42	3.264	1.628	13,56	4.100	1.441	14,05
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	51.721	6.384	11,51	40.525	6.247	9,96	43.380	6.336	10,15
Premier Class CAD-Ausschüttung (Q) Plus (e)	6.322	811	11,08	10.003	1.547	9,93	10.334	1.509	10,15
Klasse Premier EUR, thesaurierend	207.952	9.151	22,73	237.729	12.828	18,53	287.330	14.949	19,22
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	7.393	596	12,40	7.045	664	10,61	14.036	1.331	10,55
Klasse Premier GBP, thesaurierend	6.622	363	15,25	7.247	487	12,89	2.145	139	13,30
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	6.498	470	11,90
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	21.555	844	21,34	66.461	3.156	18,24	81.523	3.785	18,55
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)	74.334	4.710	13,19	31.325	2.408	11,27	29.321	2.146	11,77
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	5.346	625	10,33	4.044	424	10,53

## Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2022			28. Februar 2021			29. Februar 2020		
	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:
<b>Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund<sup>▲</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 224	3	87,06	\$ 220	3	85,51	\$ 219	2	88,93
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	174	2	83,85	171	2	82,87	178	2	87,04
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	679	7	81,36	719	7	80,01	690	7	83,91
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	730	7	79,04	709	7	75,08	732	7	85,53
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	858	9	82,16	906	9	80,64	867	9	84,40
<b>Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>▲▲</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 17.858	169	105,90	\$ –	–	–	\$ –	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	28.785	274	104,96	–	–	–	–	–	–
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	74.314	707	105,12	–	–	–	–	–	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	5.538	75	102,34	–	–	–	–	–	–
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	315	19	103,79	–	–	–	–	–	–
Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3.929	34	101,92	–	–	–	–	–	–
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	136	1	101,30	–	–	–	–	–	–
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1.827	135	106,10	–	–	–	–	–	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	27.834	36.826	1,02	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	322	3	105,76	–	–	–	–	–	–
Klasse X Euro ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	645	5	105,94	–	–	–	–	–	–
Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	160	1	100,27	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	4.720	46	102,52	–	–	–	–	–	–
Premier-Klasse, USD, ausschüttend (M) Plus	4.994	48	103,28	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	155	1	105,08	–	–	–	–	–	–
Klasse S USD, thesaurierend	263	2	107,42	–	–	–	–	–	–
Ausschüttende Klasse S USD (M) Plus	1.599	15	104,48	–	–	–	–	–	–
<b>Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 179.306	607	295,45	\$ 195.259	685	284,92	\$ 111.679	671	166,44
Klasse A USD, ausschüttend (A)	35.534	40	897,28	140.142	162	865,30	66.558	132	505,48
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	7.110	43	230,14	12.929	75	252,06	5.001	56	138,32
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	2.416	76	201,78	4.099	140	190,47	832	53	110,35
Klasse A EUR, thesaurierend	46.391	120	344,60	25.796	69	309,18	9.369	43	197,39
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	14.213	56	225,70	24.268	91	220,36	4.156	29	130,98
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	385	2	171,75	49	–	168,13	104	1	100,09
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	1.070	4	184,68	696	3	179,40	902	6	108,22
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	778	2	347,78	966	2	323,02	675	3	205,08
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	88	4	222,22	703	27	217,39	35	3	132,53
Klasse A SGD, thesaurierend	11.147	5.166	2,93	14.111	6.772	2,78	1.982	1.626	1,70
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	26.201	12.563	2,83	35.065	17.096	2,73	2.538	2.176	1,62
Klasse B USD, thesaurierend	127	–	306,67	171	1	297,23	106	1	174,49
Klasse B USD, ausschüttend (A)	22	–	820,22	8	–	795,02	4	–	466,90
Klasse C USD, thesaurierend	13.207	43	307,21	5.457	18	297,74	2.503	14	174,80
Klasse C USD, ausschüttend (A)	5.656	7	814,85	5.845	7	789,75	4.858	10	463,64
Klasse E USD, thesaurierend	11.386	41	275,16	10.042	38	267,35	1.798	11	157,34
Klasse E USD, ausschüttend (A)	528	2	275,11	503	2	267,30	336	2	157,32
Klasse E EUR thesaurierend	1.274	3	351,98	484	1	318,29	435	2	204,70
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.109	5	181,52	691	3	178,54	151	1	106,92
Klasse F USD, thesaurierend	26.949	84	319,38	22.736	74	306,15	8.058	45	177,78
Klasse F USD, ausschüttend (A)	244	1	319,72	1.035	3	306,48	196	1	177,97
Klasse R USD, thesaurierend	307	1	113,60	–	7	108,92	–	–	–
Klasse R USD, thesaurierend (abgesichert)	307	1	268,95	682	2	239,43	159	1	152,03
Klasse X USD, thesaurierend	33.276	118	282,78	74.290	274	270,67	10.278	65	156,94
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1.492	8	196,06	1.171	6	187,66	1.583	15	108,81
Klasse X EUR, thesaurierend	13.906	72	172,19	24.787	134	153,27	1.952	18	96,99
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	22.708	102	199,32	20.713	89	193,11	2.027	16	113,95
Klasse X GBP, thesaurierend	42.807	93	342,20	44.009	100	315,55	23.923	94	198,87
Klasse X GBP, ausschüttend (A)	4.309	10	313,21	3.573	9	288,84	1.032	4	181,98
Klasse Premier USD, thesaurierend	257.900	692	371,66	365.342	1.031	354,49	112.162	548	204,83
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	17.351	541	165,25	4.889	179	152,66	2.148	103	92,92
Klasse Premier EUR, thesaurierend	63.706	119	479,41	17.922	35	425,24	4.192	14	268,56
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	960	4	215,21	28.744	115	207,71	2.874	21	122,18
Klasse Premier GBP, thesaurierend	67.856	156	324,40	198.528	478	298,40	62.906	262	187,38
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	5.300	152	146,12	3.158	85	139,89	546	26	83,03
<b>Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 35.531	154	231,37	\$ 38.798	166	233,20	\$ 29.062	180	161,86
Klasse A USD, ausschüttend (A)	11.155	28	391,87	10.678	27	394,99	8.577	31	274,22
Klasse A EUR, thesaurierend	1.975	5	360,17	2.555	6	337,84	1.227	4	256,29
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	174	1	165,50	1.279	6	168,85	49	–	119,19
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	111	–	255,46	130	–	239,35	66	–	181,83
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	123	–	345,13	124	–	334,96	104	–	252,78
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1	–	167,25	10	1	170,83	6	–	123,00
Klasse C USD, thesaurierend	3.094	14	225,58	3.233	14	228,51	2.605	16	159,40
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2.999	8	356,61	3.486	10	361,25	2.929	12	252,04
Klasse E USD, thesaurierend	750	3	242,35	779	3	246,11	739	4	172,14
Klasse E USD, ausschüttend (A)	8	–	142,67	5	–	144,88	115	1	172,11
Klasse E EUR thesaurierend	8	–	150,73	31	–	142,25	18	–	108,77
Klasse F USD, thesaurierend	10.813	38	285,20	7.263	25	285,75	4.806	24	197,20
Klasse F USD, ausschüttend (A)	543	2	305,10	298	1	305,68	59	–	211,47
Klasse R USD, thesaurierend	212	1	167,46	286	2	167,95	553	5	116,02
Klasse X USD, thesaurierend	333	2	206,08	300	1	206,22	3.881	27	142,11
Klasse X USD, ausschüttend (A)	–	–	94,37	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	966	3	311,50	2.212	7	310,55	1.042	5	213,25
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	14.320	66	216,79	14.478	67	216,83	7.659	51	150,34
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	1.769	5	259,24	1.763	5	249,62	1.685	7	188,03
Klasse LM EUR, thesaurierend	854	4	208,25	1.058	5	191,48	1.028	7	142,78
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1.022	4	258,11	1.031	4	258,11	924	5	178,47
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1.174	5	239,50	1.299	5	241,16	923	6	167,26
<b>Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>▲▲</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 9	–	90,44	\$ –	–	–	\$ –	–	–
Klasse X USD, thesaurierend	9	–	90,61	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	4.516	50	90,69	–	–	–	–	–	–
<b>Franklin MV European Equity Growth and Income Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	€ 608	7	100,59	€ 589	7	96,37	€ 749	9	88,69
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	1.157	9	144,30	1.105	10	127,44	1.687	15	126,85
Klasse A USD, ausschüttend (A)	762	5	183,06	848	6	178,41	1.113	7	170,87
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	4.140	48	97,65	3.462	46	90,33	7.006	82	94,83
Klasse A USD, ausschüttend (Q) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1	–	99,97
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.402	23	92,61	1.638	30	85,96	1.602	29	92,45
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	158	11	102,33	41	3	94,91	211	16	99,81
Klasse A EUR, thesaurierend	333	2	195,74	300	2	174,14	328	2	175,15
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	84	1	166,20	88	1	150,48	527	4	157,47
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	430	4	97,95	263	3	90,68	327	3	94,90
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	224	390	0,87	105	208	0,81	241	432	0,86
Klasse B USD, thesaurierend	14	–	93,06	110	1	89,46	120	2	82,74
Klasse B USD, ausschüttend (A)	–	–	180,51	50	–	175,95	51	–	168,09
Klasse C USD, thesaurierend	144	2	94,91	130	2	91,38	709	9	84,51
Klasse C USD, ausschüttend (A)	€ 1.236	8	180,39	€ 1.172	8	175,82	€ 1.219	8	167,96
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	123	1	102,25	–	–	–	333	4	103,69
Klasse F USD, thesaurierend	290	3	124,53	1.700	17	118,52	1.640	17	108,41
Klasse F USD ausschüttend (Q) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1	–	100,01
Klasse X EUR, thesaurierend	1	–	104,43	–	–	–	–	–	–

## Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2022			28. Februar 2021			29. Februar 2020		
	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/Anteil:
<b>Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – (Fortsetzung)</b>									
Klasse Premier USD, thesaurierend	–	–	–	1.201	15	99,89	1.643	20	90,98
Klasse Premier EUR, thesaurierend	53	–	144,35	47	–	127,12	48	–	126,58
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	480	18	127,46	192	8	111,34	150	6	111,13
Klasse LM USD, thesaurierend	–	–	–	3.967	38	126,84	2.961	28	114,89
Klasse LM EUR, thesaurierend	2.034	15	137,11	2.251	19	119,96	2.672	23	118,76
Klasse A (G) USD, thesaurierend	958	10	104,34	882	11	99,58	902	11	91,42
Klasse B (G) USD, thesaurierend	1	–	96,33	2	–	92,36	1	–	85,16
Klasse L (G) USD, thesaurierend	95	1	96,85	128	2	92,95	191	2	85,93
Klasse GA USD, thesaurierend	870	5	178,58	836	6	170,54	839	6	156,67
Klasse GA EUR, thesaurierend	12.539	62	201,63	12.130	68	178,93	13.318	74	179,66
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	101	1	158,26	92	1	143,16	114	1	150,04
Klasse GE USD, thesaurierend	44	–	163,28	39	–	157,10	40	–	145,40
<b>Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund</b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 2.058	13	156,45	\$ 2.643	17	151,45	\$ 5.640	43	132,68
Klasse A USD, ausschüttend (A)	3.344	13	258,01	3.494	14	254,57	4.295	19	230,43
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	3.851	40	97,45	6.019	61	98,58	10.723	119	90,09
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2.093	30	97,46	3.221	42	99,18	4.288	71	92,51
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	223	16	87,97	220	16	89,12	368	31	81,55
Klasse A EUR, thesaurierend	249	2	141,19	73	–	127,23	118	1	121,76
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	2.075	166	97,83	2.429	192	98,24	3.367	291	90,24
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	33	42	1,05	78	97	1,07	137	194	0,98
Klasse B USD, ausschüttend (A)	43	–	251,36	42	–	248,16	79	–	224,31
Klasse C USD, thesaurierend	109	1	107,62	100	1	104,71	194	2	92,18
Klasse C USD, ausschüttend (A)	1.632	7	250,00	1.711	7	246,82	1.784	8	223,09
Klasse E USD, thesaurierend	16	–	147,17	78	1	143,65	100	1	126,89
Klasse E USD, ausschüttend (A)	11	–	105,87	11	–	104,55	10	–	94,48
Klasse F USD, thesaurierend	29	–	139,46	28	–	134,31	24	–	117,06
Klasse X EUR, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	4.586	43	96,16
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	2.281	66	145,76	3.041	82	139,65	2.393	76	122,75
Klasse GA USD, thesaurierend	7.183	46	157,32	7.174	47	152,29	7.271	54	133,42
Klasse GA EUR, thesaurierend	135	1	178,49	149	1	160,59	202	1	153,73
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	2	–	152,37	23	–	139,53	21	–	138,15
Klasse LM SGD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	17.978	27.864	0,90
Klasse GE USD, thesaurierend	516	4	144,31	503	4	140,75	444	4	124,24
Klasse GE EUR, thesaurierend	–	–	–	–	–	151,55	14	–	143,53
<b>Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>α</sup></b>									
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	37	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 – Fonds für globales Aktienwachstum und Einkommen									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 2.462	12	198,91	\$ 2.204	12	178,06	\$ 2.144	13	167,25
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	352	3	104,25	738	8	98,07	1.278	13	96,81
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	457	6	98,09	693	10	92,91	930	15	94,24
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	173	13	104,77	1.174	93	97,94	1.189	95	97,16
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	53	68	1,06	33	44	0,99	13	19	0,99
Klasse X USD, thesaurierend	1	–	104,34	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	2.811	25	110,91	1.872	19	98,27	1.736	19	91,36
Klasse GA USD, thesaurierend	3.958	20	202,76	3.683	20	181,40	3.700	22	170,54
Klasse GA EUR, thesaurierend	1.589	5	259,07	1.656	6	215,40	1.794	7	221,32
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	342	1	220,29	321	1	186,39	362	2	198,41
Klasse GE USD, thesaurierend	49	–	187,12	44	–	168,67	42	–	159,76
Klasse GE EUR, thesaurierend	296	1	238,91	267	1	200,13	281	1	207,22
<b>Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>α</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 22	–	133,46	\$ 2	–	159,99	\$ 1	–	122,73
Klasse X GBP, ausschüttend (A)	2.262	98	17,20	2.890	105	19,71	66.097	3.138	16,35
Klasse E USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	119,66
Klasse F USD, thesaurierend	1	–	138,19	1	–	164,53	–	–	125,42
Klasse M USD, ausschüttend (A)	367	25	14,43	57.186	3.332	17,16	43.809	3.334	13,14
Klasse M EUR, ausschüttend (A)	72	4	16,69	286	13	18,44	26.826	1.585	15,40
Klasse Premier USD, thesaurierend	13.357	131	102,18	19.627	162	121,06	8.127	88	91,83
Klasse Premier GBP, thesaurierend	37	–	105,44	88	1	120,25	19.856	156	98,52
<b>Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>αβ</sup></b>									
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) USD, 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
<b>Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>α</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 6.471	34	190,12	\$ 1.557	8	202,89	\$ 319	2	153,08
Klasse A EUR, thesaurierend	3.973	19	187,53	2.320	10	186,03	992	6	153,71
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	22.933	217	94,30	–	–	–	–	–	–
Klasse C USD, thesaurierend	212	3	81,36	–	–	–	–	–	–

## Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2022			28. Februar 2021			29. Februar 2020		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/Anteil:
<b>Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup> (Fortsetzung)</b>									
Klasse E USD, thesaurierend	\$ 4.240	34	126,41	\$ 1.896	14	135,92	\$ 1	–	103,20
Klasse F USD, thesaurierend	249	3	81,38	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD, thesaurierend	105	1	92,29	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend	104	–	195,54	81	–	192,44	11	–	158,08
Klasse X GBP, thesaurierend	1.631	6	194,52	1.685	6	198,38	883	4	160,85
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1.876	8	181,95	851	3	193,82	159	1	147,96
Klasse Premier USD, thesaurierend	37.745	187	202,05	14.752	69	213,26	5.674	36	159,16
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	568	3	126,13	749	4	133,90	324	2	101,84
Klasse S USD, thesaurierend	7.523	71	106,36	33.171	296	111,88	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	58.847	547	95,95	–	–	–	–	–	–
Klasse S GBP, thesaurierend	22.904	83	204,70	47.287	164	207,39	25.817	120	166,80
<b>Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund</b>									
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	\$ 5	–	90,98
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	6.166	63	98,23	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	487	7	101,33	455	6	93,44	455	6	115,43
Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus (e)	490	5	96,80	458	4	88,46	457	4	101,17
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	3	–	91,23
Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	54	75	0,98	67	95	0,94	76	103	1,03
Klasse A HKD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	684	8	111,38	379	5	109,14	–	–	–
Klasse D CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1	–	113,18	1	–	110,34	–	–	–
Klasse D HKD ausschüttend (M) Plus	1	–	114,51	1	–	110,55	–	–	–
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.016	1.221	1,13	1.015	1.230	1,10	–	–	–
Klasse D USD ausschüttend (M) Plus	856	8	113,52	505	5	110,45	–	–	–
Klasse D USD, thesaurierend	5.888	48	123,07	5.734	50	114,42	–	–	–
Klasse X AUD, thesaurierend	350	4	126,73	233	3	111,09	85	1	130,12
Klasse X USD, thesaurierend	6.077	45	134,52	5.601	45	124,63	440	4	123,73
Klasse S GBP, thesaurierend	515	3	138,89	474	3	123,09	468	3	131,91
Ausschüttende GBP-Klasse S (M) Plus (e)	515	4	105,80	474	3	98,77	468	3	110,75
Klasse LM AUD, thesaurierend	4.834	52	127,51	5.422	64	110,28	5.324	64	127,89
<b>Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend	\$ 7.343	68	108,56	\$ 4.928	37	133,66	\$ 1.598	17	93,97
Klasse E USD, thesaurierend	402	3	121,66	477	3	150,92	1	–	106,74
Klasse F USD, thesaurierend	11.843	87	136,70	2.510	15	167,30	1	–	116,91
Klasse X USD, thesaurierend	656	6	116,89	801	6	142,84	559	6	99,68
Klasse Premier USD, thesaurierend	6.709	57	118,63	7.740	54	144,46	2.796	28	100,46
Klasse S USD, thesaurierend	2.252	16	143,91	3.225	18	174,89	1.725	14	121,37
Klasse S EUR, thesaurierend	18.633	138	120,24	22.120	135	135,80	22.741	200	103,45
<b>Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>									
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	€ 39	1	86,53	€ –	–	–	€ –	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend	7.094	47	151,56	869	6	148,44	569	5	119,97
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	38	1	86,29	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend	1.877	12	155,36	661	4	151,02	546	5	121,14
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	3.184	191	96,48	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend	26.577	169	157,16	17.885	117	152,24	2.129	17	121,70
Klasse S USD, thesaurierend	–	–	–	87.876	1.077	98,43	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend	145.601	1.063	136,96	4.080	31	132,14	2.894	28	105,21
Klasse S GBP, thesaurierend	119.180	1.273	78,23	–	–	–	–	–	–

Die mit „–“ gekennzeichneten Beträge betragen entweder 0 USD/0 EUR/0 ¥/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 ¥/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 stellte der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

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

β Mit Wirkung zum 1. Juni 2021 stellte der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

ð Mit Wirkung zum 1. Dezember 2021 begann der Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup> mit dem Handel.

ε Mit Wirkung zum 10. Januar 2022 begann der Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup> mit dem Handel.

^ Nicht für den Verkauf an die Öffentlichkeit in Hongkong zugelassen.

## Gesamtergebnisrechnung

	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 das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
<b>(in Tsd.)</b>								
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>								
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 736	\$ 3.018	\$ 6.898	\$ 7.853	\$ 44.481	\$ 46.680	€ 1.475	€ 1.390
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	(3)	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierte Nettogewinn (-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	30	(3.097)	8.777	(9.356)	44.789	204	4.661
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	(11.691)	(6.864)	(91.080)	(35.271)	(6.334)	(3.518)
<b>Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen</b>	<b>736</b>	<b>3.048</b>	<b>(7.890)</b>	<b>9.766</b>	<b>(55.958)</b>	<b>56.198</b>	<b>(4.655)</b>	<b>2.533</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	5.262	6.036	2.110	2.556	9.504	9.611	33	34
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	236	269	168	200	939	1.007	77	73
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	232	301	539	613	2	3
Anwaltsgebühren	21	18	3	2	21	13	1	1
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	20	21	41	43	41	43	24	24
Druckgebühren	45	88	25	25	137	125	9	8
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	22	21	26	22
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	5	5	2	1	9	7	1	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	92	170	54	66	268	287	24	27
<b>Gesamtaufwendungen</b>	<b>5.681</b>	<b>6.607</b>	<b>2.635</b>	<b>3.194</b>	<b>11.480</b>	<b>11.727</b>	<b>197</b>	<b>192</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	(5.036)	(4.024)	–	(1)	–	(4)	–	–
<b>Nettoaufwendungen insgesamt</b>	<b>645</b>	<b>2.583</b>	<b>2.635</b>	<b>3.193</b>	<b>11.480</b>	<b>11.723</b>	<b>197</b>	<b>192</b>
<b>Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten</b>	<b>91</b>	<b>465</b>	<b>(10.525)</b>	<b>6.573</b>	<b>(67.438)</b>	<b>44.475</b>	<b>(4.852)</b>	<b>2.341</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Anmerkung 5)	(76)	(706)	(1.567)	(2.014)	(2.649)	(2.564)	(1)	(1)
<b>Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr</b>	<b>15</b>	<b>(241)</b>	<b>(12.092)</b>	<b>4.559</b>	<b>(70.087)</b>	<b>41.911</b>	<b>(4.853)</b>	<b>2.340</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	–	–	(8)	(113)	(175)	(10)	(8)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>\$ 15</b>	<b>\$ (241)</b>	<b>\$ (12.092)</b>	<b>\$ 4.551</b>	<b>\$ (70.200)</b>	<b>\$ 41.736</b>	<b>€ (4.863)</b>	<b>€ 2.332</b>

  

	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 das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
<b>(in Tsd.)</b>								
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>								
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 4.886	\$ 4.865	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2.111	\$ 480
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	(2)	–	–	–	–	–	(7)	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	1	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierte Nettogewinn (-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	2.674	(4.236)	–	–	–	–	2.482	(548)
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(10.546)	8.283	–	–	–	–	(1.994)	2.440
<b>Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen</b>	<b>(2.988)</b>	<b>8.912</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1</b>	<b>–</b>	<b>2.592</b>	<b>2.372</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	1.062	1.030	–	–	–	–	82	67
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	64	66	–	–	–	–	37	35
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	110	100	–	–	–	–	12	10
Anwaltsgebühren	1	1	–	–	–	–	1	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	17	40	–	–	–	–	25	29
Druckgebühren	9	8	–	–	–	–	4	4
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	1	–	–	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	1	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	1	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	26	40	–	–	–	–	16	19
<b>Gesamtaufwendungen</b>	<b>1.290</b>	<b>1.286</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1</b>	<b>–</b>	<b>177</b>	<b>164</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	(5)	–	–	–	–	(1)	(3)
<b>Nettoaufwendungen insgesamt</b>	<b>1.290</b>	<b>1.281</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1</b>	<b>–</b>	<b>176</b>	<b>161</b>
<b>Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten</b>	<b>(4.278)</b>	<b>7.631</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.416</b>	<b>2.211</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Anmerkung 5)	(2.633)	(2.520)	–	–	–	–	–	(86)
<b>Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr</b>	<b>(6.911)</b>	<b>5.111</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.416</b>	<b>2.125</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(11)	(33)	–	–	–	–	–	(3)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>\$ (6.922)</b>	<b>\$ 5.078</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 2.416</b>	<b>\$ 2.122</b>

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 das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
\$ 2.171	\$ 1.393	\$ 17.245	\$ 28.430	\$ 13.541	\$ 11.258	\$ 1.703	\$ 913	\$ 1.685	\$ 1.656
-	-	1	5	1	-	-	-	-	-
-	-	11	(2)	-	(1)	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
729	(186)	16.567	10.211	2.039	(1.450)	(608)	784	667	576
(2.290)	1.320	(43.376)	35.027	(13.880)	9.906	(5.119)	(27)	(5.238)	(16)
610	2.527	(9.552)	73.671	1.701	19.713	(4.024)	1.670	(2.886)	2.216
557	297	1.839	2.246	1.637	1.289	290	291	12	3
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
35	22	260	411	157	128	31	19	28	29
55	24	124	160	142	121	20	19	-	-
1	-	6	6	3	1	-	-	1	-
27	29	41	43	17	40	20	29	17	21
4	2	37	55	21	13	3	2	4	3
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	8	12	2	1	-	-	-	-
-	-	4	3	1	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
15	19	83	147	47	46	14	21	12	15
694	393	2.402	3.083	2.027	1.640	378	381	74	71
(11)	(26)	-	-	-	(2)	(8)	(24)	-	-
683	367	2.402	3.083	2.027	1.638	370	357	74	71
<b>(73)</b>	<b>2.160</b>	<b>(11.954)</b>	<b>70.588</b>	<b>(326)</b>	<b>18.075</b>	<b>(4.394)</b>	<b>1.313</b>	<b>(2.960)</b>	<b>2.145</b>
(499)	(454)	(6.202)	(7.692)	(2.869)	(3.510)	(928)	(234)	(1.525)	(1.570)
<b>(572)</b>	<b>1.706</b>	<b>(18.156)</b>	<b>62.896</b>	<b>(3.195)</b>	<b>14.565</b>	<b>(5.322)</b>	<b>1.079</b>	<b>(4.485)</b>	<b>575</b>
(3)	(2)	(241)	(488)	(42)	(21)	(12)	(12)	1	-
\$ <b>(575)</b>	\$ <b>1.704</b>	\$ <b>(18.397)</b>	\$ <b>62.408</b>	\$ <b>(3.237)</b>	\$ <b>14.544</b>	\$ <b>(5.334)</b>	\$ <b>1.067</b>	\$ <b>(4.484)</b>	\$ <b>575</b>
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	
für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
\$ 22.129	\$ 23.190	\$ 5.461	\$ 4.964	\$ 4.977	\$ 5.062	\$ 2.115	\$ 2.186	€ 1.862	€ 2.351
4	4	-	-	-	-	-	-	-	-
(17)	27	(2)	-	-	-	-	-	-	(1)
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(4.563)	7.481	9.501	9.602	3.105	20.051	2.483	(813)	473	(731)
(26.651)	3.280	(41.227)	25.711	(16.541)	(12.457)	(7.913)	2.602	(2.404)	810
(9.098)	33.982	(26.267)	40.277	(8.459)	12.656	(3.315)	3.975	(69)	2.429
4.099	4.259	1.925	1.263	515	572	41	43	1	3
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
342	353	298	247	151	158	55	53	33	38
301	340	130	48	1	-	6	6	-	-
8	5	6	2	4	2	1	1	1	1
41	43	27	29	27	29	27	29	24	24
45	45	45	25	20	18	8	7	4	4
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	1	8	6	2	3	2	2	28	19
3	3	3	1	2	1	1	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
113	134	86	72	46	61	22	24	15	18
4.953	5.183	2.528	1.693	768	844	163	165	106	107
(1)	(87)	(2)	-	-	-	-	-	-	(1)
4.952	5.096	2.526	1.693	768	844	163	165	106	106
<b>(14.050)</b>	<b>28.886</b>	<b>(28.793)</b>	<b>38.584</b>	<b>(9.227)</b>	<b>11.812</b>	<b>(3.478)</b>	<b>3.810</b>	<b>(175)</b>	<b>2.323</b>
(8.841)	(10.908)	(3.167)	(3.876)	-	(1)	-	-	(223)	(369)
<b>(22.891)</b>	<b>17.978</b>	<b>(31.960)</b>	<b>34.708</b>	<b>(9.227)</b>	<b>11.811</b>	<b>(3.478)</b>	<b>3.810</b>	<b>(398)</b>	<b>1.954</b>
(577)	(843)	13	(29)	(41)	(169)	(7)	(15)	-	-
\$ <b>(23.468)</b>	\$ <b>17.135</b>	\$ <b>(31.947)</b>	\$ <b>34.679</b>	\$ <b>(9.268)</b>	\$ <b>11.642</b>	\$ <b>(3.485)</b>	\$ <b>3.795</b>	€ <b>(398)</b>	€ <b>1.954</b>

## Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

	Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund <sup>^</sup>	
	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
<b>(in Tsd.)</b>								
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>								
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 268.078	\$ 315.872	\$ –	\$ –	\$ 39.782	\$ 45.529	\$ –	\$ –
Zinsen (Erläuterung 2)	19	22	–	–	–	2	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	(398)	(427)	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierte Nettogewinn (-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	445.215	(803.493)	–	–	21.382	27.141	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(1.088.186)	935.818	–	–	(75.250)	56.458	–	–
<b>Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen</b>	<b>(375.272)</b>	<b>447.792</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(14.086)</b>	<b>129.130</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	68.651	80.912	–	–	289	262	–	–
Erfolgprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	3.462	4.198	–	–	496	575	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	4.466	5.282	–	–	–	–	–	–
Anwaltsgebühren	91	64	–	–	10	7	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	41	43	–	–	26	43	–	–
Druckgebühren	557	566	–	–	74	69	–	–
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	178	143	–	–	8	5	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	38	37	–	–	5	4	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	1.126	1.272	–	–	125	156	–	–
<b>Gesamtaufwendungen</b>	<b>78.610</b>	<b>92.517</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1.033</b>	<b>1.121</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	(2)	–	–	(1)	–	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	78.610	92.515	–	–	1.032	1.121	–	–
<b>Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten</b>	<b>(453.882)</b>	<b>355.277</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(15.118)</b>	<b>128.009</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Anmerkung 5)	(42.036)	(58.267)	–	–	(37)	(50)	–	–
<b>Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr</b>	<b>(495.918)</b>	<b>297.010</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(15.155)</b>	<b>127.959</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(7.309)	(13.830)	–	–	(277)	(405)	–	–
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>\$ (503.227)</b>	<b>\$ 283.180</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ (15.432)</b>	<b>\$ 127.554</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>

	Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup> €		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	
	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
<b>(in Tsd.)</b>								
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>								
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 30	\$ –	\$ 6.749	\$ 16.880	\$ 21.764	\$ 22.249	\$ 657	\$ 636
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	4	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	(30)	(99)	–	(100)	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierte Nettogewinn (-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	58	–	(9.380)	(32.336)	(24.577)	74.459	262	322
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(213)	–	(18.546)	58.549	(38.509)	51.432	(940)	664
<b>Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen</b>	<b>(125)</b>	<b>–</b>	<b>(21.207)</b>	<b>42.994</b>	<b>(41.322)</b>	<b>148.044</b>	<b>(21)</b>	<b>1.622</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	4	–	2.051	4.131	2.725	3.967	56	50
Erfolgprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	5	–	171	398	433	476	13	12
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	274	402	8	19	1	–
Anwaltsgebühren	–	–	4	9	11	9	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	18	–	34	43	27	29	27	29
Druckgebühren	–	–	21	65	63	65	1	1
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	5	–	4	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	3	5	4	4	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	6	–	58	189	122	155	11	14
<b>Gesamtaufwendungen</b>	<b>33</b>	<b>–</b>	<b>2.616</b>	<b>5.247</b>	<b>3.393</b>	<b>4.728</b>	<b>109</b>	<b>106</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	(27)	–	–	(1)	–	–	(34)	(40)
Nettoaufwendungen insgesamt	6	–	2.616	5.246	3.393	4.728	75	66
<b>Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten</b>	<b>(131)</b>	<b>–</b>	<b>(23.823)</b>	<b>37.748</b>	<b>(44.715)</b>	<b>143.316</b>	<b>(96)</b>	<b>1.556</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Anmerkung 5)	–	–	(1.004)	(3.363)	(780)	(2.177)	(6)	(6)
<b>Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr</b>	<b>(131)</b>	<b>–</b>	<b>(24.827)</b>	<b>34.385</b>	<b>(45.495)</b>	<b>141.139</b>	<b>(102)</b>	<b>1.550</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	–	(294)	(375)	(1.043)	(940)	1	(1)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>\$ (131)</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ (25.121)</b>	<b>\$ 34.010</b>	<b>\$ (46.538)</b>	<b>\$ 140.199</b>	<b>\$ (101)</b>	<b>\$ 1.549</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund <sup>^</sup>		Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	
für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
\$ 44.016	\$ 58.210	\$ 22.930	\$ 26.192	£ 1.757	£ 2.471	\$ 5.649	\$ 4.588	\$ 600	\$ 55
-	12	-	2	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	1	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(20.031)	(106.904)	(20.177)	(5.961)	233	4.049	208	8.184	(524)	(62)
(20.131)	(125.752)	(31.759)	(16.030)	(4.951)	(2.986)	(17.331)	1.400	(1.412)	(420)
3.854	(174.434)	(29.006)	4.203	(2.961)	3.534	(11.474)	14.172	(1.335)	(427)
4.001	4.837	7	14	-	-	65	105	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
681	706	610	502	50	69	116	88	19	3
50	91	-	-	-	-	1	12	-	-
16	15	14	9	1	1	3	1	-	-
53	32	27	29	15	16	27	29	42	35
104	103	89	70	6	8	17	9	2	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	13	-	2	2	2	-	1	-	-
6	8	5	5	-	1	1	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
179	242	156	151	15	22	35	30	22	3
5.090	6.047	908	782	89	119	265	276	85	41
-	(1)	-	-	-	-	-	-	(85)	(41)
5.090	6.046	908	782	89	119	265	276	-	-
<b>(1.236)</b>	<b>(180.480)</b>	<b>(29.914)</b>	<b>3.421</b>	<b>(3.050)</b>	<b>3.415</b>	<b>(11.739)</b>	<b>13.896</b>	<b>(1.335)</b>	<b>(427)</b>
(2.540)	(4.391)	-	-	-	-	-	-	(614)	-
<b>(3.776)</b>	<b>(184.871)</b>	<b>(29.914)</b>	<b>3.421</b>	<b>(3.050)</b>	<b>3.415</b>	<b>(11.739)</b>	<b>13.896</b>	<b>(1.949)</b>	<b>(427)</b>
-	-	-	-	(3)	(2)	(25)	(23)	(5)	(2)
<b>\$ (3.776)</b>	<b>\$ (184.871)</b>	<b>\$ (29.914)</b>	<b>\$ 3.421</b>	<b>£ (3.053)</b>	<b>£ 3.413</b>	<b>\$ (11.764)</b>	<b>\$ 13.873</b>	<b>\$ (1.954)</b>	<b>\$ (429)</b>
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund <sup>^</sup>	
für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
\$ 8.885	\$ 18.957	\$ -	\$ 28.258	\$ 37.405	\$ 5.997	\$ 2.123	\$ 1.692	\$ 579	\$ 584
-	-	-	7	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	216	107	-	-	-	-
-	-	33	-	-	-	-	-	-	-
(12.083)	47.886	1.878	(105.505)	(49.978)	13.767	1.644	(1.966)	(431)	759
(8.859)	21.623	(1.972)	61.577	(69.045)	2.501	(2.028)	(475)	(1.126)	491
(12.057)	88.466	(61)	(15.663)	(81.402)	22.372	1.739	(749)	(978)	1.834
1.870	2.426	-	1.370	9.953	1.329	575	424	44	42
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
190	359	-	459	725	112	37	41	12	12
12	17	-	1	1.084	152	20	13	-	-
4	5	-	15	10	1	1	1	-	-
17	40	-	7	27	29	27	29	28	29
27	44	-	101	87	7	5	3	1	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	-	-	10	1	1	-	-	-	-
3	3	-	8	4	-	-	-	-	-
-	-	33	-	-	-	-	-	-	-
62	111	-	209	196	49	18	21	13	18
2.187	3.005	33	2.180	12.087	1.680	683	532	98	102
-	-	-	(29)	-	(9)	(11)	(27)	(37)	(44)
2.187	3.005	33	2.151	12.087	1.671	672	505	61	58
<b>(14.244)</b>	<b>85.461</b>	<b>(94)</b>	<b>(17.814)</b>	<b>(93.489)</b>	<b>20.701</b>	<b>1.067</b>	<b>(1.254)</b>	<b>(1.039)</b>	<b>1.776</b>
(98)	(148)	-	(17.563)	(17.678)	(3.208)	-	-	(653)	(536)
<b>(14.342)</b>	<b>85.313</b>	<b>(94)</b>	<b>(35.377)</b>	<b>(111.167)</b>	<b>17.493</b>	<b>1.067</b>	<b>(1.254)</b>	<b>(1.692)</b>	<b>1.240</b>
(232)	(686)	94	1.073	(471)	(41)	(28)	(26)	-	(1)
<b>\$ (14.574)</b>	<b>\$ 84.627</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ (34.304)</b>	<b>\$ (111.638)</b>	<b>\$ 17.452</b>	<b>\$ 1.039</b>	<b>\$ (1.280)</b>	<b>\$ (1.692)</b>	<b>\$ 1.239</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Value Fund	
	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
<b>(in Tsd.)</b>								
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>								
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ –	\$ –	\$ 13.030	\$ 19.559	\$ 39	\$ 48	\$ 13.308	\$ 7.285
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	(16)	54
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierte Nettogewinn (-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	(17.320)	30.120	253	176	57.129	39.277
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	(20.177)	30.820	(90)	376	16.803	94.033
<b>Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(24.467)</b>	<b>80.499</b>	<b>202</b>	<b>600</b>	<b>87.224</b>	<b>140.649</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	39	195	10	8	6.023	2.612
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	148	230	7	7	462	231
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	2	3	–	–	640	147
Anwaltsgebühren	–	–	6	4	–	–	10	3
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	27	28	27	29	15	27
Druckgebühren	–	–	27	29	–	–	64	27
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	1	–	–	–	1	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	2	2	–	–	3	2
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	–	–	57	70	9	10	113	73
<b>Gesamtaufwendungen</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>309</b>	<b>561</b>	<b>53</b>	<b>54</b>	<b>7.331</b>	<b>3.122</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	(20)	(2)	(40)	(42)	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	–	–	289	559	13	12	7.331	3.122
<b>Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(24.756)</b>	<b>79.940</b>	<b>189</b>	<b>588</b>	<b>79.893</b>	<b>137.527</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Anmerkung 5)	–	–	–	(1)	–	–	(148)	(7)
<b>Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(24.756)</b>	<b>79.939</b>	<b>189</b>	<b>588</b>	<b>79.745</b>	<b>137.520</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	–	(315)	(862)	(11)	(13)	(3.486)	(1.927)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ (25.071)</b>	<b>\$ 79.077</b>	<b>\$ 178</b>	<b>\$ 575</b>	<b>\$ 76.259</b>	<b>\$ 135.593</b>
<b>(in Tsd.)</b>								
	Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund		Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	
	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>								
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 5.224	\$ 8.267	\$ 1.764	\$ 1.547	\$ 14.546	\$ 3.297	\$ 135	\$ 101
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	(1)	(67)	–	(1)	31	8	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierte Nettogewinn (-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	51.437	29.692	1.547	(1.276)	45.824	16.605	1.119	743
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(133.605)	210.182	3.473	5.091	12.537	54.743	(1.289)	2.259
<b>Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen</b>	<b>(76.945)</b>	<b>248.074</b>	<b>6.784</b>	<b>5.361</b>	<b>72.938</b>	<b>74.653</b>	<b>(35)</b>	<b>3.103</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	6.381	6.632	491	420	6.820	1.311	92	65
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	435	490	34	31	791	155	14	12
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	837	866	78	68	944	227	3	2
Anwaltsgebühren	11	11	1	–	16	1	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	41	43	27	29	26	16	13	14
Druckgebühren	45	70	4	3	103	8	1	1
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	2	23	–	–	13	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	4	5	–	–	5	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	103	188	18	28	181	37	14	10
<b>Gesamtaufwendungen</b>	<b>7.859</b>	<b>8.328</b>	<b>653</b>	<b>579</b>	<b>8.899</b>	<b>1.755</b>	<b>137</b>	<b>104</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	(20)	(35)	(97)	(71)	(22)	(23)
Nettoaufwendungen insgesamt	7.859	8.328	633	544	8.802	1.684	115	81
<b>Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten</b>	<b>(84.804)</b>	<b>239.746</b>	<b>6.151</b>	<b>4.817</b>	<b>64.136</b>	<b>72.969</b>	<b>(150)</b>	<b>3.022</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Anmerkung 5)	(70)	(419)	(254)	(297)	(57)	(15)	–	–
<b>Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr</b>	<b>(84.874)</b>	<b>239.327</b>	<b>5.897</b>	<b>4.520</b>	<b>64.079</b>	<b>72.954</b>	<b>(150)</b>	<b>3.022</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(1.006)	(1.584)	(400)	(432)	(4.049)	(890)	(24)	(24)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>\$ (85.880)</b>	<b>\$ 237.743</b>	<b>\$ 5.497</b>	<b>\$ 4.088</b>	<b>\$ 60.030</b>	<b>\$ 72.064</b>	<b>\$ (174)</b>	<b>\$ 2.998</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 2.887	\$ 3.277	\$ 11.465	\$ 13.652
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	(2)	-	-
-	4	-	1	1	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	32.551	28.387	207.591	156.809
-	-	-	-	-	-	(9.208)	14.228	(56.563)	385.923
-	4	-	1	1	1	26.230	45.890	162.493	556.384
-	-	-	-	-	-	2.550	2.194	16.022	13.960
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	143	132	1.229	1.135
-	-	-	-	-	-	414	338	2.089	1.895
-	-	-	-	-	-	3	2	26	13
-	-	-	-	-	-	27	29	42	43
-	-	-	-	-	-	19	15	172	134
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	1	2
-	4	-	1	1	1	1	1	11	8
-	-	-	-	-	-	42	56	332	319
-	4	-	1	1	1	3.199	2.767	19.924	17.509
-	-	-	-	-	-	-	(3)	-	-
-	4	-	1	1	1	3.199	2.764	19.924	17.509
-	-	-	-	-	-	<b>23.031</b>	<b>43.126</b>	<b>142.569</b>	<b>538.875</b>
-	-	-	-	-	-	(16)	(44)	-	(3)
-	-	-	-	-	-	<b>23.015</b>	<b>43.082</b>	<b>142.569</b>	<b>538.872</b>
-	-	-	-	-	-	(814)	(953)	(3.192)	(3.962)
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 22.201	\$ 42.129	\$ 139.377	\$ 534.910
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
€ 16.832	€ 16.920	\$ 97	\$ 79	\$ 3.805	\$ -	\$ 11.052	\$ 4.337	\$ 932	\$ 995
-	1	-	1	-	-	-	-	-	-
(339)	(154)	-	-	(5)	-	-	-	-	12
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
57.894	(55.839)	(91)	(134)	4.597	-	324.314	9.382	19.637	(440)
76.407	(4.587)	(25)	100	1.715	-	(253.086)	350.473	(19.173)	26.368
150.794	(43.659)	(19)	45	10.112	-	82.280	364.192	1.396	26.935
6.668	6.179	31	26	1.206	-	12.523	5.900	1.337	877
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
422	429	5	7	55	-	717	352	68	49
773	748	4	4	283	-	2.173	1.020	233	160
6	4	-	-	1	-	20	21	1	1
24	24	5	20	18	-	41	44	27	29
52	51	-	-	3	-	118	34	9	5
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
122	150	-	-	-	-	-	-	-	-
3	3	-	-	-	-	6	3	1	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
108	123	6	13	29	-	212	111	27	31
8.178	7.711	51	70	1.595	-	15.810	7.485	1.703	1.152
-	(6)	(16)	(37)	(8)	-	-	(1)	-	(7)
8.178	7.705	35	33	1.587	-	15.810	7.484	1.703	1.145
<b>142.616</b>	<b>(51.364)</b>	<b>(54)</b>	<b>12</b>	<b>8.525</b>	<b>-</b>	<b>66.470</b>	<b>356.708</b>	<b>(307)</b>	<b>25.790</b>
(3.289)	(4.601)	(10)	(12)	(3.291)	-	-	-	(53)	(64)
<b>139.327</b>	<b>(55.965)</b>	<b>(64)</b>	<b>-</b>	<b>5.234</b>	<b>-</b>	<b>66.470</b>	<b>356.708</b>	<b>(360)</b>	<b>25.726</b>
(2.933)	(3.064)	(9)	18	(590)	-	(2.924)	(1.206)	(225)	(15)
€ 136.394	€ (59.029)	\$ (73)	\$ 18	\$ 4.644	\$ -	\$ 63.546	\$ 355.502	\$ (585)	\$ 25.711

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

	Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>		Legg Mason PCM US Equity Fund <sup>^</sup>		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund		Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
<b>(in Tsd.)</b>								
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>								
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 14	\$ –	\$ –	\$ –	€ 1.338	€ 1.436	\$ 1.598	\$ 2.059
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	(2)	(9)	(9)	(30)
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierte Nettogewinn (-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	17	–	–	–	856	(2.818)	(483)	(1.948)
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(483)	–	–	–	2.872	880	126	4.810
<b>Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen</b>	<b>(452)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>5.064</b>	<b>(511)</b>	<b>1.232</b>	<b>4.891</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	9	–	–	–	382	379	409	486
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	4	–	–	–	22	28	25	35
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	40	38	65	95
Anwaltsgebühren	–	–	–	–	–	1	1	1
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	12	–	–	–	9	33	15	21
Druckgebühren	–	–	–	–	1	3	2	5
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	2	2	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	9	–	–	–	6	20	14	37
<b>Gesamtaufwendungen</b>	<b>34</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>462</b>	<b>504</b>	<b>531</b>	<b>680</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	(23)	–	–	–	(3)	(15)	(16)	(25)
Nettoaufwendungen insgesamt	11	–	–	–	459	489	515	655
<b>Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten</b>	<b>(463)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.605</b>	<b>(1.000)</b>	<b>717</b>	<b>4.236</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Anmerkung 5)	–	–	–	–	(337)	(392)	(577)	(727)
<b>Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr</b>	<b>(463)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>4.268</b>	<b>(1.392)</b>	<b>140</b>	<b>3.509</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(3)	–	–	–	(272)	(142)	(154)	(212)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>\$ (466)</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>€ 3.996</b>	<b>€ (1.534)</b>	<b>\$ (14)</b>	<b>\$ 3.297</b>

	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund <sup>^</sup>	
	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
<b>(in Tsd.)</b>								
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>								
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ –	\$ –	€ 220	€ 1.351	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	1	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	4	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierte Nettogewinn (-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	4.781	(7.302)	–	–	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	(2.150)	(6.252)	–	–	–	–
<b>Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.855</b>	<b>(12.202)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	140	1.516	–	–	–	–
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	3	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	10	76	–	–	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	21	262	–	–	–	–
Anwaltsgebühren	–	–	–	2	–	–	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	12	24	–	–	–	–
Druckgebühren	–	–	1	11	–	–	–	–
Dividendenaufwand	–	–	88	1.328	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	32	605	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	–	1	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	4	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	–	–	9	39	–	–	–	–
<b>Gesamtaufwendungen</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>320</b>	<b>3.864</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	(29)	(110)	–	–	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	–	–	291	3.754	–	–	–	–
<b>Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.564</b>	<b>(15.956)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Anmerkung 5)	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>2.564</b>	<b>(15.956)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	–	(97)	(224)	–	–	–	–
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>€ 2.467</b>	<b>€ (16.180)</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund <sup>^</sup>		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>^</sup> µ		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Congruix Japan Equity Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	
für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
\$ -	\$ -	\$ 23	\$ 322	\$ 553	\$ 587	¥ -	¥ -	\$ 1.246	\$ 2.107
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	(1)	-	-	(305)	(338)
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	2.559	(588)	430	(384)	-	-	9.987	(5.335)
-	-	(2.683)	3.105	734	879	-	-	(20.160)	21.330
-	-	(101)	2.839	1.717	1.081	-	-	(9.232)	17.764
-	-	4	65	158	158	-	-	577	839
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	1	14	14	14	-	-	47	67
-	-	-	1	14	17	-	-	147	244
-	-	-	-	-	-	-	-	1	2
-	-	14	29	19	29	-	-	13	14
-	-	-	1	1	1	-	-	6	11
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	6	26	12	19	-	-	18	44
-	-	25	136	218	238	-	-	809	1.222
-	-	(23)	(51)	(14)	(24)	-	-	(119)	(211)
-	-	2	85	204	214	-	-	690	1.011
-	-	(103)	2.754	1.513	867	-	-	(9.922)	16.753
-	-	(1)	(2)	(81)	(146)	-	-	-	(313)
-	-	(104)	2.752	1.432	721	-	-	(9.922)	16.440
-	-	53	(38)	(96)	(96)	-	-	(66)	(166)
\$ -	\$ -	\$ (51)	\$ 2.714	\$ 1.336	\$ 625	¥ -	¥ -	\$ (9.988)	\$ 16.274
Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund		Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund <sup>^</sup>	
für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
¥ -	¥ -	\$ 1.071	\$ 497	\$ 1.564	\$ 802	\$ 590	\$ 715	\$ -	\$ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	9.870	1.563	871	(517)	2.438	3.289	-	-
-	-	(31.002)	16.334	86	1.220	(11.888)	11.274	-	-
-	-	(20.061)	18.394	2.521	1.505	(8.860)	15.278	-	-
-	-	1.199	342	248	110	391	243	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	107	48	22	15	36	29	-	-
-	-	133	18	76	32	29	12	-	-
-	-	1	-	-	-	1	-	-	-
-	-	26	16	20	21	11	14	-	-
-	-	13	4	3	1	4	3	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	1	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	25	24	13	19	18	27	-	-
-	-	1.505	452	382	198	490	328	-	-
-	-	-	(6)	(25)	(33)	(11)	(18)	-	-
-	-	1.505	446	357	165	479	310	-	-
-	-	(21.566)	17.948	2.164	1.340	(9.339)	14.968	-	-
-	-	-	-	(497)	(217)	-	-	-	-
-	-	(21.566)	17.948	1.667	1.123	(9.339)	14.968	-	-
-	-	(106)	(61)	(105)	(77)	(76)	(95)	-	-
¥ -	¥ -	\$ (21.672)	\$ 17.887	\$ 1.562	\$ 1.046	\$ (9.415)	\$ 14.873	\$ -	\$ -

## Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Global Funds Plc	
	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>				
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	€ 1.585	€ 98	\$ 703.005	\$ 786.050
Zinsen (Erläuterung 2)	–	11	25	73
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	(935)	(1.050)
Sonstige Erträge	–	–	40	6
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):				
Realisierte Nettogewinn (-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(462)	450	1.182.053	(548.015)
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(20.881)	(507)	(2.121.229)	2.291.604
<b>Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen</b>	<b>(19.758)</b>	<b>52</b>	<b>(237.041)</b>	<b>2.528.668</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>				
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	966	78	185.330	175.374
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	4	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	151	14	15.040	14.844
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	15	4	16.748	14.104
Anwaltsgebühren	3	–	354	258
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	12	12	1.418	1.593
Druckgebühren	16	–	2.154	1.976
Dividendenaufwand	–	–	103	1.540
Zinsaufwendungen	23	2	527	1.186
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	1	–	140	125
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	40	6
Sonstige Aufwendungen	26	9	4.522	5.185
<b>Gesamtaufwendungen</b>	<b>1.213</b>	<b>119</b>	<b>226.380</b>	<b>216.191</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	(3)	(18)	(5.749)	(5.133)
Nettoaufwendungen insgesamt	1.210	101	220.631	211.058
<b>Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten</b>	<b>(20.968)</b>	<b>(49)</b>	<b>(457.672)</b>	<b>2.317.610</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>				
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Anmerkung 5)	–	–	(104.949)	(132.689)
<b>Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr</b>	<b>(20.968)</b>	<b>(49)</b>	<b>(562.621)</b>	<b>2.184.921</b>
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(150)	(11)	(32.275)	(33.653)
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>€ (21.118)</b>	<b>€ (60)</b>	<b>\$ (594.896)</b>	<b>\$ 2.151.268</b>

Die mit „–“ gekennzeichneten Beträge betragen entweder 0 USD/0 EUR/0 ¥/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 ¥/1.000 GBP.

Gewinne und Verluste stammen ausschließlich aus fortgeführten Geschäftsbereichen, mit Ausnahme des Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup> und des Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup>, die ihre Geschäftsbereiche eingestellt haben. Es gab keine sonstigen Gewinne oder Verluste außer den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten.

Die Euro-Zahlen 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, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup>, Der Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup> und der Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup> wurden in US-Dollar in der Gesamtsumme für die Legg Mason Global Funds Plc für das am 28. Februar 2022 zu Ende gegangene Geschäftsjahr zum USD/EUR-Durchschnittskurs von 0 umgerechnet.8551 (28. Februar 2021: 0.8635).

Die britischen Pfund-Beträge für den Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup> wurden in US-Dollar umgerechnet. Die Gesamtsumme für die Legg Mason Global Funds Plc für das am 28. Februar 2022 zu Ende gegangene Geschäftsjahr wurde zum USD/GBP-Durchschnittskurs von 0,7289 (28. Februar 2021: 0,7733) berechnet.

μ Mit Wirkung vom 14. April 2021 stellte der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

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

β Mit Wirkung zum 1. Juni 2021 stellte der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

ð Mit Wirkung zum 1. Dezember 2021 begann der Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup> mit dem Handel.

ϣ Mit Wirkung zum 10. Januar 2022 begann der Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup> mit dem Handel.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb 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 das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 15	\$ (241)	\$ (12.092)	\$ 4.551	\$ (70.200)	\$ 41.736	€ (4.863)	€ 2.332
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	1.451.140	1.607.880	60.505	206.495	808.697	993.778	44.520	399
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	75	1.031	1.215	950	1.763	1.662	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(1.414.236)	(1.723.584)	(115.852)	(229.273)	(899.588)	(924.401)	(1.594)	(15.536)
<b>Anstieg/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>36.979</b>	<b>(114.673)</b>	<b>(54.132)</b>	<b>(21.828)</b>	<b>(89.128)</b>	<b>71.039</b>	<b>42.926</b>	<b>(15.137)</b>
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens	36.994	(114.914)	(66.224)	(17.277)	(159.328)	112.775	38.063	(12.805)
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	882.330	997.244	299.130	316.407	1.647.418	1.534.643	111.323	124.128
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Zum Jahresende</b>	<b>\$ 919.324</b>	<b>\$ 882.330</b>	<b>\$ 232.906</b>	<b>\$ 299.130</b>	<b>\$ 1.488.090</b>	<b>\$ 1.647.418</b>	<b>€ 149.386</b>	<b>€ 111.323</b>

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund		Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	
	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 2.416	\$ 2.122	\$ (23.468)	\$ 17.135
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	-	-	-	-	11.051	43.825	52.803	221.546
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	-	48	221	250
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-	-	-	-	(2.740)	(44.705)	(146.671)	(185.956)
<b>Anstieg/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8.311</b>	<b>(832)</b>	<b>(93.647)</b>	<b>35.840</b>
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens	-	-	-	-	10.727	1.290	(117.115)	52.975
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	-	-	-	-	48.798	47.508	626.909	573.934
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Zum Jahresende</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 59.525</b>	<b>\$ 48.798</b>	<b>\$ 509.794</b>	<b>\$ 626.909</b>

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>	
	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ (15.432)	\$ 127.554	\$ -	\$ -	\$ (3.776)	\$ (184.871)	\$ (29.914)	\$ 3.421
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	91.804	161.052	-	-	245.803	269.105	358.299	25.373
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	-	19	-	1
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(786.331)	(78.745)	-	-	(289.248)	(900.119)	(4.521)	(282.044)
<b>Anstieg/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>(694.527)</b>	<b>82.307</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>(43.445)</b>	<b>(630.995)</b>	<b>353.778</b>	<b>(256.670)</b>
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens	(709.959)	209.861	-	-	(47.221)	(815.866)	323.864	(253.249)
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	1.081.858	871.997	-	-	1.105.162	1.921.028	823.416	1.076.665
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Zum Jahresende</b>	<b>\$ 371.899</b>	<b>\$ 1.081.858</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 1.057.941</b>	<b>\$ 1.105.162</b>	<b>\$ 1.147.280</b>	<b>\$ 823.416</b>

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	
für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
\$ (575)	\$ 1.704	\$ (18.397)	\$ 62.408	\$ (3.237)	\$ 14.544	\$ (5.334)	\$ 1.067	\$ (4.484)	\$ 575	\$ (6.922)	\$ 5.078
61.237	9.546	157.618	94.278	180.706	171.839	29.799	10.613	6.972	6.159	43.436	63.594
549	515	1.017	1.312	2.300	2.490	961	268	1.525	1.570	582	474
(34.652)	(6.373)	(493.200)	(236.237)	(139.796)	(138.939)	(7.077)	(7.984)	(16.398)	(10.615)	(57.680)	(74.327)
<b>27.134</b>	<b>3.688</b>	<b>(334.565)</b>	<b>(140.647)</b>	<b>43.210</b>	<b>35.390</b>	<b>23.683</b>	<b>2.897</b>	<b>(7.901)</b>	<b>(2.886)</b>	<b>(13.662)</b>	<b>(10.259)</b>
26.559	5.392	(352.962)	(78.239)	39.973	49.934	18.349	3.964	(12.385)	(2.311)	(20.584)	(5.181)
26.433	21.041	655.931	734.170	219.127	169.193	22.769	18.805	40.233	42.544	102.562	107.743
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>\$ 52.992</b>	<b>\$ 26.433</b>	<b>\$ 302.969</b>	<b>\$ 655.931</b>	<b>\$ 259.100</b>	<b>\$ 219.127</b>	<b>\$ 41.118</b>	<b>\$ 22.769</b>	<b>\$ 27.848</b>	<b>\$ 40.233</b>	<b>\$ 81.978</b>	<b>\$ 102.562</b>

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 EM Local Currency Debt Fund^	
für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
\$ (31.947)	\$ 34.679	\$ (9.268)	\$ 11.642	\$ (3.485)	\$ 3.795	€ (398)	€ 1.954	\$ (503.227)	\$ 283.180	\$ -	\$ -
169.168	333.427	42.911	116.108	3.979	15.996	14	52	959.500	1.866.934	-	-
4	37	-	-	-	-	77	367	962	1.304	-	-
(211.675)	(125.979)	(116.987)	(105.416)	(5.866)	(16.227)	(16.590)	(5.131)	(2.919.481)	(3.143.288)	-	-
<b>(42.503)</b>	<b>207.485</b>	<b>(74.076)</b>	<b>10.692</b>	<b>(1.887)</b>	<b>(231)</b>	<b>(16.499)</b>	<b>(4.712)</b>	<b>(1.959.019)</b>	<b>(1.275.050)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
(74.450)	242.164	(83.344)	22.334	(5.372)	3.564	(16.897)	(2.758)	(2.462.246)	(991.870)	-	-
518.699	276.535	286.292	263.958	82.725	79.161	54.345	57.103	6.646.080	7.637.950	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>\$ 444.249</b>	<b>\$ 518.699</b>	<b>\$ 202.948</b>	<b>\$ 286.292</b>	<b>\$ 77.353</b>	<b>\$ 82.725</b>	<b>€ 37.448</b>	<b>€ 54.345</b>	<b>\$ 4.183.834</b>	<b>\$ 6.646.080</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>

Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^		Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^		Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^		Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^€		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	
für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
£ (3.053)	£ 3.413	\$ (11.764)	\$ 13.873	\$ (1.954)	\$ (429)	\$ (131)	\$ -	\$ (25.121)	\$ 34.010	\$ (46.538)	\$ 140.199
1	-	4.849	62.788	1.116	22.622	9.997	-	52.734	116.699	222.057	22.306
-	-	-	-	606	-	-	-	175	324	5	263
-	(40.000)	(9.512)	(8.783)	(3)	-	-	-	(180.060)	(713.793)	(151.480)	(268.697)
<b>1</b>	<b>(40.000)</b>	<b>(4.663)</b>	<b>54.005</b>	<b>1.719</b>	<b>22.622</b>	<b>9.997</b>	<b>-</b>	<b>(127.151)</b>	<b>(596.770)</b>	<b>70.582</b>	<b>(246.128)</b>
(3.052)	(36.587)	(16.427)	67.878	(235)	22.193	9.866	-	(152.272)	(562.760)	24.044	(105.929)
76.685	113.272	191.596	123.718	22.193	-	-	-	367.907	930.667	728.674	834.603
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>£ 73.633</b>	<b>£ 76.685</b>	<b>\$ 175.169</b>	<b>\$ 191.596</b>	<b>\$ 21.958</b>	<b>\$ 22.193</b>	<b>\$ 9.866</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 215.635</b>	<b>\$ 367.907</b>	<b>\$ 752.718</b>	<b>\$ 728.674</b>

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

	Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	
	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
(in Tsd.)								
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ (101)	\$ 1.549	\$ (14.574)	\$ 84.627	\$ –	\$ (34.304)	\$ (111.638)	\$ 17.452
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	269	103	25.025	145.613	–	11.511	1.541.388	474.352
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	2	5	10	56	–	1	572	169
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(639)	(254)	(351.786)	(193.507)	–	(1.568.022)	(275.534)	(109.717)
<b>Anstieg/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>(368)</b>	<b>(146)</b>	<b>(326.751)</b>	<b>(47.838)</b>	<b>–</b>	<b>(1.556.510)</b>	<b>1.266.426</b>	<b>364.804</b>
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens	(469)	1.403	(341.325)	36.789	–	(1.590.814)	1.154.788	382.256
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	12.059	10.656	585.721	548.932	–	1.590.814	453.285	71.029
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Zum Jahresende</b>	<b>\$ 11.590</b>	<b>\$ 12.059</b>	<b>\$ 244.396</b>	<b>\$ 585.721</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 1.608.073</b>	<b>\$ 453.285</b>

	Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	
	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
(in Tsd.)								
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 22.201	\$ 42.129
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	–	–	–	–	–	–	68.093	71.625
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	–	–	2	8
Kosten für zurückgekaufte Anteile	–	–	–	–	–	–	(82.824)	(101.192)
<b>Anstieg/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(14.729)</b>	<b>(29.559)</b>
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens	–	–	–	–	–	–	7.472	12.570
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	–	–	–	–	206.008	193.438
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Zum Jahresende</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 213.480</b>	<b>\$ 206.008</b>

	Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup> <sub>a</sub>		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
(in Tsd.)								
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ (73)	\$ 18	\$ 4.644	\$ –	\$ 63.546	\$ 355.502	\$ (585)	\$ 25.711
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	12	19	181.429	–	1.135.484	861.431	43.190	22.281
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	1	2	127	–	–	–	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	–	–	(12.806)	–	(1.571.691)	(376.121)	(45.766)	(24.953)
<b>Anstieg/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>13</b>	<b>21</b>	<b>168.750</b>	<b>–</b>	<b>(436.207)</b>	<b>485.310</b>	<b>(2.576)</b>	<b>(2.672)</b>
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens	(60)	39	173.394	–	(372.661)	840.812	(3.161)	23.039
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	2.725	2.686	–	–	1.288.870	448.058	91.096	68.057
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Zum Jahresende</b>	<b>\$ 2.665</b>	<b>\$ 2.725</b>	<b>\$ 173.394</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 916.209</b>	<b>\$ 1.288.870</b>	<b>\$ 87.935</b>	<b>\$ 91.096</b>

Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^		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 das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
\$ 1.039	\$ (1.280)	\$ (1.692)	\$ 1.239	\$ –	\$ –	\$ (25.071)	\$ 79.077	\$ 178	\$ 575	\$ 76.259	\$ 135.593
15.766	16.798	80	–	–	–	6.935	20.590	144	–	538.051	124.416
–	–	1	1	–	–	–	–	–	–	8	1
(16.439)	(6.883)	–	–	–	–	(268.929)	(90.453)	(24)	(1.997)	(231.165)	(76.825)
<b>(673)</b>	<b>9.915</b>	<b>81</b>	<b>1</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(261.994)</b>	<b>(69.863)</b>	<b>120</b>	<b>(1.997)</b>	<b>306.894</b>	<b>47.592</b>
366	8.635	(1.611)	1.240	–	–	(287.065)	9.214	298	(1.422)	383.153	183.185
52.020	43.385	11.774	10.534	–	–	391.296	382.082	1.879	3.301	509.085	325.900
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>\$ 52.386</b>	<b>\$ 52.020</b>	<b>\$ 10.163</b>	<b>\$ 11.774</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 104.231</b>	<b>\$ 391.296</b>	<b>\$ 2.177</b>	<b>\$ 1.879</b>	<b>\$ 892.238</b>	<b>\$ 509.085</b>

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 ClearBridge Infrastructure Value Fund^	
für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
\$ 139.377	\$ 534.910	\$ (85.880)	\$ 237.743	\$ 5.497	\$ 4.088	\$ 60.030	\$ 72.064	\$ (174)	\$ 2.998	€ 136.394	€ (59.029)
690.529	742.393	66.573	75.725	3.664	2.351	1.547.220	589.825	5.676	341	354.457	452.639
–	–	–	–	4	25	–	1	–	–	7	1
(868.263)	(987.257)	(233.232)	(468.596)	(4.575)	(7.559)	(653.159)	(66.338)	(573)	(713)	(424.447)	(562.536)
<b>(177.734)</b>	<b>(244.864)</b>	<b>(166.659)</b>	<b>(392.871)</b>	<b>(907)</b>	<b>(5.183)</b>	<b>894.061</b>	<b>523.488</b>	<b>5.103</b>	<b>(372)</b>	<b>(69.983)</b>	<b>(109.896)</b>
(38.357)	290.046	(252.539)	(155.128)	4.590	(1.095)	954.091	595.552	4.929	2.626	66.411	(168.925)
1.811.052	1.521.006	790.698	945.826	38.689	39.784	645.224	49.672	11.089	8.463	605.013	773.938
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>\$ 1.772.695</b>	<b>\$ 1.811.052</b>	<b>\$ 538.159</b>	<b>\$ 790.698</b>	<b>\$ 43.279</b>	<b>\$ 38.689</b>	<b>\$ 1.599.315</b>	<b>\$ 645.224</b>	<b>\$ 16.018</b>	<b>\$ 11.089</b>	<b>€ 671.424</b>	<b>€ 605.013</b>

Royce Global Small Cap Premier Fund^δ		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^		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^μ	
für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
\$ (466)	\$ –	\$ –	\$ –	€ 3.996	€ (1.534)	\$ (14)	\$ 3.297	\$ –	\$ –	\$ (51)	\$ 2.714
5.000	–	–	–	6.191	3.214	3.002	9.201	–	–	–	56
–	–	–	–	–	–	62	93	–	–	1	2
–	–	–	–	(15.218)	(9.086)	(8.204)	(45.590)	–	–	(14.689)	(218)
<b>5.000</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(9.027)</b>	<b>(5.872)</b>	<b>(5.140)</b>	<b>(36.296)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(14.688)</b>	<b>(160)</b>
4.534	–	–	–	(5.031)	(7.406)	(5.154)	(32.999)	–	–	(14.739)	2.554
–	–	–	–	33.368	40.774	31.037	64.036	–	–	14.739	12.185
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>\$ 4.534</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>€ 28.337</b>	<b>€ 33.368</b>	<b>\$ 25.883</b>	<b>\$ 31.037</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 14.739</b>

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

	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Congruix Japan Equity Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund <sup>^</sup>	
	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
(in Tsd.)								
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 1.336	\$ 625	¥ –	¥ –	\$ (9.988)	\$ 16.274	\$ –	\$ –
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	2.084	279	–	–	7.493	12.621	–	–
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	3	–	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(3.562)	(1.688)	–	–	(61.470)	(113.533)	–	–
<b>Anstieg/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>(1.478)</b>	<b>(1.409)</b>	–	–	<b>(53.974)</b>	<b>(100.912)</b>	–	–
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens	(142)	(784)	–	–	(63.962)	(84.638)	–	–
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	12.685	13.469	–	–	80.080	164.718	–	–
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Zum Jahresende</b>	<b>\$ 12.543</b>	<b>\$ 12.685</b>	<b>¥ –</b>	<b>¥ –</b>	<b>\$ 16.118</b>	<b>\$ 80.080</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>

	Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Global Funds Plc	
	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
(in Tsd.)								
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ (9.415)	\$ 14.873	\$ –	\$ –	€ (21.118)	€ (60)	\$ (594.896)	\$ 2.151.268
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	26.119	10.934	–	–	355.457	106.019	12.009.674	10.386.883
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	–	–	13.159	13.408
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(10.667)	(13.427)	–	–	(142.120)	(726)	(13.536.166)	(14.395.846)
<b>Anstieg/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>15.452</b>	<b>(2.493)</b>	–	–	<b>213.337</b>	<b>105.293</b>	<b>(1.513.333)</b>	<b>(3.995.555)</b>
Zunahme/(Abnahme) des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbaren Nettovermögens	6.037	12.380	–	–	192.219	105.233	(2.108.229)	(1.844.287)
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	41.801	29.421	–	–	111.371	6.138	24.833.772	26.557.820
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	(96.865)	120.239
<b>Zum Jahresende</b>	<b>\$ 47.838</b>	<b>\$ 41.801</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>€ 303.590</b>	<b>€ 111.371</b>	<b>\$ 22.628.678</b>	<b>\$ 24.833.772</b>

Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>αβ</sup>		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund <sup>α</sup>		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund <sup>α</sup>		Legg Mason Martin Currie Currie Japan Absolute Alpha Fund <sup>α</sup>		Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>α</sup>		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	
für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021	für das Jahr beendet 28. Februar 2022	für das Jahr beendet 28. Februar 2021
€ 2.467	€ (16.180)	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	¥ -	¥ -	\$ (21.672)	\$ 17.887	\$ 1.562	\$ 1.046
4.064	15.123	-	-	-	-	-	-	179.010	72.272	1.646	18.055
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	308	99
(46.874)	(148.447)	-	-	-	-	-	-	(92.306)	(19.990)	(2.158)	(865)
<b>(42.810)</b>	<b>(133.324)</b>	-	-	-	-	-	-	<b>86.704</b>	<b>52.282</b>	<b>(204)</b>	<b>17.289</b>
(40.343)	(149.504)	-	-	-	-	-	-	65.032	70.169	1.358	18.335
40.343	189.847	-	-	-	-	-	-	104.349	34.180	26.576	8.241
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
€ -	€ 40.343	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	¥ -	¥ -	\$ 169.381	\$ 104.349	\$ 27.934	\$ 26.576

Die mit „-“ gekennzeichneten Beträge betragen entweder 0 USD/0 EUR/0 ¥/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 ¥/1.000 GBP.

Alle Euro-Beträge, mit Ausnahme des Nettovermögens zu Beginn des Jahres, das den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreiben 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, den Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>α</sup>, den Legg Mason Martin Currie

Der European Unconstrained Fund<sup>α</sup> und der Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>α</sup> wurden in US-Dollar in der Gesamtsumme für die Legg Mason Global Funds Plc für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 umgerechnet, wobei der USD/EUR-Durchschnittskurs von 0,8551 (28. Februar 2021: 0,8635) verwendet wurde.

Das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbare Nettovermögen zum Jahresbeginn 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, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>α</sup>, Der Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>α</sup> und der Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>α</sup> wurden in der Gesamtsumme zum USD/EUR-Schlusskurs zum 28. Februar 2021 von 0 in US-Dollar umgerechnet. 8288 (28. Februar 2020: 0.9058).

Alle britischen Pfund-Beträge, mit Ausnahme des Nettovermögens zu Beginn des Jahres, das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist, für den Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>α</sup> wurden in US-Dollar umgerechnet, und zwar in der Gesamtsumme für die Legg Mason Global Funds Plc für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022, unter Verwendung des USD/GBP-Durchschnittssatzes von 0,7289 (28. Februar 2021: 0,7733).

Das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zurechenbare Nettovermögen des Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>α</sup> zum Jahresbeginn wurde in US-Dollar umgerechnet, wobei der USD/GBP-Schlusskurs zum 28. Februar 2021 von 0,7178 (28. Februar 2020: 0,7799) verwendet wurde.

μ Mit Wirkung vom 14. April 2021 stellte der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>α</sup> den Handel ein.

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

β Mit Wirkung zum 1. Juni 2021 stellte der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>α</sup> den Handel ein.

ð Mit Wirkung zum 1. Dezember 2021 begann der Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>α</sup> mit dem Handel.

ϕ Mit Wirkung zum 10. Januar 2022 begann der Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>α</sup> mit dem Handel.

<sup>α</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1.239	1.291		
Eingelöst	(1.446)	(1.332)		
Nettoabnahme	(207)	(41)		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	727.110	912.236		
Eingelöst	(711.328)	(1.032.908)		
Nettozunahme/(-abnahme)	15.782	(120.672)		
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse B USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	–	300		
Eingelöst	(300)	–		
Nettozunahme/(-abnahme)	(300)	300		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	5	14		
Eingelöst	(3)	(16)		
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(2)		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	104	515		
Eingelöst	(199)	(654)		
Nettoabnahme	(95)	(139)		
<b>Klasse X USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	620.936	554.123		
Eingelöst	(576.820)	(543.282)		
Nettozunahme	44.116	10.841		
<b>Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund</b>				
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	(2)	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	83	1		
Eingelöst	(104)	(120)		
Nettoabnahme	(21)	(119)		
<b>Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)</b>				
Eingelöst	(35)	(102)		
Nettoabnahme	(35)	(102)		
<b>Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	102	406		
Eingelöst	(173)	(587)		
Nettoabnahme	(71)	(181)		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	178	243		
Eingelöst	(192)	(748)		
Nettoabnahme	(14)	(505)		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	42	50		
Eingelöst	(82)	(17)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(40)	33		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	18	50		
Eingelöst	(60)	(26)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(42)	24		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	44		
Eingelöst	(33)	(3)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(32)	41		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	203	488		
Eingelöst	(377)	(199)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(174)	289		
<b>Klasse F USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	104	139		
Eingelöst	(146)	(26)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(42)	113		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	21	12		
Eingelöst	(35)	(5)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(14)	7		
<b>Klasse X USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	(2)	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	4	128		
Eingelöst	(9)	(186)		
Nettoabnahme	(5)	(58)		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	24	22		
Eingelöst	(34)	–		
Nettozunahme/(-abnahme)	(10)	22		
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	39	–		
Eingelöst	(2)	–		
Nettozunahme	37	–		
<b>Klasse GA USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	3	–		
Eingelöst	(4)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse GE USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	488	887		
Eingelöst	(905)	(728)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(417)	159		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	151	225		
Eingelöst	(200)	(190)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(49)	35		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	17	331		
Eingelöst	(220)	(64)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(203)	267		
<b>Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	89	28		
Eingelöst	(22)	(84)		
Nettozunahme/(-abnahme)	67	(56)		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	8	77		
Eingelöst	(66)	(52)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(58)	25		
<b>Klasse B USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	28	120		
Eingelöst	(107)	(38)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(79)	82		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	7	40		
Eingelöst	(31)	(19)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(24)	21		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	78	204		
Eingelöst	(212)	(74)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(134)	130		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	3.782	1.832		
Eingelöst	(1.893)	(2.010)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1.889	(178)		
<b>Klasse F USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	85	116		
Eingelöst	(107)	(71)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(22)	45		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	85	133		
Eingelöst	(251)	(243)		
Nettoabnahme	(166)	(110)		

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – (Fortsetzung)</b>		
<b>Klasse X USD, ausschüttend (D)</b>		
Verkauft	57	24
Eingelöst	(42)	(1)
Nettozunahme	15	23
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	13	136
Eingelöst	(125)	(26)
Nettozunahme/(-abnahme)	(112)	110
<b>Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>		
Verkauft	–	4
Eingelöst	(4)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(4)	4
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	1.083	2.320
Eingelöst	(2.015)	(2.058)
Nettozunahme/(-abnahme)	(932)	262
<b>Klasse Premier USD, ausschüttend (M)</b>		
Verkauft	13	11
Eingelöst	–	(442)
Nettozunahme/(-abnahme)	13	(431)
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	186	408
Eingelöst	(571)	(410)
Nettoabnahme	(385)	(2)
<b>Klasse LM USD, ausschüttend (M)</b>		
Verkauft	263	–
Eingelöst	(21)	–
Nettozunahme	242	–
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(2)	(4)
Nettoabnahme	(2)	(3)
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	(4)
Nettoabnahme	–	(4)
<b>Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)</b>		
Verkauft	2	1
Eingelöst	(2)	(2)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund</b>		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>		
Eingelöst	(2)	–
Nettoabnahme	(2)	–
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (D)</b>		
Verkauft	3	–
Eingelöst	(3)	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	–	–
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	31	3
Eingelöst	(25)	–
Nettozunahme	6	3
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	381	–
Eingelöst	(3)	(139)
Nettozunahme/(-abnahme)	378	(139)
<b>Klasse GA EUR, thesaurierend</b>		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
<b>Klasse GA EUR, ausschüttend (A)</b>		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund</b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	254	33
Eingelöst	(156)	(11)
Nettozunahme	98	22

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>		
Verkauft	84	6
Eingelöst	(28)	(13)
Nettozunahme/(-abnahme)	56	(7)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(2)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>		
Verkauft	1	1
Eingelöst	–	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(1)
<b>Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	5	2
Eingelöst	(1)	(3)
Nettozunahme/(-abnahme)	4	(1)
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	(5)
Nettoabnahme	–	(5)
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	46	18
Eingelöst	(21)	(5)
Nettozunahme	25	13
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>		
Verkauft	38	1
Eingelöst	(13)	(6)
Nettozunahme/(-abnahme)	25	(5)
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	33	14
Eingelöst	(25)	(8)
Nettozunahme	8	6
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	14	4
Eingelöst	(16)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	(2)	2
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	2	–
Eingelöst	(2)	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)</b>		
Verkauft	2	2
Eingelöst	(15)	(6)
Nettoabnahme	(13)	(4)
<b>Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund</b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	79	38
Eingelöst	(108)	(79)
Nettoabnahme	(29)	(41)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>		
Verkauft	27	35
Eingelöst	(148)	(153)
Nettoabnahme	(121)	(118)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>		
Verkauft	7	10
Eingelöst	(10)	(12)
Nettoabnahme	(3)	(2)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>		
Verkauft	8	4
Eingelöst	(11)	(9)
Nettoabnahme	(3)	(5)
<b>Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>		
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	7	4
Eingelöst	(24)	(10)
Nettoabnahme	(17)	(6)

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Eingelöst	(1)	(2)		
Nettoabnahme	(1)	(2)		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	3	–		
Eingelöst	(13)	(11)		
Nettoabnahme	(10)	(11)		
<b>Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	823	755		
Eingelöst	(613)	(857)		
Nettozunahme/(-abnahme)	210	(102)		
<b>Klasse B USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	2	3		
Eingelöst	(1)	(5)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(2)		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	16	3		
Eingelöst	(26)	(17)		
Nettoabnahme	(10)	(14)		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	21	4		
Eingelöst	(29)	(38)		
Nettoabnahme	(8)	(34)		
<b>Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	732	13		
Eingelöst	(744)	(18)		
Nettoabnahme	(12)	(5)		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(4)	(6)		
Nettoabnahme	(3)	(6)		
<b>Klasse E USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(2)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Eingelöst	(1)	(3)		
Nettoabnahme	(1)	(3)		
<b>Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	47	115		
Eingelöst	(42)	(11)		
Nettozunahme	5	104		
<b>Klasse F USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	3	14		
Eingelöst	(15)	(64)		
Nettoabnahme	(12)	(50)		
<b>Klasse X USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	2	8		
Eingelöst	(15)	(13)		
Nettoabnahme	(13)	(5)		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	87	117		
Eingelöst	(124)	(507)		
Nettoabnahme	(37)	(390)		
<b>Klasse Premier USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	342	227		
Eingelöst	(308)	(337)		
Nettozunahme/(-abnahme)	34	(110)		
<b>Klasse Premier CHF, thesaurierend (Abgesichert)</b>				
Verkauft	13	–		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme/(-abnahme)	13	(1)		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	30	10		
Eingelöst	(32)	(16)		
Nettoabnahme	(2)	(6)		
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Eingelöst	(70)	(25)		
Nettoabnahme	(70)	(25)		
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	(8)		
Nettoabnahme	–	(8)		
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	1		
Eingelöst	(168)	(211)		
Nettoabnahme	(167)	(210)		
<b>Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	32		
Eingelöst	(83)	(62)		
Nettoabnahme	(82)	(30)		
<b>Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	387	126		
Eingelöst	(83)	(173)		
Nettozunahme/(-abnahme)	304	(47)		
<b>Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(1.360)	–		
Nettozunahme/(-abnahme)	(1.360)	1		
<b>Legg Mason Western Asset US High Yield Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	235	118		
Eingelöst	(219)	(127)		
Nettozunahme/(-abnahme)	16	(9)		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	280	173		
Eingelöst	(262)	(210)		
Nettozunahme/(-abnahme)	18	(37)		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	69	113		
Eingelöst	(130)	(34)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(61)	79		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	15	18		
Eingelöst	(7)	(19)		
Nettozunahme/(-abnahme)	8	(1)		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	–		
Nettozunahme	1	–		
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	–	–		
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	629	303		
Eingelöst	(613)	(127)		
Nettozunahme	16	176		
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	–		
Nettozunahme	2	–		
<b>Klasse B USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	2	3		
Eingelöst	(12)	(5)		
Nettoabnahme	(10)	(2)		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	4	3		
Eingelöst	(7)	(7)		
Nettoabnahme	(3)	(4)		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	8	12		
Eingelöst	(9)	(27)		
Nettoabnahme	(1)	(15)		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	4	3		
Eingelöst	(3)	(5)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(2)		
<b>Klasse E USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	2	1		
Eingelöst	(2)	(18)		
Nettoabnahme	–	(17)		

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	–	–	1
Eingelöst	–	–	–	(1)
Nettozunahme	1	–	–	–
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	47	36	–	1
Eingelöst	(41)	(9)	(4)	(4)
Nettozunahme	6	27	(4)	(3)
<b>Klasse F USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	2	1	–	1
Eingelöst	–	(12)	(3)	(14)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(11)	(3)	(13)
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	9	–	–	1
Eingelöst	(9)	–	(1)	–
Nettozunahme	–	–	(1)	1
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	469	603	–	1
Eingelöst	(289)	(441)	(1)	(1)
Nettozunahme	180	162	(1)	–
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Eingelöst	(6)	–	–	1
Nettoabnahme	(6)	–	–	1
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	89	5	15
Nettozunahme	–	89	(11)	(5)
<b>Klasse LM USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	255	15	(6)	10
Eingelöst	(158)	(134)	1	–
Nettozunahme/(-abnahme)	97	(119)	1	–
<b>Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	1	288	–
Eingelöst	(1)	–	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1	288	–
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	–	1	–
Eingelöst	(1)	(1)	(2)	–
Nettoabnahme	–	(1)	(1)	–
<b>Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	1	1	1	–
Eingelöst	(2)	(4)	(2)	(2)
Nettoabnahme	(1)	(3)	(1)	(2)
<b>Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	1	–	–	1
Eingelöst	(1)	(2)	–	(9)
Nettoabnahme	–	(2)	–	(8)
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	10	40	1	–
Eingelöst	(22)	(17)	(1)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(12)	23	–	–
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	2	2	38	1
Eingelöst	(7)	(3)	(24)	–
Nettoabnahme	(5)	(1)	14	1
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	–	1	57	76
Eingelöst	(1)	–	(155)	(110)
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1	(98)	(34)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	6	3	–	–
Eingelöst	(7)	(5)	–	–
Nettoabnahme	(1)	(2)	–	–
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	1	–	–
Eingelöst	(1)	–	–	–
Nettozunahme	–	1	–	–
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)</b>				
Eingelöst	–	(1)	–	–
Nettoabnahme	–	(1)	–	–
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	10	126	116	97
Eingelöst	(1)	(270)	(68)	(52)
Nettozunahme/(-abnahme)	9	(144)	48	45
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	–	1	–
Eingelöst	–	–	(1)	–
Nettozunahme	–	–	–	–
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	–	38	1
Eingelöst	–	–	(24)	–
Nettozunahme	–	–	14	1
<b>Klasse LM USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	–	–	57	76
Eingelöst	–	–	(155)	(110)
Nettoabnahme	–	–	(98)	(34)
<b>Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	–	32	62
Eingelöst	–	–	(41)	(65)
Nettoabnahme	–	–	(9)	(3)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	–	–	24	32
Eingelöst	–	–	(47)	(55)
Nettoabnahme	–	–	(23)	(23)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	–	–	116	97
Eingelöst	–	–	(68)	(52)
Nettozunahme	–	–	48	45

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	32	15		
Eingelöst	(48)	(51)		
Nettoabnahme	(16)	(36)		
<b>Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	29	26		
Eingelöst	(34)	(50)		
Nettoabnahme	(5)	(24)		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	17	–		
Eingelöst	(16)	(5)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(5)		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	5		
Eingelöst	(5)	(5)		
Nettoabnahme	(5)	–		
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	2.905	18.385		
Eingelöst	(16.116)	(5.129)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(13.211)	13.256		
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse B USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	3	–		
Eingelöst	(4)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	1		
Eingelöst	(2)	(2)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	5	2		
Eingelöst	(25)	(21)		
Nettoabnahme	(20)	(19)		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	4	1		
Eingelöst	(3)	(3)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(2)		
<b>Klasse E USD, ausschüttend (D)</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	13	1		
Eingelöst	(2)	(2)		
Nettozunahme/(-abnahme)	11	(1)		
<b>Klasse F USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	39	4		
Eingelöst	(38)	(5)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(1)		
<b>Klasse X USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	32	11		
Eingelöst	(8)	(2)		
Nettozunahme	24	9		
<b>Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)</b>				
Verkauft	19	12		
Eingelöst	(3)	(3)		
Nettozunahme	16	9		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	56	122		
Eingelöst	(91)	(176)		
Nettoabnahme	(35)	(54)		
<b>Premier-Klasse, ausschüttend USD (M) Plus (e)</b>				
Eingelöst	–	(23)		
Nettoabnahme	–	(23)		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	3	4		
Eingelöst	(2)	(11)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(7)		
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	3	–		
Eingelöst	(3)	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	2	1		
Eingelöst	(13)	(3)		
Nettoabnahme	(11)	(2)		
<b>Klasse L (G) USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	1	1		
Eingelöst	(1)	(4)		
Nettoabnahme	–	(3)		
<b>Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	14	6		
Eingelöst	(4)	(17)		
Nettozunahme/(-abnahme)	10	(11)		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	22	13		
Eingelöst	(28)	(19)		
Nettoabnahme	(6)	(6)		
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(1)		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	2	–		
Nettozunahme	2	–		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	72	–		
Eingelöst	(9)	–		
Nettozunahme	63	–		
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	738		
Eingelöst	–	(619)		
Nettozunahme	–	119		
<b>Klasse L (G) USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	117	117		
Eingelöst	(145)	(177)		
Nettoabnahme	(28)	(60)		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	12	8		
Eingelöst	(18)	(33)		
Nettoabnahme	(6)	(25)		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	150	705		
Eingelöst	(561)	(531)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(411)	174		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	13	54		
Eingelöst	(82)	(117)		
Nettoabnahme	(69)	(63)		
<b>Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	34	230		
Eingelöst	(158)	(270)		
Nettoabnahme	(124)	(40)		
<b>Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	5		
Eingelöst	(5)	–		
Nettozunahme/(-abnahme)	(5)	5		

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	53	339	-	5
Eingelöst	(240)	(1.113)	(5)	-
Nettozunahme/(-abnahme)	(187)	(774)	(5)	5
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	6	54	73	209
Eingelöst	(14)	(50)	(110)	(56)
Nettozunahme/(-abnahme)	(8)	4	(37)	153
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	5	8	40	156
Eingelöst	(12)	(11)	(42)	(155)
Nettozunahme/(-abnahme)	(7)	(3)	(2)	1
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (A)</b>				
Eingelöst	(1)	-	52	9
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	-	(30)	(5)
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	145	1.111	22	22
Eingelöst	(1.076)	(843)	(157)	-
Nettozunahme/(-abnahme)	(931)	268	11	22
<b>Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	94	197	218	17
Eingelöst	(348)	(460)	(228)	-
Nettozunahme/(-abnahme)	(254)	(263)	(10)	17
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	3.739	10.961	102	-
Eingelöst	(5.937)	(8.086)	(102)	-
Nettozunahme/(-abnahme)	(2.198)	2.875	-	-
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	4.131	2.677	-	1
Eingelöst	(4.100)	(6.082)	-	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	31	(3.405)	-	-
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	-	(1)	-	23
Nettozunahme/(-abnahme)	-	(1)	(12)	(16)
<b>Klasse B USD, ausschüttend (D)</b>				
Eingelöst	(1)	-	(12)	7
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	-	(12)	7
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(3)	(3)	-	-
Nettozunahme/(-abnahme)	(3)	(3)	-	-
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	1	1	10	-
Eingelöst	(9)	(6)	10	-
Nettozunahme/(-abnahme)	(8)	(5)	10	-
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	3	-	-
Eingelöst	(3)	-	-	-
Nettozunahme/(-abnahme)	(2)	3	-	-
<b>Klasse E USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	1	-	-	-
Eingelöst	(1)	-	-	-
Nettozunahme/(-abnahme)	-	-	-	-
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	9	73	2.641	35
Eingelöst	(67)	(43)	(446)	(9)
Nettozunahme/(-abnahme)	(58)	30	2.195	26
<b>Klasse F USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	-	3	(3)	-
Eingelöst	-	(1)	(3)	-
Nettozunahme/(-abnahme)	-	2	(3)	-
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	78	42	41
Eingelöst	(70)	(11)	(14)	(4)
Nettozunahme/(-abnahme)	(68)	67	28	37
<b>Klasse X USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	3	12	2	3
Eingelöst	-	(1)	(1)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	11	1	1
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	2	16	35
Eingelöst	(1)	-	(21)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	-	2	(5)	30
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	-	-	-
Eingelöst	-	-	-	-
Nettozunahme/(-abnahme)	-	-	-	-
<b>Klasse X EUR, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	-	-	-	-
Eingelöst	-	-	-	-
Nettozunahme/(-abnahme)	-	-	-	-
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	-	108	318
Eingelöst	-	-	(179)	(83)
Nettozunahme/(-abnahme)	-	-	(71)	235
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	-	-	65	91
Eingelöst	-	-	(97)	-
Nettozunahme/(-abnahme)	-	-	(32)	91
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	-	-	62	117
Eingelöst	-	-	(72)	(22)
Nettozunahme/(-abnahme)	-	-	(10)	95
<b>Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	-	-	2.641	35
Eingelöst	-	-	(446)	(9)
Nettozunahme/(-abnahme)	-	-	2.195	26
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	-	-	(3)	-
Nettozunahme/(-abnahme)	-	-	(3)	-
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	-	42	41
Eingelöst	-	-	(14)	(4)
Nettozunahme/(-abnahme)	-	-	28	37
<b>Klasse C USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	-	-	2	3
Eingelöst	-	-	(1)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	-	-	1	1
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	-	16	35
Eingelöst	-	-	(21)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	-	-	(5)	30

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse E USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	–	42	–	53
Eingelöst	(3)	(1)	(42)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(3)	41	(42)	53
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	47	107	13	12
Eingelöst	(89)	(7)	(10)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	(42)	100	3	7
<b>Klasse F USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	16	5	24	–
Eingelöst	(1)	(4)	(1)	–
Nettozunahme	15	1	23	–
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	88	25	–	–
Eingelöst	(28)	–	–	–
Nettozunahme	60	25	–	–
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	223	239	15	70
Eingelöst	(189)	(91)	(5)	(80)
Nettozunahme	34	148	10	(10)
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	170	584	1	1
Eingelöst	(190)	(318)	(2)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	(20)	266	(1)	–
<b>Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	2	1	–
Eingelöst	(2)	–	(1)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(2)	2	1	–
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Eingelöst	–	(1)	–	–
Nettoabnahme	–	(1)	–	–
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	3	–	–
Eingelöst	(9)	(1)	1	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(8)	2	–	–
<b>Ausschüttende Klasse S USD (M) Plus (e)</b>				
Verkauft	10	117	2	6
Eingelöst	(121)	(29)	(23)	(28)
Nettozunahme/(-abnahme)	(111)	88	(21)	(22)
<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	–	9	39
Nettozunahme	1	–	(5)	–
<b>Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)Ä Plus (e)</b>				
Verkauft	4	17	4	39
Eingelöst	(10)	(13)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(6)	4	–	–
<b>Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)Ä Plus (e)</b>				
Verkauft	337	897	–	–
Eingelöst	(756)	(400)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(419)	497	–	–
<b>Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	155	–	–	–
Nettozunahme	155	–	–	–
<b>Ausschüttende AUD der Klasse S (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	–	29	–	–
Eingelöst	(20)	(9)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(20)	20	–	–
<b>Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^</b>				
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Eingelöst	–	(1)	–	(3)
Nettoabnahme	–	(1)	–	(3)
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	24	–	–	–
Eingelöst	(1)	–	–	–
Nettozunahme	23	–	–	–
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	176	522	–	–
Eingelöst	(644)	(399)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(468)	123	–	–
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	53	202	–	–
Eingelöst	(62)	(338)	–	–
Nettoabnahme	(9)	(136)	–	–
<b>Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	–	15	70
Eingelöst	–	–	(5)	(80)
Nettozunahme/(-abnahme)	–	–	10	(10)
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	–	1	1
Eingelöst	–	–	(2)	(1)
Nettoabnahme	–	–	(1)	–
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	–	1	–
Nettozunahme	–	–	1	–
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	–	1	–
Nettozunahme	–	–	1	–
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	–	2	6
Eingelöst	–	–	(23)	(28)
Nettoabnahme	–	–	(21)	(22)
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	–	9	39
Eingelöst	–	–	(5)	–
Nettozunahme	–	–	4	39
<b>Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund</b>				
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (D)</b>				
Eingelöst	–	(3)	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)	–	(3)
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	1	–	–
Eingelöst	–	(7)	–	–
Nettoabnahme	–	(6)	–	–
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Eingelöst	–	(2)	–	–
Nettoabnahme	–	(2)	–	–
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(43)	(18)	(43)	(18)
Nettoabnahme	(43)	(18)	(43)	(18)
<b>Klasse LM EUR, ausschüttend (Q)</b>				
Verkauft	1	3	–	–
Eingelöst	(83)	(11)	–	–
Nettoabnahme	(82)	(8)	–	–
<b>Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2.007	1.666	–	–
Eingelöst	(3.791)	(2.933)	–	–
Nettoabnahme	(1.784)	(1.267)	–	–
<b>Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)</b>				
Verkauft	879	859	–	–
Eingelöst	(1.679)	(2.137)	–	–
Nettoabnahme	(800)	(1.278)	–	–
<b>Klasse A USD, ausschüttend (S)</b>				
Verkauft	196	1.073	–	–
Eingelöst	(398)	(1.433)	–	–
Nettoabnahme	(202)	(360)	–	–
<b>Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	2	4	–	–
Eingelöst	(25)	(72)	–	–
Nettoabnahme	(23)	(68)	–	–

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	41	86		
Eingelöst	(267)	(343)		
Nettoabnahme	(226)	(257)		
<b>Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	19	17		
Eingelöst	(56)	(40)		
Nettoabnahme	(37)	(23)		
<b>Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	22	7		
Eingelöst	(58)	(26)		
Nettoabnahme	(36)	(19)		
<b>Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	71	84		
Eingelöst	(78)	(96)		
Nettoabnahme	(7)	(12)		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1.392	1.470		
Eingelöst	(2.029)	(2.942)		
Nettoabnahme	(637)	(1.472)		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	23	22		
Eingelöst	(45)	(64)		
Nettoabnahme	(22)	(42)		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	26	37		
Eingelöst	(68)	(198)		
Nettoabnahme	(42)	(161)		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)</b>				
Verkauft	23	20		
Eingelöst	(61)	(145)		
Nettoabnahme	(38)	(125)		
<b>Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	42	532		
Eingelöst	(339)	(699)		
Nettoabnahme	(297)	(167)		
<b>Klasse A GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	2		
Eingelöst	(1)	(2)		
Nettozunahme	-	-		
<b>Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	25	22		
Eingelöst	(82)	(124)		
Nettoabnahme	(57)	(102)		
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	39	1		
Eingelöst	(97)	(1)		
Nettoabnahme	(58)	-		
<b>Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	166	298		
Eingelöst	(4.643)	(899)		
Nettoabnahme	(4.477)	(601)		
<b>Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	27.402	13.644		
Eingelöst	(25.220)	(33.832)		
Nettozunahme/(-abnahme)	2.182	(20.188)		
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	13.149	15.278		
Eingelöst	(39.116)	(64.547)		
Nettoabnahme	(25.967)	(49.269)		
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus (e)</b>				
Verkauft	50	122		
Eingelöst	-	(122)		
Nettozunahme	50	-		
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(3)	-		
Nettoabnahme	(3)	-		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	164	64		
Eingelöst	(343)	(147)		
Nettoabnahme	(179)	(83)		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (S)</b>				
Verkauft	6	3		
Eingelöst	(23)	(29)		
Nettoabnahme	(17)	(26)		
<b>Klasse A NOK, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	594	229		
Eingelöst	(185)	(73)		
Nettozunahme	409	156		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	57	27		
Eingelöst	(158)	(107)		
Nettoabnahme	(101)	(80)		
<b>Klasse E USD, ausschüttend (S)</b>				
Verkauft	4	4		
Eingelöst	(9)	(18)		
Nettoabnahme	(5)	(14)		
<b>Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	3	7		
Eingelöst	(38)	(29)		
Nettoabnahme	(35)	(22)		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	476	355		
Eingelöst	(784)	(538)		
Nettoabnahme	(308)	(183)		
<b>Klasse F USD, ausschüttend (S)</b>				
Verkauft	78	33		
Eingelöst	(71)	(73)		
Nettozunahme/(-abnahme)	7	(40)		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	469	587		
Eingelöst	(892)	(810)		
Nettoabnahme	(423)	(223)		
<b>Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)</b>				
Verkauft	163	290		
Eingelöst	(295)	(417)		
Nettoabnahme	(132)	(127)		
<b>Klasse X USD, ausschüttend (S)</b>				
Verkauft	67	26		
Eingelöst	(99)	(83)		
Nettoabnahme	(32)	(57)		
<b>Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	52	33		
Eingelöst	(107)	(60)		
Nettoabnahme	(55)	(27)		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	374	584		
Eingelöst	(734)	(811)		
Nettoabnahme	(360)	(227)		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	9	6		
Eingelöst	(82)	(33)		
Nettoabnahme	(73)	(27)		
<b>Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)</b>				
Verkauft	148	17		
Eingelöst	(165)	(116)		
Nettoabnahme	(17)	(99)		
<b>Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	8	2		
Eingelöst	(10)	(9)		
Nettoabnahme	(2)	(7)		
<b>Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	135	138		
Eingelöst	(319)	(260)		
Nettoabnahme	(184)	(122)		
<b>Klasse X GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	3	12		
Eingelöst	(17)	(32)		
Nettoabnahme	(14)	(20)		
<b>Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	27	11		
Eingelöst	(39)	(24)		
Nettoabnahme	(12)	(13)		

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)</b>		
<b>Klasse X SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	1.560	1.827
Eingelöst	(1.457)	(1.032)
Nettozunahme	103	795
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	745	1.491
Eingelöst	(3.017)	(3.022)
Nettoabnahme	(2.272)	(1.531)
<b>Klasse Premier USD, ausschüttend (S)</b>		
Verkauft	333	215
Eingelöst	(674)	(384)
Nettoabnahme	(341)	(169)
<b>Klasse Premier AUD, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	–	6
Eingelöst	(27)	(4)
Nettozunahme/(-abnahme)	(27)	2
<b>Klasse Premier AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)</b>		
Verkauft	111	91
Eingelöst	(153)	(84)
Nettozunahme/(-abnahme)	(42)	7
<b>Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	213	1.211
Eingelöst	(1.727)	(1.276)
Nettoabnahme	(1.514)	(65)
<b>Klasse Premier CHF, thesaurierend (Abgesichert)</b>		
Verkauft	49	76
Eingelöst	(80)	(84)
Nettoabnahme	(31)	(8)
<b>Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)</b>		
Verkauft	25	3
Eingelöst	(20)	(95)
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(92)
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	3.637	1.372
Eingelöst	(4.003)	(2.090)
Nettoabnahme	(366)	(718)
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	89	144
Eingelöst	(114)	(64)
Nettozunahme/(-abnahme)	(25)	80
<b>Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)</b>		
Verkauft	124	481
Eingelöst	(826)	(181)
Nettozunahme/(-abnahme)	(702)	300
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	147	210
Eingelöst	(1.148)	(846)
Nettoabnahme	(1.001)	(636)
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>		
Verkauft	556	748
Eingelöst	(2.011)	(963)
Nettoabnahme	(1.455)	(215)
<b>Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	38	52
Eingelöst	(92)	(170)
Nettoabnahme	(54)	(118)
<b>Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	–	22
Eingelöst	(74)	(74)
Nettoabnahme	(74)	(52)
<b>Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	1	17
Eingelöst	(12)	(460)
Nettoabnahme	(11)	(443)
<b>Klasse S USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	(14)	(107)
Nettoabnahme	(14)	(107)
<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	1.215	52
Eingelöst	(1.404)	(23)
Nettozunahme/(-abnahme)	(189)	29
<b>Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)</b>		
Verkauft	237	562
Eingelöst	(432)	(311)
Nettozunahme/(-abnahme)	(195)	251

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(2)	(3)
Nettoabnahme	(1)	(2)
<b>Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup></b>		
<b>Klasse A USD thesaurierend</b>		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
<b>Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)</b>		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	–	15
Eingelöst	–	(88)
Nettoabnahme	–	(73)
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	59	15
Eingelöst	(81)	(4)
Nettozunahme/(-abnahme)	(22)	11
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>		
Verkauft	–	3
Eingelöst	–	(5)
Nettoabnahme	–	(2)
<b>Klasse S USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	7	18
Eingelöst	(7)	–
Nettozunahme	–	18
<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	99	77
Eingelöst	(87)	(29)
Nettozunahme	12	48
<b>Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	58	39
Eingelöst	(18)	(22)
Nettozunahme	40	17
<b>Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	227	439
Eingelöst	(57)	(95)
Nettozunahme	170	344
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	340	48
Eingelöst	(269)	(41)
Nettozunahme	71	7
<b>Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	99	702
Eingelöst	(4.253)	(328)
Nettozunahme/(-abnahme)	(4.154)	374
<b>S Klasse CHF Ausschüttend (A)</b>		
Verkauft	200	–
Nettozunahme	200	–
<b>Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup></b>		
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	6	2
Eingelöst	(8)	(12)
Nettoabnahme	(2)	(10)
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>		
Eingelöst	–	(27)
Nettoabnahme	–	(27)
<b>Klasse D USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	(91)	(120)
Nettoabnahme	(91)	(120)

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)</b>		
<b>Klasse D USD ausschüttend (M) Plus</b>		
Verkauft	–	90
Eingelöst	(107)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(107)	90
<b>Klasse D USD, ausschüttend (M)</b>		
Verkauft	3	319
Eingelöst	(256)	(135)
Nettozunahme/(-abnahme)	(253)	184
<b>Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	1	5
Eingelöst	(6)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(5)	5
<b>Klasse M GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>		
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Klasse M USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	–	8
Eingelöst	(8)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(8)	8
<b>Klasse M USD, ausschüttend (M)</b>		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(10)	–
Nettoabnahme	(9)	–
<b>Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	8	–
Nettozunahme	8	–
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	299	715
Eingelöst	(456)	(4.126)
Nettoabnahme	(157)	(3.411)
<b>Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)</b>		
Verkauft	–	12
Eingelöst	(22)	(35)
Nettoabnahme	(22)	(23)
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	750	634
Eingelöst	(1.241)	(2.288)
Nettoabnahme	(491)	(1.654)
<b>Klasse Premier EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert)</b>		
Verkauft	34	45
Eingelöst	(110)	(59)
Nettoabnahme	(76)	(14)
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>		
Verkauft	17	24
Eingelöst	(5)	(267)
Nettozunahme/(-abnahme)	12	(243)
<b>Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	–	500
Nettozunahme	–	500
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	708	48
Eingelöst	(11)	(671)
Nettozunahme/(-abnahme)	697	(623)
<b>Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup></b>		
<b>Premier Class in USD thesaurierend</b>		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(18)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(18)	2
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	7	9
Eingelöst	(29)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	(22)	8
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	3.160	212
Eingelöst	–	(2.516)
Nettozunahme/(-abnahme)	3.160	(2.304)
<b>Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup></b>		
<b>Klasse LM GBP, thesaurierend</b>		
Eingelöst	–	(327)
Nettoabnahme	–	(327)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	2	29
Eingelöst	(72)	(17)
Nettozunahme/(-abnahme)	(70)	12
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	197	44
Eingelöst	(158)	(72)
Nettozunahme/(-abnahme)	39	(28)
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	7	2
Eingelöst	(10)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(3)	2
<b>Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	–	313
Nettozunahme	–	313
<b>Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup></b>		
<b>Ausschüttende LM-Klasse in USD (Q)</b>		
Verkauft	18	226
Nettozunahme	18	226
<b>Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup> €</b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	–	–
Eingelöst	–	–
Nettozunahme	–	–
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	–	–
Eingelöst	–	–
Nettozunahme	–	–
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	25	–
Eingelöst	–	–
Nettozunahme	25	–
<b>Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	142	–
Eingelöst	–	–
Nettozunahme	142	–
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	–	–
Eingelöst	–	–
Nettozunahme	–	–
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	–	–
Eingelöst	–	–
Nettozunahme	–	–
<b>Klasse S USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	48	–
Eingelöst	–	–
Nettozunahme	48	–
<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	–	–
Eingelöst	–	–
Nettozunahme	–	–

## Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	38	30
Eingelöst	(73)	(54)
Nettoabnahme	(35)	(24)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>		
Eingelöst	(3)	–
Nettoabnahme	(3)	–
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>		
Verkauft	3	6
Eingelöst	(7)	(14)
Nettoabnahme	(4)	(8)

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse A USD, ausschüttend (S)</b>				
Verkauft	32	20		
Eingelöst	(45)	(289)		
Nettoabnahme	(13)	(269)		
<b>Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	–	2		
Eingelöst	(3)	(15)		
Nettoabnahme	(3)	(13)		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	22	9		
Eingelöst	(102)	(120)		
Nettoabnahme	(80)	(111)		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	7	2		
Eingelöst	(2)	(3)		
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(1)		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(2)	(1)		
Nettoabnahme	(2)	–		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	2	2		
Eingelöst	(19)	(22)		
Nettoabnahme	(17)	(20)		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (S)</b>				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	2	2		
Eingelöst	(3)	(3)		
Nettoabnahme	(1)	(1)		
<b>Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	8	2		
Eingelöst	(18)	(8)		
Nettoabnahme	(10)	(6)		
<b>Klasse A SGD, thesaurierend</b>				
Verkauft	3.290	897		
Eingelöst	(3.362)	(1.395)		
Nettoabnahme	(72)	(498)		
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse B USD, ausschüttend (S)</b>				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	5	–		
Eingelöst	(9)	(1)		
Nettoabnahme	(4)	(1)		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (S)</b>				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	(9)	(10)		
Nettoabnahme	(7)	(10)		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	(8)	(4)		
Nettoabnahme	(6)	(4)		
<b>Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>				
Eingelöst	(5)	(8)		
Nettoabnahme	(5)	(8)		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	2		
Eingelöst	(1)	(22)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(20)		
<b>Klasse F USD, ausschüttend (S)</b>				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	(2)	–		
Nettozunahme	–	–		
<b>Klasse R USD, ausschüttend (S)</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)</b>				
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	(1)	(1)		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	6	3		
Eingelöst	(5)	(77)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(74)		
<b>Klasse X USD, ausschüttend (S)</b>				
Verkauft	3	–		
Eingelöst	(4)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	1	1		
Eingelöst	(2)	(1)		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	5		
Eingelöst	(3)	(25)		
Nettoabnahme	(3)	(20)		
<b>Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)</b>				
Eingelöst	(5)	(3)		
Nettoabnahme	(5)	(3)		
<b>Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	1	2		
Eingelöst	(2)	(39)		
Nettoabnahme	(1)	(37)		
<b>Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	91	82		
Eingelöst	(131)	(224)		
Nettoabnahme	(40)	(142)		
<b>Klasse X GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	71	47		
Eingelöst	(80)	(212)		
Nettoabnahme	(9)	(165)		
<b>Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	22	48		
Eingelöst	(87)	(240)		
Nettoabnahme	(65)	(192)		
<b>Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)</b>				
Verkauft	32	67		
Eingelöst	(108)	(180)		
Nettoabnahme	(76)	(113)		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	7	401		
Eingelöst	(154)	(1.607)		
Nettoabnahme	(147)	(1.206)		
<b>Klasse Premier USD, ausschüttend (S)</b>				
Eingelöst	(1)	(102)		
Nettoabnahme	(1)	(102)		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	9	110		
Eingelöst	(168)	(558)		
Nettoabnahme	(159)	(448)		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Eingelöst	(338)	(121)		
Nettoabnahme	(338)	(121)		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	18		
Eingelöst	(7)	(100)		
Nettoabnahme	(6)	(82)		
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	54		
Eingelöst	(2)	(540)		
Nettoabnahme	(2)	(486)		
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	1	11		
Eingelöst	(5)	(133)		
Nettoabnahme	(4)	(122)		
<b>Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	107	–		
Eingelöst	(41)	(989)		
Nettozunahme/(-abnahme)	66	(989)		
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	11	13		
Eingelöst	(20)	(6)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(9)	7		

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^</b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	(202)
Nettoabnahme	–	(202)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>		
Verkauft	2	3
Eingelöst	(2)	(120)
Nettoabnahme	–	(117)
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	1	59
Eingelöst	–	(62)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(3)
<b>Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	–	51
Eingelöst	–	(51)
Nettozunahme	–	–
<b>Klasse A SGD, thesaurierend</b>		
Verkauft	176	1.844
Eingelöst	(176)	(3.399)
Nettoabnahme	–	(1.555)
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Klasse E USD, ausschüttend (A)</b>		
Eingelöst	(3)	(1)
Nettoabnahme	(3)	(1)
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	–	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
<b>Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	4	–
Nettozunahme	4	–
<b>Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(2)	–
Nettoabnahme	(1)	–
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	184	74
Eingelöst	(14)	(511)
Nettozunahme/(-abnahme)	170	(437)
<b>Klasse Premier USD, ausschüttend (A)</b>		
Eingelöst	–	(81)
Nettoabnahme	–	(81)
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	20	20
Eingelöst	(47)	(304)
Nettoabnahme	(27)	(284)
<b>Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)</b>		
Verkauft	6	19
Eingelöst	(57)	(259)
Nettoabnahme	(51)	(240)
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>		
Verkauft	–	17
Eingelöst	–	(150)
Nettoabnahme	–	(133)
<b>Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Eingelöst	(15)	–
Nettoabnahme	(15)	–
<b>Klasse Premier SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Eingelöst	(151.908)	(96.609)
Nettoabnahme	(151.908)	(96.609)
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	(43)	–
Nettoabnahme	(43)	–
<b>Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	1.795	–
Nettozunahme	1.795	–

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^</b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	2	–
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(1)
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	(4)	(1)
Nettoabnahme	(4)	(1)
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
<b>Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund</b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	18	13
Eingelöst	(15)	(140)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(127)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>		
Verkauft	2	3
Eingelöst	(1)	(114)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(111)
<b>Klasse A SGD, thesaurierend</b>		
Verkauft	11.856	9.613
Eingelöst	(11.977)	(9.425)
Nettozunahme/(-abnahme)	(121)	188
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(2)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	(2)	(1)
Nettoabnahme	(2)	(1)
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	18	13
Eingelöst	(23)	(2)
Nettozunahme/(-abnahme)	(5)	11
<b>Klasse F USD, ausschüttend (M)</b>		
Verkauft	–	3
Eingelöst	(9)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(9)	3
<b>Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)</b>		
Verkauft	10	6
Eingelöst	(7)	–
Nettozunahme	3	6
<b>Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>		
Verkauft	3	–
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	2	–
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>		
Eingelöst	(7)	(13)
Nettoabnahme	(7)	(13)
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	83	870
Eingelöst	(940)	(772)
Nettozunahme/(-abnahme)	(857)	98
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)</b>		
Eingelöst	(5)	(2)
Nettoabnahme	(5)	(2)
<b>Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>		
Verkauft	2	–
Eingelöst	–	(123)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(123)
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	2	4
Eingelöst	(5)	(17)
Nettoabnahme	(3)	(13)
<b>Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>		
Verkauft	99	183
Eingelöst	(1.579)	(322)
Nettoabnahme	(1.480)	(139)

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1.529	582		
Eingelöst	(495)	(71)		
Nettozunahme	1.034	511		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	14	15		
Eingelöst	(3)	(2)		
Nettozunahme	11	13		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	208	136		
Eingelöst	(47)	–		
Nettozunahme	161	136		
<b>Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)</b>				
Verkauft	1.486	580		
Eingelöst	(404)	(26)		
Nettozunahme	1.082	554		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	773	11		
Eingelöst	(58)	–		
Nettozunahme	715	11		
<b>Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	51	–		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	50	–		
<b>Klasse A AUD ausschüttend (M) Plus (abgesichert)</b>				
Verkauft	63	–		
Nettozunahme	63	–		
<b>Klasse A CNH Ausschüttende (M) Abgesicherte Plus</b>				
Verkauft	80	–		
Nettozunahme	80	–		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	322	101		
Eingelöst	(59)	(11)		
Nettozunahme	263	90		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)</b>				
Verkauft	176	60		
Eingelöst	(50)	(39)		
Nettozunahme	126	21		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	229	213		
Eingelöst	(133)	(27)		
Nettozunahme	96	186		
<b>Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	32	–		
Eingelöst	(2)	–		
Nettozunahme	30	–		
<b>Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	49	30		
Eingelöst	(14)	(1)		
Nettozunahme	35	29		
<b>Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	28	–		
Eingelöst	(2)	–		
Nettozunahme	26	–		
<b>Klasse A HKD, thesaurierend</b>				
Verkauft	64	–		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	63	–		
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	1.610	–		
Eingelöst	(136)	–		
Nettozunahme	1.474	–		
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	5.682	299		
Eingelöst	(258)	–		
Nettozunahme	5.424	299		
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	59.557	34.596		
Eingelöst	(14.289)	(13.694)		
Nettozunahme	45.268	20.902		
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	12.877	198		
Eingelöst	(481)	–		
Nettozunahme	12.396	198		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			401	20
Eingelöst			(27)	–
Nettozunahme			374	20
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft			13	4
Eingelöst			(2)	–
Nettozunahme			11	4
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			239	139
Eingelöst			(44)	(11)
Nettozunahme			195	128
<b>Klasse E USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft			8	2
Eingelöst			(3)	(1)
Nettozunahme			5	1
<b>Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft			40	13
Eingelöst			(9)	–
Nettozunahme			31	13
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			422	36
Eingelöst			(56)	–
Nettozunahme			366	36
<b>Klasse F USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft			61	7
Eingelöst			(12)	(2)
Nettozunahme			49	5
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			160	3
Eingelöst			(18)	–
Nettozunahme			142	3
<b>Klasse X USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft			1	–
Eingelöst			(1)	(1)
Nettoabnahme			–	(1)
<b>Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)</b>				
Verkauft			324	211
Eingelöst			(149)	(131)
Nettozunahme			175	80
<b>Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft			11	–
Nettozunahme			11	–
<b>Klasse X CHF Ausschüttend (A) (abgesichert)</b>				
Verkauft			30	1
Eingelöst			(2)	–
Nettozunahme			28	1
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft			416	1
Eingelöst			(77)	–
Nettozunahme			339	1
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft			4	8
Eingelöst			(1)	–
Nettozunahme			3	8
<b>Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft			121	168
Eingelöst			(92)	(4)
Nettozunahme			29	164
<b>Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft			68	21
Eingelöst			(16)	(8)
Nettozunahme			52	13
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			910	25
Eingelöst			(113)	(5)
Nettozunahme			797	20
<b>Premier-Klasse, ausschüttend USD (M) Plus (e)</b>				
Verkauft			233	22
Eingelöst			(57)	(2)
Nettozunahme			176	20
<b>Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft			135	–
Eingelöst			(17)	–
Nettozunahme			118	–

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)</b>		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	1.312	126
Eingelöst	(392)	(29)
Nettozunahme	920	97
<b>Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>		
Verkauft	400	53
Eingelöst	(33)	(8)
Nettozunahme	367	45
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>		
Verkauft	20	2
Eingelöst	(5)	(1)
Nettozunahme	15	1
<b>Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	650	1.227
Eingelöst	(1.616)	(358)
Nettozunahme/(-abnahme)	(966)	869
<b>Klasse S USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	1.990	604
Eingelöst	(452)	(352)
Nettozunahme	1.538	252
<b>S Klasse USD Ausschüttend (Q) Plus (e)</b>		
Verkauft	3	–
Nettozunahme	3	–
<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	492	125
Eingelöst	(79)	(14)
Nettozunahme	413	111
<b>Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>		
Verkauft	72	92
Eingelöst	(65)	(80)
Nettozunahme	7	12
<b>Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>		
Verkauft	15	–
Eingelöst	(14)	(7)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(7)
<b>Klasse LM USD, ausschüttend (M)</b>		
Verkauft	87	–
Eingelöst	(8)	–
Nettozunahme	79	–
<b>Klasse LM AUD, ausschüttend (Q) (abgesichert)</b>		
Eingelöst	–	(3)
Nettoabnahme	–	(3)
<b>LM-Klasse Euro ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)</b>		
Verkauft	418	–
Nettozunahme	418	–
<b>Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	16	216
Eingelöst	(9)	(3)
Nettozunahme	7	213
<b>Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^</b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	2	130
Eingelöst	(19)	(9)
Nettozunahme/(-abnahme)	(17)	121
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	136	29
Eingelöst	(43)	(55)
Nettozunahme/(-abnahme)	93	(26)
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	(58)	–
Nettoabnahme	(58)	–
<b>Klasse S BRL, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	22	–
Eingelöst	(125)	–
Nettoabnahme	(103)	–
<b>Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^</b>		
<b>Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)</b>		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^</b>		
<b>Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	9.442	25.768
Eingelöst	(10.719)	(24.235)
Nettozunahme/(-abnahme)	(1.277)	1.533
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	–	35
Eingelöst	(145)	(68)
Nettoabnahme	(145)	(33)
<b>Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	1.584	–
Eingelöst	(4.864)	–
Nettoabnahme	(3.280)	–
<b>Klasse LM SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Eingelöst	–	(96.043)
Nettoabnahme	–	(96.043)
<b>Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^</b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	1	–
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(1)
<b>Klasse S USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	–	(16)
Nettoabnahme	–	(16)
<b>Legg Mason ClearBridge Value Fund</b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	920	58
Eingelöst	(266)	(105)
Nettozunahme/(-abnahme)	654	(47)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>		
Verkauft	63	8
Eingelöst	(43)	(24)
Nettozunahme/(-abnahme)	20	(16)
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	–	–
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	67	2
Eingelöst	(28)	–
Nettozunahme	39	2
<b>Klasse A GBP, ausschüttend (A)</b>		
Verkauft	3	–
Eingelöst	(3)	–
Nettozunahme	–	–
<b>Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	1.920	316
Eingelöst	(931)	(205)
Nettozunahme	989	111
<b>Klasse A SGD, thesaurierend</b>		
Verkauft	3.159	293
Eingelöst	(1.532)	(467)
Nettozunahme/(-abnahme) 1,	627	(174)
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	101	2
Eingelöst	(49)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	52	(3)
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>		
Verkauft	5	–
Eingelöst	(2)	(6)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(6)
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	37	–
Eingelöst	(10)	–
Nettozunahme	27	–
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	93	–
Eingelöst	(28)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	65	(1)
<b>Klasse F USD, ausschüttend (A)</b>		
Verkauft	15	1
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	14	1

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason ClearBridge Value Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse X USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	246	122		
Eingelöst	(308)	(3)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(62)	119		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	36	4		
Eingelöst	(3)	–		
Nettozunahme	33	4		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	444	293		
Eingelöst	(268)	(304)		
Nettozunahme/(-abnahme)	176	(11)		
<b>Klasse Premier USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(1)		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	283	–		
Eingelöst	(16)	–		
Nettozunahme	267	–		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	399	161		
Eingelöst	(172)	(1)		
Nettozunahme	227	160		
<b>Ausschüttende LM-Klasse in USD (A)</b>				
Verkauft	140	–		
Eingelöst	(8)	–		
Nettozunahme	132	–		
<b>Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	37	31		
Eingelöst	(27)	(56)		
Nettozunahme/(-abnahme)	10	(25)		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	8	3		
Eingelöst	(12)	(14)		
Nettoabnahme	(4)	(11)		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	(7)		
Nettoabnahme	–	(7)		
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(1)	(2)		
Nettoabnahme	(1)	(2)		
<b>Klasse B USD, ausschüttend (A)</b>				
Eingelöst	(1)	(2)		
Nettoabnahme	(1)	(2)		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	7	9		
Eingelöst	(11)	(28)		
Nettoabnahme	(4)	(19)		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	4	1		
Eingelöst	(9)	(12)		
Nettoabnahme	(5)	(11)		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	16	16		
Eingelöst	(14)	(11)		
Nettozunahme	2	5		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	43	30		
Eingelöst	(47)	(15)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(4)	15		
<b>Klasse F USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	5	3		
Eingelöst	(5)	(2)		
Nettozunahme	–	1		
<b>Klasse X USD, ausschüttend (A)</b>				
Eingelöst	(2)	(11)		
Nettoabnahme	(2)	(11)		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	2		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme	–	1		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	73	11		
Eingelöst	(62)	(40)		
Nettozunahme/(-abnahme)	11	(29)		
<b>Klasse Premier USD, ausschüttend (A)</b>				
Eingelöst	–	(2)		
Nettoabnahme	–	(2)		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	100		
Eingelöst	(51)	(111)		
Nettoabnahme	(49)	(11)		
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	46	27		
Eingelöst	(14)	(12)		
Nettozunahme	32	15		
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(4)	(6)		
Nettoabnahme	(4)	(5)		
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(2)	(2)		
Nettoabnahme	(1)	(2)		
<b>Klasse L (G) USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(3)	(5)		
Nettoabnahme	(3)	(5)		
<b>Klasse GA USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	(1)	(1)		
<b>Klasse GA EUR, ausschüttend (A)</b>				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse GE USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	246	273		
Eingelöst	(275)	(351)		
Nettoabnahme	(29)	(78)		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	52	26		
Eingelöst	(69)	(41)		
Nettoabnahme	(17)	(15)		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	69	27		
Eingelöst	(81)	(31)		
Nettoabnahme	(12)	(4)		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	33	82		
Eingelöst	(57)	(115)		
Nettoabnahme	(24)	(33)		
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	49	34		
Eingelöst	(58)	(31)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(9)	3		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	5	4		
Eingelöst	(7)	(13)		
Nettoabnahme	(2)	(9)		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	22	38		
Eingelöst	(26)	(88)		
Nettoabnahme	(4)	(50)		

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse E USD, ausschüttend (A)</b>				
Eingelöst	(2)	(4)		
Nettoabnahme	(2)	(4)		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	319	330		
Eingelöst	(253)	(408)		
Nettozunahme/(-abnahme)	66	(78)		
<b>Klasse F USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	39	23		
Eingelöst	(37)	(53)		
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(30)		
<b>Klasse U USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	509	481		
Eingelöst	(610)	(646)		
Nettoabnahme	(101)	(165)		
<b>Klasse U EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	187	522		
Eingelöst	(165)	(1.050)		
Nettozunahme/(-abnahme)	22	(528)		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	60	47		
Eingelöst	(63)	(184)		
Nettoabnahme	(3)	(137)		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	26	48		
Eingelöst	(93)	(58)		
Nettoabnahme	(67)	(10)		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	6	4		
Eingelöst	(14)	(21)		
Nettoabnahme	(8)	(17)		
<b>Klasse X GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	12	40		
Eingelöst	(24)	(64)		
Nettoabnahme	(12)	(24)		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	449	649		
Eingelöst	(811)	(805)		
Nettoabnahme	(362)	(156)		
<b>Klasse Premier USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	24	17		
Eingelöst	(14)	(17)		
Nettozunahme	10	–		
<b>Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	728	1.124		
Eingelöst	(624)	–		
Nettozunahme	104	1.124		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	46	120		
Eingelöst	(44)	(283)		
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(163)		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	167	351		
Eingelöst	(321)	(43)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(154)	308		
<b>Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	10	14		
Eingelöst	(5)	(6)		
Nettozunahme	5	8		
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	98	95		
Eingelöst	(85)	(74)		
Nettozunahme	13	21		
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	172	75		
Eingelöst	(76)	(130)		
Nettozunahme/(-abnahme)	96	(55)		
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	(1)	(1)		
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	(3)	(2)		
Nettoabnahme	(1)	(2)		
<b>Klasse L (G) USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(2)	(1)		
Nettoabnahme	(2)	(1)		
<b>Klasse GA USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse GA EUR, thesaurierend</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	67	62		
Eingelöst	(129)	(223)		
Nettoabnahme	(62)	(161)		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	28	6		
Eingelöst	(38)	(38)		
Nettoabnahme	(10)	(32)		
<b>Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	14	67		
Eingelöst	(61)	(82)		
Nettoabnahme	(47)	(15)		
<b>Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Eingelöst	–	(2)		
Nettoabnahme	–	(2)		
<b>Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	99	74		
Eingelöst	(70)	(75)		
Nettozunahme/(-abnahme)	29	(1)		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	43		
Eingelöst	(4)	(243)		
Nettoabnahme	(3)	(200)		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	3	2		
Eingelöst	(10)	(24)		
Nettoabnahme	(7)	(22)		
<b>Klasse A GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(2)	(1)		
Nettoabnahme	(1)	(1)		
<b>Klasse A HKD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	24		
Eingelöst	–	(149)		
Nettoabnahme	–	(125)		
<b>Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	924	869		
Eingelöst	(1.204)	(564)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(280)	305		
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(2)	(2)		
Nettoabnahme	(2)	(2)		
<b>Klasse B USD, ausschüttend (A)</b>				
Eingelöst	(2)	(3)		
Nettoabnahme	(2)	(3)		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	4	3		
Eingelöst	(8)	(14)		
Nettoabnahme	(4)	(11)		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	12	2		
Eingelöst	(21)	(29)		
Nettoabnahme	(9)	(27)		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	8	1		
Eingelöst	(9)	(26)		
Nettoabnahme	(1)	(25)		

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse E USD, ausschüttend (A)</b>				
Eingelöst	–	(1)	–	(2)
Nettoabnahme	–	(1)	–	(2)
<b>Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Eingelöst	–	(1)	11	6
Nettoabnahme	–	(1)	(17)	(22)
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	4	9	(6)	(16)
Eingelöst	(12)	(20)	–	–
Nettoabnahme	(8)	(11)	–	–
<b>Klasse F USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	8	1	–	–
Eingelöst	(6)	(1)	3	3
Nettozunahme	2	–	(5)	(13)
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	8	11	(2)	(10)
Eingelöst	(22)	(55)	(1)	(5)
Nettoabnahme	(14)	(44)	–	–
<b>Klasse X USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	2	–	1	–
Eingelöst	(3)	(5)	(1)	(5)
Nettoabnahme	(1)	(5)	–	–
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Eingelöst	(1)	(20)	–	–
Nettoabnahme	(1)	(20)	–	–
<b>Klasse X GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	15	31	–	–
Eingelöst	(55)	(67)	45	28
Nettoabnahme	(40)	(36)	(43)	(105)
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	115	89	2	(77)
Eingelöst	(358)	(808)	–	–
Nettoabnahme	(243)	(719)	–	–
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Eingelöst	–	(3)	–	–
Nettoabnahme	–	(3)	–	–
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	3	–	–
Eingelöst	(3)	(3)	–	–
Nettoabnahme	(2)	–	–	–
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	1	–	–
Eingelöst	(3)	(73)	–	–
Nettoabnahme	(2)	(72)	–	–
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	–	–	–
Eingelöst	–	(4)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(4)	–	–
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	7	5	–	–
Eingelöst	(57)	(256)	–	–
Nettoabnahme	(50)	(251)	–	–
<b>Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	7	12	–	–
Eingelöst	(4)	(7)	–	–
Nettozunahme	3	5	–	–
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>				
Eingelöst	–	(2)	–	–
Nettoabnahme	–	(2)	–	–
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	4	–	–	–
Eingelöst	(10)	(11)	–	–
Nettoabnahme	(6)	(11)	–	–
<b>Klasse L (G) USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(4)	(5)	–	–
Nettoabnahme	(4)	(5)	–	–
<b>Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	–	296	40
Eingelöst	–	–	(32)	–
Nettozunahme	–	–	264	40
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	–	–	52	8
Eingelöst	–	–	(18)	(2)
Nettozunahme	–	–	34	6
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	–	201	46
Eingelöst	–	–	(48)	(2)
Nettozunahme	–	–	153	44
<b>Klasse A SEK, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	–	5.052	5.422
Eingelöst	–	–	(5.408)	(410)
Nettozunahme/(-abnahme)	–	–	(356)	5.012
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	–	21	18
Nettozunahme	–	–	21	18
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	–	301	89
Eingelöst	–	–	(224)	(17)
Nettozunahme	–	–	77	72
<b>Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	9	2	–	–
Eingelöst	(7)	(6)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(4)	–	–

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse X USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	5	4		
Eingelöst	(2)	(10)		
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(6)		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	11	31		
Eingelöst	(12)	(24)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	7		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	24	–		
Eingelöst	(17)	–		
Nettozunahme	7	–		
<b>Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	28	34		
Eingelöst	(39)	(17)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(11)	17		
<b>Klasse X GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	688	84		
Eingelöst	(138)	(21)		
Nettozunahme	550	63		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1.449	485		
Eingelöst	(783)	(5)		
Nettozunahme	666	480		
<b>Klasse Premier USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	116	20		
Eingelöst	–	(2)		
Nettozunahme	116	18		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	9	–		
Eingelöst	(1)	(2)		
Nettozunahme/(-abnahme)	8	(2)		
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	14	7		
Eingelöst	(4)	(9)		
Nettozunahme/(-abnahme)	10	(2)		
<b>Klasse S USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	4.695	1.156		
Eingelöst	(2.656)	(154)		
Nettozunahme	2.039	1.002		
<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	50	3		
Eingelöst	(3)	–		
Nettozunahme	47	3		
<b>Klasse S EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	178	176		
Nettozunahme	178	176		
<b>Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	232	452		
Eingelöst	(263)	(49)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(31)	403		
<b>Klasse S GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	580	704		
Eingelöst	(531)	(56)		
Nettozunahme	49	648		
<b>Klasse S GBP, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	63	26		
Eingelöst	(13)	(3)		
Nettozunahme	50	23		
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	177	–		
Eingelöst	(4)	–		
Nettozunahme	173	–		
<b>Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	36	2		
Eingelöst	(3)	(6)		
Nettozunahme/(-abnahme)	33	(4)		
<b>Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	5.237	3.286		
Eingelöst	(4.749)	(6.874)		
Nettozunahme/(-abnahme)	488	(3.588)		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2.970	61		
Eingelöst	(318)	–		
Nettozunahme	2.652	61		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	3.390	4.490		
Eingelöst	(4.157)	(3.675)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(767)	815		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (Q)</b>				
Verkauft	165	164		
Eingelöst	(175)	(214)		
Nettoabnahme	(10)	(50)		
<b>Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	965	269		
Eingelöst	(360)	(61)		
Nettozunahme	605	208		
<b>Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	4.818	2.254		
Eingelöst	(2.681)	(1.414)		
Nettozunahme	2.137	840		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)</b>				
Verkauft	341	110		
Eingelöst	(55)	(46)		
Nettozunahme	286	64		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	3.000	3.266		
Eingelöst	(3.273)	(5.849)		
Nettoabnahme	(273)	(2.583)		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	162	327		
Eingelöst	(196)	(200)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(34)	127		
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	10.608	2.414		
Eingelöst	(7.189)	(1.270)		
Nettozunahme	3.419	1.144		
<b>Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	61	25		
Eingelöst	(85)	(3)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(24)	22		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	384	4		
Eingelöst	(68)	(5)		
Nettozunahme/(-abnahme)	316	(1)		
<b>Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	129	–		
Eingelöst	(39)	–		
Nettozunahme	90	–		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	478	301		
Eingelöst	(139)	(142)		
Nettozunahme	339	159		
<b>Klasse F USD thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	140	18		
Eingelöst	(145)	(145)		
Nettoabnahme	(5)	(127)		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	32	21		
Eingelöst	(5)	(22)		
Nettozunahme/(-abnahme)	27	(1)		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	15		
Eingelöst	(48)	(6)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(48)	9		
<b>Klasse X USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	3	–		
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(1)		

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)</b>				
Verkauft	239	181		
Eingelöst	(26)	(212)		
Nettozunahme/(-abnahme)	213	(31)		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	1.582	5.573		
Eingelöst	(2.358)	(7.144)		
Nettoabnahme	(776)	(1.571)		
<b>Klasse X GBP, ausschüttend (Q)</b>				
Verkauft	98	26		
Eingelöst	(26)	(1)		
Nettozunahme	72	25		
<b>Klasse X GBP ausschüttend (Q) (abgesichert)</b>				
Verkauft	67	–		
Nettozunahme	67	–		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	573	276		
Eingelöst	(97)	(299)		
Nettozunahme/(-abnahme)	476	(23)		
<b>Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	543	325		
Eingelöst	(343)	(138)		
Nettozunahme	200	187		
<b>Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)</b>				
Verkauft	137	163		
Eingelöst	–	(252)		
Nettozunahme/(-abnahme)	137	(89)		
<b>Premier Class CAD-Ausschüttung (Q) Plus (e)</b>				
Verkauft	26	38		
Eingelöst	(762)	–		
Nettozunahme/(-abnahme)	(736)	38		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)</b>				
Verkauft	10	2.536		
Eingelöst	(78)	(3.203)		
Nettoabnahme	(68)	(667)		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	8.130	9.677		
Eingelöst	(11.807)	(11.798)		
Nettoabnahme	(3.677)	(2.121)		
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Eingelöst	–	(470)		
Nettoabnahme	–	(470)		
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	6	420		
Eingelöst	(130)	(72)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(124)	348		
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)</b>				
Verkauft	94	1.807		
Eingelöst	(2.406)	(2.436)		
Nettoabnahme	(2.312)	(629)		
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)</b>				
Verkauft	4.282	888		
Eingelöst	(1.980)	(626)		
Nettozunahme	2.302	262		
<b>Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	29	331		
Eingelöst	(654)	(130)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(625)	201		
<b>Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund<sup>^</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	1		
Nettozunahme	–	1		
<b>Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	173	–		
Eingelöst	(4)	–		
Nettozunahme	169	–		
<b>Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)</b>				
Verkauft	759	–		
Eingelöst	(52)	–		
Nettozunahme	707	–		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	306	–		
Eingelöst	(32)	–		
Nettozunahme	274	–		
<b>Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	83	–		
Eingelöst	(8)	–		
Nettozunahme	75	–		
<b>Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	19	–		
Nettozunahme	19	–		
<b>Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	34	–		
Nettozunahme	34	–		
<b>Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	1	–		
Nettozunahme	1	–		
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	135	–		
Nettozunahme	135	–		
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	45.506	–		
Eingelöst	(8.680)	–		
Nettozunahme	36.826	–		
<b>Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)</b>				
Verkauft	16	–		
Eingelöst	(13)	–		
Nettozunahme	3	–		
<b>Klasse X Euro ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	15	–		
Eingelöst	(10)	–		
Nettozunahme	5	–		
<b>Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	–	–		
Nettozunahme	1	–		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	46	–		
Nettozunahme	46	–		
<b>Premier-Klasse, USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	48	–		
Eingelöst	–	–		
Nettozunahme	48	–		
<b>Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	1	–		
<b>Klasse S USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	–		
Nettozunahme	2	–		
<b>Ausschüttende Klasse S USD (M) Plus</b>				
Verkauft	15	–		
Nettozunahme	15	–		
<b>Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	811	696		
Eingelöst	(889)	(682)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(78)	14		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	28	83		
Eingelöst	(150)	(53)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(122)	30		
<b>Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	132	130		
Eingelöst	(164)	(111)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(32)	19		
<b>Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	452	713		
Eingelöst	(516)	(626)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(64)	87		

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	170	98		
Eingelöst	(205)	(36)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(35)	62		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	262	57		
Eingelöst	(211)	(31)		
Nettozunahme	51	26		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)</b>				
Verkauft	6	5		
Eingelöst	(4)	(6)		
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(1)		
<b>Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	2	1		
Eingelöst	(1)	(4)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(3)		
<b>Klasse A GBP, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	3	–		
Eingelöst	(3)	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	51	46		
Eingelöst	(74)	(22)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(23)	24		
<b>Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	12.298	21.259		
Eingelöst	(16.831)	(6.339)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(4.533)	14.920		
<b>Klasse A SGD, thesaurierend</b>				
Verkauft	5.184	8.186		
Eingelöst	(6.790)	(3.040)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(1.606)	5.146		
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	33	7		
Eingelöst	(8)	(3)		
Nettozunahme	25	4		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	(3)		
Nettoabnahme	–	(3)		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	33	30		
Eingelöst	(30)	(3)		
Nettozunahme	3	27		
<b>Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	10	3		
Eingelöst	(8)	(1)		
Nettozunahme	2	2		
<b>Klasse E EUR thesaurierend</b>				
Verkauft	7	1		
Eingelöst	(5)	(2)		
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(1)		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	69	41		
Eingelöst	(59)	(12)		
Nettozunahme	10	29		
<b>Klasse F USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	1	2		
Eingelöst	(3)	–		
Nettozunahme/(-abnahme)	(2)	2		
<b>Klasse R EUR thesaurierend</b>				
Verkauft	1	1		
Eingelöst	(2)	–		
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	352	265		
Eingelöst	(508)	(56)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(156)	209		
<b>Klasse X USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	–	(9)		
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(9)		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	293	203		
Eingelöst	(280)	(130)		
Nettozunahme	13	73		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	170	154		
Eingelöst	(232)	(38)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(62)	116		
<b>Klasse X GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	110	59		
Eingelöst	(117)	(53)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(7)	6		
<b>Klasse X GBP, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	16	7		
Eingelöst	(15)	(2)		
Nettozunahme	1	5		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	666	720		
Eingelöst	(1.005)	(237)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(339)	483		
<b>Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	467	82		
Eingelöst	(105)	(6)		
Nettozunahme	362	76		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	17	117		
Eingelöst	(128)	(23)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(111)	94		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	133	29		
Eingelöst	(49)	(8)		
Nettozunahme	84	21		
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	106	356		
Eingelöst	(428)	(140)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(322)	216		
<b>Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	100	107		
Eingelöst	(33)	(48)		
Nettozunahme	67	59		
<b>Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	94	51		
Eingelöst	(106)	(65)		
Nettoabnahme	(12)	(14)		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	17	2		
Eingelöst	(16)	(6)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(4)		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	5	7		
Eingelöst	(10)	(1)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(5)	6		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	13	7		
Eingelöst	(14)	(5)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	2		
<b>Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	7	3		
Eingelöst	(8)	(2)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	1		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	3	2		
Eingelöst	(3)	(4)		
Nettoabnahme	–	(2)		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	3	–		
Eingelöst	(5)	(2)		
Nettoabnahme	(2)	(2)		

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	5	–		
Eingelöst	(5)	(1)		
Nettozunahme	–	(1)		
<b>Klasse E USD, ausschüttend (A)</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme	–	(1)		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	24	6		
Eingelöst	(11)	(5)		
Nettozunahme	13	1		
<b>Klasse F USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	2	1		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	1	1		
<b>Klasse R USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(1)	(3)		
Nettoabnahme	(1)	(3)		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	18	3		
Eingelöst	(17)	(29)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(26)		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	4		
Eingelöst	(5)	(2)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(4)	2		
<b>Klasse Premier USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	8	25		
Eingelöst	(9)	(9)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	16		
<b>Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	(2)		
Nettoabnahme	–	(2)		
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(1)	(3)		
Nettoabnahme	(1)	(2)		
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Klasse L (G) USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
<b>Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>Δ</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	–		
Eingelöst	–	–		
Nettozunahme	–	–		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	–		
Eingelöst	–	–		
Nettozunahme	–	–		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	50	–		
Eingelöst	–	–		
Nettozunahme	50	–		
<b>Franklin MV European Equity Growth and Income Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	(3)	(5)		
Nettoabnahme	(1)	(5)		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	3	–		
Eingelöst	(3)	(2)		
Nettoabnahme	–	(2)		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(2)	(1)		
Nettoabnahme	(1)	(1)		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	22	7		
Eingelöst	(20)	(43)		
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(36)		
<b>Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	3	8		
Eingelöst	(10)	(7)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(7)	1		
<b>Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	9	–		
Eingelöst	(1)	(13)		
Nettozunahme/(-abnahme)	8	(13)		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	1		
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettozunahme	–	–		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (A)</b>				
Eingelöst	–	(3)		
Nettoabnahme	–	(3)		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	1	–		
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	3.874	220		
Eingelöst	(3.692)	(444)		
Nettozunahme/(-abnahme)	182	(224)		
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	(1)	(1)		
<b>Klasse C USD akkumulierend</b>				
Eingelöst	–	(7)		
Nettoabnahme	–	(7)		
<b>Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	(1)	(4)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(4)		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	3	1		
Eingelöst	(17)	(1)		
Nettoabnahme	(14)	–		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	2		
Eingelöst	(15)	(7)		
Nettoabnahme	(15)	(5)		
<b>Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	12	4		
Eingelöst	(2)	(2)		
Nettozunahme	10	2		
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	12		
Eingelöst	(39)	(2)		
Nettozunahme/(-abnahme)	(38)	10		
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	3		
Eingelöst	(4)	(7)		
Nettoabnahme	(4)	(4)		
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse L (G) USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse GA USD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
<b>Klasse GA EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	6	–		
Eingelöst	(12)	(6)		
Nettoabnahme	(6)	(6)		

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund</b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	3	1
Eingelöst	(7)	(27)
Nettoabnahme	(4)	(26)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>		
Verkauft	4	32
Eingelöst	(5)	(37)
Nettoabnahme	(1)	(5)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>		
Verkauft	7	10
Eingelöst	(28)	(68)
Nettoabnahme	(21)	(58)
<b>Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>		
Verkauft	2	4
Eingelöst	(14)	(33)
Nettoabnahme	(12)	(29)
<b>Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>		
Verkauft	–	6
Eingelöst	–	(21)
Nettoabnahme	–	(15)
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	3	–
Eingelöst	(1)	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(1)
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>		
Verkauft	93	43
Eingelöst	(119)	(142)
Nettoabnahme	(26)	(99)
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>		
Verkauft	10	111
Eingelöst	(65)	(208)
Nettoabnahme	(55)	(97)
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>		
Eingelöst	–	(43)
Nettoabnahme	–	(43)
<b>Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	–	15
Eingelöst	(16)	(9)
Nettozunahme/(-abnahme)	(16)	6
<b>Klasse GA USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(2)	(7)
Nettoabnahme	(1)	(7)
<b>Klasse LM SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Eingelöst	–	(27.864)
Nettoabnahme	–	(27.864)
<b>Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>μ</sup></b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	(2)	–
Nettoabnahme	(2)	–
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>		
Eingelöst	(1)	–
Nettoabnahme	(1)	–

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(90)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(90)	1
<b>Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund</b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>		
Eingelöst	(5)	(5)
Nettoabnahme	(5)	(5)
<b>Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>		
Verkauft	–	2
Eingelöst	(4)	(7)
Nettoabnahme	(4)	(5)
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(80)	(3)
Nettoabnahme	(80)	(2)
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>		
Verkauft	522	113
Eingelöst	(498)	(88)
Nettozunahme	24	25
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	15	1
Eingelöst	(9)	(1)
Nettozunahme	6	–
<b>Klasse GA USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	1	–
Eingelöst	(1)	(2)
Nettoabnahme	–	(2)
<b>Klasse GA EUR, thesaurierend</b>		
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	(1)
<b>Klasse GA EUR, ausschüttend (A)</b>		
Eingelöst	–	(1)
Nettoabnahme	–	(1)
<b>Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>		
<b>Klasse M GBP, ausschüttend (A)</b>		
Verkauft	21	92
Eingelöst	(28)	(3.125)
Nettoabnahme	(7)	(3.033)
<b>Klasse M USD, ausschüttend (A)</b>		
Eingelöst	(3.307)	(2)
Nettoabnahme	(3.307)	(2)
<b>Klasse M EUR, ausschüttend (A)</b>		
Verkauft	–	25
Eingelöst	(9)	(1.597)
Nettoabnahme	(9)	(1.572)
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	179	74
Eingelöst	(210)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(31)	74
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend</b>		
Verkauft	–	19
Eingelöst	(1)	(174)
Nettoabnahme	(1)	(155)
<b>Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>β</sup></b>		
<b>Klasse A (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)</b>		
Verkauft	50	205
Eingelöst	(588)	(295)
Nettoabnahme	(538)	(90)
<b>Klasse A (PF) EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	–	3
Eingelöst	(28)	(30)
Nettoabnahme	(28)	(27)
<b>Klasse A (PF) EUR, ausschüttend (A)</b>		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(238)	(403)
Nettoabnahme	(238)	(402)

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

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>α</sup> – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse A (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)</b>				
Eingelöst	–	(16)	–	–
Nettoabnahme	–	(16)	–	–
<b>Klasse J (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Eingelöst	–	(20)	–	–
Nettoabnahme	–	(20)	–	–
<b>Klasse J (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Eingelöst	–	(560)	–	–
Nettoabnahme	–	(560)	–	–
<b>Klasse M (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	139	–	–
Eingelöst	(195)	(130)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(195)	9	–	–
<b>Klasse M (PF) EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	6	–	–
Eingelöst	(37)	(290)	–	–
Nettoabnahme	(37)	(284)	–	–
<b>Klasse M (PF) EUR, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	7	673	–	–
Eingelöst	(589)	(4.519)	–	–
Nettoabnahme	(582)	(3.846)	–	–
<b>Klasse M (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	4	–	–
Eingelöst	(85)	(53)	–	–
Nettoabnahme	(85)	(49)	–	–
<b>Klasse M (PF) NOK, ausschüttend (A) (abgesichert)</b>				
Eingelöst	(2)	–	–	–
Nettoabnahme	(2)	–	–	–
<b>Klasse M (PF) SEK, ausschüttend (A) (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	5	–	–
Eingelöst	(102)	(100)	–	–
Nettoabnahme	(102)	(95)	–	–
<b>Klasse Premier (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	38	18	–	–
Eingelöst	(173)	(101)	–	–
Nettoabnahme	(135)	(83)	–	–
<b>Klasse Premier (PF) BRL, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	3	28	–	–
Eingelöst	(155)	–	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(152)	28	–	–
<b>Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>α</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	31	6	–	–
Eingelöst	(5)	–	–	–
Nettozunahme	26	6	–	–
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	434	–	–	–
Eingelöst	(217)	–	–	–
Nettozunahme	217	–	–	–
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	16	32	–	–
Eingelöst	(7)	(28)	–	–
Nettozunahme	9	4	–	–
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	5	–	–	–
Eingelöst	(2)	–	–	–
Nettozunahme	3	–	–	–
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	34	14	–	–
Eingelöst	(14)	–	–	–
Nettozunahme	20	14	–	–
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	3	–	–	–
Nettozunahme	3	–	–	–
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	–	–	–
Nettozunahme	1	–	–	–
<b>Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	6	3	–	–
Eingelöst	(1)	(1)	–	–
Nettozunahme	5	2	–	–
<b>Klasse X GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	4	–	–
Eingelöst	(2)	(2)	–	–
Nettozunahme	–	2	–	–
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	129	98	–	–
Eingelöst	(11)	(65)	–	–
Nettozunahme	118	33	–	–
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	3	–	–
Eingelöst	(2)	(1)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1)	2	–	–
<b>Klasse S USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	78	312	–	–
Eingelöst	(303)	(16)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(225)	296	–	–
<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	815	–	–	–
Eingelöst	(268)	–	–	–
Nettozunahme	547	–	–	–
<b>Klasse S GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	5	44	–	–
Eingelöst	(86)	–	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(81)	44	–	–
<b>Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund</b>				
<b>Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)</b>				
Verkauft	3	55	–	–
Nettozunahme	3	55	–	–
<b>Klasse A AUD ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	1	–	–	–
Nettozunahme	1	–	–	–
<b>Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus (e)</b>				
Verkauft	1	–	–	–
Nettozunahme	1	–	–	–
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	147	78	–	–
Eingelöst	(167)	(86)	–	–
Nettoabnahme	(20)	(8)	–	–
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	3	8	–	–
Eingelöst	–	(3)	–	–
Nettozunahme	3	5	–	–
<b>Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	89	1.411	–	–
Eingelöst	(98)	(181)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(9)	1.230	–	–
<b>Klasse D USD ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	8	7	–	–
Eingelöst	(5)	(2)	–	–
Nettozunahme	3	5	–	–
<b>Klasse D USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	50	–	–
Eingelöst	(2)	–	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(2)	50	–	–
<b>Klasse X AUD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	2	–	–
Eingelöst	(1)	–	–	–
Nettozunahme	1	2	–	–
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	43	–	–
Eingelöst	–	(2)	–	–
Nettozunahme	–	41	–	–
<b>Ausschüttende GBP-Klasse S (M) Plus (e)</b>				
Verkauft	1	–	–	–
Nettozunahme	1	–	–	–
<b>Klasse LM AUD, thesaurierend</b>				
Eingelöst	(12)	–	–	–
Nettoabnahme	(12)	–	–	–

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2021 Anteile (in Tsd.)
<b>Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup></b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	44	26
Eingelöst	(13)	(6)
Nettozunahme	31	20
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	2	3
Eingelöst	(2)	–
Nettozunahme	–	3
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	94	21
Eingelöst	(22)	(6)
Nettozunahme	72	15
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	22	28
Eingelöst	(19)	(2)
Nettozunahme	3	26
<b>Klasse S USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	15	7
Eingelöst	(17)	(3)
Nettozunahme/(-abnahme)	(2)	4
<b>Klasse S EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	138	–
Eingelöst	(135)	(65)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(65)
<b>Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>		
<b>Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	49	1
Eingelöst	(8)	–
Nettozunahme	41	1
<b>Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	8	–
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme/(-abnahme)	8	(1)
<b>Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)</b>		
Verkauft	216	–
Eingelöst	(25)	–
Nettozunahme	191	–
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	88	100
Eingelöst	(36)	–
Nettozunahme	52	100
<b>Klasse S USD, thesaurierend</b>		
Verkauft	–	1.077
Eingelöst	(1.077)	–
Nettozunahme/(-abnahme)	(1.077)	1.077
<b>Klasse S EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	1.249	9
Eingelöst	(217)	(6)
Nettozunahme	1.032	3
<b>Klasse S GBP, thesaurierend</b>		
Verkauft	1.273	–
Nettozunahme	1.273	–

– Als „–“ bezeichnete Beträge sind entweder 0 oder weniger als 1.000. Es werden nur Klassen mit Transaktionen während des Geschäftsjahres angezeigt.

μ Mit Wirkung vom 14. April 2021 hat der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup> den Handel eingestellt.

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

β Mit Wirkung zum 1. Juni 2021 stellte der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

δ Mit Wirkung zum 1. Dezember 2021 begann der Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup> mit dem Handel.

ϕ Mit Wirkung zum 10. Januar 2022 begann der Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup> mit dem Handel.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss

## 1. Allgemein

Legg Mason Global Solutions Plc (die „Gesellschaft“) ist eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital, die nach irischem Recht als Aktiengesellschaft gemäß dem Companies Act von 2014, den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren) von 2011 in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Vorschriften“) und den OGAW-Bestimmungen der Zentralbank organisiert ist. Sie wurde am 13. Januar 1998 unter der Registernummer 278601 eingetragen.

Ihr Zweck gemäß Ziffer ihrer Gründungsdokumente ist die gemeinsame Anlage von öffentlich beschafftem Kapital in übertragbaren Wertpapieren und anderen liquiden Finanzanlagen nach dem Grundsatz der Risikostreuung. Die Gesellschaft ist in Form eines Umbrella-Fonds organisiert. Laut ihrer Gründungsdokumente darf die Gesellschaft unterschiedliche Anteilsklassen anbieten, die jeweils Beteiligungen an einem Teilfonds (der „Fonds“ oder zusammen die „Fonds“) mit eigenem Anlageportfolio darstellen. Für eine Klasse darf kein separates Portfolio von Vermögenswerten geführt werden. Die von der Gesellschaft aufgelegten Fonds sind im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ dieses Berichts enthalten. Die Anlageziele und Anlagepolitiken für alle aktiven Fonds sind im Bericht des Verwaltungsrats aufgeführt.

## 2. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze

Zur Erstellung des Abschlusses hat die Gesellschaft die unten dargelegten Rechnungslegungs- und Schätzungsmethoden zugrunde gelegt.

### Übereinstimmungserklärung

Der Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 wurde in Übereinstimmung mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsstandards erstellt, einschließlich des Financial Reporting Standard („FRS“) 102: „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and the Republic of Ireland“ („FRS 102“) und irischem Recht einschließlich des Companies Act 2014, der OGAW-Vorschriften und der OGAW-Bestimmungen der Zentralbank erstellt. Diese Richtlinien entsprechen den Richtlinien, die im Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2021 angewendet werden.

### 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. Der Jahresabschluss des Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund, Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset US Variable Rate Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Growth Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund<sup>^</sup>, Legg Mason PCM US Equity Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund<sup>^</sup>, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund, Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup>, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Congruix Japan Equity Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Greater China Fund<sup>^</sup>, Der Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> und der Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund<sup>^</sup> wurden auf der Grundlage der laufenden Geschäftstätigkeit aufgelegt, da diese Fonds während des aktuellen und des vorherigen Geschäftsjahres oder nach dem Bilanzstichtag 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.

### (a) Anlagen zum beizulegenden Zeitwert

Die Gesellschaft hat alle Finanzinstrumente, einschließlich Anlagen in Anleihen und Aktien und damit verbundene Derivate als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte bzw. finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert. Diese finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden als für Handelszwecke gehalten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden grundsätzlich gekauft oder eingegangen, um sie kurzfristig zu verkaufen oder zurückzukaufen. Derivate werden ebenfalls als zu Handelszwecken gehalten eingestuft, da die Gesellschaft keine Derivate als Absicherungsgeschäfte in Absicherungsbeziehungen ausweist.

Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden anfänglich zu ihrem beizulegenden Zeitwert angesetzt. Transaktionskosten werden in der Gesamtergebnisrechnung als Aufwand verbucht. Nach dem erstmaligen Ansatz werden alle erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Gewinne und Verluste aus Änderungen des beizulegenden Zeitwerts der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten werden in der Gesamtergebnisrechnung des Geschäftsjahres, in dem sie entstehen, ausgewiesen.

Der beizulegende Zeitwert von Finanzinstrumenten, die an aktiven Märkten gehandelt werden (z. B. börsennotierte Derivate und Wertpapiere), basiert auf den Kursnotierungen am Bilanzstichtag. Der beizulegende Zeitwert von Investmentfonds basiert auf dem vom Fondsverwalter bereitgestellten gehandelten Nettoinventarwert des betreffenden Fonds zum Bilanzstichtag.

Die Gesellschaft kann gelegentlich in Finanzinstrumente investieren, die nicht an einem aktiven Markt gehandelt werden (wie z.B. außerbörslich gehandelte OTC-Derivate). Zur Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts werden Bewertungsmethoden herangezogen. Die Gesellschaft verwendet eine Vielzahl von Methoden und geht von Annahmen aus, die auf den zum jeweiligen Bilanzstichtag herrschenden Marktbedingungen basieren. Zu den eingesetzten Bewertungsmethoden gehören die Verwendung vergleichbarer Transaktionen mit unabhängigen Parteien zu diesem Zeitpunkt, diskontierte Cashflow-Analyse und andere unter Marktteilnehmern übliche Bewertungsmethoden. Die diesen Instrumenten zugewiesenen Werte basieren auf den besten verfügbaren Informationen. Aufgrund der Unsicherheit dieser Bewertung können diese Werte erheblich von jenen Werten abweichen, die realisiert worden wären, hätte es einen aufnahmebereiten Markt für diese Instrumente gegeben. Der Abschluss derartiger Vereinbarungen beinhaltet in unterschiedlichem Ausmaß Elemente des Kredit-, Markt- und Dokumentationsrisikos sowie des gesetzlichen Risikos, die die in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen Beträge übersteigen. Zu diesen Risiken zählt unter anderem auch die Möglichkeit, dass ein liquider Markt für diese Geschäfte fehlt, dass die Gegenparteien ihren Verpflichtungen zur Erfüllung nicht nachkommen oder dass Uneinigkeit über die Bedeutung der vertraglichen Bestimmungen in den Vereinbarungen herrscht oder dass sich die Zinssätze oder der Kurs des Index oder Wertpapiers, der/das dem Geschäft zugrunde liegt, nachteilig verändern. Die am Ende des Geschäftsjahres verwendeten Kurse stammen aus einer Brokerquelle und entsprechen der realistischen Schätzung des beizulegenden Zeitwerts am letzten Tag der Periode. Diese Kurse sind gleichwohl mit einer gewissen Unsicherheit behaftet. Eventuell können die Positionen nicht immer zum angegebenen Marktwert mit der jeweiligen Gegenpartei glattgestellt werden.

### (b) Erkennung/Ausbuchung

Reguläre Käufe und Verkäufe von Wertpapieren werden an dem einem Handelstag folgenden Tag ausgewiesen, d. h. zu dem Datum, an dem die Gesellschaft sich verpflichtet, das Wertpapier zu kaufen oder zu verkaufen. Wertpapiere werden anfänglich zum beizulegenden Zeitwert angesetzt, wobei die entstehenden Transaktionskosten sämtlicher Finanzanlagen, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen werden, sofort als Aufwand verbucht werden. Wertpapiere werden nicht mehr ausgewiesen, wenn der Anspruch auf Cashflows aus dem Wertpapier erloschen ist oder die Gesellschaft so gut wie alle Risiken und Erträge aus dem Besitz des Wertpapiers übertragen hat.

### (c) Einzelmakler-Preisgestaltung

Die am Ende des Geschäftsjahres verwendeten Kurse stammen aus einer Brokerquelle und entsprechen der realistischen Schätzung des beizulegenden Zeitwerts am letzten Tag des Geschäftsjahres. Diese Kurse sind gleichwohl mit einer gewissen Unsicherheit behaftet. Eventuell können die Positionen nicht immer zum angegebenen Marktwert mit der jeweiligen Gegenpartei glattgestellt werden. Werte von Wertpapieren für jeden Fonds, die mit Hilfe von Einzelmaklerquellen zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 bewertet wurden, werden in Anmerkung 12.1 (d) offengelegt.

### (d) Anlagerechnung

Wertpapiertransaktionen werden an dem einem Handelstag folgenden Tag verbucht. Anlagen werden anfänglich zum beizulegenden Zeitwert angesetzt, wobei die Transaktionskosten für sämtliche erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Wertpapiere bei Anfall als Aufwand verbucht werden. Gewinne oder Verluste beim Verkauf von Wertpapieren werden nach der First-In-First-Out-Methode („FIFO“) berechnet.

### (e) Erträge aus Anlagen

In der Gesamtergebnisrechnung werden Zinserträge und -aufwendungen für alle Schuldtitel nach der Effektivzinismethode ausgewiesen. Die Anlagemanager überwachen ausstehende Zinserträge für sämtliche rückständigen ausstehenden Zinsforderungen. Die Konten wurden auf rückständige Zinsforderungen geprüft und zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 wurden alle Beträge als erstattungsfähig angesehen.

Dividenden werden am Tag des Dividendenabchlags in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen, wenn das jeweilige Wertpapier „ex-Dividende“ notiert. Dividenerträge werden einschließlich nicht rückerstattungsfähiger Quellensteuern, die getrennt in der Gesamtergebnisrechnung erscheinen, ausgewiesen.

### (f) Verrechnung von Finanzinstrumenten

Finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten werden miteinander saldiert und der Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen, falls ein einklagbares Recht gibt, die anerkannten Beträge miteinander zu saldieren, und falls die Absicht besteht, auf Nettobasis abzuschließen, oder die Aktiva zu realisieren (verkaufen) und gleichzeitig einen Ausgleich für die Verbindlichkeiten zu finden. Zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 liegen keine gegenläufigen Finanzinstrumente vor.

### (g) Kritische Schätzungen und Annahmen zur Rechnungslegung

Der Anlageverwalter unternimmt künftige Schätzungen und formuliert entsprechende Annahmen. Die daraus resultierenden rechnungslegungsbezogenen Schätzungen entsprechen naturgemäß nur selten den tatsächlichen Ergebnissen. Nachfolgend sind jene Schätzungen und Annahmen aufgeführt, die höchstwahrscheinlich eine erhebliche Anpassung des Buchwerts der Aktiva und Passiva im nächsten Berichtszeitraum bewirken werden.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 2. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze – (Fortsetzung)

### (g) Kritische Buchhaltungsschätzungen und -annahmen – (Fortsetzung)

#### Fair Value von derivativen Finanzinstrumenten

Die Gesellschaft kann gelegentlich in Finanzinstrumente investieren, die nicht an einem aktiven Markt gehandelt werden (wie z.B. außerbörslich gehandelte OTC-Derivate). Der beizulegende Zeitwert dieser Instrumente wird anhand der in Erläuterung 2(a) besprochenen Bewertungsmethoden bestimmt. Sofern zur Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts Bewertungsmethoden (z.B. Modelle) verwendet werden, werden diese validiert, regelmäßig überprüft und, wenn verfügbar, mit dem von einem unabhängigen Kurstdienst bereitgestellten Kurs verglichen.

Soweit möglich verwenden die Modelle empirisch beobachtbare Daten. Bestimmte Bereiche, wie Kreditrisiko (sowohl das eigene als auch das der Gegenpartei), Schwankungen und Korrelationen, machen jedoch Schätzungen seitens des Fondsverwalters erforderlich. Veränderungen der Annahmen zu diesen Faktoren könnten sich auf den angegebenen beizulegenden Zeitwert der Finanzinstrumente auswirken.

Die diesen Instrumenten zugewiesenen Werte basieren auf den besten verfügbaren Informationen. Aufgrund der Unsicherheit dieser Bewertung können diese Werte erheblich von jenen Werten abweichen, die realisiert worden wären, hätte es einen aufnahmebereiten Markt für diese Instrumente gegeben. Der Abschluss derartiger Vereinbarungen beinhaltet in unterschiedlichem Ausmaß Elemente des Kredit-, Markt- und Dokumentationsrisikos sowie des gesetzlichen Risikos, die die in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen Beträge übersteigen. Zu diesen Risiken zählt unter anderem auch die Möglichkeit, dass ein liquider Markt für diese Geschäfte fehlt, dass die Gegenparteien ihren Verpflichtungen zur Erfüllung nicht nachkommen oder dass Uneinigkeit über die Bedeutung der vertraglichen Bestimmungen in den Vereinbarungen herrscht oder dass sich die Zinssätze oder der Kurs des Index oder Wertpapiers, der/das dem Geschäft zugrunde liegt, nachteilig verändern.

### (h) Verleih von Wertpapieren

Bestimmte Fonds können Wertpapiere an Makler, Händler und andere Finanzinstitute zur Erwirtschaftung zusätzlicher Erträge ausleihen. Jedes Wertpapier-Darlehen wird durch Anlagen in Höhe eines Betrags besichert, der mindestens dem derzeitigen Marktwert der verliehenen Wertpapiere entspricht. Es besteht das Risiko einer Verzögerung beim Erhalt der Sicherheit bzw. der Wiedererlangung der verliehenen Wertpapiere oder sogar des Verlusts der Rechte auf die Sicherheit, falls die leiheende Partei zahlungsunfähig werden sollte.

Zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 waren keine Fonds an der Wertpapierleihe beteiligt.

### (i) Ausgleich

Eine Ausgleichsrechnung wird vorgenommen, so dass Ausschüttungen für alle Anteile derselben Art gleich hoch sind, ungeachtet der unterschiedlichen Ausgabedaten. Ertrags- und Aufwandsausgleich werden in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen.

#### Ausgleichseinkommen

Eine dem Ausgabepreis des Anteils entsprechende Summe, die die ggf. aufgelaufenen und noch nicht ausgeschütteten Erträge bis zum Datum der Emission darstellt, wird als Ausgleichszahlung durch die Anteilsinhaber angesehen. Auf diese Weise soll dem Anteilsinhaber ein Anrecht auf Dividenden ab dem Stichtag der Emission erteilt werden, sofern diese Daten in den Abrechnungszeitraum fallen.

#### Ausgleichskosten

Eine dem Ausgabepreis des Anteils entsprechende Summe, die den ggf. aufgelaufenen und noch nicht ausgeschütteten Aufwand bis zum Datum der Emission darstellt, wird als Ausgleichszahlung angesehen. Auf diese Weise soll dem Anteilsinhaber ein Anrecht auf Dividenden ab dem Stichtag der Emission erteilt werden, sofern diese Daten in den Abrechnungszeitraum fallen.

### (j) Ausgaben

Die Ausgaben werden periodengerecht abgegrenzt. Bestimmte Aufwendungen gelten nur für eine bestimmte Anteilsklasse und werden daher direkt dieser Anteilsklasse belastet. Die allgemeinen Aufwendungen des Fonds werden den verschiedenen Anteilsklassen auf der Basis des relativen Nettoinventarwerts zugeordnet.

### (k) Transaktionskosten

Transaktionskosten sind zusätzliche Kosten, die unmittelbar dem Erwerb, der Emission oder der Veräußerung eines finanziellen Vermögenswertes oder einer finanziellen Verbindlichkeit zurechenbar sind. Zusätzliche Kosten sind solche, die nicht entstanden wären, wenn das Finanzinstrument nicht erworben, begeben oder veräußert worden wäre. Bei der erstmaligen Erfassung von finanziellen Vermögenswerten oder finanziellen Verbindlichkeiten sind diese erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu erfassen, wobei die Transaktionskosten unmittelbar in der Gesamtergebnisrechnung erfasst werden.

Die von der Verwahrstelle bei der Abrechnung von Käufen und Verkäufen von Anlagen erhobenen Transaktionskosten werden in der Gesamtergebnisrechnung für jeden Fonds in den Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren ausgewiesen.

Die Transaktionskosten aus Käufen und Verkäufen von Aktien, Investmentfonds, Futures-Kontrakten und Optionen sind in Erläuterung 4 für die einzelnen Fonds angegeben.

Die Transaktionskosten beim Kauf und Verkauf von Anleihen und sonstigen Devisenterminkontrakten sind im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Diese Kosten können nicht praktisch oder zuverlässig erfasst werden, da sie in den Kosten der Anlage eingepreist sind und nicht separat geprüft oder ausgewiesen werden können.

### (l) Übersetzung ausländischer Börsen

- Funktions- und Präsentationswährung: Alle Posten, die in den Abschlussunterlagen der Gesellschaft ausgewiesen sind, werden unter Verwendung der Währung ihres primären wirtschaftlichen Umfelds (in der „Leitwährung“) bewertet. Dies sind US-Dollar (US-Dollar) für alle Fonds außer dem Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> und Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup>, für die die funktionale Währung Euro ist, Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup>, für den die funktionale Währung Pfund Sterling (Britische Pfund) ist, und Legg Mason Congruix Japan Equity Fund<sup>^</sup> und Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund<sup>^</sup>, für die die funktionale Währung Japanischer Yen ist. Die Gesellschaft hat die Leitwährung jedes Fonds als Darstellungswährung für diesen Abschluss übernommen. Der Abschluss der Gesellschaft wird in US-Dollar dargestellt.
- Käufe und Verkäufe von Wertpapieren sowie Erträge und Aufwendungen werden zu dem Wechselkurs umgerechnet, der am jeweiligen Tag der Erfassung solcher Transaktionen notiert ist. Aktiva und Passiva werden zum Devisenkurs am Ende des Geschäftsjahres umgerechnet. Differenzen zwischen dem verbuchten und dem bezahlten bzw. vereinnahmten Aufwand und Ertrag werden in der Gesamtergebnisrechnung als Wechselkursgewinne bzw. -verluste aus finanziellen Vermögenswerten und -verbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert verbucht.

### (m) Forward- und Spot-Devisenkontrakte

Ein Devisenterminkontrakt (nachstehend „Forward-Kontrakt“ genannt) ist eine Verpflichtung zum Kauf oder Verkauf einer Fremdwährung an einem in der Zukunft liegenden Termin zu einem ausgehandelten Wechselkurs. Mit Forward-Kontrakten sollen Wechselkursrisiken kontrolliert und das Währungsrisiko des Portfolios taktisch verlagert werden. Forward-Kontrakte werden in der Regel als Absicherung beim Kauf oder Verkauf eines auf eine ausländische Währung lautenden Wertpapiers abgeschlossen. Nach dem Abschluss bzw. der Glatstellung des Forward-Kontrakts realisiert der Fonds einen Gewinn oder Verlust. Die nicht realisierten Wertsteigerungen oder Wertminderungen von Terminkontrakten werden in der Bilanz und Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen. Realisierte Gewinne und Verluste werden zusammen mit allen anderen Fremdwährungsgewinnen und -verlusten in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen. Forward-Kontrakte beinhalten unter anderem das Risiko, dass die Gegenpartei die Bedingungen des Kontrakts eventuell nicht erfüllen kann oder dass der Wert einer Währung gegenüber der Basiswährung des Fonds unerwartet schwankt. Der beizulegende Zeitwert von Forward-Kontrakten wird von einer unabhängigen Quelle bestimmt, wobei der Preis herangezogen wird, zu dem ein neuer Forward-Kontrakt derselben Höhe und Fälligkeit abgeschlossen werden könnte. Für jeden relevanten Fonds sind Gewinne oder Verluste aus offenen Kassadevisengeschäften in den Barmitteln in der Bilanz enthalten.

### (n) Zukünftige Verträge

Bei Abschluss eines Futures-Kontrakts wird ein Einschuss (Marge) - normalerweise in bar - geleistet. Der beizulegende Zeitwert von Futures-Kontrakten wird auf der Basis ihres täglichen Abrechnungskurses bestimmt. Änderungen im Wert offener Futures-Positionen werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Futures-Kontrakten ausgewiesen, bis die Kontrakte abgelaufen sind und die realisierten Gewinne und Verluste ausgewiesen werden. Sie werden entsprechend als realisierter Gewinn oder Verlust im Posten Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen. Nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Futures-Kontrakten werden in der Bilanz aufgeführt. Realisierte Gewinne und Verluste, die noch nicht erbracht wurden, werden in Margenkonten und eingeschränkten Barmitteln in der Rechnung der Finanzlage ausgewiesen.

### (o) Optionsverträge

Die Optionsprämie für ausgeübte gekaufte Verkaufsoptionen wird zur Feststellung des realisierten Gewinns bzw. Verlusts vom Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Währung abgezogen. Die Optionsprämie für ausgeübte gekaufte Kaufoptionen wird zu den Kosten der gekauften Wertpapiere bzw. Währungen hinzuaddiert. Die beim Kauf von unausgeübten verfallenen Optionen gezahlten Optionsprämien werden als realisierte Verluste behandelt. Der nicht realisierte Gewinn oder Verlust aus offenen Optionspositionen wird berechnet und als beizulegender Zeitwert der Option abzüglich der für die Option gezahlten Optionsprämie ausgewiesen. Nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus offenen Optionspositionen werden in der Bilanz als Aktiva oder Passiva aufgeführt.

Die Optionsprämie auf verkaufte Kaufoptionen, die ausgeübt wurden, wird zur Feststellung des realisierten Gewinns bzw. Verlusts zum Erlös aus dem Verkauf der zugrunde liegenden Wertpapiere bzw. Währungen hinzuaddiert. Die Optionsprämie auf verkaufte Verkaufsoptionen, die ausgeübt wurden, wird von den Kosten der gekauften Wertpapiere bzw. Währungen abgezogen. Optionsprämien aus dem Verkauf unausgeübter verfallener Optionen werden als realisierte Gewinne behandelt.

### (p) Austausch von Instrumenten

Swap-Instrumente werden zu ihren Marktpreisen an dem Datum, an dem der Derivatkontrakt geschlossen wird, bewertet, und anschließend auf ihren Marktwert hin überprüft. Angemessene Werte werden in aktiven Märkten durch eine laufende Notierung oder durch die Ermittlung einer kürzlichen Markttransaktion und durch Bewertungstechniken, wie z. B. die diskontierten Cashflow-Modelle und Optionspreis-Modelle (je nachdem, was besser zutrifft) ermittelt. Alle Derivate werden, falls ihr Wert positiv ist, auf der Aktivseite zum beizulegenden Zeitwert gehalten oder, falls ihr beizulegender Zeitwert negativ ist, auf der

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 2. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze – (Fortsetzung)

### (p) Swap-Instrumente – (Fortsetzung)

Passivseite gehalten. Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts der Swap-Instrumente werden in der Gesamtergebnisrechnung unter „Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten“ erfasst.

#### Credit Default Swaps

Jeder Fixed Income Fund (Fixed Income Fund, wie auf Seite 15 definiert), mit Ausnahme des Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund, kann Credit Default Swap-Vereinbarungen abschließen, vorausgesetzt, dass (i) der Credit Default Swap-Vertrag einer täglichen Bewertung durch die Fonds unterliegt und unabhängig mindestens wöchentlich überprüft wird und (ii) die mit dem Credit Default Swap verbundenen Risiken unabhängig auf halbjährlicher Basis bewertet werden müssen und der Bericht dem Verwaltungsrat zur Überprüfung vorgelegt werden muss. Ein Fonds kann sowohl als Käufer als auch als Verkäufer bei einem Credit Default Swap-Geschäft auftreten. Der „Sicherungsnehmer“ eines Credit Default Swaps ist verpflichtet, während der Laufzeit des Kontraktes regelmäßige Zahlungen an die Gegenpartei zu leisten, vorausgesetzt, bei der zugrunde liegenden Referenzverpflichtung kommt es nicht zu einem Zahlungsausfall. Wenn ein Fonds Käufer ist und kein Kreditereignis eintritt, verliert der Fonds sein gesamtes eingesetztes Kapital. Ist der Fonds aber Käufer und ein Kreditereignis tritt ein, erhält der Fonds (der Käufer) den vollen nominellen Wert der Referenzverbindlichkeit, die einen geringen oder keinen Wert haben kann. Tritt der Fonds hingegen als Sicherungsgeber auf und kommt es zu einem Zahlungsausfall, muss der Fonds (der Sicherungsgeber) der Gegenpartei im Tausch gegen die Referenzverpflichtung den vollständigen Nominalwert oder „Nennwert“ der Referenzverpflichtung zahlen. Als Verkäufer erhält ein Fonds während der Laufzeit des Kontrakts, die normalerweise zwischen sechs Monaten und drei Jahren liegt, feste Zinserträge, solange kein Kreditereignis eintritt.

Die Fonds kaufen Credit Default Swaps, um sich gegen das Risiko des Kapitalverlusts oder des Zahlungsausfalls bei den gehaltenen Schuldtiteln abzusichern. Die Fonds verkaufen Credit Default Swaps, um ein Engagement in dem Anstieg des Kapitalpreises aufzubauen, und das Ausfallrisiko wird vom Käufer von Credit Default Swaps auf den Fonds als Verkäufer der Credit Default Swaps übertragen. Dabei besteht das Risiko, dass der Swap wertlos verfällt, und das Kreditrisiko, dass der Verkäufer bei einem Zahlungsausfall seinen Zahlungsverpflichtungen gegenüber den Fonds nicht nachkommt. Die Fonds dürfen derartige Transaktionen nur mit Gegenparteien eingehen, deren Bonität mit A- oder höher eingestuft ist.

#### Zinsswaps

Bei einem Zins-Swap oder Cross Currency Interest Rate Swap tauscht ein Fonds mit einer anderen Partei die jeweilige Verpflichtung, Zahlungsströme zu zahlen oder zu erhalten (z.B. Tausch von variablen Zinszahlungen gegen feste Zinszahlungen in Basis- oder Fremdwährungen). Beim Kauf eines Cap hat der Käufer, sofern ein bestimmter Index einen vorher festgelegten Wert übersteigt, Anspruch auf Erhalt von Zahlungen auf einen nominellen Kapitalbetrag von der Partei, die den Cap verkauft. Beim Kauf eines Floor hat der Käufer, sofern ein bestimmter Index unter einen vorher festgelegten Wert fällt, Anspruch auf Zahlungen auf einen nominellen Kapitalbetrag von der Partei zu erhalten, die den Floor verkauft. Ein Collar ist eine Kombination aus Cap-Kauf und Floor-Verkauf. Spread Locks sind Kontrakte, die garantieren, dass ein Zinsswap zu einem vorher festgelegten Zinssatz abgeschlossen werden kann, der über einem Benchmarksatz liegt.

#### Aktien-Swaps

Aktien-Swaps sind Vereinbarungen zwischen einem Fonds und Dritten, die es dem Fonds ermöglichen, ein Engagement in den Kursschwankungen bestimmter Wertpapiere zu erwerben, ohne die Wertpapiere tatsächlich zu kaufen. Die Veränderungen der vertraglich zugrunde liegenden Werte werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste ausgewiesen. Der Fonds weist einen realisierten Gewinn oder Verlust aus, wenn der Vertrag abgeschlossen wird.

#### Total Return Swaps

Bestimmte Fonds können in Total Return Swaps investieren, um ihr langfristiges Risiko für Marktrisiken und Kreditrisiken zu reduzieren. Total Return Swaps sind Vereinbarungen, nach denen ein Fonds Cashflows auf der Grundlage des Gesamtertrags eines bestimmten Vermögenswerts als Gegenleistung für die gezahlten bzw. vereinnahmten festen oder variablen Zinsen auf diesen Vermögenswert zahlt oder erhält. Total Return Swaps werden von einem unabhängigen Anbieter von Preisdiensten zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Wenn der Preis nicht verfügbar ist, wird er vom Franklin Templeton Global Valuation Committee (dem „Bewertungsausschuss“) zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Diese Positionen werden monatlich mit dem Preis der Gegenpartei abgestimmt.

#### Währungsübergreifende Swaps

Bei Währungs-Swaps werden zwei verschiedene Währungen ausgetauscht mit einer Vereinbarung, den Umtausch zu einem späteren Datum zu bestimmten Wechselkursen umzukehren. Der Austausch von Währungen am Auflegungsdatum des Kontrakts erfolgt zum aktuellen Kassakurs. Der Rücktausch bei der Fälligkeit kann zum selben Wechselkurs, zu einem bestimmten Wechselkurs oder zum zu diesem Zeitpunkt aktuellen Kassakurs erfolgen. Zinszahlungen erfolgen gegebenenfalls zwischen den Parteien auf der Grundlage von bei der Auflegung des Kontrakts in den beiden Währungen verfügbaren Zinssätzen.

#### Inflation Swaps

Bei Inflationsswaps wird ein fester Satz auf einen nominellen Nennbetrag gegen einen an einen Inflationsindex gebundenen variablen Satz getauscht. Die Partei, die den variablen Zinssatz zahlt, zahlt den inflationsbereinigten Satz multipliziert mit dem nominellen Nennbetrag.

#### Index-Swaps

Ein Index-Swap bezieht sich auf einen Absicherungsvertrag, bei dem eine Partei an einem bestimmten Datum einen vorbestimmten Cashflow mit einer Gegenpartei tauscht. Als vereinbarter Austausch für eine Seite dieses Swaps wird ein Schulden-, Eigenkapital- oder anderer Preisindex verwendet. Bei einem Overnight-Index-Swap wird ein Overnight-Zinsindex wie die Leitzinsen der Bundesfonds oder der London Interbank Offered Rate (LIBOR) angewendet. Der Overnight-Index-Swap bezeichnet einen Zinsswap, bei dem der Tagessatz in einen festen Zinssatz umgetauscht wird.

### (q) Differenzverträge

Ein Differenzkontrakt ist eine Vereinbarung zwischen zwei Parteien über den Austausch der Differenz zwischen dem Eröffnungskurs und dem Schlusskurs eines Kontrakts. Bei einem Long-Differenzkontrakt verpflichtet sich die Gegenpartei, dem Fonds ggf. den Betrag zu zahlen, um den der Wert des nominellen Betrags des Kontrakts gestiegen wäre, wenn er in dem bzw. den zugrunde liegenden Wertpapier(en) investiert gewesen wäre, zuzüglich aller Dividenden, die für diese Werte gezahlt worden wären. Bei einem Short-Differenzkontrakt verpflichtet sich die Gegenpartei, dem Fonds ggf. den Betrag zu zahlen, um den der Wert des nominellen Betrags des Kontrakts gesunken wäre, wenn er in dem bzw. den zugrunde liegenden Wertpapier(en) investiert gewesen wäre. Der Fonds muss der Gegenpartei auch den Wert aller Dividenden zahlen, die für diese Werte gezahlt worden wären.

### (r) Wertpapiere, die auf einer „To-Be-Announced“-Basis gehandelt werden

Die Fonds können Wertpapiere auf einer „To-Be-Announced“ („TBA“-)Basis handeln. Bei einer TBA-Transaktion geht der Fonds die Verpflichtung ein, Wertpapiere zu kaufen oder zu verkaufen, für die gewisse Informationen zum Handelszeitpunkt noch nicht vorliegen. Bei einer TBA-Transaktion erworbene Wertpapiere werden nicht glattgestellt, bis sie an das bzw. von dem Portfolio geliefert werden. In der Regel dauert dies zwischen 15 und 45 Tagen. Diese Transaktionen unterliegen den laufenden Marktschwankungen und ihr Tageswert wird wie der aller anderen Wertpapiere bestimmt.

### (s) Kurzfristige Anlagen

Einlagenzertifikate, Termineinlagen und andere bei Finanzinstituten verwahrte Wertpapiere des Umlaufvermögens werden zu ihrem Nennwert mit ggf. aufgelaufenen Zinsen bewertet.

### (t) Rückkauf- und umgekehrte Rückkaufvereinbarungen

„Wertpapierpensionsgeschäft“ bezieht sich auf eine Vereinbarung, wonach ein Fonds Wertpapiere oder Rechte im Zusammenhang mit einem Titel oder Wertpapier an eine Gegenpartei überträgt und sich verpflichtet, diese zu einem bestimmten Preis zu einem festgelegten oder festzulegenden Zeitpunkt zurückzukaufen; „Umgekehrtes Wertpapierpensionsgeschäft“ bezieht sich auf eine Vereinbarung, wonach ein Fonds von einer Gegenpartei Wertpapiere oder Rechte im Zusammenhang mit einem Titel oder Wertpapier erhält und sich verpflichtet, diese zu einem bestimmten Preis zu einem festgelegten oder festzulegenden Zeitpunkt zurückzukaufen;

Der beizulegende Zeitwert von im Rahmen von Wertpapierpensionsgeschäften erworbenen Wertpapieren wird zum Nennwert bewertet und um etwaige Wechselkurschwankungen berichtigt. Die Zinssätze variieren bei jedem Wertpapierpensionsgeschäft und werden beim Abschluss der Vereinbarung festgesetzt. Die Gesellschaft nimmt die im Rahmen von Wertpapierpensionsgeschäften gekauften Wertpapiere grundsätzlich in Verwahrung und bewertet die Wertpapiere täglich, um die Gesellschaft zu schützen, falls die Wertpapiere von der Gegenpartei nicht zurückgekauft werden. Die Gesellschaft erhält in der Regel zusätzliche Sicherheiten, wenn der Marktwert der zugrunde liegenden Wertpapiere unter dem Nennwert des Wertpapierpensionsgeschäfts zuzüglich aufgelaufener Zinsen liegt. Falls der Rückkaufverpflichtung nicht nachgekommen wird, hat die Gesellschaft das Recht, die Sicherheiten zu verwerten und den Erlös zur Erfüllung der Verbindlichkeit zu verwenden. Im Falle des Zahlungsausfalls oder Konkurses der Gegenpartei der Vereinbarung bedarf die Verwertung oder Einbehaltung der Sicherheiten oder des Erlöses unter Umständen gerichtlicher Schritte. Im Geschäftsjahr wurden umgekehrte Rückkaufvereinbarungen zum Zweck eines effizienten Portfoliomanagements verwendet.

### (u) Exchange Traded Funds

Die Fonds können in börsenhandelnden Fonds („ETF“) anlegen. ETF sind Fonds, die einen Index oder einen Wertpapierkorb wie bei einem Indexfonds abbilden, jedoch wie eine Aktie an der Börse gehandelt werden. Diese Wertpapiere unterliegen den laufenden Marktschwankungen und ihr Tageswert wird wie derjenige aller anderen Wertpapiere bestimmt.

### (v) Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen

Der beizulegende Zeitwert von Anlagen in offenen Investmentfonds beruht auf dem ungeprüften Nettoinventarwert pro Anteil, wie er von der Verwaltungsstelle des betreffenden Fonds angegeben wird.

### (w) Austausch

Bestimmte Fonds können zur Absicherung gegen ungünstige Zinsentwicklungen Swaptions abschließen. Bei diesen Instrumenten werden die Merkmale von zwei anderen Finanzinstrumenten, nämlich einer Option und eines Zins-Swaps, miteinander kombiniert. Die Fonds verbuchen einen nicht realisierten Gewinn/(Verlust) zum beizulegenden Zeitwert über den Betrag, der nach der Vereinbarung vereinnahmt würde bzw. zu zahlen wäre, wenn dieser Betrag bei der Bewertung liquidiert würde. Der beizulegende Zeitwert wird täglich von Markit als Anbieter bereitgestellt. Der nicht realisierte Gewinn/(Verlust) wird in der Bilanz als ein finanzieller Vermögenswert oder als eine finanzielle Verbindlichkeit ausgewiesen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 2. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze – (Fortsetzung)

### (x) Treasury Inflationary Index Obligations (TIPS)

Bestimmte Fonds können in indexierte Wertpapiere investieren. Indexierte Wertpapiere sind Wertpapiere, deren Kurse gemäß dem Verfahren von Wertpapier- und Währungsindizes oder anderen Finanzstatistiken indexiert werden. Indexierte Wertpapiere sind in der Regel Schuldtitel oder Einlagen, deren Wert bei Fälligkeit und/oder Kupon durch Bezug auf ein bestimmtes Instrument oder eine Statistik ermittelt wird. Die Performance indexierter Wertpapiere schwankt (je nach Instrument entweder direkt oder umgekehrt) mit der Performance des Index, des Wertpapiers oder der Währung. Der beizulegende Zeitwert dieser Wertpapiere wird täglich vom jeweiligen Anbieter ermittelt, und die Änderungen werden vom Fonds als nicht realisierter Gewinn oder Verlust ausgewiesen.

### (y) Darlehensschuldverschreibungen und Darlehensbeteiligungen

Darlehensscheine und Darlehensbeteiligungen sind festverzinsliche und variabel verzinsliche Darlehen, die durch private Verhandlungen zwischen einem Unternehmen oder einer anderen Art von Unternehmen und einem oder mehreren Finanzinstituten arrangiert werden. Derartige Anlagen erfolgen meist in Form von Darlehensbeteiligungen oder Abtretungen von Darlehen, die verbrieft sein können oder nicht. Darlehensscheine und Darlehensbeteiligungen werden von der Gesellschaft als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzanlagen klassifiziert und zunächst zum beizulegenden Zeitwert angesetzt. Gewinne und Verluste aus Änderungen des beizulegenden Zeitwerts der finanziellen Vermögenswerte werden in der Gesamtergebnisrechnung in dem Geschäftsjahr, in dem sie entstehen, ausgewiesen.

### (z) Master-Limited Partnership

Bestimmte Fonds können in Master-Limited-Partnerships (MLPs) investieren, indem sie an Limited Partners der MLP ausgegebene Anteile kaufen, die an geregelten Märkten öffentlich gehandelt werden. MLPs sind Personen- oder Kapitalgesellschaft mit beschränkter Haftung (limited partnerships oder limited liability companies), die typischerweise Erträge und Kapitalerträge aus der Exploration, Entwicklung, Lagerung, Erfassung, dem Abbau, der Produktion, Verarbeitung, Raffinierung, dem Transport (einschließlich von Pipelines, die Gas, Öl oder Gas- oder Ölprodukte befördern) oder der Vermarktung von Mineralien oder natürlichen Ressourcen erzielen. MLPs haben im allgemeinen zwei Arten von Inhabern, den General Partner und die Limited Partners. Den Limited Partners gehört der Rest der Gesellschaft über das Eigentum an Gesellschaftsanteilen, und sie spielen beim Betrieb und bei der Führung des Unternehmens nur eine eingeschränkte Rolle.

Der beizulegende Zeitwert einer Anlage in MLP wird ebenso bestimmt wie bei anderen Wertpapieren. Die Änderungen des beizulegenden Zeitwerts werden als nicht realisierter Gewinn oder Verlust erfasst.

### (aa) Zinserträge und Zinsaufwendungen

Die Zinsaufwendungen umfassen Zinsaufwendungen in Bezug auf Zahlungsmittel, Zahlungsmitteläquivalente, Termineinlagen und Bareinschüsse. Die Zinserträge und Zinsaufwendungen werden in der Gesamtergebnisrechnung offengelegt.

### (ab) Marginkonten und eingeschränkte Barmittel

Der Posten „Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung“ weist in der Darstellung der Vermögenslage Einschusszahlungen, Barsicherheiten und realisierte Gewinne und Verluste aus Terminkontrakten aus, die noch nicht geliefert wurden.

Einschusszahlungen werden im Hinblick auf offene börsengehandelte und außerbörsliche Derivatekontrakte bei Brokern gehalten oder an sie verpfändet. Die von den Fonds für den Derivathandel bereitgestellten oder erhaltenen Barsicherheiten werden in der Darstellung der Vermögenslage innerhalb des Postens Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung ausgewiesen und sind nicht als Komponenten in den Zahlungsmitteln und Zahlungsmitteläquivalenten enthalten. Die Barsicherheitsalden sind Beträge im Zusammenhang mit dem Derivathandel und werden zum Jahresende bei Brokern gehalten. Die Barsicherheitsalden, die im Zusammenhang mit dem Derivathandel eingehen, werden bei der Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin, und allen Unterdepotstellen gehalten und sind am Jahresende an die Broker zu zahlen.

### (ac) Forderungen für Anlagen / rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile verkauft und zahlbar für erworbene Anlagen / rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile

Forderungen aus Anlagen / verkauften rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen sind Forderungen aus Wertpapieren / verkauften rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen, die verkauft wurden, über die ein Vertrag abgeschlossen, die zum Datum der Darstellung der Vermögenslage jedoch noch nicht abgewickelt oder geliefert wurden. Diese Beträge werden anfänglich zum beizulegenden Zeitwert erfasst und anschließend zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet.

Die Verbindlichkeiten aus erworbenen / rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen, die wiedererworben wurden, sind Verbindlichkeiten aus gekauften Wertpapieren / wiedererworbenen rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen, über die ein Vertrag abgeschlossen, die zum Datum der Darstellung der Vermögenslage jedoch noch nicht abgewickelt oder geliefert wurden. Diese Beträge werden anfänglich zum beizulegenden Zeitwert erfasst und anschließend zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet.

### (ad) Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile

Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile werden an einem Ex-Dividenden-Datum erfasst und als „Finanzkosten“ in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen.

## 3. Effizientes Portfoliomanagement

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. OGAW sind 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 zum Ende des Geschäftsjahres sind im Portfolio der Anlagen der Fonds enthalten. Alle realisierten Gewinne und Verluste aus der Verwendung von Derivatekontrakten für Zwecke des effizienten Portfoliomanagements werden in der Gesamtergebnisrechnung unter Nettogewinne/(-verluste) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert erfolgswirksam erfasst.

Im Geschäftsjahr wurden umgekehrte Rückkaufvereinbarungen zum Zweck eines effizienten Portfoliomanagements abgeschlossen. Einzelheiten zu allen umgekehrten Pensionsgeschäften zum Ende des Geschäftsjahres sind im Portfolio der Anlagen enthalten.

### 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 zeigt die Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften in den Geschäftsjahren zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021:

Fondsname	28. Februar 2022 (in Tsd.)	28. Februar 2021 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	\$70	\$176
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	\$-	\$30

Als „-“ bezeichnete Beträge betragen entweder 0 USD oder weniger als 1.000 USD.

Es wurden keine Transaktionskosten für die Käufe und Verkäufe von umgekehrten Pensionsgeschäften erhoben.

### Transaktionen mit Wertpapierleihgeschäften

Bestimmte Fonds können für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung wie oben dargelegt auch Wertpapierleihgeschäfte abschließen. Bei solchen Transaktionen kann der Fonds seine Wertpapiere vorübergehend an einen Kreditnehmer übertragen, mit Zustimmung des Kreditnehmers, dem Fonds zu einem vorab vereinbarten Zeitpunkt gleichwertige Wertpapiere 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. Für die Geschäftsjahre zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 gab es keine Wertpapierleihgeschäfte mit einem der Fonds.

### 4. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien

Gemäß dem Verwaltungsvertrag zwischen Franklin Templeton International Services S.à.r.l (der „Manager“ oder „FTIS“) und der Gesellschaft (der „Verwaltungsvertrag“) hat der Manager Anspruch auf Erhalt einer Verwaltungsgebühr aus dem Vermögen des betreffenden Fonds für seine Anlageverwaltungs- und Vertriebsdienstleistungen, die an jedem Handelstag anfällt und monatlich nachträglich zu zahlen ist (die „Verwaltungsgebühren“). Das Unternehmen ist auch für die unverzügliche Zahlung oder Erstattung von Provisionen, Übertragungsgebühren, Registrierungsgebühren, Steuern und ähnlichen Verbindlichkeiten, Kosten und Auslagen an den Manager verantwortlich, die ordnungsgemäß an FTIS zu zahlen sind oder angefallen sind.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Die maximale Verwaltungsgebühr für jede Anteilsklasse (ausgedrückt als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des betreffenden Fonds, der dieser Klasse zuzurechnen ist) zum Ende des Geschäftsjahres beträgt wie folgt:

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
<b>Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund</b>		<b>Legg Mason Western Asset US High Yield Fund</b>	
Klasse A	0,800 %	Klasse A	1,150 %
Klasse B	1,050 %	Klasse B	1,400 %
Klasse C	1,300 %	Klasse C	1,650 %
Klasse E	1,400 %	Klasse E	1,750 %
Klasse X	0,600 %	Klasse F	0,700 %
Premier-Klasse	0,300 %	Klasse R	0,750 %
LM-Klasse	Keine	Klasse T	1,150 %
Klasse A (G)	0,800 %	Klasse X	0,575 %
Klasse L (G)	0,800 %	Premier-Klasse	0,450 %
<b>Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund</b>		LM-Klasse	Keine
Klasse A	0,950 %	Klasse A (G)	1,150 %
Klasse B	1,200 %	Klasse L (G)	1,650 %
Klasse C	1,450 %	Klasse GF	0,950 %
Klasse E	1,550 %	<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund</b>	
Klasse F	0,550 %	Klasse A	1,500 %
Klasse R	0,550 %	Klasse B	1,750 %
Klasse T	0,950 %	Klasse C	2,000 %
Klasse X	0,475 %	Klasse E	2,100 %
Premier-Klasse	0,300 %	Klasse F	0,800 %
S-Klasse	0,200 %	Klasse R	1,100 %
LM-Klasse	Keine	Klasse T	1,500 %
Klasse GA	0,820 %	Klasse X	0,750 %
Klasse GE	1,420 %	Premier-Klasse	0,550 %
<b>Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund</b>		S-Klasse	0,450 %
Klasse A	1,150 %	LM-Klasse	Keine
Klasse B	1,400 %	Klasse A (G)	1,250 %
Klasse C	1,650 %	Klasse B (G)	1,750 %
Klasse E	1,750 %	Klasse L (G)	1,750 %
Klasse F	0,550 %	<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>	
Klasse R	0,750 %	Klasse A	1,500 %
Klasse T	1,150 %	Klasse B	1,750 %
Klasse X	0,575 %	Klasse C	2,000 %
Premier-Klasse	0,300 %	Klasse E	2,100 %
LM-Klasse	Keine	Klasse F	0,800 %
Klasse A (G)	1,150 %	Klasse R	1,100 %
Klasse B (G)	1,650 %	Klasse T	1,500 %
Klasse L (G)	1,650 %	Klasse X	0,750 %
<b>Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund</b>		Premier-Klasse	0,550 %
Klasse A	1,000 %	S-Klasse	0,450 %
Klasse B	1,250 %	LM-Klasse	Keine
Klasse C	1,500 %	<b>Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund</b>	
Klasse E	1,600 %	Klasse A	1,250 %
Klasse F	0,550 %	Klasse B	1,500 %
Klasse R	0,600 %	Klasse C	1,750 %
Klasse T	1,000 %	Klasse E	1,850 %
Klasse X	0,500 %	Klasse F	0,700 %
Premier-Klasse	0,300 %	Klasse R	0,850 %
S-Klasse	0,200 %	Klasse T	1,250 %
LM-Klasse	Keine	Klasse X	0,625 %
Klasse GA	0,820 %	Premier-Klasse	0,450 %
Klasse GE	1,420 %	S-Klasse	0,300 %
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund</b>		LM-Klasse	Keine
Klasse A	1,100 %	Klasse A (G)	1,250 %
Klasse B	1,350 %	Klasse L (G)	1,750 %
Klasse C	1,600 %	<b>Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund</b>	
Klasse E	1,700 %	Klasse A	0,900 %
Klasse F	0,850 %	Klasse B	1,150 %
Klasse R	0,700 %	Klasse C	1,400 %
Klasse X	0,600 %	Klasse E	1,500 %
Premier-Klasse	0,600 %	Klasse F	0,600 %
S-Klasse	0,300 %	Klasse R	0,550 %
LM-Klasse	Keine	Klasse T	0,900 %
Klasse A (G)	1,200 %	Klasse X	0,450 %
Klasse B (G)	1,700 %	Premier-Klasse	0,350 %
Klasse L (G)	1,700 %	S-Klasse	0,250 %
<b>Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund</b>		LM-Klasse	Keine
Klasse A	1,100 %	Klasse A (G)	1,100 %
Klasse B	1,350 %	Klasse L (G)	1,600 %
Klasse C	1,600 %	<b>Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund</b>	
Klasse E	1,700 %	Klasse A	1,100 %
Klasse F	0,650 %	Klasse B	1,350 %
Klasse R	0,700 %	Klasse C	1,600 %
Klasse T	1,100 %	Klasse E	1,700 %
Klasse X	0,550 %	Klasse F	0,850 %
Premier-Klasse	0,400 %	Klasse R	0,700 %
LM-Klasse	Keine	Klasse T	1,100 %
		Klasse X	0,600 %
		Premier-Klasse	0,600 %
		LM-Klasse	Keine

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsvergütung	Fondsname	Maximale Verwaltungsvergütung
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund</b>		<b>Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse A	0,850 %	Klasse A	0,800 %
Klasse B	1,100 %	Klasse R	0,500 %
Klasse C	1,350 %	Klasse T	0,800 %
Klasse E	1,450 %	Klasse X	0,400 %
Klasse F	0,600 %	Premier-Klasse	0,300 %
Klasse R	0,450 %	S-Klasse	0,200 %
Klasse T	0,850 %	LM-Klasse	Keine
Klasse X	0,425 %	<b>Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>	
Premier-Klasse	0,350 %	Klasse A	0,800 %
S-Klasse	0,250 %	Klasse R	0,500 %
LM-Klasse	Keine	Klasse T	0,800 %
<b>Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup></b>		Klasse X	0,400 %
Klasse A	1,100 %	Premier-Klasse	0,300 %
Klasse B	1,350 %	S-Klasse	0,200 %
Klasse C	1,600 %	LM-Klasse	Keine
Klasse E	1,700 %	<b>Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse F	0,650 %	LM-Klasse	Keine
Klasse R	0,700 %	<b>Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse T	1,100 %	Klasse A	0,850 %
Klasse X	0,550 %	Klasse B	1,100 %
Premier-Klasse	0,400 %	Klasse C	1,350 %
LM-Klasse	Keine	Klasse E	1,450 %
<b>Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup></b>		Klasse F	0,600 %
Klasse A	0,850 %	Klasse R	0,650 %
Klasse B	1,100 %	Klasse T	0,850 %
Klasse C	1,350 %	Klasse X	0,350 %
Klasse E	1,450 %	Premier-Klasse	0,350 %
Klasse F	0,600 %	S-Klasse	0,250 %
Klasse R	0,650 %	LM-Klasse	Keine
Klasse T	0,850 %	<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund</b>	
Klasse X	0,350 %	Klasse A	1,100 %
Premier-Klasse	0,350 %	Klasse B	1,350 %
S-Klasse	0,250 %	Klasse C	1,600 %
LM-Klasse	Keine	Klasse E	1,700 %
<b>Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund</b>		Klasse F	0,850 %
Klasse A	1,150 %	Klasse R	0,700 %
Klasse B	1,400 %	Klasse T	1,100 %
Klasse C	1,650 %	Klasse X	0,600 %
Klasse E	1,750 %	Premier-Klasse	0,600 %
Klasse F	0,700 %	LM-Klasse	Keine
Klasse R	0,750 %	<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse T	1,150 %	Klasse A	1,350 %
Klasse X	0,575 %	Klasse B	1,600 %
Premier-Klasse	0,450 %	Klasse C	1,850 %
S-Klasse	0,350 %	Klasse E	1,950 %
LM-Klasse	Keine	Klasse F	1,100 %
<b>Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup></b>		Klasse J	0,900 %
Klasse A	1,500 %	Klasse R	0,950 %
Klasse B	1,750 %	Klasse X	0,900 %
Klasse C	2,000 %	Premier-Klasse	0,900 %
Klasse E	2,100 %	LM-Klasse	Keine
Klasse F	1,250 %	<b>Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse R	1,100 %	Klasse A	1,100 %
Klasse T	1,500 %	Klasse F	0,750 %
Klasse X	1,000 %	Klasse T	1,100 %
Klasse Y	1,000 %	Klasse X	0,550 %
Premier-Klasse	1,000 %	Premier-Klasse	0,550 %
S-Klasse	0,600 %	S-Klasse	0,450 %
LM-Klasse	Keine	LM-Klasse	Keine
<b>Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup></b>		<b>Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund</b>	
Klasse A	1,250 %	Klasse A	1,150 %
Klasse B	1,500 %	Klasse B	1,400 %
Klasse C	1,750 %	Klasse C	1,650 %
Klasse E	1,850 %	Klasse E	1,750 %
Klasse F	0,800 %	Klasse F	0,900 %
Klasse R	0,750 %	Klasse R	0,750 %
Klasse T	1,250 %	Klasse T	1,150 %
Klasse X	0,625 %	Klasse X	0,650 %
Premier-Klasse	0,600 %	Premier-Klasse	0,650 %
S-Klasse	0,400 %	LM-Klasse	Keine
LM-Klasse	Keine	<b>Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund</b>	
<b>Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup></b>		Klasse A	1,100 %
Klasse D	1,200 %	Klasse B	1,350 %
Klasse F	1,200 %	Klasse C	1,600 %
Klasse M	0,600 %	Klasse E	1,700 %
Premier-Klasse	0,600 %	Klasse F	0,800 %
LM-Klasse	Keine	Klasse J	0,450 %
<b>Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup></b>		Klasse R	0,700 %
Klasse A	1,000 %	Klasse T	1,100 %
Klasse B	1,250 %	Klasse X	0,550 %
Klasse C	1,500 %	Premier-Klasse	0,550 %
Klasse E	1,600 %	S-Klasse	0,450 %
Klasse F	0,550 %	LM-Klasse	Keine
Klasse R	0,600 %		
Klasse X	0,500 %		
Premier-Klasse	0,300 %		
LM-Klasse	Keine		

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
<b>Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup></b>		<b>Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund</b>	
Klasse A	1,650 %	Klasse A	1,300 %
Klasse B	1,900 %	Klasse B	1,800 %
Klasse C	2,150 %	Klasse C	1,800 %
Klasse E	2,250 %	Klasse E	2,050 %
Klasse F	1,300 %	Klasse F	1,050 %
Klasse J	0,750 %	Klasse R	0,800 %
Klasse R	1,250 %	Klasse T	1,300 %
Klasse T	1,650 %	Klasse X	0,650 %
Klasse X	1,150 %	Premier-Klasse	0,650 %
Premier-Klasse	1,150 %	LM-Klasse	Keine
S-Klasse	0,750 %	Klasse A (G)	1,300 %
LM-Klasse	Keine	Klasse B (G)	1,800 %
<b>Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup></b>		Klasse L (G)	1,800 %
Klasse A	1,050 %	Klasse GA	1,420 %
Klasse B	1,300 %	Klasse GE	2,170 %
Klasse C	1,550 %	<b>Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund</b>	
Klasse E	1,650 %	Klasse A	1,250 %
Klasse F	0,700 %	Klasse B	1,750 %
Klasse T	1,050 %	Klasse C	1,750 %
Klasse X	0,525 %	Klasse E	2,000 %
Premier-Klasse	0,525 %	Klasse F	1,000 %
S-Klasse	0,400 %	Klasse R	0,800 %
LM-Klasse	Keine	Klasse T	1,250 %
<b>Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>		Klasse X	0,625 %
Klasse A	2,000 %	Premier-Klasse	0,625 %
Klasse T	2,000 %	LM-Klasse	Keine
Klasse U	1,000 %	<b>Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse X	1,150 %	Klasse A	1,200 %
Premier-Klasse	1,150 %	Klasse B	1,700 %
LM-Klasse	Keine	Klasse C	1,700 %
<b>Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup></b>		Klasse E	1,950 %
Klasse A	1,200 %	Klasse F	0,950 %
Klasse E	1,950 %	Klasse R	0,700 %
Klasse F	0,950 %	Klasse T	1,200 %
Klasse R	0,700 %	Klasse X	0,600 %
Klasse T	1,200 %	Premier-Klasse	0,600 %
Klasse X	0,600 %	S-Klasse	0,400 %
Premier-Klasse	0,600 %	LM-Klasse	Keine
S-Klasse	0,500 %	<b>Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup></b>	
LM-Klasse	Keine	Klasse A	1,300 %
<b>Legg Mason ClearBridge Value Fund</b>		Klasse B	1,800 %
Klasse A	1,350 %	Klasse C	1,800 %
Klasse B	1,850 %	Klasse E	2,050 %
Klasse C	1,850 %	Klasse F	1,050 %
Klasse E	2,100 %	Klasse R	0,800 %
Klasse F	1,100 %	Klasse T	1,300 %
Klasse R	0,850 %	Klasse X	0,650 %
Klasse T	1,350 %	Premier-Klasse	0,650 %
Klasse X	0,675 %	S-Klasse	0,550 %
Premier-Klasse	0,675 %	LM-Klasse	Keine
LM-Klasse	Keine	<b>Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup></b>	
<b>Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund</b>		Klasse A	1,500 %
Klasse A	1,250 %	Klasse B	2,000 %
Klasse B	1,750 %	Klasse C	2,000 %
Klasse C	1,750 %	Klasse E	2,250 %
Klasse E	2,000 %	Klasse F	1,250 %
Klasse F	1,000 %	Klasse R	1,000 %
Klasse R	0,750 %	Klasse T	1,500 %
Klasse T	1,250 %	Klasse X	0,850 %
Klasse X	0,625 %	Premier-Klasse	0,850 %
Premier-Klasse	0,625 %	LM-Klasse	Keine
LM-Klasse	Keine	<b>Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse A	1,650 %
Klasse B (G)	1,750 %	Klasse B	2,150 %
Klasse L (G)	1,750 %	Klasse C	2,150 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse E	2,400 %
Klasse GE	2,170 %	Klasse F	1,400 %
<b>Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund</b>		Klasse R	1,150 %
Klasse A	1,250 %	Klasse T	1,650 %
Klasse B	1,750 %	Klasse X	1,000 %
Klasse C	1,750 %	Premier-Klasse	1,000 %
Klasse E	2,000 %	S-Klasse	0,600 %
Klasse F	1,000 %	LM-Klasse	Keine
Klasse R	0,750 %	<b>Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse T	1,250 %	Klasse A	1,500 %
Klasse U	0,525 %	Klasse B	2,000 %
Klasse X	0,625 %	Klasse C	2,000 %
Premier-Klasse	0,625 %	Klasse E	2,250 %
LM-Klasse	Keine	Klasse F	1,250 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse R	1,000 %
Klasse L (G)	1,750 %	Klasse T	1,500 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse U	0,600 %
		Klasse X	0,750 %
		Premier-Klasse	0,750 %
		S-Klasse	0,400 %
		LM-Klasse	Keine

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
<b>Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund</b>		<b>Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund</b>	
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 R	1,000 %	Klasse R	0,850 %
Klasse T	1,500 %	Klasse T	1,350 %
Klasse X	0,750 %	Klasse X	0,675 %
Premier-Klasse	0,750 %	Premier-Klasse	0,675 %
LM-Klasse	Keine	S-Klasse	0,500 %
<b>Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund</b>		<b>Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse A	1,500 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %	Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %	Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %	Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,000 %	Klasse M	1,000 %
Klasse T	1,500 %	Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,750 %	Klasse T	1,500 %
Premier-Klasse	0,750 %	Premier-Klasse	0,750 %
LM-Klasse	Keine	LM-Klasse	Keine
Klasse A (G)	1,250 %	<b>Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse L (G)	1,750 %	Klasse A (PF)	2,000 %
<b>Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup></b>		Klasse E (PF)	2,750 %
Klasse A	1,500 %	Klasse F (PF)	1,750 %
Klasse B	2,000 %	Klasse J (PF)	1,000 %
Klasse C	2,000 %	Klasse M (PF)	1,500 %
Klasse E	2,250 %	Klasse R (PF)	1,500 %
Klasse F	1,250 %	Premier Class (PF)	1,500 %
Klasse R	1,000 %	LM-Klasse	Keine
Klasse T	1,500 %	<b>Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse X	0,750 %	Klasse A	1,500 %
Premier-Klasse	0,750 %	Klasse B	2,000 %
S-Klasse	0,550 %	Klasse C	2,000 %
LM-Klasse	Keine	Klasse E	2,250 %
<b>Franklin MV European Equity Growth and Income Fund</b>		Klasse F	1,250 %
Klasse A	1,350 %	Klasse R	1,000 %
Klasse B	1,850 %	Klasse T	1,500 %
Klasse C	1,850 %	Klasse X	0,750 %
Klasse E	2,100 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse F	1,100 %	S-Klasse	0,650 %
Klasse R	0,850 %	LM-Klasse	Keine
Klasse T	1,350 %	<b>Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund</b>	
Klasse X	0,675 %	Klasse A	1,500 %
Premier-Klasse	0,675 %	Klasse B	2,000 %
S-Klasse	0,500 %	Klasse C	2,000 %
LM-Klasse	Keine	Klasse D	1,100 %
Klasse A (G)	1,350 %	Klasse E	2,250 %
Klasse B (G)	1,850 %	Klasse F	1,250 %
Klasse L (G)	1,850 %	Klasse R	1,000 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse T	1,500 %
Klasse GE	2,170 %	Klasse X	0,750 %
Klasse GP	0,850 %	Premier-Klasse	0,750 %
<b>Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund</b>		S-Klasse	0,440 %
Klasse A	1,350 %	LM-Klasse	Keine
Klasse B	1,850 %	<b>Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup></b>	
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 J	0,650 %
Premier-Klasse	0,675 %	Klasse R	1,000 %
S-Klasse	0,500 %	Klasse T	1,500 %
LM-Klasse	Keine	Klasse X	0,750 %
Klasse GA	1,620 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse GE	2,370 %	S-Klasse	0,650 %
<b>Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup></b>		LM-Klasse	Keine
Klasse A	1,000 %	<b>Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse B	1,500 %	Klasse A	1,500 %
Klasse C	1,500 %	Klasse B	2,000 %
Klasse E	1,750 %	Klasse C	2,000 %
Klasse F	0,750 %	Klasse E	2,250 %
Klasse R	0,650 %	Klasse F	1,250 %
Klasse T	1,000 %	Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,500 %	Klasse X	0,750 %
Premier-Klasse	0,500 %	Premier-Klasse	0,750 %
S-Klasse	0,400 %	S-Klasse	0,650 %
LM-Klasse	Keine	LM-Klasse	Keine

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Die in den obenstehenden Tabellen angegebenen Verwaltungsgebühren für die einzelnen Fonds gelten für alle in der jeweiligen Spalte aufgeführten Anteilklassen, die der Fonds anbietet. Nicht alle Anteilklassen werden von jedem Fonds angeboten und nicht alle Anteilklassen waren zum 28. Februar 2022 im 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 Manager für die Zahlung der Gebühren und Auslagen des jeweiligen 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 die Geschäftsjahre zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 wurden die Managementgebühren erlassen, erstattet und andere Ausgaben erstattet:

Fondsname	28. Februar 2022 in (in Tsd.)		28. Februar 2021 in (in Tsd.)	
	Erläss der Verwaltungsgebühr	Erstattete Verwaltungsgebühr und sonstige erstattete Ausgaben	Erläss der Verwaltungsgebühr	Erstattete Verwaltungsgebühr und sonstige erstattete Ausgaben
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	\$4.389	\$647	\$3.786	\$238
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	\$–	\$–	\$2	\$–
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	\$1	\$–	\$6	\$–
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	\$–	\$–	\$–	\$2
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	\$1	\$–	\$7	\$–
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	\$–	\$–	\$1	\$–
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	\$1	\$–	\$87	\$–
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	\$–	\$2	\$–	\$–
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	€–	€–	€–	€1
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	\$–	\$–	\$–	\$2
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	\$1	\$–	\$–	\$–
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	\$–	\$–	\$1	\$–
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	\$–	\$85	\$–	\$41
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	\$4	\$23	\$–	\$–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	\$–	\$–	\$–	\$1
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	\$34	\$–	\$40	\$–
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund <sup>^</sup>	\$–	\$–	\$17	\$12
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	\$–	\$–	\$2	\$2
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	\$6	\$2	\$15	\$8
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund <sup>^</sup>	\$36	\$1	\$41	\$3
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	\$–	\$20	\$–	\$2
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund <sup>^</sup>	\$9	\$31	\$8	\$34
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	\$–	\$–	\$2	\$–
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	\$10	\$–	\$17	\$1
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund <sup>^</sup>	\$–	\$–	\$8	\$7
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	\$21	\$–	\$21	\$–
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup>	€–	€–	€1	€4
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup>	\$11	\$2	\$22	\$11
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup>	\$3	\$–	\$–	\$–
Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>	\$9	\$14	\$–	\$–
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund	€–	€–	€3	€–
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	\$1	\$–	\$–	\$2
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>^</sup>	\$–	\$23	\$49	\$1
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund	\$4	\$–	\$8	\$–
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	\$3	\$–	\$4	\$–
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>^</sup>	€5	€13	€6	€–
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	\$–	\$–	\$4	\$2
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	\$1	\$5	\$4	\$15
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	\$9	\$–	\$16	\$–
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>	€3	€–	€14	€1

Als „–“ bezeichnete Beträge betragen entweder 0 USD/0 EUR oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR

Jedem Anlageverwaltungsvertrag zufolge hat jeder Anlageverwalter Anspruch auf eine Anlageverwaltungsgebühr und jeder Anlageverwalter ist dafür verantwortlich, die Gebühren und Spesen von Unteranlageverwaltern aus seiner eigenen Anlageverwaltungsgebühr (die die „Performancegebühr“ umfassen kann) zu zahlen.

Gemäß den Bedingungen des Hauptvertriebsvertrags zwischen der Verwaltungsgesellschaft, der Gesellschaft und Franklin Distributors, LLC (früher bekannt als Legg Mason Investor Services, LLC) (der „Hauptvertriebshändler“) ist die Hauptvertriebsgesellschaft befugt, Aktien der Gesellschaft zu vermarkten, zu bewerben, anzubieten und deren Verkauf und Rücknahme zu veranlassen (zusammen „Vertriebsdienstleistungen“). Darüber hinaus ist der Hauptvertriebspartner berechtigt, auf eigene Kosten und Ausgaben einen oder mehrere Vertriebspartner zu beauftragen, um ihn bei der Erfüllung von Pflichten und Verantwortlichkeiten zu unterstützen, vorausgesetzt, die Ernennung solcher anderen Unternehmen erfolgt gemäß den Anforderungen der Zentralbankregeln. Gemäß den Bedingungen des Hauptvertriebsvertrags zwischen dem Manager, der Gesellschaft und dem Hauptvertriebspartner bleibt der Hauptvertriebspartner in solchen Fällen gegenüber dem Manager für die Erfüllung seiner Verpflichtungen aus diesem Vertrag verantwortlich. Die Hauptvertriebsstelle hat gemäß den Anforderungen der Zentralbank Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited („LMAMHK“) und Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Beschränkt als zusätzliche Vertriebshändler der Fonds. Der Manager hat sich selbst und Franklin Templeton Securities Investment Consulting (Sino-Am) 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 der Rahmen-Aktionärsdienstvereinbarung zwischen der Verwaltungsgesellschaft, der Gesellschaft und Franklin Distributors, LLC (die „Haupt-Aktionärsdienststelle“) ist die Haupt-Aktionärsdienststelle berechtigt, von der Verwaltungsgesellschaft eine Aktionärsdienstgebühr von bestimmten der Anteilklassen für ihre Dienste als Aktionärsdienststelle zu erhalten.

Gemäß den Bedingungen des Hauptgeschäftsführervertrags ist die Hauptgeschäftsführerin berechtigt, auf eigene Kosten und Kosten eine oder mehrere Parteien zu beauftragen, um sie bei der Erfüllung ihrer Pflichten aus dem Vertrag zu unterstützen, vorausgesetzt, dass die Hauptgeschäftsführerin gegenüber der Verwaltungsgesellschaft für die Erfüllung ihrer Pflichten aus diesem Vertrag verantwortlich bleibt. Danach hat die Master Shareholder Servicing Agent Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited und Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Beschränkt als zusätzliche Aktionärs-Servicing-Agenten der Gesellschaft. Der Manager hat Franklin Templeton Securities Investment Consulting (Sino-Am) Inc. ermächtigt, Aktionärsdienstleistungen in Bezug auf Taiwan zu erbringen.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

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

- (i) 0,15 Prozent, jährlich 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 Blue Chip Bond Fund mit kurzer Duration, Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup>, Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund, Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund, Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup> und Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup>; und
- (ii) 0,35 Prozent, jährlich, des Nettoinventarwerts des Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup>, 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<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund, Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund, Legg Mason Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup>, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup>, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund, Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup> und Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup>.

Die Gebühren für Aktionärsdienstleistungen sind für alle Klassen außer Anteilsklassen der Klasse F, Anteilsklassen der Klasse J, Anteilsklassen der Klasse U, Anteilsklassen der Klasse Y, Premier-Anteilsklassen, LM-Anteilsklassen, Grandfathered-Anteilsklassen und Galleon-Anteilsklassen (jeweils wie im Verkaufsprospekt definiert) zahlbar, noch sind diese für alle Anteilsklassen zahlbar, die vom Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund und Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup> angeboten werden.

Während der Geschäftsjahre zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 wurden auf die Gebühren für Aktionärsdienstleistungen wie folgt verzichtet:

Fondsname	Entfallene Informationsstellengebühr	
	28. Februar 2022 (in Tsd.)	28. Februar 2021 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	\$-	\$1
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	\$-	\$2
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	\$10	\$20
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	\$7	\$17
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	\$-	\$5
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	\$1	\$2
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	\$-	\$5
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	\$3	\$4
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	\$-	\$1
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	\$10	\$17
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund <sup>^</sup>	\$97	\$56
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	\$1	\$2
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup>	€-	€1
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup>	\$3	\$4
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup>	\$5	\$-
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	\$-	\$1
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	\$-	\$7
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund	€3	€12
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	\$15	\$23
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>^</sup>	\$-	\$1
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund	\$10	\$16
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	\$116	\$207
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>^</sup>	€11	€104
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	\$19	\$14
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	\$2	\$2
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>	€-	€3

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

Darüber hinaus sind bestimmte Betriebsausgaben, einschließlich, aber nicht beschränkt auf, an Tochtergesellschaften von Franklin Templeton zu zahlende Gebühren für die Bereitstellung von Governance-Unterstützung und Berichterstattung an den Vorstand, Versicherungsdienstleistungen für den Vorstand und laufende Registrierungsleistungen für Gerichtsbarkeiten, in denen die Fonds öffentlich angeboten werden. Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 beliefen sich diese Aufwendungen auf 1.260.797 USD (28. Februar 2021: 1.361.748 USD).

#### Verbundene Parteien

Jane Trust, Joseph Carrier, Jaspal Sagger und William Jackson waren Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft und waren auch Verwaltungsratsmitglieder und/oder Führungskräfte bestimmter verbundener Unternehmen des Managers, der Investmentmanager, der Vertriebsstellen und der Shareholder Servicing Agents. William Jackson und Jane Trust sind ebenfalls Verwaltungsratsmitglieder von FTIS. Die übrigen Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft, wie oben aufgeführt, sind alle Mitarbeiter von FTIS oder eines ihrer verbundenen Unternehmen. 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 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 hielten die Fonds in der nachstehenden Tabelle Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen, die denselben Manager, dieselben Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter wie der Fonds oder eine verbundene Partei dieses Managers, dieser Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter ernannt haben.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

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

Fondsname	Zugrunde liegender Organismus für gemeinsame Anlagen	28. Februar 2022		28. Februar 2021	
		%	Wert (in Tsd.)	%	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)	0,30 %	\$5.470	0,54 %	\$12.610
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	4,20 %	\$34.088	5,15 %	\$27.476
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 %	€808	0,07 %	€1.423
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	–	–	2,61 %	\$13.933
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Klasse Euro thesaurierend	11,55 %	\$6.832	11,08 %	\$7.251
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Klasse USD thesaurierend	11,08 %	\$4.821	24,50 %	\$8.025
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,05 %	\$914	0,22 %	\$5.196
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Klasse Euro thesaurierend	1,29 %	\$762	1,72 %	\$1.126
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,17 %	\$3.010	0,04 %	\$940
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Legg Mason Western Asset Asian Bond Trust – Klasse A (SGD), thesaurierend	–	–	26,35 %	\$4.838
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,68 %	\$12.311	0,77 %	\$18.146
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,37 %	\$6.636	1,03 %	\$24.052
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	2,52 %	\$20.460	5,39 %	\$28.758
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,04 %	\$718	0,04 %	\$940
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,00 %	€2	0,02 %	€336
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	18,61 %	\$150.896	14,03 %	\$74.803
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Klasse Euro thesaurierend	24,56 %	\$14.535	23,57 %	\$15.425
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Klasse Euro thesaurierend	4,81 %	\$2.845	14,35 %	\$9.390
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	2,00 %	\$36.257	2,52 %	\$59.043
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1,03 %	\$18.650	3,16 %	\$74.145
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,62 %	\$11.279	0,41 %	\$9.727
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	0,12 %	\$1.003	0,11 %	\$572
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	\$213	0,04 %	\$901
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,00 %	\$64	–	–
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	2,31 %	\$41.913	3,92 %	\$91.807
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,08 %	\$1.480	0,06 %	\$1.422
Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	\$140	–	–

Die Kapitalanlagen werden in den Finanzabschlüssen in Anmerkung 13 über die Fondsgeschäfte hinweg ausgewiesen.

### Transaktionskosten

Die Transaktionskosten für den Kauf und Verkauf von Aktien, Organismen für gemeinsame Anlagen, Terminkontrakten und Optionen für die Geschäftsjahre zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 sind in der folgenden Tabelle aufgeführt:

Fondsname	28. Februar 2022 (in Tsd.)	28. Februar 2021 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	\$43	\$52
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	\$235	\$281
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	€11	€12
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	\$–	\$1
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	\$12	\$18
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	\$4	\$1
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	\$1	\$–
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	\$–	\$–
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	\$2	\$1
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	\$3	\$4
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	\$16	\$30
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	\$16	\$12
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	\$22	\$26
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>	\$3	\$2
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	\$7.891	\$6.683
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	\$83	\$75
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	\$29	\$47
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>	\$36	\$40
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup>	£2	£1
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	\$7	\$8
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	\$7	\$1
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	\$–	\$–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	\$7	\$4
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>	\$23	\$22
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	\$4	\$7
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund <sup>^</sup>	\$–	\$7
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	\$81	\$4

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	28. Februar 2022 (in Tsd.)	28. Februar 2021 (in Tsd.)
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	\$8	\$4
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	\$14	\$30
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund <sup>^</sup>	\$1	\$2
Legg Mason ClearBridge Value Fund	\$247	\$147
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	\$6	\$14
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	\$58	\$67
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	\$64	\$157
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	\$5	\$6
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund <sup>^</sup>	\$161	\$41
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	\$9	\$9
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup>	€546	€769
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup>	\$3	\$2
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup>	\$355	\$–
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	\$2.082	\$1.332
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	\$92	\$106
Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>	\$7	\$–
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund	€24	€34
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	\$26	\$105
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>^</sup>	\$–	\$13
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund	\$3	\$4
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	\$144	\$229
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>^</sup>	€–	€363
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	\$215	\$111
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	\$13	\$24
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	\$45	\$45
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>	€467	€198

Als „–“ bezeichnete Beträge betragen entweder 0 USD/0 EUR/0 GBP oder weniger als 1.000 USD/1.000 EUR/1.000 GBP.

#### Performance-Gebühr

Zusätzlich zu den oben beschriebenen Anlageverwaltungsgebühren kann der Anlageverwalter je nach Wertentwicklung der Anteile der PF-Klasse (Performance-Gebührenklassen, wie durch „(PF)“ im Namen der Anteilsklasse angegeben) Anspruch auf eine Vergütung haben (eine „Performancegebühr“).

#### Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> (Handel eingestellt am 1. Juni 2021)

Für den Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> wurde die Performancegebühr für jede PF-Anteilsklasse normalerweise für jeden Zeitraum von zwölf Monaten berechnet, der am letzten Handelstag eines jeden Geschäftsjahres endet (ein „Berechnungszeitraum“). Für jede PF-Anteilsklasse war der erste Berechnungszeitraum der Zeitraum, der an dem Geschäftstag beginnt, der unmittelbar auf den Handelstag folgt, an dem der Nettoinventarwert erstmals für die Anteilsklasse berechnet wurde (der „erste Handelstag“) und am letzten Handelstag des Geschäftsjahres endet, in dem der erste Handelstag stattfindet (der „erste Berechnungszeitraum“).

Für jeden Berechnungszeitraum für jeden Anteil der PF-Klasse hat der Anlageverwalter Anspruch auf eine Performancegebühr in Höhe von 20 % des Betrags, falls vorhanden, um den die Performance des Nettoinventarwerts pro Anteil während dieses Zeitraums die High Water Mark (wie unten definiert) zum Ende des vorherigen Berechnungszeitraums übersteigt. Bei ausschüttenden Anteilsklassen sollten zum Zwecke der Messung der Wertentwicklung des Nettoinventarwerts pro Anteil während eines Berechnungszeitraums alle Ausschüttungen, die während des Zeitraums gezahlt wurden, wieder zum Nettoinventarwert hinzugerechnet werden. Für jede PF-Anteilsklasse, sobald sie in Bezug auf einen Berechnungszeitraum zahlbar ist, sollte eine Performancegebühr nicht durch Verluste beeinflusst werden, die den Fonds oder der PF-Anteilsklasse in einem nachfolgenden Berechnungszeitraum entstehen. Jede Performancegebühr wurde an jedem Handelstag aufgelaufen und wäre normalerweise innerhalb von 21 Tagen nach Ende des relevanten Berechnungszeitraums nach Überprüfung durch die Verwahrstelle gezahlt worden. Wenn der Anlageverwaltungsvertrag vor dem letzten Handelstag eines Geschäftsjahres gekündigt wurde, wäre für jede PF-Anteilsklasse die Performancegebühr in Bezug auf den dannaktuellen Berechnungszeitraum berechnet und gezahlt worden, als ob das Datum der Kündigung das Ende des Berechnungszeitraums wäre. Für den Fall, dass ein Aktionär seine Anteile der PF-Klasse vor dem Ende eines Berechnungszeitraums zurücknehmen sollte, sollte jede aufgelaufene Performancegebühr, die seinen Anteilen zuzuschreiben ist, kristallisiert und an den Anlageverwalter gezahlt werden.

Die High Water Mark in Bezug auf jede PF-Anteilsklasse des Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> bedeutete den größeren Wert von: (i) der anfängliche Angebotspreis pro Aktie; (ii) den höchsten Nettoinventarwert je Aktie, der unmittelbar nach Ende eines früheren Berechnungszeitraums wirksam ist; und (iii) wenn die Anteilsklasse PF durch eine Fusion einer Anteilsklasse in einem anderen Fonds, der vom Unternlageverwalter verwaltet wird, aufgelegt wird, die Hochwassermark für diese Anteilsklasse am Tag der Fusion, wie sie gemäß dem entsprechenden Angebotsdokument für diesen anderen Fonds berechnet wird.

Der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> unterhielt keine Ausgleichskonten für Aktionäre in Bezug auf die Rückstellungen für Performancegebühren.

Die während der Geschäftsjahre zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 berechneten Performance-Gebühren werden in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen.

#### Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren

Die Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch fungiert als Verwahrstelle (die „Verwahrstelle“) und die BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company fungiert als Verwalter (die „Verwalter“) für alle 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 erfolgswirksam in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen Verwaltungsratsgebühren und Auslagen, die sich auf das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 beziehen, beliefen sich auf 140.000 USD (28. Februar 2021: 125.000 USD).

#### Vergütung der Wirtschaftsprüfer

Die an die Abschlussprüfer PricewaterhouseCoopers gezahlten Honorare in Höhe von 1.068.650 € (ohne MwSt.) beziehen sich auf die gesetzliche Prüfung des Jahresabschlusses der Gesellschaft (28. Februar 2021: 1.055.300 € (ohne MwSt.)). Die Gesamtprüfungsgebühr für die Gesellschaft, wie in der Gesamtergebnisrechnung auf Seite 246 angegeben, versteht sich inklusive Mehrwertsteuer in Höhe von 23 % und wird in der Darstellungswährung der Gesellschaft (US-Dollar) ausgewiesen.

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (28. Februar 2021: 11.735 € (ohne MwSt.)) wurden keine Auslagen an die Abschlussprüfer gezahlt.

#### 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	% Holding 28. Februar 2022 (in Tsd.)	% Holding 28. Februar 2021 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	73,47	77,14
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	26,73	–
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	97,13	96,24
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	22,36	23,79
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	25,50	28,33
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	66,96	23,58
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	24,70	23,69
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	22,32	21,82
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	31,62	77,39
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	73,89	86,50
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	–	20,55
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	39,26	52,54
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	32,01	–
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	61,17	49,06

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	% Holding 28. Februar 2022 (in Tsd.)	% Holding 28. Februar 2021 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>	84,13	87,33
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	44,11	27,37
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	24,98	24,88
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	21,74	22,42
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	32,51	61,68
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	39,07	41,30
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>	99,94	99,38
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup>	100,00	100,00
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	83,85	81,47
Western Asset UCITS SMA5h Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	94,78	99,46
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	65,44	–
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	23,00	–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>	72,28	96,87
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	96,77	94,82
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	50,15	33,16
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	20,52	22,32
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	44,84	60,86
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	24,50	–
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	39,63	24,89
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	24,02	23,41
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund <sup>^</sup>	99,02	99,87
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	79,63	58,94
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	20,36	39,84
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund <sup>^</sup>	94,31	100,00
Legg Mason ClearBridge Value Fund	–	27,98
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	32,50	30,41
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	28,47	–
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	20,79	–
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund <sup>^</sup>	37,18	40,37
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	48,76	71,47
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	23,67	–
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup>	97,91	97,98
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup>	75,35	–
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	38,93	45,77
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	–	21,88
Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>	100,00	–
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund	54,02	23,94
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	38,44	31,40
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>^</sup>	–	87,21
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund	–	45,20
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	50,58	91,41
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	35,12	39,78
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	59,03	57,81
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	21,24	20,76
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	36,19	50,43
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>	–	89,29

Als „–“ bezeichnete Beträge sind 0.

## 5. Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen

### Ausschüttende Anteilklassen

Der hinter dem Namen jeder ausschüttenden Anteilsklasse in Klammern angegebene Buchstabe gibt an, in welchen Abständen die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführten Dividenden erklärt und gezahlt werden.

Bezeichnung der ausschüttenden Anteilsklasse	Häufigkeit der Dividendenerklärungen	Häufigkeit der Dividendenzahlungen
(D)	Täglich	Monatlich
(M)	Monatlich	Monatlich
(Q)	Vierteljährlich	Vierteljährlich (März, Juni, September, Dezember)
(S)	Halbjährlich	Halbjährlich (März, September)
(A)	Jährlich	Jährlich (März)

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Rentenfonds (Festverzinsliche Fonds wie auf Seite 15 definiert) zum Zeitpunkt jeder Dividendenerklärung: (1) alle oder ein Teil der Nettoanlageerträge, falls vorhanden, werden als Dividende deklariert; und (2) alle oder ein Teil der realisierten und nicht realisierten Kapitalgewinne abzüglich realisierter und nicht realisierter Kapitalverluste können als Dividende deklariert werden, müssen aber nicht als Dividende deklariert werden.

Für jede ausschüttende Anteilsklasse eines jeden Aktienfonds (Aktienfonds wie auf Seite 15 definiert) wird zum Zeitpunkt jeder Dividendenerklärung der gesamte oder ein Teil des Nettoanlageertrags, falls vorhanden, als Dividende deklariert. 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 Multi-Asset-Fonds (Multi-Asset-Fonds wie auf Seite 15 definiert) werden zum Zeitpunkt jeder Dividendenerklärung alle oder Teile der Nettoanlageerträge, falls vorhanden, als Dividende deklariert. 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-Anteilklassen 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.

Während des Geschäftsjahres haben die folgenden Fonds Ausschüttungen aus Kapital auf ausschüttende Plus-Anteilklassen gezahlt:

	Ausschüttungen aus Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Ausschüttungen aus Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2021 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$313	\$324
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$60	\$108
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$7	\$4
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$1	\$–
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$9	\$6
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$25	\$31

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 5. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile – (Fortsetzung)

	Ausschüttungen aus Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Ausschüttungen aus Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2021 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$1	\$2
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$2	\$3
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$19	\$24
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A ZAR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$390	\$119
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$101	\$99
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$–	\$–
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$9	\$7
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$1	\$1
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$–	\$1
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$164	\$106
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$138	\$211
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$65	\$133
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$1.045	\$1.391
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$463	\$679
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$276	\$421
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$284	\$407
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$58	\$66
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	\$26	\$26
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$20	\$22
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup> – Klasse D USD ausschüttend (M) Plus	\$76	\$141
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup> – Klasse D AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$–	\$1
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$10	\$16
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$–	\$–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$1	\$5
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund <sup>^</sup> – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$473	\$2
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund <sup>^</sup> – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$719	\$74
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund <sup>^</sup> – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	\$52	\$–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund <sup>^</sup> – Klasse A CNH ausschüttend (monatlich) abgesichert plus	\$42	\$–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund <sup>^</sup> – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$132	\$–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund <sup>^</sup> – Ausschüttende GBP Klasse A (M) (abgesichert) Plus	\$21	\$–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund <sup>^</sup> – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$18	\$–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund <sup>^</sup> – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$26	\$–
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$62	\$84
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$31	\$44
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$6	\$4
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$19	\$28
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$5	\$7
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> – Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	€1.311	€1.377
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	€327	€145
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	€93	€22
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> – Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus	€57	€46
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	€86	€32
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup> – Premier-Klasse, ausschüttende USD (M) Plus	\$19	\$–
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup> – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$406	\$–
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup> – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$73	\$–
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup> – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$6	\$–
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup> – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$60	\$–
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup> – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$1	\$–
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup> – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$31	\$–
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup> – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$446	\$–
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup> – Ausschüttende Klasse S USD (M) Plus	\$11	\$–
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	€94	€116
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	€29	€47
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	€5	€3
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus	€5	€5
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	€4	€5
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$50	\$111
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$28	\$65
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$8	\$8
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$30	\$39
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$1	\$1
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$14	\$23
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$15	\$20
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$8	\$30
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$2	\$1
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$–	\$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$5	\$8
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	\$1	\$1
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$–	\$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$–	\$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse D USD ausschüttend (M) Plus	\$10	\$5
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse D HKD ausschüttend (M) Plus	\$–	\$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse D CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$–	\$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse D AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$3	\$4
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse D SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$8	\$10

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 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 Dividendenauszahlung 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.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 5. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile – (Fortsetzung)

Während des Geschäftsjahres haben die folgenden Fonds Gebühren und Aufwendungen für das Kapital auf ausschüttende Plus (e) Anteilsklassen berechnet:

	Gebühren und Aufwendungen , die dem Kapital für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2022 (in Tsd.)	28. Februar 2021 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$4	\$5
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$1	\$1
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Premier Class, ausschüttende USD (M) Plus (e)	\$–	\$1
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Ausschüttende Klasse S USD (M) Plus (e)	\$42	\$62
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$13	\$11
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$953	\$922
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Ausschüttende AUD-Klasse S (M) (abgesichert) Plus (e)	\$–	\$4
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$4.797	\$5.051
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$644	\$800
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$92	\$79
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$304	\$448
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A JPY ausschüttend (M) Plus (e)	\$3	\$3
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$910	\$1.138
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus (e)	\$–	\$–
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$195	\$301
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus (e)	\$–	\$–
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$594	\$534
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$100	\$105
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$2.586	\$3.501
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$1	\$–
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$5	\$6
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$80	\$59
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$–	\$–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$554	\$230
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$105	\$13
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$41	\$–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$2.012	\$160
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$183	\$43
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$64	\$7
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$124	\$41
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – LM Klasse Euro ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	\$9	\$–
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Class Euro Distributing (M) (abgesichert) Plus (e)	\$154	\$15
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Ausschüttende Premier-Klasse GBP (M) (abgesichert) Plus (e)	\$9	\$1
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Class, ausschüttende USD (M) Plus (e)	\$83	\$12
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$32	\$29
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Ausschüttende Klasse S GBP (M) (abgesichert) Plus (e)	\$8	\$8
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Klasse USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	\$–	\$–
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ – Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$–	\$–
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$2	\$2
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$6	\$5
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$–	\$1
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$–	\$–
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Premier Class GBP ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	€173	€535
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Ausschüttende Premier Class CAD (Q) Plus (e)	€59	€62
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Ausschüttende Premier Class CAD (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	€400	€250
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund^ – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$802	\$–
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund^ – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$12	\$–
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund^ – Klasse X Euro ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	\$11	\$–
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund^ – Klasse X GBP ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	\$–	\$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$107	\$51
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus (e)	\$9	\$9
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Ausschüttende Klasse S GBP (M) Plus (e)	\$2	\$3

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.

## 6. Aktienkapital und Redeemable gewinnberechtigte

### Aktien Aktienkapital

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.

### Rückkaufbarer und gewinnberechtigter Anteile

Das Grundkapital der Gesellschaft entspricht zu jeder Zeit dem Nettoinventarwert. Die Mitglieder des Verwaltungsrats sind ermächtigt, bis zu 500 Milliarden Anteile der Gesellschaft ohne Nennwert zum Nettoinventarwert je Anteil und zu den ihnen angemessen erscheinenden Bedingungen auszugeben. Bei der Emission von Anteilen an der Gesellschaft besteht kein Vorkaufsrecht.

Jeder Anteil berechtigt den Anteilsinhaber dazu, gleichberechtigt auf 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 Anteilsinhaber seine Anteile kaufte.

Der Erlös aus der Ausgabe von Anteilen wird in den Büchern der Gesellschaft dem betreffenden Fonds zugeschrieben und im Namen des Fonds zum Erwerb von Vermögenswerten verwendet, in die der Fonds investieren kann. Die Unterlagen und Bücher der einzelnen Fonds werden getrennt geführt.

Jeder Fonds bietet unterschiedliche Anteilsklassen an. Diese sind im Verkaufsprospekt der Gesellschaft angegeben. Die verschiedenen Anteilsklassen unterscheiden sich hauptsächlich durch ihre Ausgabeaufschläge, Kosten, Gebührensätze, Ausschüttungspolitik und 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.

Anteilsklassen werden in ausschüttend und thesaurierend unterschieden. Die thesaurierenden Anteilsklassen verteilen keinen Nettoertrag, realisierte Netto- oder nicht realisierte Nettokapitalgewinne, während die ausschüttenden Anteilsklassen in bestimmten Abständen ausschütten, die je nach dem Buchstaben in Klammern am Ende des Namens der ausschüttenden Anteilsklasse variieren, wie unter Anmerkung 5 Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer gewinnberechtigter Anteile erläutert. 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 Anlagemanager oder Submanager 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.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 6. Aktienkapital und gewinnberechtignte Aktien – (Fortsetzung)

Anteile der Klasse A sind allen Investoren 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 Investoren 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 Investoren, die eine Vereinbarung mit einem Vertriebshändler haben, in Bezug auf solche Aktien erfolgen. Anteile der Klasse F stehen professionellen Investoren und Investoren mit einer diskretionellen Anlagevereinbarung mit einem Händler zur Verfügung, der vom Vertriebshändler im Hinblick auf diese Aktien beauftragt wurde. Provisions-/Rabattzahlungen können durch Vertriebsstellen an Händler oder andere Investoren geleistet werden, die eine Vereinbarung mit dem Vertriebshändler in Bezug auf solche Aktien haben. 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 im Hinblick auf diese Aktien beauftragten Stelle verfügbar. Anteile der Klasse R stehen allen Anlegern zur Verfügung, die eine gebührenbasierte Vereinbarung mit einem Vermittler haben, von dem sie eine persönliche Empfehlung in Bezug auf ihre Anlage in den Fonds erhalten haben. Anteile der Klasse X stehen Händlern, Portfoliomanagern oder Plattformen zur Verfügung, die gemäß den regulatorischen Anforderungen oder auf der Grundlage von Gebührenvereinbarungen mit ihren Kunden keine Trail-Provisionen akzeptieren und behalten dürfen; und institutionellen Anlegern (für Anleger in der Europäischen Union bedeutet dies „berechtigte Counterparties“ im Sinne von MIFID II), die auf eigene Rechnung investieren. Anteile der Klassen U, Y und S sind im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für institutionelle Investoren verfügbar. BW LM-Anteilsklassen sind nach Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für qualifizierte Anleger verfügbar, die Mitglieder der Franklin Templeton-Gruppe oder Kunden solcher Mitglieder sind. LM-Anteilsklassen sind nach Ermessen der Direktoren oder Vertriebshändler für qualifizierte Anleger, die Mitglieder der Franklin Templeton-Gruppe sind, für Altersvorsorgeprogramme und ähnliche Programme verfügbar, die von Mitgliedern der Franklin Templeton-Gruppe oder Kunden solcher Mitglieder gesponsert werden. Für Anleger mit Sitz in der Europäischen Union stehen BW Premier-Anteilsklassen nach Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebshändler „berechtigten Gegenparteien“ gemäß Definition in MIFID II zur Verfügung; für Anleger mit Sitz außerhalb der Europäischen Union stehen BW Premier-Anteilsklassen institutionellen Anlegern nach Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebshändler oder qualifizierten Anlegern zur Verfügung, die Mitglieder der Franklin Templeton-Gruppe oder Kunden solcher Mitglieder sind. Für Anleger, die in der Europäischen Union ansässig sind, stehen die Premier Share Klassen 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 Währungsdenomination das Wort „(abgesichert)“ enthalten ist, ist beabsichtigt, dass solche Anteilsklassen gegen Bewegungen 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. Die von Brandywine Global Investment Management, LLC verwalteten Fonds und der von ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited verwaltete Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund bieten Portfolio-gesicherte Anteilsklassen, was durch die Aufnahme eines „(PH)“ in den Namen der Anteilsklasse angezeigt wird. Der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> (mit Handelsende am 1. Juni 2021) bot Anteilsklassen an, die möglicherweise eine Performancegebühr gezahlt haben, wie durch „(PF)“ im Namen der Anteilsklasse angegeben.

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.

## 7. Besteuerung

Gemäß aktuellem Recht und aktueller Praxis in Irland erfüllt die Gesellschaft die Voraussetzungen für einen Investmentfonds gemäß Section 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 zu steuernden Ereignisses in Bezug auf Folgendes nicht steuerpflichtig:

- (i) ein Aktionär, der zum Zeitpunkt des steuerpflichtigen Ereignisses weder in Irland ansässig noch gewöhnlich in Irland ansässig ist, sofern eine angemessene gültige Erklärung vorliegt oder die Gesellschaft von Irish Revenue ermächtigt wurde, Bruttozahlungen zu leisten, wenn keine entsprechenden Erklärungen vorliegen; und
- (ii) bestimmte steuerbefreite in Irland ansässige Aktionäre, die der Gesellschaft die erforderlichen unterzeichneten gesetzlichen Erklärungen abgegeben haben.

Darüber hinaus stellt jede Transaktion (die ansonsten ein steuerpflichtiges Ereignis sein könnte) in Bezug auf Aktien, die in einem anerkannten Clearingsystem gehalten werden, wie durch die Anordnung der Irish Revenue Commissioners bestimmt, kein steuerpflichtiges Ereignis dar.

Sofern keine entsprechende Erklärung vorliegt, ist die Gesellschaft bei Eintreten eines Steuertatbestandes 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.

## 8. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente und Margenkonten

Barmittel und andere liquide Mittel werden zum Nennwert und gegebenenfalls unter Berücksichtigung aufgelaufener Zinsen bewertet. Die Barmittel und Barmitteläquivalente sowie die Barüberziehungssalden eines Fonds werden bei der Verwahrstelle gehalten. Der Posten „Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung“ weist in der Darstellung der Vermögenslage Einschusszahlungen, Barsicherheiten und realisierte Gewinne und Verluste aus Terminkontrakten aus, die noch nicht geliefert wurden. Margineinlagen und Barsicherheiten, die in Bezug auf OTCs und börsengehandelte Derivate gehalten werden, werden zum 28. Februar 2022 bei den folgenden Brokern gehalten: Bank of America Merrill Lynch, Barclays, BNY Mellon, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley und UBS (28. Februar 2021: Bank of America Merrill Lynch, Barclays, BNP Paribas, BNY Mellon, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley und UBS).

## 9. Verpflichtungen und Eventualverbindlichkeiten

Zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 bestanden keine wesentlichen Verpflichtungen oder Eventualverbindlichkeiten.

## 10. Soft Commission-Vereinbarungen

Die Gesellschaft verfügt über Richtlinien, die sicherstellen sollen, dass ihre Dienstleister im besten Interesse der Fonds handeln, wenn sie Entscheidungen treffen, im Namen dieser Fonds im Kontext der Portfolios der Fonds zu handeln. 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. Der Compübertnimmt keine Kosten für externes Research, das von den Anlageverwaltern und den Unteranlageverwaltern erhalten wird. Derartige Kosten werden vom entsprechenden Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter getragen. Informationen zu den Richtlinien für Auftragsausführungen der Fonds sind für Anteilsinhaber auf Anfrage kostenlos erhältlich.

Während der Geschäftsjahre zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 schloss Royce & Associates, LP („Royce“) Soft-Commission-Vereinbarungen mit Maklern ab, erstattete den entsprechenden Fonds jedoch alle Forschungskosten, die im Rahmen dieser Vereinbarungen entstanden sind.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 11. Wechselkurse

Die folgenden Wechselkurse wurden in diesem Jahresabschluss verwendet, um die entsprechenden Beträge in US-Dollar, Euro und britischen Pfund für die jeweiligen Fonds mit auf US-Dollar, Euro und britischen Pfund basierenden Währungen zu erhalten:

	Währung	Wechselkurse zum 28. Februar 2022	Wechselkurse zum 28. Februar 2021
<b>Auf USD lautende Fonds</b>	Argentinischer Peso	208,2521*	148,7469
	Australischer Dollar	1,3768	1,2996
	Brasilianischer Real	5,1517	5,6042
	Britisches Pfund	0,7454	0,7178
	Kanadischer Dollar	1,2675	1,2726
	Chilenischer Peso	799,2000	723,8900
	Chinesischer Renminbi (CNH)	6,3168	6,4855
	Chinesischer Renminbi (CNY)	6,3111	6,4600
	Kolumbianischer Peso	3.937,0050	3.647,0000
	Tschechische Krone	22,4397	21,6908
	Dänische Krone	6,6330	6,1632
	Ägyptisches Pfund	15,7100	15,7000
	Euro	0,8919	0,8288
	Hongkong-Dollar	7,8146	7,7565
	Ungarischer Forint	331,7191	300,4559
	Indische Rupie	75,3475	73,4850
	Indonesische Rupiah	14.367,0000	14.240,0000
	Israelischer Schekel	3,2108	3,3101
	Japanischer Yen	114,9650	106,5950
	Malaysischer Ringgit	4,1985	4,0475
	Mexikanischer Peso	20,4810	20,9210
	Neuseeländischer Dollar	1,4780	1,3840
	Norwegische Krone	8,8158	8,6706
	Pakistanische Rupie	177,3500	158,1000
	Philippinischer Peso	51,2700	48,5200
	Polnischer Zloty	4,1980	3,7475
	Katarischer Rial	–	3,6418
	Russischer Rubel	107,9975	74,5413
	Saudi-Rial	3,7517	–
	Singapur-Dollar	1,3557	1,3334
	Südafrikanischer Rand	15,3763	15,1313
	Südkoreanischer Won	1.202,3500	1.123,5000
	Schwedische Krone	9,4722	8,4439
	Schweizer Franke	0,9171	0,9097
	Taiwan-Dollar	28,0350	27,8525
	Thailändischer Baht	32,6750	30,1350
	Türkische Lira	13,8403	7,4268
	Vereinigte Arab. Emirate Dirham	–	3,6732
		<b>Wechselkurse zum 28. Februar 2022</b>	<b>Wechselkurse zum 28. Februar 2021</b>
	<b>Auf EUR lautende Fonds</b>	Australischer Dollar	1,5438
Brasilianischer Real		–	6,7618
Britisches Pfund		0,8358	0,8660
Kanadischer Dollar		1,4212	1,5355
Tschechische Krone		25,1605	26,1710
Dänische Krone		7,4373	7,4362
Ungarischer Forint		–	362,5152
Japanischer Yen		128,9045	128,6123
Norwegische Krone		9,8847	10,4615
Polnischer Zloty		4,7070	4,5215
Russischer Rubel		121,0922	–
Südafrikanischer Rand		17,2406	18,2566
Schwedische Krone		10,6207	10,1880
Schweizer Franke		1,0283	1,0975
Türkische Lira		15,5184	8,9608
US-Dollar	1,1213	1,2066	
	<b>Wechselkurse zum 28. Februar 2022</b>	<b>Wechselkurse zum 28. Februar 2021</b>	
<b>Auf GBP lautende Fonds</b>	Australischer Dollar	1,8470	–
	Euro	1,1964	1,1547
	US-Dollar	1,3415	1,3932

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

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement

Nach seiner Ernennung zur OGAW-Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft mit Verantwortung für die Führung der Gesellschaft und für bestimmtes Investmentmanagement, Verwaltungs- und Vertriebsfunktionen in Bezug auf die Gesellschaft, wie in den OGAW-Verordnungen dargelegt, FTIS (der „Manager“) hat die Entscheidung getroffen, einige, aber nicht alle Anlageverwaltungsaktivitäten an relevante Anlageverwalter und/oder Untereinlageverwalter, vorausgesetzt, dass der Fondsmanager gegenüber den Fonds für die Erfüllung seiner vereinbarten Verpflichtungen verantwortlich bleibt (siehe die Seiten mit den allgemeinen Informationen für die einzelnen Fondsmanager und Unterfondsmanager, ggf. gemäß Prospekt).

Gemeinsam mit dem Verwalter und den Anlagemanagern hat die Gesellschaft das Marktrisiko, das Kreditrisiko und das Liquiditätsrisiko als für sie wesentliche Risiken definiert. Die Risiken bei der Verwendung von Finanzderivaten bestehen im Kontrahentenrisiko, im Kreditrisiko, in erhöhten Einschussforderungen und im unbegrenzten Verlustrisiko. Nähere Einzelheiten zu diesen und anderen Risiken sind weiter unten aufgeführt und können dem Abschnitt „Risikofaktoren“ im Verkaufsprospekt entnommen werden.

Das Marktrisiko beinhaltet das Marktpreis-, das Fremdwährungs- und das Zinsrisiko sowie andere Preisrisiken.

Das Marktpreisrisiko bezeichnet das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert oder künftige Kapitalströme eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Kurse am Markt schwanken werden. Das maximale Preisrisiko, das sich aus dem Eigentum an Finanzinstrumenten ergibt, bestimmt sich aus dem beizulegenden Zeitwert der Finanzinstrumente. Die Untereinlageverwalter können das mit bestimmten Ländern, Branchen oder Wertpapieren verbundene Risiko über die Vermögensaufteilung der Portfolios steuern. Dabei sind jedoch die im Bericht des Verwaltungsrats genannten Anlageziele jedes Fonds zu beachten. Der Untereinlageverwalter/-berater steuert das Risiko, indem er Wertpapiere und andere Finanzinstrumente innerhalb bestimmter Anlagegrenzen und entsprechend der Mandate sorgfältig auswählt. Nähere Angaben zur Anlagepolitik der einzelnen Fonds entnehmen Sie bitte dem Bericht des Verwaltungsrats. Einzelheiten zu den finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten der einzelnen Fonds sind in der Bilanz dargestellt.

Das Fremdwährungsrisiko bezeichnet das Risiko, dass der Wert eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen des Wechselkurses zwischen der Währung, auf die der finanzielle Vermögenswert oder die finanzielle Verbindlichkeit lautet, und der Leitwährung des Fonds schwanken wird. Der Wert der auf eine andere Währung als die Leitwährung lautenden Anlagen eines Fonds kann aufgrund von Wechselkursschwankungen bei den maßgeblichen Währungen steigen oder fallen. Größere Wechselkursschwankungen können sich durchaus erheblich auf die Wertentwicklung der Fonds auswirken.

Wenn ein Fonds Anlagen in einer anderen Währung als der funktionalen Währung des Fonds hält, kann der jeweilige Anlageverwalter oder Untereinlageverwalter das Fremdwährungsrisiko verwalten, indem er entweder Fremdwährungen in die funktionale Währung des Fonds absichert oder alternativ Anlagen über mehrere Währungen hinweg unter Verwendung eines MultiBank-Devisenhandelsnetzwerks diversifiziert.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

Das Zinsrisiko bezeichnet das Risiko, dass der Wert eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Marktzinsen schwanken wird. Die Fonds, die festverzinsliche Schuldverschreibungen und Überziehungpositionen halten, sind einem Zinsrisiko ausgesetzt, wenn der Wert dieser Wertpapiere oder Darlehen infolge einer Zinsänderung schwanken kann. Beteiligungen an variabel verzinslichen Wertpapieren können ebenfalls einem Zinsrisiko unterliegen, wenngleich in geringerem Umfang. Von der Verwahrstelle verwaltete Barmittel haben das Potenzial, Zinseinnahmen zu generieren, deren Höhe je nach den aktuellen Marktzinsen schwankt.

Die Aktienfonds legen generell nicht in zinstragenden Wertpapieren an. Ausgenommen hiervon sind die von der Verwahrstelle gehaltenen Barbestände. Barmittel generieren Zinseinnahmen, deren Höhe je nach den aktuellen Marktzinsen schwankt. Folglich ist für Aktienfonds das Risiko aufgrund von Schwankungen der aktuellen Marktzinsen für die finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds unbedeutend.

Die Fixed Income Funds und die Multi-Asset Funds investieren in verzinsliche finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten, die sie Risiken aussetzen, die mit den Auswirkungen von Schwankungen der vorherrschenden Marktzinssätze auf ihre Finanzpositionen und Cashflows verbunden sind. Der Wert von Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren kann aufgrund von Zinsänderungen preisschwankend sein. Schwankungen der Marktzinsen wirken sich auf die Höhe der Zinseinnahmen eines Fonds aus.

Bei steigenden Zinsen verringert sich im Allgemeinen der Wert von emittierten und im Umlauf befindlichen Schuldtiteln, während bei sinkenden Zinsen der Wert von emittierten und im Umlauf befindlichen Schuldtiteln in der Regel steigt. Die Spanne dieser Kursschwankungen ist umso größer, je länger die Restlaufzeit der im Umlauf befindlichen Wertpapiere ist. Ändert sich der Wert der von einem Fonds gehaltenen Wertpapiere bei Zinsänderungen, bedeutet dies, dass der Nettoinventarwert je Anteil aufgrund der Auswirkung auf den Wert des aus Schuldtiteln bestehenden Fondsportfolios sinken oder steigen kann.

Der zuständige Unteranlageverwalter jedes Rentenfonds überwacht das Zinsumfeld und beurteilt die Risiken für die wichtigsten Strategien. Das Zinsrisiko wird durch Überwachung der Laufzeiten und Dauer im Vergleich zu den Benchmarks der Fonds gesteuert. Techniken wie die Messung der Key Rate Duration werden verwendet, um die Portfoliokurve exposures zu bewerten.

Einzelheiten zur gewichteten durchschnittlichen Rendite jedes Rentenfonds, zu den gewichteten durchschnittlichen Jahren bis zur Fälligkeit und eine Analyse von festverzinslichen und nicht verzinslichen Wertpapieren sind in den Anmerkungen 12.1(b) und 12.1(c) unten aufgeführt.

Anlagen in Aktienfonds sind unter anderem mit dem Risiko von Veränderungen des konjunkturellen Umfelds, der Lage einzelner Branchen und Unternehmen sowie dem Risiko der Titelauswahl verbunden. Rentenfonds und Mischfonds unterliegen darüber hinaus dem Zins-, Kredit-, Laufzeiten- und Marktrisiko. Internationale Aktien unterliegen veränderlichen Wechselkursen, dem Risiko einer verringerten Liquidität der Märkte und, je nach Land, dem Risiko politischer und wirtschaftlicher Unsicherheit. Die Märkte der Entwicklungsländer sind den gleichen Risiken ausgesetzt, wenn auch mitunter in stärkerem Maße. Zum Zweck der effizienten Portfolioverwaltung können die Fondsbörsengehandelte oder außerbörsliche („OTC“) Derivate, einschließlich, aber nicht beschränkt auf Futures, Swaps, Termingeschäfte, Optionen und Optionsscheine, abschließen und können Aktienkreditvereinbarungen abschließen.

Das Investment Management and Portfolio Oversight Committee („IMPOC“ oder das „Committee“) wurde innerhalb von Franklin Templeton eingerichtet, um die Delegation der Verantwortlichkeiten des Investmentmanagements für alle Fonds zu überwachen. Der Ausschuss besteht aus Mitgliedern, die als Gruppe Erfahrung und spezialisierte Kenntnisse in Bereichen wie Investment management, einschließlich Aktien, festverzinsliche Wertpapiere und Derivate, Investmentanalyse und -berichterstattung, Risikomanagement und Compliance haben. Der Ausschuss ist im Namen des Anlageverwalters dafür verantwortlich, zu überwachen, dass die Fonds in Übereinstimmung mit den im Verkaufsprospekt und den OGAW-Verordnungen enthaltenen Bestimmungen zu Anlagerichtlinien und -beschränkungen für die Fonds sowie gemäß den internen Anlagerichtlinien und -beschränkungen des Anlagemanagers oder Unteranlageverwalters verwaltet werden. Im Allgemeinen kommt der Ausschuss einmal monatlich zusammen, um zu überwachen, dass die Fonds in Übereinstimmung mit diesen Beschränkungen und Vorschriften verwaltet werden. Die Unteranlageverwalter melden dem Ausschuss sämtliche Angelegenheiten, die im Rahmen der Überwachung bestimmter wesentlicher Risiken auffallen und die auf die im Fonds enthaltenen Anlagen in Finanzinstrumenten zurückzuführen sind.

### 12.1 Marktrisiko

Jeder Fonds, der Finanzderivate einsetzt, ist bestrebt, das Marktrisiko und die durch den Einsatz von Derivaten erzeugte Hebelung zu begrenzen, indem entweder der Commitment-Ansatz oder eine als „Value-at-Risk“ bezeichnete Risikomessungstechnik (der „VaR-Ansatz“) angewendet wird<sup>1</sup>). Jeder Fonds, der FDI verwendet (außer Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>, Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund, Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>, Der Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup> und der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup>) (mit Einstellung des Handels am 1. Juni 2021) verwenden den Commitment-Ansatz. Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>, Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund, Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup> und Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> (Handel eingestellt am 1. Juni 2021) verwenden oder haben verwendet, entsprechend, den VaR-Ansatz.

Die jeweiligen Anlagemanager oder Unteranlageverwalter derjenigen Fonds, die Derivate einsetzen, verwenden einen Risikomanagementprozess, um die mit Positionen in Finanzderivaten verbundenen Risiken überwachen, messen und steuern zu können;

Der Commitment-Ansatz berechnet die Hebelung, indem der Marktwert der zugrunde liegenden Derivatebestände im Verhältnis zum Nettoinventarwert des jeweiligen Fonds gemessen wird. VaR ist eine statistische Methode, die anhand historischer Daten den wahrscheinlichen maximalen Verlust vorhersagen soll, den ein Fonds erleiden könnte, berechnet auf ein spezifisches (z. B. „einseitiges“ 99-prozentiges) Konfidenzniveau. Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>, Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund, Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup> und Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> (Handel eingestellt am 1. Juni 2021) verwenden oder verwendet haben, entsprechend, ein „absolutes“ VaR-Modell, bei dem die Messung des VaR relativ zum Nettoinventarwert des Fonds erfolgt. Ein VaR-Modell unterliegt naturgemäß bestimmten Einschränkungen und ist daher keine Garantie für irgendeine bestimmte Begrenzung der Höhe oder Häufigkeit der Verluste in Zukunft möglicherweise entstehenden Verluste. Da sich das VaR-Modell auf historische Marktdaten als wesentliche Berechnungsgrundlage stützt, kann die Effektivität des VaR-Modells zur Vorhersage des VaR eines Fonds erheblich beeinträchtigt sein, wenn die aktuellen Marktbedingungen von den Marktbedingungen während der historischen Beobachtungsperiode abweichen. Unter außergewöhnlichen Marktbedingungen können den Anlegern erhebliche finanzielle Verluste entstehen.

Die Effektivität des VaR-Modells könnte auf ähnliche Weise beeinträchtigt sein, wenn sich die im VaR-Modell enthaltenen Annahmen oder Komponenten als ungeeignet oder unrichtig erweisen.

Western Asset Management Company Limited und Western Asset Management Company, LLC („Western Asset“) berechnen VaR mit einer entsprechenden Stichprobe von historischen Daten für einen Tag nach einem Tag mit einem Konfidenzniveau von 99 %. Die nachstehende Tabelle enthält den absoluten VaR für die Fonds:

Fonds	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	2,66 %	1,76 %
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	1,02 %	0,96 %
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	0,51 %	1,39 %
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	1,65 %	2,20 %

Brandywine Global Investment Management, LLC („Brandywine“) berechnet den VaR mit einem Konfidenzniveau von 95 % für einen Zeithorizont von 1 Tag unter Verwendung historischer Daten über 2 Jahre. Die nachstehende Tabelle enthält den absoluten VaR für die Fonds:

Fonds	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>	0,50 %	1,59 %
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund <sup>^</sup>	0,52 %	1,75 %
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	0,53 %	2,60 %
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	1,22 %	2,58 %

Wo der Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>, Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund, Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup> und Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup> verwenden ein absolutes VaR-Modell, gemäß den Anforderungen der Zentralbank unterliegt jeder dieser Fonds einer absoluten VaR-Grenze von 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds. Gelegentlich kann jeder dieser Fonds jedoch innerhalb einer 20-tägigen Haltefrist eine Änderung des Nettoinventarwerts von mehr als 20 Prozent des Nettoinventarwerts erfahren.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

Zusätzlich zum VaR-Ansatz die jeweiligen Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter des Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>, Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund, Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>, Der Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup> und der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> (mit Stand vom 1. Juni 2021) überwachen oder überwachen, ggf. die Verschuldungsgrade täglich, um Veränderungen aufgrund von Marktbewegungen zu überwachen. Darüber hinaus führen die jeweiligen Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter jedes dieser Fonds pretrade-Tests durch, um die Auswirkungen des Handels auf die Gesamtverschuldung des betreffenden Fonds zu berücksichtigen und die Risiko-/Ertragsstufen des Handels zu berücksichtigen.

Die niedrigsten, durchschnittlichen und höchsten Nutzungen der VaR-Grenze bei einem Konfidenzniveau von 99 % über einen Horizont von 20 Tagen für die entsprechenden Western Asset- und Brandywine-Fonds sahen wie folgt aus:

#### Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022

Fonds	Minimum	Average	Maximale
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	4,70 %	5,82 %	11,90 %
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	2,42 %	2,86 %	4,88 %
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	2,26 %	2,47 %	2,59 %
Western Asset SMASH Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	3,12 %	5,10 %	10,04 %
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>	1,92 %	2,61 %	3,61 %
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund <sup>^</sup>	2,76 %	3,31 %	4,51 %
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	2,43 %	3,81 %	4,75 %
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	6,27 %	7,40 %	8,70 %

#### Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022

Fonds	Minimum	Average	Maximale
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	5,75 %	11,77 %	24,47 %
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	4,11 %	8,91 %	22,13 %
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	1,21 %	8,41 %	17,90 %
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	3,82 %	4,24 %	10,08 %
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>	4,73 %	11,07 %	13,83 %
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	4,64 %	12,00 %	15,35 %
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	7,36 %	12,54 %	16,55 %
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	12,12 %	15,80 %	18,59 %

Gemäß den Anforderungen der Zentralbank hat Martin Currie Investment Management Limited den VaR auf der Grundlage einer Haltedauer von 10 Geschäftstagen und eines „onetailed“-Konfidenzintervalls von 95 % berechnet. Der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> (mit Handelsende am 1. Juni 2021) unterliegt einem absoluten VaR-Limit von 8,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds. Die niedrigsten, durchschnittlichen und höchsten VaR-Niveaus waren wie folgt:

#### Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022

Fonds	Minimum	Average	Maximale
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>^*</sup>	0,00 %	4,14 %	6,16 %

β bis zu dem Zeitpunkt, an dem es den Handel am 1. Juni 2021 eingestellt hat.

#### Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022

Fonds	Minimum	Average	Maximale
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>^</sup>	1,85 %	4,47 %	9,87 %

Für Fonds, die den VaR-Ansatz benutzen, wird die Hebelung als die Summe der Nennwerte der verwendeten Derivate berechnet.

Die durchschnittliche Hebelung sah wie folgt aus:

Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2021
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	1.175,10 %	752,50 %
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	113,25 %	107,40 %
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	31,96 %	29,20 %
Western Asset SMASH Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	389,53%	275 %*
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>	277,27 %	125,20%
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund <sup>^</sup>	98,08 %	70,86 %
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	67,54 %	57,35 %
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	267,56 %	105,83 %
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>^</sup>	88,25 %**	108,12 %

\* Seit dem 11. Januar 2021, dem Datum der Auflegung des Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup>, bis zum Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022.

\*\* Der Betrag für den Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> gilt für den Zeitraum vom 1. März 2021 bis zu dem Zeitpunkt, an dem er den Handel am 1. Juni 2021 eingestellt hat.

Bei Stresstests werden die potenziellen Auswirkungen bestimmter Änderungen der Risikofaktoren in Bezug auf außergewöhnliche Ereignisse, die jedoch möglich sind, auf die finanzielle Lage eines Fonds geprüft. Der Anlageverwalter verfolgt einen konservativen Ansatz, indem er Stresstests verwendet, die außerhalb der Palette relativ wahrscheinlicher Ereignisse liegen. Western Asset erwartet (obwohl es keine Zusage gibt), dass, wenn der Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund in der Lage ist, Stresstests zu widerstehen, die über den Bereich der vernünftigerweise wahrscheinlichen Ereignisse hinausgehen, der Nettoinventarwert je Aktie (oder eine bestimmte Anteilsklasse) dieses Fonds im Falle angemessener negativer Marktereignisse stabil bleiben würde.

Ein szenariobasierter Stresstest kann verwendet werden, um die Sensitivitätsanalyseanforderung von FRS 102 zu erfüllen. FRS 102 schreibt für Sensitivitätsanalysen keine bestimmte Basispunktänderung oder prozentuale Änderung vor. Dementsprechend werden für die Zwecke dieses Jahresberichts die Währungsauswirkungen auf den Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund einer sofortigen Erhöhung der kurzfristigen Zinssätze um 25 Basispunkte dargestellt:

Stand: 28. Februar 2022	Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund
Stand: 28. Februar 2021	(\$206.914)
	(\$264.893)

#### (a) Marktpreisrisiko

Das Marktpreisrisiko jedes Fonds in Bezug auf einen Index wird überwacht, jedoch nicht gemanagt. Die Indizes zum 28. Februar 2022 und zum 28. Februar 2021 sind nachfolgend aufgeführt.

In den folgenden Tabellen ist der Index für jeden Fonds aufgeführt, mit Ausnahme des Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>, Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund, Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup> und Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> (Handel eingestellt am 1. Juni 2021); und die wahrscheinlichen Auswirkungen auf den Wert des Nettoinventarwerts für jeden Fonds basierend auf positiven und negativen Bewegungen im Index zu quantifizieren, einschließlich eines Jahres Beta für jeden Fonds. Das Beta misst die Volatilität der Beteiligungen eines Fonds im Vergleich zum Markt oder Index. Während Beta eine klare, quantifizierbare Messgröße bietet, enthält es keine neuen Informationen, und vergangene Preisbewegungen sind keine genauen Prädiktoren für die Zukunft.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (a) Marktpreisrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022

Fonds	Index	Währung	Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Indexbewegungen (in Tsd.)	
			Positiv 5 %*	Negativ 5 %*
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	FTSE Treasury Bill 1-Monat (USD)	USD	13.793	(13.793)
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	13.835	(13.835)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	94.029	(94.029)
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	FTSE Euro Broad Investment-Grade Bond Index	EUR	5.630	(5.630)
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	Bloomberg U.S. High Yield 1-5 Jahre Cash Pay 2% Constrained Index	USD	2.599	(2.599)
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	ICE BofA US-Dollar 3-Month Einzahlungsangebot Preiskonstantev Fälligkeit	USD	1.197.902	(1.197.902)
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	Bloomberg U.S. Corporate High Yield Bond Index 2 % Emittent gedeckelt	USD	12.765	(12.765)
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund**	JP Morgan EMBI Global Index	USD	1.359	(1.359)
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index – Broad Composite	USD	1.622	(1.622)
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	Bloomberg Global High Yield Index – Währungsabgesicherte Währung (USD)	USD	4.327	(4.327)
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	Bloomberg Global Inflation-Linked 1-10 Year Hedged (USD)	USD	1.922	(1.922)
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Markit iBoxx Asian Local Bond Index	USD	22.884	(22.884)
Legg Mason Western Asset Blue Chip Bond Fund mit kurzer Duration**	ICE BofA U.S. Treasury 1-10 Jahre Index	USD	14.249	(14.249)
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Bloomberg Global Aggregate Index Currency Hedged (USD)	USD	9.738	(9.738)
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	Bloomberg Global Aggregate Credit Index Currency Hedged (USD)	USD	4.215	(4.215)
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	ICE BofA European Currency High Yield (z. B. Finanzen) 2 % Consgeschulte Indexwährung abgesichert (EUR)	EUR	1.313	(1.313)
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	Bloomberg U.S. Mortgage Backed Securities Index	USD	59.527	(59.527)
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^	ICE Bank of America Merrill Lynch Sterling Non-Endurance Index Brutto Dividends (GBP)	GBP	3.359	(3.359)
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	Bloomberg Index für US-Unternehmensanleihen	USD	8.977	(8.977)
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	8.068	(8.068)
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^	Bloomberg Global High Yield Index (USD)	USD	516	(516)
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	8.680	(8.680)
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	ICE Bank of America Merrill Lynch Global High Yield BBB Index	USD	495	(495)
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	Russell 1000 Value Index	USD	119	(119)
Legg Mason ClearBridge Value Fund	Russell 1000 Value Index (S&P 500 Index vor dem 17May2021)	USD	39.869	(39.869)
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	S&P 500 Index	USD	10.693	(10.693)
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Russell 1000 Growth Index	USD	81.804	(81.804)
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Russell 3000 Growth Index	USD	16.761	(16.761)
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Dow Jones U.S. Select Dividend Index (Gesamt)	USD	1.150	(1.150)
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	Russell 3000 Index	USD	88.983	(88.983)
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^	MSCI AC World Net Dividends Index	USD	883	(883)
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^	OECD G7 CPI + 5,5 %. CPI: Verbraucherpreisindex (Inflation)	EUR	(340.765)	340.765
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^	S&P Emerging Markets Infrastructure Net Total Return (Nettorendite der Schwellenländer-Infrastruktur)	USD	73	(73)
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	Russell 2000 Value Index (Russell 2000 Index vor dem 17May2021)	USD	43.387	(43.387)
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	Russell 3000 Index	USD	3.991	(3.991)
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Europäischer Aktienwachstums- und Einkommensfonds	MSCI Europe Net Dividends Index	EUR	1.280	(1.280)
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	MSCI AC Asia Pacific ex Japan Net Dividends Index	USD	636	(636)
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund	MSCI AC World Net Dividends Index	USD	430	(430)
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	MSCI AC Asia ex Japan Net Dividends Index	USD	567	(567)
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	MSCI AC World Net Dividends Index	USD	12.236	(12.236)
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	50 % MSCI AC Asia Pacific Ex Japan Equity REITS Index Net Dividendet (USD)/50 % MSCI AC Asia Pacific Ex Japan/UTILITIES Index Nettodividenden (USD)	USD	599	(599)
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	MSCI Emerging Markets Net Dividends Index	USD	2.398	(2.398)

\* Das wahrscheinlichste Ergebnis basiert auf einer +5%igen Outperformance oder -5%igen Underperformance gegenüber der tatsächlichen Benchmark-Performance des laufenden Jahres.

\*\* DerFonds hat keinen Index als Benchmark, daher wurde ein Ersatzindex als Indikator für die Beta-Berechnung verwendet.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (a) Marktpreisrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2021

Fonds	Index	Währung	Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Indexbewegungen (in Tsd.)	
			Positiv 5 %*	Negativ 5 %*
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	FTSE Treasury Bill 1-Month (USD)	USD	18.536	(18.536)
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Bond Index	USD	25.837	(25.837)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Bloomberg Barclays U.S. Aggregate Bond Index	USD	171.404	(171.404)
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	FTSE Euro Broad Investment Grade Bond Index	EUR	7.042	(7.042)
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	Bloomberg Barclays U.S. High Yield 1-5 Years Cash Pay 2 % Constrained Index	USD	1.220	(1.220)
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity	USD	912.921	(912.921)
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	Bloomberg Barclays U.S. Corporate High Yield Bond Index 2 % Issuer Capped	USD	11.587	(11.587)
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund**	JP Morgan EMBI Global Index	USD	960	(960)
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index – Broad Composite	USD	2.337	(2.337)
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	Barclays Global High Yield Bond Hedged Index	USD	4.520	(4.520)
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	Bloomberg Barclays Global Inflationgebunden 1-10 Year Hedged (USD)	USD	4.208	(4.208)
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Markit iBoxx Asian Local Bond Index	USD	39.176	(39.176)
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund**	ICE BofA U.S. Treasury 1-10 Years Index	USD	(20.784)	20.784
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Bloomberg Barclays Global Aggregate Bond Index Currency Hedged to USD	USD	26.904	(26.904)
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^	Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index Currency Hedged to USD	USD	4.701	(4.701)
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	ICE BofA European Currency High Yield (ex. Financials) 2 % Constrained Index Currency Hedged (EUR)	EUR	2.654	(2.654)
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	Bloomberg Barclays U.S. Hypothekenbesichert Securities Index	USD	3.090	(3.090)
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^	ICE Bank of America Merrill Lynch Sterling Nicht verschleiert Index Gross Dividends (GBP)	GBP	4.177	(4.177)
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^	Bloomberg Barclays U.S. Credit	USD	13.826	(13.826)
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	30.672	(30.672)
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^	Bloomberg Barclays Global High Yield Bond Index	USD	488	(488)
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	51.605	(51.605)
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	ICE Bank of America Merrill Lynch Global High Yield BBB Index	USD	478	(478)
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	Russell 1000 Value Index	USD	88	(88)
Legg Mason ClearBridge Value Fund	S&P 500 Index	USD	31.610	(31.610)
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	S&P 500 Index	USD	9.193	(9.193)
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Russell 1000 Growth Index	USD	86.900	(86.900)
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Russell 3000 Growth Index	USD	38.037	(38.037)
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Dow Jones US Select Dividend Index	USD	1.730	(1.730)
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	Russell 3000 Index	USD	25.088	(25.088)
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^	MSCI AC World Net Dividends Index	USD	502	(502)
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^	OECD G7 Consumer Price Index +5,5 %	EUR	203.897	(203.897)
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^	S&P Emerging Markets Infrastructure Net Total Return	USD	133	(133)
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	Russell 2000 Index	USD	78.943	(78.943)
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	Russell 2000 Index	USD	4.609	(4.609)
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund	MSCI Europe Net Dividends Index	EUR	1.617	(1.617)
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	MSCI AC Asia Pacific ex Japan Net Dividends Index	USD	1.362	(1.362)
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund	MSCI Emerging Markets Net Dividends Index	USD	838	(838)
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund	MSCI AC World Net Dividends Index	USD	623	(623)
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	MSCI AC Asia ex-Japan Net Dividends Index	USD	3.330	(3.330)
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	MSCI AC World Net Dividends Index	USD	3.481	(3.481)
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	MSCI AC Asia Pacific Ex Japan Net Dividends Index	USD	1.409	(1.409)
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	MSCI Emerging Markets Net Dividends Index	USD	2.100	(2.100)
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^	MSCI Europe Net Dividends (EUR)	EUR	4.226	(4.226)

\* Das wahrscheinlichste Ergebnis basiert auf einer +5%igen Outperformance oder -5%igen Underperformance gegenüber der tatsächlichen Benchmark-Performance des laufenden Jahres.

\*\* DerFonds hat keinen Index als Benchmark, daher wurde ein Ersatzindex als Indikator für die Beta-Berechnung verwendet.

Die oben erwähnte Sensitivitätsanalyse sollte nicht als Hinweis auf künftige Ergebnisse verwendet werden.

Die Marktpreisrisikosensitivitätsanalyse für den Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^, Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^, Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^, Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^, Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund, Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^, Der Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ und der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ (mit Stand vom 1. Juni 2021) wurden in die Berechnung des Marktrisiko unter Verwendung des VaR-Ansatzes einbezogen (Anmerkung 12.1 oben).

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (b) Fremdwährungsrisiko

Die in den Fonds enthaltenen finanziellen Vermögenswerte lauten teilweise auf eine andere Währung als US-Dollar, Euro oder Britische Pfund (die funktionalen Währungen der Fonds), sodass sich Wechselkursschwankungen erheblich auf die Bilanzen und den Gesamtertrag auswirken können.

Western Asset hat eine starke Tendenz, alle Fremdwährungen in die funktionale Währung des Portfolios des Fonds zu sichern. Western Asset lässt hingegen üblicherweise nur einen kleinen Teil des Portfolios ungesichert, und das nur, wenn aufgrund des Ausblicks stark mit einem attraktiven Währungsrisiko zu rechnen ist. In anderen Portfolios werden Absicherungen immer dann eingesetzt, wenn eine Währung ein Risiko für die Wertminderung um mehr als die Kosten der Absicherungstransaktion aufweist. Western Asset kann innerhalb strenger Grenzen (üblicherweise weniger als 5 % des Portfolios) ein Cross-Hedging in andere Währungen als die Leitwährung vornehmen, wenn dies gemäß den Vorschriften zulässig ist und im Bestreben erfolgt, das Engagement des Referenzindex nachzubilden.

In den folgenden Tabellen ist das Nettoengagement des Fonds in Fremdwährungen zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 dargestellt.

Die unten dargestellten Beträge sind hauptsächlich monetäre Vermögenswerte und monetäre Verbindlichkeiten, mit Ausnahme von Anlagen in nicht verzinsliche Wertpapiere, zu denen Aktien gehören, bei denen es sich um nicht monetäre Vermögenswerte handelt. Die unten aufgeführten Beträge für Devisenterminkontrakte stellen die Werte dar, die im Rahmen von Währungsverträgen eingehen und beinhalten Devisensicherungsgeschäfte. Die angegebenen Werte für sonstige Derivate geben die nicht realisierte Wertsteigerung/(-minderung) zum Jahresende an.

Stand: 28. Februar 2022

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamt Nettovermögenswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund</b>							
US-Dollar	\$ 806.429	\$ 133.015	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (20.120)	\$ 919.324
Gesamt	\$ 806.429	\$ 133.015	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (20.120)	\$ 919.324
<b>Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund</b>							
Chinesischer Renminbi	\$ 82	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 16	\$ 98
Euro	–	–	–	2.562	–	–	2.562
US-Dollar	180.989	48.325	5.470	(2.612)	1.106	(3.032)	230.246
Gesamt	\$ 181.071	\$ 48.325	\$ 5.470	\$ (50)	\$ 1.106	\$ (3.016)	\$ 232.906
<b>Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund</b>							
Argentinischer Peso	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 8	\$ 8
Australischer Dollar	–	–	–	25.839	(523)	1.205	26.521
Brasilianischer Real	5.274	1.692	–	(364)	(855)	2.539	8.286
Britisches Pfund	–	–	–	9.076	–	1.698	10.774
Kanadischer Dollar	–	–	–	53.137	–	866	54.003
Chinesischer Renminbi	–	–	–	(41.391)	–	–	(41.391)
Euro	–	–	–	23.776	1.526	2.197	27.499
Indische Rupie	–	–	–	2.056	–	–	2.056
Indonesische Rupiah	11.786	–	–	2.802	–	633	15.221
Japanischer Yen	–	–	–	18.877	167	1.339	20.383
Malaysischer Ringgit	–	–	–	–	–	27	27
Mexikanischer Peso	27.048	–	–	8.594	(313)	3.138	38.467
Russischer Rubel	9.825	–	–	7.310	–	1.062	18.197
Südafrikanischer Rand	–	–	–	1.903	–	–	1.903
US-Dollar	1.022.043	366.296	34.088	(115.510)	3.882	(4.663)	1.306.136
Gesamt	\$ 1.075.976	\$ 367.988	\$ 34.088	\$ (3.895)	\$ 3.884	\$ 10.049	\$ 1.488.090
<b>Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund</b>							
Australischer Dollar	€ –	€ –	€ –	€ (72)	€ (38)	€ 146	€ 36
Britisches Pfund	345	–	–	(433)	(136)	293	69
Kanadischer Dollar	–	–	–	(224)	(13)	254	17
Tschechische Krone	–	–	–	(59)	(11)	78	8
Euro	110.688	14.737	–	17.280	84	1.887	144.676
Ungarischer Forint	–	–	–	1.348	–	–	1.348
Norwegische Krone	–	–	–	2.011	–	–	2.011
Polnischer Zloty	–	–	–	1.352	–	26	1.378
US-Dollar	19.645	391	808	(21.713)	(583)	1.295	(157)
Gesamt	€ 130.678	€ 15.128	€ 808	€ (510)	€ (697)	€ 3.979	€ 149.386
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 30	\$ –	\$ (1)	\$ 29
Kanadischer Dollar	171	–	–	(175)	–	7	3
Euro	–	–	–	1.473	–	5	1.478
Hongkong-Dollar	–	–	–	(8)	–	–	(8)
US-Dollar	42.570	7.761	216	(1.348)	–	2.291	51.490
Gesamt	\$ 42.741	\$ 7.761	\$ 216	\$ (28)	\$ –	\$ 2.302	\$ 52.992

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamt Nettovermögenswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 92.930	\$ (117)	\$ 595	\$ 93.408
Brasilianischer Real	7.847	–	–	(1.008)	–	312	7.151
Britisches Pfund	7.527	3.843	–	40.232	–	2.095	53.697
Kanadischer Dollar	–	–	–	970	–	3	973
Chinesischer Renminbi	9.405	–	–	(5.094)	–	413	4.724
Kolumbianischer Peso	–	–	–	–	–	78	78
Tschechische Krone	–	–	–	–	–	38	38
Euro	11.387	5.594	17.332	(19.395)	(364)	1.782	16.336
Indische Rupie	–	–	–	1.442	–	–	1.442
Indonesische Rupiah	7.388	–	–	2.386	–	419	10.193
Mexikanischer Peso	8.613	–	–	334	–	403	9.350
Polnischer Zloty	–	–	–	3.701	–	–	3.701
Russischer Rubel	3.458	–	–	(3.038)	–	123	543
Singapur-Dollar	–	–	–	(5.692)	–	–	(5.692)
Südafrikanischer Rand	3.160	–	–	(2.051)	–	785	1.894
Schweizer Franke	–	–	–	3.448	–	–	3.448
Taiwan-Dollar	–	–	–	(3.537)	–	–	(3.537)
US-Dollar	141.243	44.585	12.063	(103.298)	(1.353)	11.982	105.222
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 200.028</b>	<b>\$ 54.022</b>	<b>\$ 29.395</b>	<b>\$ 2.330</b>	<b>\$ (1.834)</b>	<b>\$ 19.028</b>	<b>\$ 302.969</b>
<b>Legg Mason Western Asset US High Yield Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3	\$ 3
Britisches Pfund	–	–	–	52	–	–	52
Kanadischer Dollar	–	–	–	(7)	–	–	(7)
Euro	–	–	–	1.811	–	–	1.811
Mexikanischer Peso	–	–	–	–	–	2	2
Singapur-Dollar	–	–	–	514	–	–	514
US-Dollar	218.734	32.137	5.005	(2.411)	68	3.192	256.725
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 218.734</b>	<b>\$ 32.137</b>	<b>\$ 5.005</b>	<b>\$ (41)</b>	<b>\$ 68</b>	<b>\$ 3.197</b>	<b>\$ 259.100</b>
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund</b>							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (21)	\$ –	\$ 29	\$ 8
Britisches Pfund	–	–	–	139	–	–	139
Chinesischer Renminbi	–	–	–	121	–	–	121
Ägyptisches Pfund	255	–	–	–	–	43	298
Euro	–	–	–	2.663	–	–	2.663
Indische Rupie	527	–	–	(546)	–	8	(11)
Indonesische Rupiah	681	–	–	(710)	–	37	8
Mexikanischer Peso	183	–	–	(223)	–	12	(28)
Russischer Rubel	–	–	–	(33)	–	4	(29)
Singapur-Dollar	–	–	–	9	–	–	9
Südafrikanischer Rand	–	–	–	–	–	19	19
US-Dollar	27.702	3.881	4.048	(1.418)	(94)	3.802	37.921
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 29.348</b>	<b>\$ 3.881</b>	<b>\$ 4.048</b>	<b>\$ (19)</b>	<b>\$ (94)</b>	<b>\$ 3.954</b>	<b>\$ 41.118</b>
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.963	\$ –	\$ (1)	\$ 1.962
US-Dollar	24.491	2.599	–	(2.002)	(17)	815	25.886
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 24.491</b>	<b>\$ 2.599</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ (39)</b>	<b>\$ (17)</b>	<b>\$ 814</b>	<b>\$ 27.848</b>
<b>Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 7.754	\$ –	\$ 2	\$ 7.756
Brasilianischer Real	–	–	–	–	–	17	17
Britisches Pfund	3.389	542	–	561	–	222	4.714
Euro	2.683	134	4.505	874	–	430	8.626
Indonesische Rupiah	705	–	–	–	–	35	740
Mexikanischer Peso	874	–	–	–	–	17	891
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	6	6
Russischer Rubel	634	–	–	–	–	79	713
Singapur-Dollar	–	–	–	2.201	–	–	2.201
Türkische Lira	–	–	–	–	–	1	1
US-Dollar	54.852	5.337	2.128	(11.336)	51	5.281	56.313
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 63.137</b>	<b>\$ 6.013</b>	<b>\$ 6.633</b>	<b>\$ 54</b>	<b>\$ 51</b>	<b>\$ 6.090</b>	<b>\$ 81.978</b>

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnet-towert-gesamtwert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ 353	\$ –	\$ (956)	\$ (26)	\$ 113	\$ (516)
Britisches Pfund	–	–	–	(47)	(51)	124	26
Kanadischer Dollar	–	366	–	(1.041)	(9)	119	(565)
Tschechische Krone	–	–	–	(22)	(5)	30	3
Euro	1.129	14.002	–	(7.231)	114	211	8.225
Ungarischer Forint	–	–	–	530	–	–	530
Indonesische Rupiah	125	–	–	–	–	12	137
Japanischer Yen	–	5.064	–	(5.187)	28	76	(19)
Mexikanischer Peso	922	–	–	73	–	171	1.166
Neuseeländischer Dollar	–	177	–	(52)	–	4	129
Norwegische Krone	–	–	–	368	–	–	368
Polnischer Zloty	–	–	–	532	–	8	540
Russischer Rubel	–	–	–	10	–	–	10
Südafrikanischer Rand	817	–	–	(790)	–	81	108
Südkoreanischer Won	–	–	–	(3)	–	–	(3)
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	3	3
US-Dollar	1.725	30.213	3.010	13.871	(234)	798	49.383
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 4.718</b>	<b>\$ 50.175</b>	<b>\$ 3.010</b>	<b>\$ 55</b>	<b>\$ (183)</b>	<b>\$ 1.750</b>	<b>\$ 59.525</b>
<b>Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 21.831	\$ –	\$ 96	\$ 21.927
Chinesischer Renminbi	121.775	–	–	5.390	–	2.557	129.722
Euro	–	–	–	11.798	–	(15)	11.783
Hongkong-Dollar	–	960	–	–	–	7	967
Indische Rupie	48.494	–	–	–	–	2.433	50.927
Indonesische Rupiah	62.358	–	–	–	7.755	970	71.083
Malaysischer Ringgit	54.031	–	–	–	–	692	54.723
Philippinischer Peso	46.748	–	–	–	–	318	47.066
Singapur-Dollar	14.571	7.600	–	40.602	–	433	63.206
Südkoreanischer Won	67.112	–	–	7.066	(1.113)	2.979	76.044
Schweizer Franke	–	–	–	331	–	(1)	330
Thailändischer Baht	26.180	–	–	–	–	164	26.344
US-Dollar	24.366	6.264	12.311	(87.234)	–	(35)	(44.328)
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 465.635</b>	<b>\$ 14.824</b>	<b>\$ 12.311</b>	<b>\$ (216)</b>	<b>\$ 6.642</b>	<b>\$ 10.598</b>	<b>\$ 509.794</b>
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 10.316	\$ –	\$ 701	\$ 11.017
Britisches Pfund	65.822	1.793	–	194.510	(181)	3.194	265.138
Euro	145.958	18.816	–	(107.634)	2.014	(4.998)	54.156
Schwedische Krone	–	–	–	22.926	–	74	23.000
US-Dollar	179.489	26.839	6.636	(120.587)	180	(1.619)	90.938
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 391.269</b>	<b>\$ 47.448</b>	<b>\$ 6.636</b>	<b>\$ (469)</b>	<b>\$ 2.013</b>	<b>\$ (2.648)</b>	<b>\$ 444.249</b>
<b>Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup></b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (2.641)	\$ (201)	\$ 517	\$ (2.325)
Brasilianischer Real	–	–	–	(8)	–	8	–
Britisches Pfund	7.880	1.175	–	(10.423)	(217)	587	(998)
Kanadischer Dollar	2.914	–	–	99.084	(50)	337	102.285
Chinesischer Renminbi	–	–	–	(18.194)	–	–	(18.194)
Tschechische Krone	–	–	–	(88)	(18)	118	12
Euro	22.518	4.533	–	18.692	66	1.887	47.696
Ungarischer Forint	–	–	–	2.273	–	–	2.273
Indonesische Rupiah	2.219	–	–	(55)	–	108	2.272
Israelischer Schekel	–	–	–	–	–	81	81
Japanischer Yen	4.308	8.744	–	(13.466)	(52)	168	(298)
Mexikanischer Peso	4.257	–	–	(139)	–	109	4.227
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	6.139	–	–	6.139
Norwegische Krone	–	–	–	2.073	–	–	2.073
Polnischer Zloty	–	–	–	2.310	–	35	2.345
Russischer Rubel	1.465	–	–	(1.323)	–	155	297
Südafrikanischer Rand	3.266	–	–	(3.128)	–	160	298
Südkoreanischer Won	2.056	–	–	(2.124)	–	47	(21)
Taiwan-Dollar	–	–	–	9	–	–	9
US-Dollar	109.935	4.367	20.460	(79.101)	(1.235)	351	54.777
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 160.818</b>	<b>\$ 18.819</b>	<b>\$ 20.460</b>	<b>\$ (110)</b>	<b>\$ (1.707)</b>	<b>\$ 4.668</b>	<b>\$ 202.948</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnetvermögenswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup></b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (3)	\$ –	\$ 23	\$ 20
Brasilianischer Real	–	–	–	310	–	–	310
Britisches Pfund	6.219	2.961	–	(9.457)	(14)	294	3
Euro	21.475	11.056	–	(29.337)	(17)	1.057	4.234
Japanischer Yen	–	–	–	815	–	–	815
Mexikanischer Peso	167	–	–	–	–	37	204
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	14	14
Russischer Rubel	51	–	–	–	–	20	71
US-Dollar	27.062	4.745	718	38.383	31	743	71.682
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 54.974</b>	<b>\$ 18.762</b>	<b>\$ 718</b>	<b>\$ 711</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 2.188</b>	<b>\$ 77.353</b>
<b>Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund</b>							
Britisches Pfund	€ 6.855	€ 332	€ –	€ (8.180)	€ –	€ 833	€ (160)
Euro	21.219	4.362	–	8.100	–	3.904	37.585
US-Dollar	–	–	2	22	–	(1)	23
<b>Gesamt</b>	<b>€ 28.074</b>	<b>€ 4.694</b>	<b>€ 2</b>	<b>€ (58)</b>	<b>€ –</b>	<b>€ 4.736</b>	<b>€ 37.448</b>
<b>Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup></b>							
Australischer Dollar	\$ 73.065	\$ –	\$ –	\$ 129.453	\$ 3.205	\$ 6.311	\$ 212.034
Brasilianischer Real	71.683	–	–	353.355	(71.375)	524	354.187
Britisches Pfund	–	16.247	–	359.157	(6.434)	10.238	379.208
Kanadischer Dollar	–	–	–	57.700	–	4.387	62.087
Chinesischer Renminbi	145.773	–	–	(418.925)	–	2.033	(271.119)
Kolumbianischer Peso	–	–	–	47.481	–	–	47.481
Ägyptisches Pfund	5.128	–	–	–	–	(10)	5.118
Euro	13.327	76.463	14.535	1.381.169	56.396	680	1.542.570
Indische Rupie	174.083	–	–	(167.733)	–	4.598	10.948
Indonesische Rupiah	380.772	–	–	(198.637)	–	8.385	190.520
Japanischer Yen	–	–	–	(277.380)	–	4.834	(272.546)
Malaysischer Ringgit	–	–	–	47.030	–	–	47.030
Mexikanischer Peso	378.593	–	–	(308.946)	–	11.394	81.041
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	1.450	–	–	1.450
Norwegische Krone	–	–	–	13.047	–	34	13.081
Polnischer Zloty	–	–	–	1.605	–	–	1.605
Russischer Rubel	183.535	–	–	(26.567)	(87.606)	17.422	86.784
Singapur-Dollar	–	–	–	70.491	–	194	70.685
Südafrikanischer Rand	–	–	–	6.840	–	–	6.840
Südkoreanischer Won	–	–	–	75.532	–	–	75.532
Schwedische Krone	–	–	–	3.531	–	15	3.546
Schweizer Franke	–	–	–	67.796	–	64	67.860
Taiwan-Dollar	–	–	–	(74.813)	–	–	(74.813)
US-Dollar	1.485.150	657.162	150.896	(1.128.786)	(30.071)	408.354	1.542.705
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 2.911.109</b>	<b>\$ 749.872</b>	<b>\$ 165.431</b>	<b>\$ 13.850</b>	<b>\$ (135.885)</b>	<b>\$ 479.457</b>	<b>\$ 4.183.834</b>
<b>Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup></b>							
Argentinischer Peso	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ 2
Australischer Dollar	–	–	–	103.709	(43)	236	103.902
Brasilianischer Real	1.313	92	–	(1.863)	(350)	225	(583)
Britisches Pfund	3.126	1.196	–	178.307	–	688	183.317
Kanadischer Dollar	326	–	–	6.088	–	77	6.491
Chinesischer Renminbi	–	–	–	(1.470)	–	–	(1.470)
Euro	1.010	5.709	2.845	57.361	210	(59)	67.076
Indonesische Rupiah	6.560	–	–	(6.692)	–	576	444
Japanischer Yen	–	266	–	3.339	–	1	3.606
Mexikanischer Peso	1.214	–	–	1.523	(182)	468	3.023
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	2.373	–	10	2.383
Norwegische Krone	–	–	–	7.697	–	–	7.697
Russischer Rubel	1.971	–	–	1.404	–	286	3.661
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	3	3
Schweizer Franke	–	–	–	48	–	–	48
Türkische Lira	–	–	–	–	–	4	4
US-Dollar	226.701	94.697	11.177	(353.719)	(1.260)	14.699	(7.705)
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 242.221</b>	<b>\$ 101.960</b>	<b>\$ 14.022</b>	<b>\$ (1.895)</b>	<b>\$ (1.625)</b>	<b>\$ 17.216</b>	<b>\$ 371.899</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtvermögenswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup></b>							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 12.895	\$ –	\$ –	\$ 12.895
Euro	–	–	–	173.499	–	–	173.499
Japanischer Yen	–	–	–	53.383	–	–	53.383
Schweizer Franke	–	–	–	1.426	–	–	1.426
US-Dollar	161.497	856.860	36.257	(244.513)	400	6.237	816.738
Gesamt	\$ 161.497	\$ 856.860	\$ 36.257	\$ (3.310)	\$ 400	\$ 6.237	\$ 1.057.941
<b>Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup></b>							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 718	\$ –	\$ –	\$ 718
US-Dollar	1.149.672	114.744	18.650	(732)	2.270	(138.042)	1.146.562
Gesamt	\$ 1.149.672	\$ 114.744	\$ 18.650	\$ (14)	\$ 2.270	\$ (138.042)	\$ 1.147.280
<b>Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup></b>							
Australischer Dollar	£ –	£ –	£ –	£ (105)	£ –	£ 124	£ 19
Britisches Pfund	54.931	12.121	–	3.756	2	2.802	73.612
Euro	538	317	–	(1.003)	22	110	(16)
US-Dollar	1.908	325	–	(2.675)	25	435	18
Gesamt	£ 57.377	£ 12.763	£ –	£ (27)	£ 49	£ 3.471	£ 73.633
<b>Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 280	\$ –	\$ –	\$ 280
Britisches Pfund	443	–	–	153.633	–	12	154.088
Euro	–	–	–	2.444	–	213	2.657
Mexikanischer Peso	880	–	–	587	–	89	1.556
Russischer Rubel	88	–	–	–	–	8	96
US-Dollar	127.739	33.093	11.779	(158.540)	44	2.377	16.492
Gesamt	\$ 129.150	\$ 33.093	\$ 11.779	\$ (1.596)	\$ 44	\$ 2.699	\$ 175.169
<b>Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup></b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 611	\$ (17)	\$ 34	\$ 628
Brasilianischer Real	258	–	–	280	–	19	557
Britisches Pfund	–	–	–	327	–	–	327
Kanadischer Dollar	–	–	–	1.278	–	12	1.290
Chinesischer Renminbi	–	–	–	(1.218)	–	–	(1.218)
Euro	–	–	–	(319)	12	186	(121)
Indonesische Rupiah	272	–	–	214	–	18	504
Japanischer Yen	–	–	–	795	–	–	795
Mexikanischer Peso	1.211	–	–	(290)	–	158	1.079
Russischer Rubel	184	–	–	209	–	18	411
US-Dollar	14.184	3.739	1.216	(1.956)	(28)	551	17.706
Gesamt	\$ 16.109	\$ 3.739	\$ 1.216	\$ (69)	\$ (33)	\$ 996	\$ 21.958
<b>Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2.622	\$ –	\$ –	\$ 2.622
Britisches Pfund	402	257	–	(643)	–	22	38
Euro	2.366	1.450	–	(3.862)	12	63	29
US-Dollar	3.634	1.262	64	2.127	9	81	7.177
Gesamt	\$ 6.402	\$ 2.969	\$ 64	\$ 244	\$ 21	\$ 166	\$ 9.866

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnettovermögenswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ 17.565	\$ –	\$ –	\$ (549)	\$ –	\$ 144	\$ 17.160
Brasilianischer Real	9.592	–	–	–	–	(72)	9.520
Britisches Pfund	11.455	–	–	30.138	–	99	41.692
Kanadischer Dollar	–	–	–	(1.380)	–	–	(1.380)
Chilenischer Peso	–	–	–	18.353	–	–	18.353
Chinesischer Renminbi	–	–	–	(630)	–	–	(630)
Kolumbianischer Peso	8.926	–	–	(8.930)	–	456	452
Dänische Krone	–	–	–	(289)	–	–	(289)
Euro	10.756	–	–	49.382	–	44	60.182
Ungarischer Forint	–	–	–	7.039	–	–	7.039
Israelischer Schekel	–	–	–	(301)	–	(1)	(302)
Japanischer Yen	–	–	–	10.157	–	–	10.157
Malaysischer Ringgit	9.125	–	–	–	–	137	9.262
Mexikanischer Peso	30.602	–	–	(22.426)	–	472	8.648
Neuseeländischer Dollar	8.843	–	–	4.400	–	151	13.394
Norwegische Krone	9.268	–	–	4.840	–	141	14.249
Peruanischer Nuevo Sol	–	–	–	4.961	–	–	4.961
Polnischer Zloty	12.911	–	–	5.227	–	898	19.036
Russischer Rubel	4.085	–	–	(3.165)	–	39	959
Singapur-Dollar	–	–	–	(301)	–	–	(301)
Südafrikanischer Rand	11.147	–	–	(11.098)	–	16	65
Südkoreanischer Won	11.689	–	–	(11.448)	–	59	300
Schwedische Krone	–	–	–	9.610	–	–	9.610
Thailändischer Baht	–	–	–	2.060	–	–	2.060
US-Dollar	18.460	36.549	4.135	(85.876)	–	(1.830)	(28.562)
Gesamt	\$ 174.424	\$ 36.549	\$ 4.135	\$ (226)	\$ –	\$ 753	\$ 215.635
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^</b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 568.312	\$ –	\$ –	\$ 568.312
Brasilianischer Real	38.563	–	–	8.855	–	568	47.986
Britisches Pfund	14.331	–	–	(23.217)	–	41	(8.845)
Chilenischer Peso	–	–	–	67.418	–	–	67.418
Chinesischer Renminbi	23.798	–	–	(62.023)	–	392	(37.833)
Kolumbianischer Peso	23.795	–	–	(24.512)	–	935	218
Euro	–	5.163	–	221.400	(4.865)	78	221.776
Indonesische Rupiah	45.736	–	–	(45.993)	–	983	726
Japanischer Yen	–	–	–	37.820	–	–	37.820
Mexikanischer Peso	46.956	–	–	(46.852)	–	863	967
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	46.313	–	–	46.313
Norwegische Krone	–	–	–	23.306	–	–	23.306
Peruanischer Nuevo Sol	–	–	–	39.544	–	–	39.544
Polnischer Zloty	–	–	–	35.801	–	319	36.120
Russischer Rubel	–	–	–	21.839	–	–	21.839
Singapur-Dollar	–	–	–	(45.623)	–	–	(45.623)
Südafrikanischer Rand	29.793	–	–	(30.262)	–	(5)	(474)
Südkoreanischer Won	60.610	–	–	(59.420)	–	188	1.378
Schwedische Krone	–	–	–	72.256	–	–	72.256
Schweizer Franke	–	–	–	(152.009)	–	–	(152.009)
Thailändischer Baht	–	–	–	39.208	–	–	39.208
US-Dollar	44.161	395.100	752	(692.400)	1.272	23.430	(227.685)
Gesamt	\$ 327.743	\$ 400.263	\$ 752	\$ (239)	\$ (3.593)	\$ 27.792	\$ 752.718
<b>Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^</b>							
Brasilianischer Real	\$ 241	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3	\$ 244
Britisches Pfund	–	–	–	107	–	–	107
Kanadischer Dollar	–	–	–	11.201	–	–	11.201
Euro	102	–	–	(141)	86	17	64
Schwedische Krone	–	–	–	(1)	–	–	(1)
Schweizer Franke	–	–	–	(4)	–	(1)	(5)
US-Dollar	10.354	181	538	(11.132)	(1)	40	(20)
Gesamt	\$ 10.697	\$ 181	\$ 538	\$ 30	\$ 85	\$ 59	\$ 11.590

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkon- trakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnet- tovermö- genswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ 20.980	\$ –	\$ –	\$ (294)	\$ –	\$ 165	\$ 20.851
Brasilianischer Real	12.658	–	–	(1.465)	–	187	11.380
Britisches Pfund	12.420	–	–	(8.833)	–	3	3.590
Kanadischer Dollar	–	–	–	(374)	–	–	(374)
Chilenischer Peso	–	–	–	22.542	–	–	22.542
Chinesischer Renminbi	7.876	–	–	(7.687)	–	129	318
Kolumbianischer Peso	8.034	–	–	(8.097)	–	293	230
Dänische Krone	–	–	–	(78)	–	–	(78)
Euro	11.700	54	–	18.864	–	–	30.618
Ungarischer Forint	–	–	–	8.458	–	–	8.458
Indonesische Rupiah	–	–	–	–	–	10	10
Israelischer Schekel	–	–	–	(82)	–	–	(82)
Japanischer Yen	–	–	–	20.980	–	–	20.980
Malaysischer Ringgit	10.886	–	–	–	–	174	11.060
Mexikanischer Peso	22.203	–	–	(11.907)	–	408	10.704
Neuseeländischer Dollar	9.811	–	–	25.242	–	168	35.221
Norwegische Krone	10.086	–	–	7.392	–	155	17.633
Polnischer Zloty	21.393	–	–	775	–	1.103	23.271
Russischer Rubel	404	–	–	3.137	–	21	3.562
Singapur-Dollar	–	–	–	(82)	–	–	(82)
Südafrikanischer Rand	10.099	–	–	(10.100)	–	(1)	(2)
Südkoreanischer Won	17.525	–	–	(16.984)	–	92	633
Schwedische Krone	–	–	–	11.724	–	–	11.724
Thailändischer Baht	–	–	–	2.504	–	–	2.504
US-Dollar	20.930	42.236	3.333	(56.855)	–	81	9.725
Gesamt	\$ 197.005	\$ 42.290	\$ 3.333	\$ (1.220)	\$ –	\$ 2.988	\$ 244.396
<b>Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 56.572	\$ –	\$ –	\$ 56.572
Brasilianischer Real	52.270	–	–	(227)	–	735	52.778
Britisches Pfund	–	1.443	–	56.126	–	16	57.585
Chilenischer Peso	–	–	–	81.824	–	–	81.824
Chinesischer Renminbi	–	–	–	1.177	–	–	1.177
Euro	2.673	–	–	501.635	11.485	1.582	517.375
Mexikanischer Peso	14.838	–	–	(13.664)	–	236	1.410
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	49.652	–	–	49.652
Russischer Rubel	1.285	–	–	(1.356)	–	9	(62)
Singapur-Dollar	–	–	–	53.926	–	(818)	53.108
Schwedische Krone	–	–	–	3.370	–	3	3.373
Schweizer Franke	7.999	–	–	(1.496)	–	24	6.527
Thailändischer Baht	–	–	–	63.944	–	–	63.944
US-Dollar	882.292	518.584	40.689	(859.558)	9.956	70.847	662.810
Gesamt	\$ 961.357	\$ 520.027	\$ 40.689	\$ (8.075)	\$ 21.441	\$ 72.634	\$ 1.608.073
<b>Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^</b>							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.055	\$ –	\$ –	\$ 1.055
Chilenischer Peso	–	–	–	1.025	–	–	1.025
Chinesischer Renminbi	1.388	–	–	(1.310)	–	23	101
Tschechische Krone	–	–	–	495	–	–	495
Euro	–	1.923	–	(1.214)	(13)	1	697
Japanischer Yen	–	–	–	1.047	–	–	1.047
Schwedische Krone	–	–	–	486	–	–	486
Thailändischer Baht	–	–	–	1.549	–	–	1.549
US-Dollar	15.347	31.237	1.958	(3.199)	172	416	45.931
Gesamt	\$ 16.735	\$ 33.160	\$ 1.958	\$ (66)	\$ 159	\$ 440	\$ 52.386
<b>Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^</b>							
Brasilianischer Real	\$ 204	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3	\$ 207
Britisches Pfund	–	–	–	(50)	–	–	(50)
Kanadischer Dollar	–	–	–	(70)	–	–	(70)
Euro	223	–	–	9.709	74	14	10.020
US-Dollar	8.856	–	882	(9.785)	(6)	109	56
Gesamt	\$ 9.283	\$ –	\$ 882	\$ (196)	\$ 68	\$ 126	\$ 10.163

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnettovermögenswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 113.113	\$ –	\$ –	\$ 113.113
Brasilianischer Real	10.797	–	–	–	–	156	10.953
Britisches Pfund	–	–	–	7	–	–	7
Kanadischer Dollar	–	–	–	7.251	–	–	7.251
Chilenischer Peso	–	–	–	10.831	–	–	10.831
Kolumbianischer Peso	3.350	–	–	(3.448)	–	171	73
Tschechische Krone	5.060	–	–	(4.961)	–	85	184
Euro	–	–	–	3.259	248	1	3.508
Japanischer Yen	–	–	–	9.178	–	–	9.178
Malaysischer Ringgit	3.901	–	–	–	–	62	3.963
Mexikanischer Peso	17.927	–	–	(1.173)	–	328	17.082
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	3.319	–	–	3.319
Polnischer Zloty	10.076	–	–	–	–	183	10.259
Russischer Rubel	1.017	–	–	7.824	–	53	8.894
Singapur-Dollar	–	–	–	4.099	–	–	4.099
Südafrikanischer Rand	9.841	–	–	(1.043)	–	(1)	8.797
Südkoreanischer Won	7.216	–	–	(1.771)	–	39	5.484
Schwedische Krone	–	–	–	10.231	–	–	10.231
Thailändischer Baht	–	–	–	3.388	–	–	3.388
US-Dollar	3.123	24.340	4.248	(161.140)	(523)	3.569	(126.383)
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 72.308</b>	<b>\$ 24.340</b>	<b>\$ 4.248</b>	<b>\$ (1.036)</b>	<b>\$ (275)</b>	<b>\$ 4.646</b>	<b>\$ 104.231</b>
<b>Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup></b>							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.431	\$ –	\$ –	\$ 1.431
US-Dollar	–	–	2.236	(1.459)	–	(31)	746
<b>Gesamt</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 2.236</b>	<b>\$ (28)</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ (31)</b>	<b>\$ 2.177</b>
<b>Legg Mason ClearBridge Value Fund</b>							
Kanadischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 219	\$ 219
Euro	–	–	27.459	31.036	–	(226)	58.269
Japanischer Yen	–	–	8.397	–	–	–	8.397
Singapur-Dollar	–	–	–	2.329	–	1	2.330
US-Dollar	–	–	845.932	(33.992)	–	11.083	823.023
<b>Gesamt</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 881.788</b>	<b>\$ (627)</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 11.077</b>	<b>\$ 892.238</b>
<b>Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund</b>							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ –	\$ –	\$ 1
US-Dollar	–	–	207.470	(1)	–	6.010	213.479
<b>Gesamt</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 207.470</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 6.010</b>	<b>\$ 213.480</b>
<b>Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund</b>							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 54.603	\$ –	\$ –	\$ 54.603
Britisches Pfund	–	–	–	(84)	–	(25)	(109)
Euro	–	–	–	36.993	–	604	37.597
US-Dollar	–	–	1.756.332	(88.618)	–	12.890	1.680.604
<b>Gesamt</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 1.756.332</b>	<b>\$ 2.894</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 13.469</b>	<b>\$ 1.772.695</b>
<b>Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 5.820	\$ –	\$ 2	\$ 5.822
Britisches Pfund	–	–	–	2.236	–	87	2.323
Chinesischer Renminbi	–	–	–	1.334	–	–	1.334
Euro	–	–	–	928	–	58	986
Polnischer Zloty	–	–	–	1.137	–	–	1.137
Singapur-Dollar	–	–	–	2.292	–	–	2.292
Schwedische Krone	–	–	–	22	–	–	22
Schweizer Franke	–	–	–	60	–	–	60
US-Dollar	–	–	536.471	(13.839)	–	1.551	524.183
<b>Gesamt</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 536.471</b>	<b>\$ (10)</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 1.698</b>	<b>\$ 538.159</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnettovermögenswert (in Tsd.)					
<b>Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund</b>												
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	1.154	\$	1.154				
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	9	9					
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	122	122					
Euro	–	–	–	–	–	1.673	1.673					
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	440	440					
US-Dollar	836	–	41.374	(3.407)	–	1.078	39.881					
Gesamt	\$	836	\$	41.374	\$	(18)	\$	1.087	\$	43.279		
<b>Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund<sup>^</sup></b>												
Britisches Pfund	\$	–	\$	–	\$	80.105	\$	(801)	\$	79.304		
Euro	–	–	–	–	–	61.158	–	(304)	60.854			
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	–	–	36	36			
US-Dollar	–	–	1.618.990	(143.217)	–	(16.652)	1.459.121					
Gesamt	\$	–	\$	1.618.990	\$	(1.954)	\$	(17.721)	\$	1.599.315		
<b>Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup></b>												
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	73	\$	–	\$	73		
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	362	–	–	362			
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	491	–	1	492			
Euro	–	–	–	–	–	1.848	–	–	1.848			
Hongkong-Dollar	–	–	–	–	–	242	–	–	242			
Japanischer Yen	–	–	–	–	–	467	–	–	467			
Südkoreanischer Won	–	–	–	–	–	112	–	1	113			
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	342	–	–	342			
Schweizer Franke	–	–	–	–	–	469	–	–	469			
US-Dollar	–	–	–	–	–	9.886	–	1.724	11.610			
Gesamt	\$	–	\$	14.292	\$	–	\$	–	\$	1.726	\$	16.018
<b>Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup></b>												
Australischer Dollar	€	–	€	12.746	€	3.869	€	(2)	€	16.613		
Brasilianischer Real	–	–	–	–	–	5.242	–	–	5.242			
Britisches Pfund	–	–	–	52.025	–	13.891	–	256	66.172			
Kanadischer Dollar	–	–	–	57.019	–	43.209	–	344	100.572			
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	7.466	–	–	7.466			
Dänische Krone	–	–	–	–	–	–	–	40	40			
Euro	–	–	–	181.973	–	(128.367)	–	18.075	71.681			
Japanischer Yen	–	–	–	20.475	–	(2.755)	–	(244)	17.476			
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	4.243	–	–	4.243			
US-Dollar	–	–	–	324.060	–	55.959	–	1.900	381.919			
Gesamt	€	–	€	648.298	€	2.757	€	–	€	20.369	€	671.424
<b>Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund<sup>^</sup></b>												
Brasilianischer Real	\$	–	\$	434	\$	–	\$	–	\$	434		
Chinesischer Renminbi	–	–	–	52	–	–	–	–	52			
Euro	–	–	–	–	–	1.506	–	–	1.506			
Hongkong-Dollar	–	–	–	675	–	–	–	–	675			
Indische Rupie	–	–	–	525	–	–	–	–	525			
Indonesische Rupiah	–	–	–	115	–	–	–	–	115			
Malaysischer Ringgit	–	–	–	124	–	–	–	–	124			
Mexikanischer Peso	–	–	–	496	–	–	–	1	497			
Philippinischer Peso	–	–	–	188	–	–	–	–	188			
Thailändischer Baht	–	–	–	28	–	–	–	–	28			
US-Dollar	–	–	–	30	–	(1.536)	–	27	(1.479)			
Gesamt	\$	–	\$	2.667	\$	(30)	\$	–	\$	28	\$	2.665
<b>Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup></b>												
Australischer Dollar	\$	–	\$	16.494	\$	5.446	\$	–	\$	185	\$	22.125
Brasilianischer Real	–	–	–	5.712	–	–	–	–	5.712			
Britisches Pfund	–	–	–	19.993	–	292	–	132	20.417			
Kanadischer Dollar	–	–	–	20.220	–	–	–	127	20.347			
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	309	–	–	309			
Euro	–	–	–	42.484	–	4.673	–	78	47.235			
Mexikanischer Peso	–	–	–	7.880	–	–	–	–	7.880			
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	27.455	–	(218)	27.237			
US-Dollar	–	–	–	51.350	–	(38.425)	–	9.207	22.132			
Gesamt	\$	–	\$	164.133	\$	(250)	\$	–	\$	9.511	\$	173.394

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnettovermögenswert (in Tsd.)									
<b>Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund</b>																
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	7.254	\$	–	\$	(4)	\$	7.250				
Brasilianischer Real	–	–	–	–	–	16.354	–	–	–	–	–	16.354				
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	1.252	–	–	–	477	–	1.729				
Kanadischer Dollar	–	–	–	6.555	–	–	–	–	–	(2.913)	–	3.642				
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	2.406	–	–	–	–	–	2.406				
Euro	–	–	–	–	–	39.523	–	–	–	12.046	–	51.569				
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	5.274	–	–	–	–	–	5.274				
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	26.304	–	–	–	51	–	26.355				
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	88	–	–	–	(1)	–	87				
US-Dollar	–	–	–	926.975	–	(98.778)	–	–	–	(26.654)	–	801.543				
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	933.530	\$	–	\$	(323)	\$	–	\$	(16.998)	\$	916.209
<b>Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund</b>																
Kanadischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	2.110	\$	–	\$	–	\$	(1)	\$	2.109		
Euro	–	–	–	–	–	–	–	–	–	174	–	174				
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	–	–	–	–	1	–	1				
US-Dollar	–	–	–	–	–	86.350	–	–	–	(179)	–	(520)	85.651			
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	88.460	\$	–	\$	(4)	\$	–	\$	(521)	\$	87.935
<b>Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup></b>																
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	315	\$	–	\$	–	\$	2	\$	317		
Brasilianischer Real	–	–	–	–	–	50	–	–	–	–	–	–	50			
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	499	–	–	–	–	–	–	499			
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	33	–	–	–	–	–	–	33			
Euro	–	–	–	–	–	389	–	–	–	–	–	–	389			
Japanischer Yen	–	–	–	–	–	513	–	–	–	–	–	–	513			
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	62	–	–	–	–	–	–	62			
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	136	–	–	–	–	–	–	136			
Schweizer Franke	–	–	–	–	–	89	–	–	–	–	–	–	89			
US-Dollar	–	–	–	–	–	2.464	–	–	–	–	(18)	–	2.446			
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	4.550	\$	–	\$	–	\$	–	\$	(16)	\$	4.534
<b>Franklin MV European Equity Growth and Income Fund</b>																
Australischer Dollar	€	–	€	–	€	–	€	1.396	€	–	€	–	€	1.396		
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	7.898	–	–	–	–	28	–	7.926			
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	–	–	–	–	156	–	–	156			
Dänische Krone	–	–	–	–	–	1.379	–	–	–	–	–	–	1.412			
Euro	–	–	–	–	–	10.946	–	–	–	(7.520)	–	327	3.753			
Norwegische Krone	–	–	–	–	–	674	–	–	–	–	1	–	675			
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	–	–	–	–	469	–	–	469			
Russischer Rubel	–	–	–	–	–	34	–	–	–	–	–	–	34			
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	–	–	–	–	223	–	(50)	173			
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	1.606	–	–	–	–	–	–	1.606			
Schweizer Franke	–	–	–	–	–	5.297	–	–	–	–	–	–	5.297			
US-Dollar	–	–	–	–	–	–	–	–	–	5.415	–	25	5.440			
Gesamt	€	–	€	–	€	27.834	€	–	€	139	€	–	€	364	€	28.337
<b>Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund</b>																
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	1.981	\$	2.146	\$	–	\$	19	\$	4.146		
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	–	–	–	–	227	–	–	227			
Hongkong-Dollar	–	–	–	–	–	10.706	–	–	–	–	–	–	10.706			
Indische Rupie	–	–	–	–	–	1.964	–	–	–	–	–	–	1.964			
Indonesische Rupiah	–	–	–	–	–	748	–	–	–	–	56	–	804			
Malaysischer Ringgit	–	–	–	–	–	794	–	–	–	–	–	–	794			
Pakistanische Rupie	–	–	–	–	–	185	–	–	–	–	–	–	185			
Philippinischer Peso	–	–	–	–	–	362	–	–	–	–	54	–	416			
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	–	–	–	–	2.324	–	–	2.324			
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	273	–	–	–	34	–	–	307			
Südkoreanischer Won	–	–	–	–	–	3.371	–	–	–	–	–	57	3.428			
Taiwan-Dollar	–	–	–	–	–	4.876	–	–	–	–	1	–	4.877			
Thailändischer Baht	–	–	–	–	–	302	–	–	–	–	–	–	302			
US-Dollar	–	–	–	–	–	335	–	–	–	(4.836)	–	(96)	(4.597)			
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	25.897	\$	–	\$	(105)	\$	–	\$	91	\$	25.883

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkon- trakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnet- tovermög- enswert (in Tsd.)					
<b>Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund</b>												
Australischer Dollar	\$	–	\$	283	\$	456	\$	3	\$	742		
Britisches Pfund	–	–	–	432	–	–	–	6	–	438		
Kanadischer Dollar	–	–	–	152	–	–	–	1	–	153		
Euro	–	–	–	1.098	–	–	–	11	–	1.109		
Hongkong-Dollar	–	–	–	616	–	–	–	1	–	617		
Japanischer Yen	–	–	–	1.014	–	–	–	–	–	1.014		
Malaysischer Ringgit	–	–	–	96	–	–	–	–	–	96		
Singapur-Dollar	–	–	–	–	53	–	–	–	–	53		
Schweizer Franke	–	–	–	412	–	–	–	–	–	412		
Taiwan-Dollar	–	–	–	937	–	–	–	1	–	938		
Türkische Lira	–	–	–	113	–	–	–	12	–	125		
US-Dollar	–	–	–	7.219	(503)	–	–	130	–	6.846		
Gesamt	\$	–	\$	12.372	\$	6	\$	–	\$	165	\$	12.543
<b>Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^</b>												
Hongkong-Dollar	\$	–	\$	6.614	\$	–	\$	–	\$	–	\$	6.614
Indische Rupie	–	–	–	1.901	–	–	–	28	–	1.929		
Indonesische Rupiah	–	–	–	362	–	–	–	–	–	362		
Singapur-Dollar	–	–	–	1.937	–	–	–	–	–	1.937		
Südkoreanischer Won	–	–	–	2.174	–	–	–	24	–	2.198		
Taiwan-Dollar	–	–	–	1.879	–	–	–	–	–	1.879		
US-Dollar	–	–	–	596	–	–	–	603	–	1.199		
Gesamt	\$	–	\$	15.463	\$	–	\$	–	\$	655	\$	16.118
<b>Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^</b>												
Australischer Dollar	\$	–	\$	5.028	\$	(377)	\$	–	\$	377	\$	5.028
Britisches Pfund	–	–	–	889	–	2.460	–	–	–	–	–	3.349
Dänische Krone	–	–	–	5.093	–	–	–	17	–	5.110		
Euro	–	–	–	41.268	–	94.884	–	1.786	–	137.938		
Hongkong-Dollar	–	–	–	14.747	–	(1.083)	–	1.083	–	14.747		
Schwedische Krone	–	–	–	18.215	–	(926)	–	926	–	18.215		
Taiwan-Dollar	–	–	–	10.526	–	–	–	789	–	11.315		
US-Dollar	–	–	–	74.692	–	(96.875)	–	(4.138)	–	(26.321)		
Gesamt	\$	–	\$	170.458	\$	(1.917)	\$	–	\$	840	\$	169.381
<b>Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund</b>												
Australischer Dollar	\$	–	\$	9.168	\$	681	\$	–	\$	143	\$	9.992
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	1	–	–	–	–	–	1
Hongkong-Dollar	–	–	–	6.848	–	–	–	(1)	–	6.847		
Indische Rupie	–	–	–	3.665	–	–	–	(1)	–	3.664		
Malaysischer Ringgit	–	–	–	708	–	–	–	–	–	708		
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	1.154	–	–	–	1	–	1.155		
Philippinischer Peso	–	–	–	1.005	–	–	–	–	–	1.005		
Singapur-Dollar	–	–	–	3.744	–	1.022	–	16	–	4.782		
Thailändischer Baht	–	–	–	1.321	–	–	–	22	–	1.343		
US-Dollar	–	–	–	–	–	(1.703)	–	140	–	(1.563)		
Gesamt	\$	–	\$	27.613	\$	1	\$	–	\$	320	\$	27.934
<b>Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^</b>												
Brasilianischer Real	\$	–	\$	2.427	\$	–	\$	–	\$	3	\$	2.430
Britisches Pfund	–	–	–	906	–	–	–	–	–	906		
Chinesischer Renminbi	–	–	–	2.232	–	–	–	(1)	–	2.231		
Euro	–	–	–	664	–	–	–	–	–	664		
Hongkong-Dollar	–	–	–	9.993	–	–	–	–	–	9.993		
Ungarischer Forint	–	–	–	998	–	–	–	–	–	998		
Indische Rupie	–	–	–	8.569	–	–	–	(148)	–	8.421		
Indonesische Rupiah	–	–	–	1.424	–	–	–	–	–	1.424		
Mexikanischer Peso	–	–	–	368	–	–	–	–	–	368		
Philippinischer Peso	–	–	–	203	–	–	–	(1)	–	202		
Saudi-Rial	–	–	–	911	–	–	–	–	–	911		
Südkoreanischer Won	–	–	–	8.972	–	–	–	51	–	9.023		
Taiwan-Dollar	–	–	–	6.329	–	–	–	–	–	6.329		
US-Dollar	–	–	–	3.643	–	–	–	295	–	3.938		
Gesamt	\$	–	\$	47.639	\$	–	\$	–	\$	199	\$	47.838

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnettovermögenswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>							
Brasilianischer Real	€ –	€ –	€ –	€ 3.169	€ –	€ –	€ 3.169
Britisches Pfund	–	–	11.052	–	–	–	11.052
Dänische Krone	–	–	13.417	–	–	17	13.434
Euro	–	–	203.394	(3.034)	–	808	201.168
Schwedische Krone	–	–	42.376	–	–	1	42.377
Schweizer Franke	–	–	11.864	–	–	–	11.864
US-Dollar	–	–	20.448	77	–	1	20.526
Gesamt	€ –	€ –	€ 302.551	€ 212	€ –	€ 827	€ 303.590

Stand: 28. Februar 2021

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnettovermögenswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund</b>							
US-Dollar	\$ 610.469	\$ 300.007	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (28.146)	\$ 882.330
Gesamt	\$ 610.469	\$ 300.007	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (28.146)	\$ 882.330
<b>Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund</b>							
Chinesischer Renminbi	\$ 79	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 14	\$ 93
Euro	–	–	–	4.290	–	–	4.290
US-Dollar	252.252	57.488	12.610	(4.278)	2.905	(26.230)	294.747
Gesamt	\$ 252.331	\$ 57.488	\$ 12.610	\$ 12	\$ 2.905	\$ (26.216)	\$ 299.130
<b>Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund</b>							
Argentinischer Peso	\$ –	\$ 123	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 12	\$ 135
Australischer Dollar	–	–	–	23.886	–	1	23.887
Brasilianischer Real	5.441	–	–	5.269	152	3.436	14.298
Britisches Pfund	–	–	–	12.046	–	1.763	13.809
Kanadischer Dollar	–	–	–	36.758	–	–	36.758
Chinesischer Renminbi	–	–	–	(27.170)	–	–	(27.170)
Euro	20.796	–	–	40.021	1.739	3.360	65.916
Indische Rupie	–	–	–	2.096	–	–	2.096
Indonesische Rupiah	–	–	–	15.127	–	–	15.127
Japanischer Yen	–	–	–	20.349	172	1.506	22.027
Malaysischer Ringgit	–	–	–	–	–	28	28
Mexikanischer Peso	29.466	–	–	8.372	1.281	568	39.687
Russischer Rubel	21.561	–	–	12.984	–	3.267	37.812
Südafrikanischer Rand	–	–	–	1.934	–	(1)	1.933
US-Dollar	1.223.701	404.738	27.476	(152.439)	9.106	(111.507)	1.401.075
Gesamt	\$ 1.300.965	\$ 404.861	\$ 27.476	\$ (767)	\$ 12.450	\$ (97.567)	\$ 1.647.418
<b>Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund</b>							
Australischer Dollar	€ 897	€ –	€ –	€ (1.192)	€ –	€ 127	€ (168)
Britisches Pfund	1.916	–	–	(2.369)	34	349	(70)
Kanadischer Dollar	–	187	–	(345)	14	155	11
Tschechische Krone	–	–	–	(4)	172	(91)	77
Euro	73.276	15.452	–	14.569	69	4.818	108.184
Ungarischer Forint	–	–	–	2.226	–	–	2.226
Norwegische Krone	–	–	–	1.107	–	–	1.107
Polnischer Zloty	–	–	–	(22)	–	31	9
US-Dollar	10.902	1.021	1.423	(14.115)	138	578	(53)
Gesamt	€ 86.991	€ 16.660	€ 1.423	€ (145)	€ 427	€ 5.967	€ 111.323
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 33	\$ –	\$ –	\$ 33
Kanadischer Dollar	–	–	–	(1)	–	–	(1)
Euro	–	–	–	1.083	–	3	1.086
US-Dollar	21.389	4.161	454	(1.112)	8	415	25.315
Gesamt	\$ 21.389	\$ 4.161	\$ 454	\$ 3	\$ 8	\$ 418	\$ 26.433

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2021 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnettovermögenswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund</b>							
Argentinischer Peso	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Australischer Dollar	5.562	99	–	–	–	945	1.044
Brasilianischer Real	6.978	–	–	–	72.838	171	78.571
Britisches Pfund	10.684	6.736	–	–	6.494	725	14.197
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	358.060	(192)	378.877
Kolumbianischer Peso	56	–	–	–	967	2	969
Tschechische Krone	–	–	–	–	27	28	84
Euro	20.018	19.890	23.804	(23.010)	393	2.123	43.218
Indische Rupie	–	–	–	–	1.451	–	1.451
Indonesische Rupiah	18.448	–	–	–	2.348	1.897	22.693
Japanischer Yen	–	–	–	–	13.341	–	13.341
Mexikanischer Peso	20.708	–	–	–	(1.380)	1.967	21.295
Polnischer Zloty	–	–	–	–	7.097	–	7.097
Russischer Rubel	14.897	–	–	–	3.405	1.597	19.899
Singapur-Dollar	–	–	–	–	(17.339)	(2)	(17.341)
Südafrikanischer Rand	8.365	–	–	–	(7.141)	896	2.120
Schweizer Franke	–	–	–	–	1.973	–	1.973
Türkische Lira	–	–	–	–	6.178	–	6.178
US-Dollar	304.888	107.825	41.403	(417.818)	626	23.275	60.199
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 410.604</b>	<b>\$ 134.550</b>	<b>\$ 65.207</b>	<b>\$ 7.491</b>	<b>\$ 827</b>	<b>\$ 37.252</b>	<b>\$ 655.931</b>
<b>Legg Mason Western Asset US High Yield Fund</b>							
Australischer Dollar	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	3	3
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	1.102	–	1.102
Euro	–	–	–	–	(7)	–	(7)
Mexikanischer Peso	–	–	–	–	1.861	–	1.861
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	2	2
US-Dollar	178.956	33.871	9.414	(3.477)	548	(9)	539
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 178.956</b>	<b>\$ 33.871</b>	<b>\$ 9.414</b>	<b>\$ 27</b>	<b>\$ (72)</b>	<b>\$ (3.069)</b>	<b>\$ 219.127</b>
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund</b>							
Brasilianischer Real	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Britisches Pfund	212	–	–	–	(219)	2	(5)
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	116	–	116
Euro	–	–	–	–	67	–	67
Indische Rupie	206	–	–	–	3.986	2	4.194
Indonesische Rupiah	242	–	–	–	(165)	4	81
Mexikanischer Peso	392	–	–	–	(428)	19	(17)
Russischer Rubel	281	–	–	–	(341)	13	(47)
Saudi-Rial	404	–	–	–	(245)	14	173
Singapur-Dollar	–	–	–	–	(810)	–	(810)
Südafrikanischer Rand	–	–	–	–	5	–	5
Ukrainische Hryvnia	112	–	–	–	–	6	118
US-Dollar	106	–	–	–	–	–	106
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 16.537</b>	<b>\$ 1.716</b>	<b>\$ 2.084</b>	<b>\$ (1.917)</b>	<b>\$ 59</b>	<b>\$ 309</b>	<b>\$ 18.788</b>
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>							
Euro	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Indonesische Rupiah	121	–	–	–	437	1	559
Saudi-Rial	–	–	–	–	(26)	–	(26)
US-Dollar	–	–	–	–	(1.905)	1	(1.904)
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 36.543</b>	<b>\$ 2.772</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 1.495</b>	<b>\$ 71</b>	<b>\$ 723</b>	<b>\$ 41.604</b>
<b>Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund</b>							
Argentinischer Peso	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Australischer Dollar	–	14	–	–	–	1	15
Brasilianischer Real	–	–	–	–	9.401	44	9.445
Britisches Pfund	212	–	–	–	–	18	230
Euro	1.044	1.146	–	–	1.630	28	3.848
Indonesische Rupiah	2.222	–	6.993	–	644	27	9.886
Mexikanischer Peso	871	–	–	–	–	41	912
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	9	9
Russischer Rubel	–	–	–	–	–	6	6
Singapur-Dollar	970	–	–	–	–	145	1.115
Türkische Lira	–	–	–	–	–	–	–
US-Dollar	–	–	–	–	10.246	(12)	10.234
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 79.112</b>	<b>\$ 7.457</b>	<b>\$ 2.668</b>	<b>\$ (21.839)</b>	<b>\$ 52</b>	<b>\$ (590)</b>	<b>\$ 66.860</b>
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 84.431</b>	<b>\$ 8.617</b>	<b>\$ 9.661</b>	<b>\$ 82</b>	<b>\$ 52</b>	<b>\$ (281)</b>	<b>\$ 102.562</b>

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2021 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnettovermögenswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ 379	\$ 364	\$ –	\$ (945)	\$ (7)	\$ 112	\$ (97)
Brasilianischer Real	–	–	–	380	–	–	380
Britisches Pfund	451	290	–	(962)	(23)	137	(107)
Kanadischer Dollar	–	443	–	(539)	6	62	(28)
Tschechische Krone	–	–	–	(24)	37	9	22
Euro	1.773	8.132	–	(9.738)	143	133	443
Ungarischer Forint	–	–	–	484	–	–	484
Japanischer Yen	–	4.688	–	(4.792)	26	80	2
Mexikanischer Peso	892	–	–	(409)	–	90	573
Neuseeländischer Dollar	–	194	–	(720)	–	665	139
Norwegische Krone	–	–	–	31	–	–	31
Polnischer Zloty	–	–	–	(8)	–	9	1
Russischer Rubel	–	–	–	488	–	–	488
Südafrikanischer Rand	816	–	–	–	–	40	856
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	3	3
US-Dollar	1.796	26.169	940	16.810	38	(145)	45.608
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 6.107</b>	<b>\$ 40.280</b>	<b>\$ 940</b>	<b>\$ 56</b>	<b>\$ 220</b>	<b>\$ 1.195</b>	<b>\$ 48.798</b>
<b>Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 33.880	\$ –	\$ 322	\$ 34.202
Chinesischer Renminbi	132.469	–	–	8.189	–	3.365	144.023
Euro	–	–	–	9.681	–	(1)	9.680
Hongkong-Dollar	3.624	964	–	–	–	209	4.797
Indische Rupie	50.347	–	–	–	–	1.148	51.495
Indonesische Rupiah	75.974	–	–	–	–	305	76.279
Malaysischer Ringgit	58.350	–	–	–	–	590	58.940
Philippinischer Peso	55.422	–	–	–	–	335	55.757
Singapur-Dollar	22.013	12.766	4.838	44.833	–	375	84.825
Südkoreanischer Won	93.670	–	–	26.745	(1.119)	2.217	121.513
Schweizer Franke	–	–	–	848	–	–	848
Thailändischer Baht	30.666	–	–	–	–	178	30.844
US-Dollar	39.550	21.889	18.146	(124.814)	(76)	(989)	(46.294)
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 562.085</b>	<b>\$ 35.619</b>	<b>\$ 22.984</b>	<b>\$ (638)</b>	<b>\$ (1.195)</b>	<b>\$ 8.054</b>	<b>\$ 626.909</b>
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.558	\$ –	\$ 1	\$ 1.559
Britisches Pfund	68.923	1.967	–	269.967	371	2.851	344.079
Euro	147.587	12.197	–	(102.776)	(114)	(861)	56.033
Schwedische Krone	–	–	–	314	–	–	314
US-Dollar	218.838	30.818	24.052	(163.062)	118	5.950	116.714
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 435.348</b>	<b>\$ 44.982</b>	<b>\$ 24.052</b>	<b>\$ 6.001</b>	<b>\$ 375</b>	<b>\$ 7.941</b>	<b>\$ 518.699</b>
<b>Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup></b>							
Australischer Dollar	\$ 3.325	\$ –	\$ –	\$ (4.415)	\$ (199)	\$ 433	\$ (856)
Brasilianischer Real	–	–	–	–	–	7	7
Britisches Pfund	13.277	1.467	–	(16.182)	(5)	402	(1.041)
Kanadischer Dollar	3.097	487	–	104.365	(9)	337	108.277
Chinesischer Renminbi	–	–	–	(19.546)	–	–	(19.546)
Tschechische Krone	–	–	–	–	420	(137)	283
Euro	45.166	7.757	–	(7.472)	173	1.002	46.626
Ungarischer Forint	–	–	–	2.728	–	–	2.728
Indonesische Rupiah	7.011	–	–	(1.164)	–	(22)	5.825
Japanischer Yen	7.407	7.860	–	(15.881)	(53)	418	(249)
Mexikanischer Peso	6.989	–	–	(3.301)	–	130	3.818
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	10.113	–	–	10.113
Norwegische Krone	–	–	–	145	–	–	145
Polnischer Zloty	–	–	–	(3)	–	48	45
Russischer Rubel	–	–	–	7.642	–	–	7.642
Südafrikanischer Rand	3.253	–	–	–	–	137	3.390
Südkoreanischer Won	2.293	–	–	(2.339)	–	115	69
Türkische Lira	–	–	–	2.719	–	1	2.720
US-Dollar	134.089	10.867	28.758	(56.993)	617	(1.042)	116.296
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 225.907</b>	<b>\$ 28.438</b>	<b>\$ 28.758</b>	<b>\$ 416</b>	<b>\$ 944</b>	<b>\$ 1.829</b>	<b>\$ 286.292</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2021 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnettovermögenswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>A</sup></b>							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 284	\$ –	\$ –	\$ 284
Britisches Pfund	7.465	2.230	–	(10.168)	18	407	(48)
Euro	21.376	12.540	–	(29.281)	(548)	977	5.064
Mexikanischer Peso	183	–	–	–	–	23	206
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	16	16
Russischer Rubel	159	–	–	–	–	19	178
US-Dollar	31.115	5.259	940	39.082	(125)	754	77.025
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 60.298</b>	<b>\$ 20.029</b>	<b>\$ 940</b>	<b>\$ (83)</b>	<b>\$ (655)</b>	<b>\$ 2.196</b>	<b>\$ 82.725</b>
<b>Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund</b>							
Britisches Pfund	€ 8.038	€ 436	€ –	€ (8.362)	€ –	€ 608	€ 720
Euro	31.847	5.328	–	8.568	252	7.605	53.600
US-Dollar	–	–	336	(311)	–	–	25
<b>Gesamt</b>	<b>€ 39.885</b>	<b>€ 5.764</b>	<b>€ 336</b>	<b>€ (105)</b>	<b>€ 252</b>	<b>€ 8.213</b>	<b>€ 54.345</b>
<b>Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>A</sup></b>							
Australischer Dollar	\$ 103.519	\$ –	\$ –	\$ 95.341	\$ (1.652)	\$ 1.436	\$ 198.644
Brasilianischer Real	86.360	–	–	356.523	(1.207)	58.269	499.945
Britisches Pfund	–	18.485	–	866.340	5.355	39.525	929.705
Kanadischer Dollar	–	–	–	89.653	–	57	89.710
Chinesischer Renminbi	237.733	–	–	22.100	–	4.900	264.733
Ägyptisches Pfund	1.560	–	–	–	–	154	1.714
Euro	66.339	211.163	15.425	1.758.820	77.896	73.231	2.202.874
Indische Rupie	150.420	–	–	60.521	–	38.777	249.718
Indonesische Rupiah	451.164	–	–	(349.780)	–	5.568	106.952
Japanischer Yen	–	–	–	30.334	–	7.821	38.155
Mexikanischer Peso	444.939	–	–	(472.828)	–	38.465	10.576
Norwegische Krone	–	–	–	5.149	–	(25)	5.124
Polnischer Zloty	–	–	–	4.023	–	203	4.226
Russischer Rubel	669.389	–	–	(297.288)	4.852	30.774	407.277
Singapur-Dollar	–	–	–	92.652	–	274	92.926
Südafrikanischer Rand	67.062	–	–	(64.045)	–	5.990	9.007
Schwedische Krone	–	–	–	64.713	–	(35)	64.678
Schweizer Franke	–	–	–	87.473	–	(419)	87.054
Taiwan-Dollar	–	–	–	(143.483)	–	–	(143.483)
US-Dollar	2.654.476	815.765	142.612	(2.154.714)	439.144	(371.188)	1.526.095
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 4.932.961</b>	<b>\$ 1.045.413</b>	<b>\$ 158.037</b>	<b>\$ 51.504</b>	<b>\$ 524.388</b>	<b>\$ (66.223)</b>	<b>\$ 6.646.080</b>
<b>Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>A</sup></b>							
Argentinischer Peso	\$ –	\$ 146	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3	\$ 149
Australischer Dollar	–	–	–	97.376	(340)	618	97.654
Brasilianischer Real	4.456	–	–	(5.408)	131	298	(523)
Britisches Pfund	4.290	494	–	922.295	–	1.255	928.334
Kanadischer Dollar	–	–	–	10.598	–	144	10.742
Euro	2.351	19.631	9.390	28.387	290	1.273	61.322
Indonesische Rupiah	19.637	–	–	(16.566)	–	791	3.862
Japanischer Yen	–	882	–	7.615	–	5	8.502
Mexikanischer Peso	3.246	–	–	5.639	2.325	(895)	10.315
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	(1.185)	–	33	(1.152)
Norwegische Krone	–	–	–	1.642	–	–	1.642
Russischer Rubel	16.429	–	–	8.236	–	648	25.313
Saudi-Rial	–	–	–	(8.542)	–	–	(8.542)
Südafrikanischer Rand	–	–	–	(1)	–	–	(1)
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	10	10
Schweizer Franke	–	–	–	52	–	–	52
Türkische Lira	–	–	–	–	–	26	26
US-Dollar	637.757	310.705	17.991	(1.028.983)	2.939	3.744	(55.847)
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 688.166</b>	<b>\$ 331.858</b>	<b>\$ 27.381</b>	<b>\$ 21.155</b>	<b>\$ 5.345</b>	<b>\$ 7.953</b>	<b>\$ 1.081.858</b>
<b>Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>A</sup></b>							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 12.317	\$ –	\$ (1)	\$ 12.316
Euro	–	–	–	264.323	–	2.856	267.179
Japanischer Yen	–	–	–	56.627	–	–	56.627
Schweizer Franke	–	–	–	1.967	–	–	1.967
US-Dollar	145.600	880.672	59.043	(335.134)	(1.897)	18.789	767.073
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 145.600</b>	<b>\$ 880.672</b>	<b>\$ 59.043</b>	<b>\$ 100</b>	<b>\$ (1.897)</b>	<b>\$ 21.644</b>	<b>\$ 1.105.162</b>

<sup>A</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2021 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkon- trakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnet- tovermö- genswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup></b>							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3.445	\$ –	\$ –	\$ 3.445
US-Dollar	802.205	96.810	74.145	(3.436)	(358)	(149.395)	819.971
Gesamt	\$ 802.205	\$ 96.810	\$ 74.145	\$ 9	\$ (358)	\$ (149.395)	\$ 823.416
<b>Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup></b>							
Britisches Pfund	£ 64.100	£ 7.222	£ –	£ 4.046	£ (18)	£ 1.377	£ 76.727
Euro	330	341	–	(880)	7	247	45
US-Dollar	2.161	341	–	(3.117)	(16)	544	(87)
Gesamt	£ 66.591	£ 7.904	£ –	£ 49	£ (27)	£ 2.168	£ 76.685
<b>Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>							
Britisches Pfund	\$ 719	\$ –	\$ –	\$ 163.302	\$ 8	\$ 101	\$ 164.130
Euro	190	–	–	1.207	4	17	1.418
Mexikanischer Peso	–	–	–	577	–	–	577
Russischer Rubel	247	–	–	–	–	4	251
US-Dollar	144.242	33.177	10.216	(161.606)	(145)	(664)	25.220
Gesamt	\$ 145.398	\$ 33.177	\$ 10.216	\$ 3.480	\$ (133)	\$ (542)	\$ 191.596
<b>Western Asset UCITS SMA5h Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup></b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 667	\$ –	\$ –	\$ 667
Brasilianischer Real	117	–	–	244	–	2	363
Britisches Pfund	–	–	–	629	–	–	629
Kanadischer Dollar	–	–	–	1.285	–	(1)	1.284
Chinesischer Renminbi	–	–	–	(568)	–	–	(568)
Euro	–	–	–	(908)	38	179	(691)
Indonesische Rupiah	84	–	–	402	–	2	488
Japanischer Yen	–	–	–	857	–	–	857
Mexikanischer Peso	749	–	–	335	–	13	1.097
Russischer Rubel	519	–	–	450	–	8	977
US-Dollar	17.059	5.158	1.473	(3.445)	445	(3.600)	17.090
Gesamt	\$ 18.528	\$ 5.158	\$ 1.473	\$ (52)	\$ 483	\$ (3.397)	\$ 22.193
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ 17.148	\$ –	\$ –	\$ (8.667)	\$ –	\$ 135	\$ 8.616
Brasilianischer Real	8.238	–	–	–	–	(264)	7.974
Britisches Pfund	54.203	–	–	68.099	–	926	123.228
Kanadischer Dollar	–	–	–	16.665	–	–	16.665
Chilenischer Peso	–	–	–	25.444	–	–	25.444
Kolumbianischer Peso	15.689	–	–	772	–	599	17.060
Tschechische Krone	–	–	–	14.230	–	–	14.230
Dänische Krone	–	–	–	(578)	–	–	(578)
Euro	–	–	–	91.390	–	120	91.510
Ungarischer Forint	–	–	–	13.635	–	–	13.635
Indische Rupie	–	–	–	10.711	–	–	10.711
Indonesische Rupiah	14.039	–	–	–	–	188	14.227
Israelischer Schekel	–	–	–	(508)	–	–	(508)
Japanischer Yen	–	–	–	(22.881)	–	–	(22.881)
Malaysischer Ringgit	5.385	–	–	11.146	–	69	16.600
Mexikanischer Peso	39.884	–	–	(882)	–	611	39.613
Norwegische Krone	–	–	–	19.031	–	–	19.031
Polnischer Zloty	2.772	–	–	19.104	–	761	22.637
Russischer Rubel	4.817	–	–	10.737	–	22	15.576
Singapur-Dollar	–	–	–	(483)	–	–	(483)
Südafrikanischer Rand	13.002	–	–	(12.368)	–	675	1.309
Südkoreanischer Won	–	–	–	20.899	–	(1)	20.898
Schwedische Krone	–	–	–	(374)	–	–	(374)
US-Dollar	26.962	152.584	15.295	(273.737)	–	(7.337)	(86.233)
Gesamt	\$ 202.139	\$ 152.584	\$ 15.295	\$ 1.385	\$ –	\$ (3.496)	\$ 367.907

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2021 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnettovermögenswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 368.481	\$ –	\$ –	\$ 368.481
Brasilianischer Real	21.753	–	–	(22.782)	–	242	(787)
Britisches Pfund	–	–	–	74.332	545	(5)	74.872
Chilenischer Peso	–	–	–	66.770	–	–	66.770
Kolumbianischer Peso	29.845	–	–	25.524	–	1.093	56.462
Euro	–	6.103	–	66.660	–	–	72.763
Indische Rupie	–	–	–	57.973	–	–	57.973
Indonesische Rupiah	27.151	–	–	(27.384)	–	214	(19)
Japanischer Yen	–	–	–	(107.521)	–	(1)	(107.522)
Mexikanischer Peso	32.823	–	–	3.300	–	539	36.662
Polnischer Zloty	–	–	–	115.139	–	471	115.610
Russischer Rubel	–	–	–	29.291	–	–	29.291
Singapur-Dollar	–	–	–	134.257	–	–	134.257
Südafrikanischer Rand	34.612	–	–	(34.334)	–	1.374	1.652
Südkoreanischer Won	–	–	–	36.703	–	(1)	36.702
Schwedische Krone	–	–	–	176	–	–	176
Schweizer Franke	–	–	–	(116.680)	–	–	(116.680)
US-Dollar	115.864	414.080	42.056	(655.090)	–	(14.899)	(97.989)
Gesamt	\$ 262.048	\$ 420.183	\$ 42.056	\$ 14.815	\$ 545	\$ (10.973)	\$ 728.674
<b>Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup></b>							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 119	\$ –	\$ –	\$ 119
Kanadischer Dollar	121	–	–	11.245	–	2	11.368
Kolumbianischer Peso	–	–	–	224	–	–	224
Euro	118	–	–	(1.442)	165	(19)	(1.178)
Mexikanischer Peso	–	–	–	228	–	–	228
Schwedische Krone	–	–	–	(2)	–	–	(2)
Schweizer Franke	–	–	–	(4)	–	–	(4)
US-Dollar	10.594	838	216	(10.346)	91	(89)	1.304
Gesamt	\$ 10.833	\$ 838	\$ 216	\$ 22	\$ 256	\$ (106)	\$ 12.059
<b>Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund</b>							
Australischer Dollar	\$ 13.019	\$ –	\$ –	\$ (1.548)	\$ –	\$ 77	\$ 11.548
Brasilianischer Real	18.652	–	–	7.361	–	209	26.222
Britisches Pfund	84.893	–	–	(9.242)	–	700	76.351
Kanadischer Dollar	–	–	–	13.983	–	–	13.983
Chilenischer Peso	–	–	–	40.703	–	–	40.703
Kolumbianischer Peso	26.250	–	–	–	–	648	26.898
Tschechische Krone	–	–	–	21.972	–	–	21.972
Dänische Krone	–	–	–	(1.002)	–	–	(1.002)
Euro	–	119	–	(80.166)	–	60	(79.987)
Ungarischer Forint	–	–	–	21.318	–	–	21.318
Indische Rupie	–	–	–	16.749	–	–	16.749
Indonesische Rupiah	20.598	–	–	–	–	257	20.855
Israelischer Schekel	–	–	–	(881)	–	–	(881)
Japanischer Yen	–	–	–	(39.661)	–	–	(39.661)
Malaysischer Ringgit	21.424	–	–	2.283	–	323	24.030
Mexikanischer Peso	54.120	–	–	6.684	–	882	61.686
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	226.957	–	–	226.957
Norwegische Krone	–	–	–	17.509	–	–	17.509
Polnischer Zloty	5.871	–	–	28.555	–	720	35.146
Russischer Rubel	2.862	–	–	21.684	–	72	24.618
Singapur-Dollar	–	–	–	(836)	–	38	(798)
Südafrikanischer Rand	27.844	–	–	(27.368)	–	1.450	1.926
Südkoreanischer Won	–	–	–	33.427	–	–	33.427
Schwedische Krone	–	–	–	(647)	–	–	(647)
US-Dollar	87.066	195.411	32.385	(298.974)	(723)	(8.366)	6.799
Gesamt	\$ 362.599	\$ 195.530	\$ 32.385	\$ (1.140)	\$ (723)	\$ (2.930)	\$ 585.721
<b>Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund<sup>^</sup></b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 78.220	\$ –	\$ 418	\$ 78.638
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	121	121
Euro	–	–	–	900	–	1	901
Indonesische Rupiah	–	–	–	–	–	43	43
Südafrikanischer Rand	–	–	–	–	–	180	180
US-Dollar	–	–	–	(80.126)	–	243	(79.883)
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (1.006)	\$ –	\$ 1.006	\$ –

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2021 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnettovermögenswert (in Tsd.)
<b>Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund</b>							
Brasilianischer Real	\$ 2.917	\$ –	\$ –	\$ (2.294)	\$ –	\$ 16	\$ 639
Britisches Pfund	–	1.668	–	39.990	234	(78)	41.814
Kanadischer Dollar	3.645	–	–	(3.159)	–	68	554
Chilenischer Peso	–	–	–	8.822	–	–	8.822
Kolumbianischer Peso	–	–	–	6.128	–	–	6.128
Ägyptisches Pfund	9.723	–	–	–	–	5.976	15.699
Euro	–	–	–	150.377	7.647	(3.123)	154.901
Mexikanischer Peso	2.785	–	–	3.817	–	13	6.615
Russischer Rubel	2.906	–	–	(2.600)	–	13	319
Singapur-Dollar	–	–	–	17.588	–	(75)	17.513
Schwedische Krone	–	–	–	18.405	–	(51)	18.354
Schweizer Franke	–	–	–	68	–	–	68
US-Dollar	293.533	74.881	35.025	(236.895)	2.415	12.900	181.859
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 315.509</b>	<b>\$ 76.549</b>	<b>\$ 35.025</b>	<b>\$ 247</b>	<b>\$ 10.296</b>	<b>\$ 15.659</b>	<b>\$ 453.285</b>
<b>Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^</b>							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.983	\$ –	\$ –	\$ 1.983
Britisches Pfund	–	–	–	1.031	41	–	1.072
Kanadischer Dollar	–	–	–	511	–	–	511
Chilenischer Peso	–	–	–	1.023	–	–	1.023
Chinesischer Renminbi	–	–	–	508	–	–	508
Euro	–	2.115	–	(1.869)	–	–	246
Malaysischer Ringgit	–	–	–	516	–	–	516
Mexikanischer Peso	–	–	–	735	–	–	735
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	513	–	–	513
Norwegische Krone	–	–	–	508	–	(1)	507
Polnischer Zloty	–	–	–	513	–	–	513
Russischer Rubel	–	–	–	769	–	–	769
US-Dollar	11.918	31.467	6.152	(6.837)	26	398	43.124
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 11.918</b>	<b>\$ 33.582</b>	<b>\$ 6.152</b>	<b>\$ (96)</b>	<b>\$ 67</b>	<b>\$ 397</b>	<b>\$ 52.020</b>
<b>Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^</b>							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (47)	\$ –	\$ –	\$ (47)
Kanadischer Dollar	117	–	–	(52)	–	2	67
Kolumbianischer Peso	–	–	–	216	–	–	216
Euro	130	–	–	9.890	153	43	10.216
Mexikanischer Peso	–	–	–	223	–	–	223
US-Dollar	10.548	428	430	(10.232)	62	(137)	1.099
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 10.795</b>	<b>\$ 428</b>	<b>\$ 430</b>	<b>\$ (2)</b>	<b>\$ 215</b>	<b>\$ (92)</b>	<b>\$ 11.774</b>
<b>Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^</b>							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 376.437	\$ –	\$ –	\$ 376.437
Brasilianischer Real	23.208	–	–	3.755	–	239	27.202
Britisches Pfund	–	–	–	54.806	–	–	54.806
Chilenischer Peso	–	–	–	6.568	–	–	6.568
Chinesischer Renminbi	–	–	–	31.108	–	–	31.108
Kolumbianischer Peso	15.533	–	–	14.738	–	565	30.836
Tschechische Krone	–	–	–	12.864	–	–	12.864
Euro	–	–	–	(6.536)	998	(7)	(5.545)
Indonesische Rupiah	33.622	–	–	(5.577)	–	288	28.333
Malaysischer Ringgit	15.010	–	–	22.759	–	237	38.006
Mexikanischer Peso	69.130	–	–	(11.428)	–	1.124	58.826
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	8.692	–	–	8.692
Norwegische Krone	–	–	–	36.422	–	–	36.422
Polnischer Zloty	–	–	–	32.835	–	1	32.836
Russischer Rubel	10.387	–	–	32.995	–	264	43.646
Singapur-Dollar	–	–	–	5.404	–	5	5.409
Südafrikanischer Rand	34.194	–	–	(5.827)	–	1.813	30.180
Südkoreanischer Won	–	–	–	17.990	–	–	17.990
US-Dollar	35.666	113.569	16.560	(624.610)	(1.176)	16.671	(443.320)
<b>Gesamt</b>	<b>\$ 236.750</b>	<b>\$ 113.569</b>	<b>\$ 16.560</b>	<b>\$ 3.395</b>	<b>\$ (178)</b>	<b>\$ 21.200</b>	<b>\$ 391.296</b>
<b>Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^</b>							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.398	\$ –	\$ –	\$ 1.398
US-Dollar	–	–	1.903	(1.395)	–	(27)	481
<b>Gesamt</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 1.903</b>	<b>\$ 3</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ (27)</b>	<b>\$ 1.879</b>

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2021 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtvermögenswert (in Tsd.)			
<b>Legg Mason ClearBridge Value Fund</b>										
Euro	\$	–	\$	15.235	\$	35	\$	(474)	\$	14.796
Singapur-Dollar	–	–	–	–	405	–	–	(21)	–	384
US-Dollar	–	–	–	478.184	(441)	–	–	16.162	–	493.905
Gesamt	\$	–	\$	493.419	\$	(1)	\$	15.667	\$	509.085
<b>Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund</b>										
Euro	\$	–	\$	–	\$	–	\$	479	\$	479
US-Dollar	–	–	–	203.955	–	–	–	1.574	–	205.529
Gesamt	\$	–	\$	203.955	\$	–	\$	2.053	\$	206.008
<b>Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund</b>										
Brasilianischer Real	\$	–	\$	–	\$	40.093	\$	(3.926)	\$	36.167
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	–	–	(459)	–	(459)
Euro	–	–	–	–	–	57.166	–	13.706	–	70.872
US-Dollar	–	–	–	1.810.957	(98.466)	–	–	(8.019)	–	1.704.472
Gesamt	\$	–	\$	1.810.957	\$	(1.207)	\$	1.302	\$	1.811.052
<b>Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund</b>										
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	14.855	\$	(110)	\$	14.745
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	1.165	–	311	–	1.476
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	872	–	–	–	872
Euro	–	–	–	–	–	2.143	–	(18)	–	2.125
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	1.324	–	–	–	1.324
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	3.168	–	–	–	3.168
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	33	–	–	–	33
Schweizer Franke	–	–	–	–	–	71	–	–	–	71
US-Dollar	–	–	–	789.786	(23.522)	–	–	620	–	766.884
Gesamt	\$	–	\$	789.786	\$	109	\$	803	\$	790.698
<b>Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund</b>										
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	1.354	\$	–	\$	1.354
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	–	–	5	–	5
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	96	–	–	–	96
Euro	–	–	–	–	–	1.601	–	–	–	1.601
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	159	–	–	–	159
US-Dollar	–	993	–	36.040	–	(3.196)	–	1.637	–	35.474
Gesamt	\$	993	\$	36.040	\$	14	\$	1.642	\$	38.689
<b>Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^</b>										
Britisches Pfund	\$	–	\$	–	\$	85.178	\$	(2.396)	\$	82.782
Euro	–	–	–	–	–	14.006	–	(316)	–	13.690
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	–	–	72	–	72
US-Dollar	–	–	–	635.560	(97.488)	–	–	10.608	–	548.680
Gesamt	\$	–	\$	635.560	\$	1.696	\$	7.968	\$	645.224
<b>Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^</b>										
Australischer Dollar	\$	–	\$	86	\$	–	\$	–	\$	86
Britisches Pfund	–	–	–	501	–	–	–	(1)	–	500
Kanadischer Dollar	–	–	–	141	–	–	–	1	–	142
Dänische Krone	–	–	–	105	–	–	–	–	–	105
Euro	–	–	–	1.033	–	–	–	1	–	1.034
Hongkong-Dollar	–	–	–	198	–	–	–	–	–	198
Japanischer Yen	–	–	–	727	–	–	–	–	–	727
Südkoreanischer Won	–	–	–	171	–	–	–	3	–	174
Schwedische Krone	–	–	–	30	–	–	–	–	–	30
Schweizer Franke	–	–	–	277	–	–	–	–	–	277
US-Dollar	–	–	–	7.658	–	–	–	158	–	7.816
Gesamt	\$	–	\$	10.927	\$	–	\$	162	\$	11.089

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2021 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkon- trakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnet- tovermö- genswert (in Tsd.)					
<b>Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup></b>												
Australischer Dollar	€	–	€	44.200	€	(7.070)	€	(1)	€	37.129		
Brasilianischer Real	–	–	–	–	–	3.298	–	–	–	3.298		
Britisches Pfund	–	–	–	31.557	–	61.757	–	619	–	93.933		
Kanadischer Dollar	–	–	–	19.008	–	37.198	–	273	–	56.479		
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	3.440	–	(9)	–	3.431		
Dänische Krone	–	–	–	18.482	–	–	–	15	–	18.497		
Euro	–	–	–	193.595	–	(127.904)	–	(3.473)	–	62.218		
Japanischer Yen	–	–	–	12.729	–	(888)	–	–	–	11.841		
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	1.451	–	(1)	–	1.450		
US-Dollar	–	–	–	287.980	–	28.390	–	367	–	316.737		
Gesamt	€	–	€	607.551	€	(328)	€	–	€	(2.210)	€	605.013
<b>Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund<sup>^</sup></b>												
Brasilianischer Real	\$	–	\$	369	\$	–	\$	–	\$	(6)	\$	363
Chilenischer Peso	–	–	–	47	–	–	–	–	–	(1)	–	46
Chinesischer Renminbi	–	–	–	64	–	–	–	–	–	–	–	64
Euro	–	–	–	–	–	1.705	–	–	–	–	–	1.705
Hongkong-Dollar	–	–	–	611	–	–	–	–	–	–	–	611
Indische Rupie	–	–	–	723	–	–	–	–	–	(3)	–	720
Indonesische Rupiah	–	–	–	114	–	–	–	–	–	(3)	–	111
Malaysischer Ringgit	–	–	–	146	–	–	–	–	–	–	–	146
Mexikanischer Peso	–	–	–	422	–	–	–	–	–	–	–	422
Philippinischer Peso	–	–	–	161	–	–	–	–	–	–	–	161
Thailändischer Baht	–	–	–	69	–	–	–	–	–	(2)	–	67
US-Dollar	–	–	–	–	–	(1.701)	–	–	–	10	–	(1.691)
Gesamt	\$	–	\$	2.726	\$	4	\$	–	\$	(5)	\$	2.725
<b>Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund</b>												
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	12.923	\$	–	\$	(354)	\$	12.569
Brasilianischer Real	–	–	–	–	–	4.975	–	–	–	–	–	4.975
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	694	–	–	–	(371)	–	323
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	5.038	–	–	–	(1.022)	–	4.016
Euro	–	–	–	–	–	74.560	–	–	–	(6.870)	–	67.690
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	3.182	–	–	–	–	–	3.182
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	34.973	–	–	–	(797)	–	34.176
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	711	–	–	–	(135)	–	576
US-Dollar	–	–	–	1.248.814	–	(137.164)	–	–	–	49.713	–	1.161.363
Gesamt	\$	–	\$	1.248.814	\$	(108)	\$	–	\$	40.164	\$	1.288.870
<b>Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund</b>												
Kanadischer Dollar	\$	–	\$	3.451	\$	–	\$	–	\$	(48)	\$	3.403
Euro	–	–	–	–	–	1.284	–	–	–	(836)	–	448
Norwegische Krone	–	–	–	745	–	–	–	–	–	5	–	750
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	10	–	–	–	(1)	–	9
US-Dollar	–	–	–	85.907	–	(1.294)	–	–	–	1.873	–	86.486
Gesamt	\$	–	\$	90.103	\$	–	\$	–	\$	993	\$	91.096
<b>Franklin MV European Equity Growth and Income Fund</b>												
Australischer Dollar	€	–	€	–	€	1.661	€	–	€	1	€	1.662
Britisches Pfund	–	–	–	8.229	–	–	–	–	–	40	–	8.269
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	42	–	–	–	–	–	42
Dänische Krone	–	–	–	2.028	–	–	–	–	–	42	–	2.070
Euro	–	–	–	13.760	–	(6.689)	–	–	–	251	–	7.322
Norwegische Krone	–	–	–	445	–	–	–	–	–	–	–	445
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	195	–	–	–	–	–	195
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	106	–	–	–	(1)	–	105
Schwedische Krone	–	–	–	1.779	–	–	–	–	–	–	–	1.779
Schweizer Franke	–	–	–	6.765	–	–	–	–	–	–	–	6.765
US-Dollar	–	–	–	–	–	4.677	–	–	–	37	–	4.714
Gesamt	€	–	€	33.006	€	(8)	€	–	€	370	€	33.368

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2021 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkon- trakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnet- tovermö- genswert (in Tsd.)									
<b>Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund</b>																
Australischer Dollar	\$	–	\$	1.714	\$	3.458	\$	11	\$	5.183						
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	224	–	–	–	224						
Euro	–	–	–	–	–	–	–	8	–	8						
Hongkong-Dollar	–	–	–	14.079	–	32	–	12	–	14.123						
Indische Rupie	–	–	–	2.299	–	–	–	327	–	2.626						
Indonesische Rupiah	–	–	–	709	–	–	–	129	–	838						
Malaysischer Ringgit	–	–	–	908	–	–	–	–	–	908						
Pakistanische Rupie	–	–	–	243	–	–	–	44	–	287						
Philippinischer Peso	–	–	–	656	–	–	–	123	–	779						
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	3.092	–	–	–	3.092						
Singapur-Dollar	–	–	–	266	–	79	–	–	–	350						
Südkoreanischer Won	–	–	–	3.537	–	–	–	100	–	3.637						
Taiwan-Dollar	–	–	–	5.630	–	–	–	358	–	5.988						
Thailändischer Baht	–	–	–	314	–	–	–	–	–	314						
US-Dollar	–	–	–	287	–	(6.871)	–	–	(736)	(7.320)						
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	30.642	\$	14	\$	–	\$	381	\$	31.037		
<b>Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup></b>																
Brasilianischer Real	\$	–	\$	–	\$	444	\$	–	\$	–	\$	(17)	\$	427		
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	–	–	–	–	1	–	–	–	1		
Chilenescher Peso	–	–	–	393	–	–	–	–	–	2	–	–	–	395		
Chinesischer Renminbi	–	–	–	1.010	–	–	–	–	–	(3)	–	–	–	1.007		
Kolumbianischer Peso	–	–	–	84	–	–	–	–	–	3	–	–	–	87		
Ägyptisches Pfund	–	–	–	61	–	–	–	–	–	–	–	–	–	61		
Euro	–	–	–	97	–	–	–	–	–	–	–	–	–	97		
Hongkong-Dollar	–	–	–	2.990	–	–	–	–	–	6	–	–	–	2.996		
Ungarischer Forint	–	–	–	88	–	–	–	–	–	–	–	–	–	88		
Indische Rupie	–	–	–	1.232	–	–	–	–	–	(29)	–	–	–	1.203		
Indonesische Rupiah	–	–	–	573	–	–	–	–	–	1	–	–	–	574		
Malaysischer Ringgit	–	–	–	968	–	–	–	–	–	5	–	–	–	973		
Mexikanischer Peso	–	–	–	434	–	–	–	–	–	1	–	–	–	435		
Philippinischer Peso	–	–	–	423	–	–	–	–	–	4	–	–	–	427		
Polnischer Zloty	–	–	–	231	–	–	–	–	–	1	–	–	–	232		
Qatari Riyal	–	–	–	97	–	–	–	–	–	1	–	–	–	98		
Russischer Rubel	–	–	–	11	–	–	–	–	–	1	–	–	–	12		
Südafrikanischer Rand	–	–	–	503	–	–	–	–	–	–	–	–	–	503		
Südkoreanischer Won	–	–	–	1.177	–	–	–	–	–	15	–	–	–	1.192		
Taiwan-Dollar	–	–	–	1.070	–	–	–	–	–	–	–	–	–	1.070		
Thailändischer Baht	–	–	–	1.032	–	–	–	–	–	3	–	–	–	1.035		
Türkische Lira	–	–	–	252	–	–	–	–	–	3	–	–	–	255		
Vereinigte Arab. Emirate Dirham	–	–	–	319	–	–	–	–	–	2	–	–	–	321		
US-Dollar	–	–	–	1.157	–	–	–	–	13	–	–	–	–	1.250		
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	14.646	\$	–	\$	13	\$	–	\$	80	\$	14.739
<b>Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund</b>																
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	314	\$	691	\$	–	\$	–	\$	1.005		
Brasilianischer Real	–	–	–	81	–	–	–	–	–	–	–	–	–	81		
Britisches Pfund	–	–	–	464	–	–	–	–	–	6	–	–	–	470		
Kanadischer Dollar	–	–	–	349	–	–	–	–	–	2	–	–	–	351		
Euro	–	–	–	1.820	–	–	–	–	–	15	–	–	–	1.835		
Hongkong-Dollar	–	–	–	796	–	–	–	–	–	(1)	–	–	–	795		
Japanischer Yen	–	–	–	1.390	–	–	–	–	–	1	–	–	–	1.391		
Malaysischer Ringgit	–	–	–	202	–	–	–	–	–	–	–	–	–	202		
Singapur-Dollar	–	–	–	17	–	–	–	–	–	33	–	–	–	50		
Schwedische Krone	–	–	–	60	–	–	–	–	–	2	–	–	–	62		
Schweizer Franke	–	–	–	472	–	–	–	–	–	–	–	–	–	472		
Taiwan-Dollar	–	–	–	798	–	–	–	–	–	–	–	–	–	798		
Türkische Lira	–	–	–	111	–	–	–	–	–	–	–	–	–	111		
US-Dollar	–	–	–	5.814	–	–	–	–	–	(719)	–	–	–	5.062		
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	12.688	\$	5	\$	–	\$	–	\$	(8)	\$	12.685
<b>Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>																
Hongkong-Dollar	\$	–	\$	–	\$	34.874	\$	–	\$	–	\$	–	\$	1	\$	34.875
Indische Rupie	–	–	–	10.069	–	–	–	–	–	–	–	–	–	1	10.070	
Singapur-Dollar	–	–	–	7.142	–	–	–	–	–	–	–	–	–	(1)	7.141	
Südkoreanischer Won	–	–	–	14.275	–	–	–	–	–	–	–	–	–	243	14.518	
Taiwan-Dollar	–	–	–	8.150	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	8.150	
US-Dollar	–	–	–	2.581	–	–	–	–	–	–	–	–	–	2.745	5.326	
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	77.091	\$	–	\$	–	\$	–	\$	2.989	\$	80.080

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2021 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinsliche Wertpapiere (in Tsd.)	Investitionen in nicht zinstragende Wertpapiere (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/ (Verbindlichkeiten) (in Tsd.)	Gesamtnettovermögenswert (in Tsd.)	
<b>Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup></b>								
Brasilianischer Real	€	–	€	–	€	2.187	€	2.187
Britisches Pfund	–	–	–	2.330	–	(1.082)	–	1.193
Dänische Krone	–	–	–	4.868	–	(4.903)	–	1
Euro	–	–	–	16.442	–	(3.550)	(341)	4.127
Ungarischer Forint	–	–	–	1.419	–	(1.375)	–	44
Norwegische Krone	–	–	–	1.573	–	(1.811)	–	(418)
Schwedische Krone	–	–	–	1.339	–	(409)	4	126
Schweizer Franke	–	–	–	6.974	–	(7.153)	–	(16)
Türkische Lira	–	–	–	1.592	–	(1.555)	–	37
US-Dollar	–	–	–	–	–	19.712	–	68
Gesamt	€	–	€	–	€	36.537	€	61
								(415)
								€
								4.160
								€
								40.343
<b>Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>								
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	2.864	\$	–
Britisches Pfund	–	–	–	881	–	1.615	–	(1)
Dänische Krone	–	–	–	2.879	–	–	–	10
Euro	–	–	–	22.060	–	–	–	1
Hongkong-Dollar	–	–	–	10.729	–	–	–	–
Schwedische Krone	–	–	–	10.076	–	–	–	–
Taiwan-Dollar	–	–	–	6.100	–	–	–	–
US-Dollar	–	–	–	43.337	–	(1.579)	–	5.377
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	98.926	\$	36
								\$
								–
								5.387
								\$
								104.349
<b>Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund</b>								
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	9.143	\$	385
Chinesischer Renminbi	–	–	–	691	–	1	–	–
Hongkong-Dollar	–	–	–	6.036	–	–	–	30
Indische Rupie	–	–	–	3.050	–	–	–	12
Malaysischer Ringgit	–	–	–	1.148	–	–	–	6
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	1.116	–	–	–	–
Philippinischer Peso	–	–	–	562	–	–	–	–
Singapur-Dollar	–	–	–	3.743	–	1.031	–	28
Thailändischer Baht	–	–	–	832	–	–	–	18
US-Dollar	–	–	–	–	–	(1.415)	–	40
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	26.321	\$	2
								\$
								–
								253
								\$
								26.576
<b>Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup></b>								
Brasilianischer Real	\$	–	\$	–	\$	726	\$	–
Britisches Pfund	–	–	–	579	–	–	–	–
Chinesischer Renminbi	–	–	–	1.270	–	–	–	–
Euro	–	–	–	1.133	–	–	–	–
Hongkong-Dollar	–	–	–	12.526	–	–	–	–
Ungarischer Forint	–	–	–	796	–	–	–	–
Indische Rupie	–	–	–	4.459	–	–	–	(126)
Indonesische Rupiah	–	–	–	908	–	–	–	–
Mexikanischer Peso	–	–	–	238	–	–	–	–
Philippinischer Peso	–	–	–	159	–	–	–	–
Südkoreanischer Won	–	–	–	7.312	–	–	–	105
Taiwan-Dollar	–	–	–	5.376	–	–	–	–
Türkische Lira	–	–	–	184	–	–	–	–
US-Dollar	–	–	–	5.312	–	–	–	843
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	40.978	\$	–
								\$
								–
								823
								\$
								41.801
<b>Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>								
Britisches Pfund	€	–	€	–	€	5.203	€	–
Dänische Krone	–	–	–	3.140	–	–	–	1
Euro	–	–	–	71.509	–	–	–	3.069
Schwedische Krone	–	–	–	14.828	–	–	–	–
Schweizer Franke	–	–	–	6.089	–	–	–	–
US-Dollar	–	–	–	7.531	–	–	–	1
Gesamt	€	–	€	–	€	108.300	€	–
								€
								3.071
								€
								111.371

Einige Fonds verfügen auch über Anteilsklassen, die auf Fremdwährungen lauten. Bestimmte Fonds (wie im entsprechenden Nachtrag zum Verkaufsprospekt angegeben) können in lieferbare oder nicht lieferbare Devisenterminkontrakte einfließen, um das Risiko von Wechselkursschwankungen abzusichern, um die Exposition gegenüber einer Währung zu erhöhen, um die Exposition gegenüber Währungsschwankungen von einer Währung in die andere zu verändern oder die Rendite zu verbessern. Jeder festverzinsliche Fonds kann auch Optionen für lieferbare oder nicht lieferbare Devisenterminkontrakte abschließen, die dem Fonds gegen eine Prämie die Option, aber nicht die Verpflichtung, bieten, einen solchen Vertrag zu einem bestimmten Zeitpunkt vor einem bestimmten Datum abzuschließen.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Sensitivitätsanalyse in Bezug auf das Fremdwährungsrisiko und dessen Auswirkung auf den Nettoinventarwert der Fonds, sofern das Fremdwährungsrisiko als erheblich eingestuft wird. Eine Momentaufnahme der zugrunde liegenden Positionen für alle Fonds wurde zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 erstellt. Die Wechselkurse wurden um +/- 5 % erhöht/ gesenkt (aufgrund der Beschaffenheit der Märkte, in denen die Fonds anlegen, wurde eine 5%-ige Erhöhung/Senkung vorgenommen); es wurde eine Schätzung der entsprechenden Auswirkung auf den Gesamt Nettoinventarwert vorgenommen. Des Weiteren wird angenommen, dass auch alle anderen Marktparameter unverändert bleiben.

		Auswirkungen auf den Nettoinventarwert aufgrund von Wechselkursschwankungen* (Betrag in Fondsbasiswährung) (in Tsd.)			
Fonds	Währung	Montag, 28. Februar 2022		Sonntag, 28. Februar 2021	
		Positiv 5 %	Negativ 5 %	Positiv 5 %	Negativ 5 %
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Australischer Dollar	4.916	(4.448)	4.135	(3.741)
	Britisches Pfund	2.826	(2.557)	19.941	(18.042)
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	Euro	454	(411)	n/a	n/a
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	Euro	n/a	n/a	221	(200)
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	Euro	433	(392)	n/a	n/a
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Chinesischer Renminbi	6.827	(6.177)	7.580	(6.858)
	Indonesische Rupiah	3.741	(3.385)	4.015	(3.632)
	Malaysischer Ringgit	2.880	(2.606)	n/a	n/a
	Singapur-Dollar	3.327	(3.010)	4.464	(4.039)
	Südkoreanischer Won	4.002	(3.621)	6.395	(5.786)
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Britisches Pfund	13.955	(12.626)	18.109	(16.385)
	Euro	2.850	(2.579)	2.949	(2.668)
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	Kanadischer Dollar	5.383	(4.871)	5.699	(5.156)
	Euro	2.510	(2.271)	2.454	(2.220)
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	Britisches Pfund	n/a	n/a	48.932	(44.272)
	Euro	81.188	(73.456)	115.941	(104.899)
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	Australischer Dollar	5.469	(4.948)	n/a	n/a
	Britisches Pfund	9.648	(8.729)	48.860	(44.206)
	Euro	3.530	(3.194)	n/a	n/a
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	Euro	9.132	(8.262)	14.062	(12.723)
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	Britisches Pfund	8.110	(7.338)	8.638	(7.816)
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	Brasilianischer Real	138	(125)	n/a	n/a
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	Britisches Pfund	2.194	(1.985)	6.486	(5.868)
	Euro	3.167	(2.866)	4.816	(4.358)
	Mexikanischer Peso	n/a	n/a	2.085	(1.886)
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>	Australischer Dollar	29.911	(27.062)	19.394	(17.547)
	Britisches Pfund	n/a	n/a	3.941	(3.565)
	Euro	11.672	(10.561)	n/a	n/a
	Japanischer Yen	n/a	n/a	(5.659)	5.120
	Polnischer Zloty	n/a	n/a	6.085	(5.505)
	Singapur-Dollar	n/a	n/a	7.066	(6.393)
	Schweizer Franke	(8.000)	7.239	(6.141)	5.556
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	Kanadischer Dollar	590	(533)	598	(541)
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Britisches Pfund	n/a	n/a	4.018	(3.636)
	Euro	1.611	(1.458)	(4.210)	3.809
	Mexikanischer Peso	n/a	n/a	3.247	(2.937)
	Neuseeländischer Dollar	1.854	(1.677)	11.945	(10.807)
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	Euro	27.230	(24.637)	8.153	(7.376)
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund <sup>^</sup>	Euro	527	(477)	538	(486)
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	Australischer Dollar	5.953	(5.386)	19.812	(17.926)
	Brasilianischer Real	576	(522)	n/a	n/a
	Britisches Pfund	n/a	n/a	2.885	(2.610)
	Chilenischer Peso	570	(516)	n/a	n/a
	Mexikanischer Peso	899	(813)	3.096	(2.801)
	Russischer Rubel	n/a	n/a	2.297	(2.078)
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund <sup>^</sup>	Euro	75	(68)	74	(67)
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund <sup>^</sup>	Britisches Pfund	n/a	n/a	4.357	(3.942)
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	Euro	97	(88)	n/a	n/a
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup>	Britisches Pfund	n/a	n/a	4.944	(4.473)
	Kanadischer Dollar	5.293	(4.789)	n/a	n/a
	US-Dollar	20.101	(18.187)	16.670	(15.083)
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup>	Brasilianischer Real	23	(21)	19	(17)
	Euro	79	(72)	90	(81)
	Hongkong-Dollar	36	(32)	32	(29)
	Indische Rupie	28	(25)	38	(34)
	Mexikanischer Peso	26	(24)	22	(20)
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup>	Australischer Dollar	1.164	(1.054)	n/a	n/a
	Britisches Pfund	1.075	(972)	n/a	n/a
	Kanadischer Dollar	1.071	(969)	n/a	n/a
	Euro	2.486	(2.249)	n/a	n/a
	Singapur-Dollar	1.434	(1.297)	n/a	n/a
Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>	Britisches Pfund	26	(24)	n/a	n/a
	Japanischer Yen	27	(24)	n/a	n/a
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund	Britisches Pfund	417	(377)	435	(394)
	US-Dollar	286	(259)	248	(224)
	Schweizer Franke	279	(252)	356	(322)
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	Australischer Dollar	218	(197)	273	(247)
	Hongkong-Dollar	563	(510)	743	(673)
	Südkoreanischer Won	180	(163)	191	(173)
	Taiwan-Dollar	257	(232)	315	(285)
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>^</sup>	Hongkong-Dollar	n/a	n/a	158	(143)

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

		Auswirkungen auf den Nettoinventarwert aufgrund von Wechselkursschwankungen* (Betrag in Fondsbasiswährung) (in Tsd.)			
		Montag, 28. Februar 2022		Sonntag, 28. Februar 2021	
Fonds	Währung	Positiv 5 %	Negativ 5 %	Positiv 5 %	Negativ 5 %
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund	Euro	n/a	n/a	97	(87)
	Japanischer Yen	n/a	n/a	73	(66)
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	Hongkong-Dollar	348	(315)	1.836	(1.661)
	Indische Rupie	102	(92)	530	(480)
	Singapur-Dollar	102	(92)	n/a	n/a
	Südkoreanischer Won	116	(105)	764	(691)
	Taiwan-Dollar	99	(89)	429	(388)
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>^</sup>	US-Dollar	n/a	n/a	1.041	(942)
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	Euro	7.260	(6.568)	1.161	(1.051)
	Hongkong-Dollar	n/a	n/a	565	(511)
	Schwedische Krone	959	(867)	n/a	n/a
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	Australischer Dollar	526	(476)	508	(459)
	Hongkong-Dollar	360	(326)	319	(289)
	Indische Rupie	193	(174)	161	(146)
	Singapur-Dollar	252	(228)	253	(229)
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	Hongkong-Dollar	526	(476)	659	(596)
	Indische Rupie	780	(706)	52	(47)
	Südkoreanischer Won	475	(430)	390	(353)
	Taiwan-Dollar	333	(301)	283	(256)
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>	Schwedische Krone	2.230	(2.018)	780	(706)

Eine Analyse wird angegeben, sofern der Fonds eine erhebliche Fremdwährungsengagement enthält. Als erheblich gilt ein Engagement, wenn es 10% des Nettovermögens übersteigt. Veränderungen sämtlicher Wechselkurse werden sich direkt auf den Nettoinventarwert auswirken. Die Wechselkurse zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 sind in Anmerkung 11 aufgeführt. Diese Sensitivitätsanalyse sollte nicht als Prognose für die künftige Wertentwicklung verwendet werden.

Die Fremdwährungsrisikosensitivitätsanalyse für den Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund, Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>, Der Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup> und der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> (mit Stand vom 1. Juni 2021) wurden in die Berechnung des Marktrisikos unter Verwendung des VaR-Ansatzes einbezogen (Anmerkung 12.1 oben).

##### (c) Zinsrisiko

Eine Sensitivitätsanalyse für die Aktienfonds wurde nicht erstellt, da die Mehrheit der Vermögenswerte der Aktienfonds nicht zinstragende Vermögenswerte sind und das Risiko daher nicht ausreichend wesentlich ist.

Zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 werden alle von den Fonds gehaltenen Barmittel bei der Verwahrstelle oder anderen Brokern gehalten und haben das Potenzial, Zinserträge zu erzielen, deren Höhe je nach dem vorherrschenden Niveau der Marktzinssätze schwankt.

Die Analyse von festverzinslichen, variablen und nicht verzinslichen Wertpapieren ist in Anmerkung 12.1(b) oben offengelegt.

Die gewichtete durchschnittliche Rendite und die gewichteten durchschnittlichen Jahre bis zur Fälligkeit jedes Fonds auf seine festverzinslichen Instrumente je Währung zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 lauten wie folgt:

##### Stand: 28. Februar 2022

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt der Jahre bis zur Fälligkeit
<b>Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund</b>		
US-Dollar	0,15 %	0,10
<b>Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund</b>		
Chinesischer Renminbi	3,20 %	3,76
US-Dollar	3,13 %	17,76
<b>Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund</b>		
Brasilianischer Real	10,36 %	3,23
Indonesische Rupiah	6,45 %	10,13
Mexikanischer Peso	8,17 %	19,44
Russischer Rubel	12,36 %	8,78
US-Dollar	3,00 %	15,82
<b>Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund</b>		
Euro	1,39 %	10,60
Britisches Pfund	4,21 %	7,18
US-Dollar	2,98 %	12,73
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund</b>		
Kanadischer Dollar	5,33 %	4,21
US-Dollar	6,08 %	4,67
<b>Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund</b>		
Brasilianischer Real	10,32 %	2,74
Britisches Pfund	5,48 %	8,58
Chinesischer Renminbi	3,67 %	10,40
Euro	5,47 %	6,30
Indonesische Rupiah	7,05 %	6,31
Mexikanischer Peso	7,97 %	16,81
Russischer Rubel	14,03 %	8,80
Südafrikanischer Rand	9,74 %	19,01
US-Dollar	4,93 %	10,72
<b>Legg Mason Western Asset US High Yield Fund</b>		
US-Dollar	5,94 %	7,05

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt der Jahre bis zur Fälligkeit
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund</b>		
Ägyptisches Pfund	14,04 %	0,64
Indische Rupie	5,86 %	0,78
Indonesische Rupiah	7,46 %	4,40
Mexikanischer Peso	8,09 %	20,72
US-Dollar	5,35 %	14,25
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>		
US-Dollar	5,51 %	9,28
<b>Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund</b>		
Britisches Pfund	5,76 %	4,47
Euro	4,46 %	5,40
Indonesische Rupiah	6,94 %	0,21
Mexikanischer Peso	7,94 %	14,74
Russischer Rubel	13,40 %	6,50
US-Dollar	5,41 %	7,38
<b>Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund</b>		
Chinesischer Renminbi	3,47 %	11,45
Indische Rupie	7,31 %	4,88
Indonesische Rupiah	7,33 %	4,95
Malaysischer Ringgit	3,93 %	7,58
Philippinischer Peso	4,93 %	8,33
Singapur-Dollar	2,67 %	41,56
Südkoreanischer Won	1,51 %	9,27
Thailändischer Baht	3,09 %	16,31
US-Dollar	4,22 %	42,42
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund</b>		
Euro	0,69 %	4,48
Britisches Pfund	1,26 %	3,35
US-Dollar	2,19 %	5,81
<b>Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup></b>		
Britisches Pfund	3,82 %	16,24
Kanadischer Dollar	2,78 %	14,31
Euro	2,45 %	15,52
Indonesische Rupiah	7,36 %	17,14
Japanischer Yen	0,48 %	27,91
Mexikanischer Peso	8,09 %	20,72
Russischer Rubel	13,67 %	7,24
Südafrikanischer Rand	9,74 %	19,01
Südkoreanischer Won	1,92 %	4,28
US-Dollar	2,16 %	11,92
<b>Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup></b>		
Britisches Pfund	3,32 %	6,26
Euro	1,65 %	7,05
Mexikanischer Peso	8,09 %	20,72
Russischer Rubel	13,67 %	7,24
US-Dollar	4,18 %	14,38
<b>Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund</b>		
Britisches Pfund	5,27 %	6,23
Euro	4,52 %	4,68
<b>Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup></b>		
Australischer Dollar	2,60 %	26,34
Brasilianischer Real	10,78 %	8,00
Chinesischer Renminbi	3,43 %	23,24
Ägyptisches Pfund	5,03 %	0,75
Euro	3,61 %	6,47
Indische Rupie	7,24 %	4,44
Indonesische Rupiah	7,18 %	10,15
Mexikanischer Peso	8,10 %	21,72
Russischer Rubel	13,20 %	8,04
US-Dollar	4,68 %	17,52
<b>Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup></b>		
Brasilianischer Real	10,50 %	5,09
Britisches Pfund	5,69 %	4,78
Kanadischer Dollar	5,33 %	4,21
Euro	3,18 %	37,61
Indonesische Rupiah	6,99 %	5,01
Mexikanischer Peso	8,20 %	7,26
Russischer Rubel	13,18 %	5,89
US-Dollar	5,29 %	7,98
<b>Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup></b>		
US-Dollar	4,28 %	13,01
<b>Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup></b>		
US-Dollar	3,38 %	22,95

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt der Jahre bis zur Fälligkeit
<b>Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup></b>		
Britisches Pfund	3,29 %	10,42
Euro	0,47 %	9,58
US-Dollar	3,19 %	16,22
<b>Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>		
Britisches Pfund	3,69 %	6,27
Mexikanischer Peso	8,19 %	16,73
Russischer Rubel	13,67 %	7,24
US-Dollar	3,60 %	12,79
<b>Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup></b>		
Brasilianischer Real	10,67 %	6,81
Indonesische Rupiah	6,51 %	7,80
Mexikanischer Peso	8,09 %	20,72
Russischer Rubel	13,67 %	7,24
US-Dollar	3,05 %	15,96
<b>Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>		
Britisches Pfund	2,92 %	6,54
Euro	1,40 %	6,92
US-Dollar	3,86 %	14,47
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund</b>		
Australischer Dollar	5,29 %	0,74
Brasilianischer Real	10,21 %	3,86
Britisches Pfund	0,28 %	9,42
Kolumbianischer Peso	7,05 %	6,17
Euro	0,00 %	9,75
Malaysischer Ringgit	3,61 %	2,53
Mexikanischer Peso	7,68 %	13,86
Neuseeländischer Dollar	4,69 %	8,21
Norwegische Krone	1,98 %	1,23
Polnischer Zloty	4,00 %	1,65
Russischer Rubel	8,89 %	4,38
Südafrikanischer Rand	9,35 %	18,74
Südkoreanischer Won	2,72 %	22,80
US-Dollar	2,06 %	27,93
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>		
Brasilianischer Real	10,84 %	8,59
Britisches Pfund	0,80 %	28,67
Chinesischer Renminbi	3,55 %	28,56
Kolumbianischer Peso	8,38 %	17,91
Indonesische Rupiah	7,53 %	11,09
Mexikanischer Peso	8,17 %	21,87
Südafrikanischer Rand	10,47 %	26,02
Südkoreanischer Won	1,65 %	8,79
US-Dollar	4,71 %	26,32
<b>Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup></b>		
Brasilianischer Real	10,47 %	4,84
Euro	3,69 %	5,88
US-Dollar	5,91 %	6,13
<b>Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund</b>		
Australischer Dollar	5,34 %	0,69
Brasilianischer Real	10,70 %	7,19
Britisches Pfund	0,28 %	9,42
Chinesischer Renminbi	3,55 %	28,56
Kolumbianischer Peso	6,96 %	5,19
Euro	0,00 %	9,75
Malaysischer Ringgit	3,72 %	2,01
Mexikanischer Peso	8,16 %	16,51
Neuseeländischer Dollar	4,70 %	8,15
Norwegische Krone	1,98 %	1,23
Polnischer Zloty	4,00 %	1,65
Russischer Rubel	14,56 %	8,12
Südafrikanischer Rand	10,11 %	22,58
Südkoreanischer Won	2,14 %	14,55
US-Dollar	3,79 %	27,61
<b>Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund</b>		
Brasilianischer Real	10,23 %	4,79
Euro	0,48 %	7,18
Mexikanischer Peso	7,55 %	21,80
Russischer Rubel	6,80 %	3,90
Schweizer Franke	0,50 %	0,41
US-Dollar	4,21 %	5,43

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt der Jahre bis zur Fälligkeit
<b>Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup></b>		
Chinesischer Renminbi	3,55 %	28,56
US-Dollar	4,89 %	8,77
<b>Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup></b>		
Brasilianischer Real	10,47 %	4,84
Euro	4,20 %	5,24
US-Dollar	5,95 %	6,38
<b>Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>		
Brasilianischer Real	10,77 %	7,71
Kolumbianischer Peso	7,05 %	6,17
Tschechische Krone	1,98 %	10,32
Malaysischer Ringgit	3,76 %	2,14
Mexikanischer Peso	8,13 %	18,91
Polnischer Zloty	2,14 %	10,16
Russischer Rubel	14,56 %	8,12
Südafrikanischer Rand	10,33 %	24,67
Südkoreanischer Won	2,14 %	14,53
US-Dollar	6,22 %	24,91

Stand: 28. Februar 2021

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt der Jahre bis zur Fälligkeit
<b>Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund</b>		
US-Dollar	0,67 %	0,17
<b>Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund</b>		
Chinesischer Renminbi	3,21 %	4,76
US-Dollar	2,83 %	19,30
<b>Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund</b>		
Brasilianischer Real	9,23 %	4,28
Euro	2,27 %	0,48
Mexikanischer Peso	7,28 %	19,96
Russischer Rubel	7,03 %	9,89
US-Dollar	2,86 %	16,95
<b>Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund</b>		
Australischer Dollar	2,28 %	30,33
Britisches Pfund	2,18 %	37,71
Euro	1,53 %	12,46
US-Dollar	3,91 %	17,69
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund</b>		
US-Dollar	5,78 %	4,77
<b>Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund</b>		
Australischer Dollar	2,28 %	30,33
Brasilianischer Real	9,28 %	3,15
Britisches Pfund	3,54 %	10,77
Kolumbianischer Peso	8,35 %	3,40
Euro	4,02 %	5,96
Indonesische Rupiah	7,05 %	7,15
Mexikanischer Peso	7,17 %	19,94
Russischer Rubel	6,95 %	10,24
Südafrikanischer Rand	9,93 %	18,98
US-Dollar	4,29 %	10,84
<b>Legg Mason Western Asset US High Yield Fund</b>		
US-Dollar	5,71 %	7,21
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund</b>		
Brasilianischer Real	9,19 %	4,88
Euro	4,86 %	10,93
Indische Rupie	5,79 %	1,74
Indonesische Rupiah	7,48 %	7,13
Mexikanischer Peso	6,11 %	10,31
Russischer Rubel	7,04 %	11,70
Südafrikanischer Rand	10,17 %	15,93
Ukrainische Hryvnia	8,09 %	0,99
US-Dollar	4,88 %	14,55
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>		
Euro	4,86 %	10,93
US-Dollar	4,48 %	9,42

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2021 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt der Jahre bis zur Fälligkeit
<b>Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund</b>		
Brasilianischer Real	9,34 %	1,84
Britisches Pfund	4,40 %	3,42
Euro	3,65 %	5,50
Indonesische Rupiah	6,97 %	1,07
Russischer Rubel	6,82 %	6,89
US-Dollar	5,00 %	6,62
<b>Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund</b>		
Chinesischer Renminbi	3,91 %	10,17
Hongkong-Dollar	2,89 %	0,20
Indische Rupie	7,22 %	5,89
Indonesische Rupiah	7,57 %	5,02
Malaysischer Ringgit	3,78 %	8,57
Philippinischer Peso	4,39 %	9,77
Singapur-Dollar	2,40 %	17,87
Südkoreanischer Won	1,43 %	10,03
Thailändischer Baht	2,86 %	17,31
US-Dollar	4,34 %	29,64
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund</b>		
Euro	0,62 %	4,76
Britisches Pfund	1,31 %	4,09
US-Dollar	2,16 %	5,43
<b>Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup></b>		
Australischer Dollar	2,28 %	30,33
Britisches Pfund	3,24 %	21,71
Kanadischer Dollar	2,60 %	15,58
Euro	1,62 %	14,52
Indonesische Rupiah	7,67 %	18,14
Japanischer Yen	0,58 %	27,11
Mexikanischer Nuevo Peso	7,22 %	21,72
Südafrikanischer Rand	9,96 %	19,30
Südkoreanischer Won	1,84 %	5,28
US-Dollar	2,77 %	14,66
<b>Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup></b>		
Britisches Pfund	3,25 %	7,66
Euro	1,63 %	6,92
Mexikanischer Peso	7,22 %	21,72
Russischer Rubel	6,79 %	8,24
US-Dollar	3,74 %	13,51
<b>Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund</b>		
Britisches Pfund	4,79 %	6,55
Euro	4,10 %	5,07
<b>Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup></b>		
Australischer Dollar	2,76 %	27,09
Brasilianischer Real	9,28 %	3,14
Chinesischer Renminbi	3,71 %	26,40
Ägyptisches Pfund	16,53 %	3,25
Euro	2,72 %	23,59
Indische Rupie	7,51 %	3,73
Indonesische Rupiah	7,26 %	9,74
Mexikanischer Peso	7,24 %	22,98
Russischer Rubel	7,11 %	10,23
Südafrikanischer Rand	9,43 %	15,40
US-Dollar	3,96 %	18,37
<b>Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup></b>		
Brasilianischer Real	9,15 %	6,09
Britisches Pfund	4,03 %	5,03
Euro	3,73 %	1,78
Indonesische Rupiah	6,81 %	6,12
Mexikanischer Nuevo Peso	7,26 %	8,26
Russischer Rubel	6,82 %	6,89
US-Dollar	5,13 %	9,43
<b>Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup></b>		
US-Dollar	6,20 %	12,65
<b>Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup></b>		
US-Dollar	3,42 %	24,00
<b>Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup></b>		
Britisches Pfund	3,17 %	10,48
Euro	0,00 %	8,97
US-Dollar	3,26 %	17,24

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Stand: 28. Februar 2021 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt der Jahre bis zur Fälligkeit
<b>Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>		
Britisches Pfund	3,91 %	10,68
Euro	3,83 %	17,01
Russischer Rubel	6,79 %	8,24
US-Dollar	3,50 %	12,35
<b>Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup></b>		
Brasilianischer Real	9,15 %	5,84
Indonesische Rupiah	6,69 %	6,21
Mexikanischer Peso	7,22 %	21,72
Russischer Rubel	6,79 %	8,24
US-Dollar	2,60 %	14,07
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund</b>		
Australischer Dollar	5,52 %	0,82
Brasilianischer Real	9,23 %	3,84
Britisches Pfund	1,71 %	1,52
Kolumbianischer Peso	5,79 %	7,17
Indonesische Rupiah	7,77 %	8,05
Malaysischer Ringgit	3,67 %	5,97
Mexikanischer Peso	7,04 %	16,45
Polnischer Zloty	1,99 %	0,15
Russischer Rubel	4,36 %	4,90
Südafrikanischer Rand	10,31 %	23,95
US-Dollar	3,15 %	27,86
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>		
Brasilianischer Real	9,15 %	6,33
Kolumbianischer Peso	5,79 %	7,17
Indonesische Rupiah	7,74 %	11,16
Mexikanischer Peso	7,32 %	18,44
Südafrikanischer Rand	8,77 %	10,58
US-Dollar	4,93 %	22,71
<b>Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup></b>		
Kanadischer Dollar	8,47 %	3,32
Euro	3,44 %	6,88
US-Dollar	5,86 %	7,09
<b>Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund</b>		
Australischer Dollar	5,34 %	1,38
Brasilianischer Real	9,15 %	6,29
Britisches Pfund	1,71 %	1,52
Kolumbianischer Peso	5,79 %	6,05
Indonesische Rupiah	7,74 %	11,82
Malaysischer Ringgit	3,60 %	3,32
Mexikanischer Peso	7,27 %	17,43
Polnischer Zloty	1,99 %	0,15
Russischer Rubel	7,17 %	9,12
Südafrikanischer Rand	10,33 %	24,20
US-Dollar	4,90 %	24,36
<b>Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund</b>		
Brasilianischer Real	5,23 %	4,90
Kanadischer Dollar	4,66 %	2,60
Ägyptisches Pfund	0,00 %	0,02
Mexikanischer Peso	4,45 %	4,90
Russischer Rubel	4,36 %	4,90
US-Dollar	4,16 %	6,92
<b>Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup></b>		
US-Dollar	5,59 %	7,39
<b>Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup></b>		
Kanadischer Dollar	8,47 %	3,32
Euro	3,44 %	6,88
US-Dollar	5,71 %	7,03
<b>Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>		
Brasilianischer Real	9,13 %	7,85
Kolumbianischer Peso	5,79 %	7,17
Indonesische Rupiah	7,77 %	8,05
Malaysischer Ringgit	3,68 %	2,98
Mexikanischer Peso	7,25 %	19,90
Russischer Rubel	7,17 %	9,12
Südafrikanischer Rand	10,49 %	25,78
US-Dollar	5,40 %	24,10

#### Zins-Benchmark-Reform

Global wird eine grundlegende Reform der wichtigsten Zins-Benchmarks durchgeführt, einschließlich der Ersetzung einiger Interbank Offered Rates (IBORs) durch alternative Fast-Riskfree-Raten (als „IBOR-Reform“ bezeichnet). Die Fonds sind mit IBORs auf ihren Finanzinstrumenten engagiert, die im Rahmen dieser Markeninitiativen ersetzt oder reformiert werden. Bestimmte Gerichtsbarkeiten reformieren oder stufen derzeit ihre Benchmark-Zinssätze ab, insbesondere die London Interbank Offered Rates („LIBOR“) über mehrere Währungen hinweg. Viele solcher Reformen und Ausstiege traten Ende des Kalenderjahres 2021 in Kraft, wobei ausgewählte US-Dollar-LIBOR-Tenoren bis Juni 2023 anhielten. Diese Preisänderungen können sich auf bestehende Transaktionen und vertragliche Vereinbarungen auswirken. Das Management hat Schritte unternommen, um sich auf die Auswirkungen von sich ändernden Basiszinssätzen vorzubereiten und diese zu mindern, und verwaltet weiterhin die Übergangsbemühungen und bewertet die Auswirkungen von zukünftigen Änderungen auf bestehende Transaktionen und vertragliche Vereinbarungen.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (d) Sonstiges Preisrisiko – beizulegender Zeitwert von finanziellen Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten

Zusätzlich zum Ausschuss hat Franklin Templeton den Bewertungsausschuss eingerichtet, um die Umsetzung der vom Verwaltungsrat (der „Vorstand“) verabschiedeten Bewertungsrichtlinien und -verfahren zu überwachen. Der Bewertungsausschuss, einschließlich des Vorsitzenden, besteht aus mindestens vier und höchstens zehn Mitgliedern. Vertreter von Franklin Templeton Legal and Compliance werden dem Bewertungsausschuss beratend zur Seite stehen. Der Bewertungsausschuss trifft sich monatlich, um alle Wertpapiere zu überprüfen, deren Preis manuell, von einem Makler bzw. anhand einer Matrix bestimmt wird, die zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, illiquide oder verfallen sind. Darüber hinaus kann der Bewertungsausschuss jederzeit einberufen werden, um über Fragen oder Themen zu beraten, die in seine Zuständigkeit fallen. Die Sitzungen des Bewertungsausschusses können persönlich, per E-Mail oder auf sonstige Weise schriftlich abgehalten werden.

Einige Fonds kauften während des Berichtszeitraums Derivate. Der Wert der Derivate basiert auf bestimmten zugrunde liegenden Aktien oder Anleihen, Zinsen, Währungen oder Indizes und schließt Futures, Optionen, Optionen auf Futures und Swaps ein. Unter Umständen ist es schwierig, Derivate zu einem günstigen Preis oder Zeitpunkt zu verkaufen, da sie empfindlich auf Veränderungen des zugrunde liegenden Wertpapiers, Zinssatzes, Indexes oder der zugrunde liegenden Währung reagieren. Daher können Derivate erheblichen Schwankungen unterliegen und dem Fonds Verluste bescheren. Einzelheiten zu offenen Derivatepositionen finden Sie im jeweiligen Fondsportfolio zum 28. Februar 2022.

#### Schätzung des beizulegenden Zeitwerts

Die Gesellschaft hat im Einklang mit FRS 102 beschlossen, die Bestimmungen zu Ansatz und Bewertung von International Accounting Standards („IAS“) 39 „Financial Instruments: Recognition and Measurement“ („IAS 39“) in der zur Anwendung in der Europäischen Union übernommenen Fassung und die Offenlegungsbestimmungen der Abschnitte 11 und 12 von FRS 102 anzuwenden.

Der beizulegende Zeitwert von Finanzinstrumenten, die an aktiven Märkten gehandelt werden (z. B. börsengehandelte Derivate und Wertpapiere), basiert auf den Kursnotierungen am Bilanzstichtag. Steht für ein Wertpapier keine „jederzeit verfügbare Marktnotierung“ zur Verfügung, wendet die Gesellschaft „Marktwertmethoden“ an, um den Preis des Wertpapiers zu bestimmen. Generell handelt es sich beim beizulegenden Zeitwert um den Preis, mit dessen Erzielung der Fonds bei einem sofortigen Verkauf in angemessener Weise rechnen darf. Bei der Bewertung zum beizulegenden Zeitwert muss der Bewertungsausschuss ausgehend von den jeweiligen Fakten und Umständen den Wert eines bestimmten Wertpapiers oder einer Gruppe von Wertpapieren in gutem Glauben bestimmen.

Umstände, unter denen keine jederzeit verfügbare Marktnotierung zur Verfügung steht, beinhalten unter anderem die Aussetzung des Handels vor der Schließung des betreffenden Marktes; Ereignisse, die unerwartet zur Schließung ganzer Märkte führen, wie beispielsweise Naturkatastrophen, Stromausfall oder ähnliche schwerwiegende Ereignisse; Feiertage ohne Handel oder das Handelsvolumen für ein bestimmtes Wertpapier.

Bei der Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts eines Portfoliowertpapiers kann der Bewertungsausschuss alle relevanten Methoden berücksichtigen, unter anderem eine oder sämtliche der nachfolgend aufgeführten Preisbestimmungsmethoden:

- (i) Ein Vielfaches des Einkommens;
- (ii) Ein Rabatt vom Markt eines ähnlichen frei gehandelten Wertpapiers;
- (iii) Eine diskontierte Cashflow-Analyse;
- (iv) Der Buchwert oder ein Vielfaches davon;
- (v) Eine Risikoprämien-/Renditeanalyse;
- (vi) Rendite bis zur Fälligkeit; und/oder
- (vii) Grundlegende Anlageanalyse.

Der Bewertungsausschuss überprüft die Angemessenheit und Genauigkeit der Methoden, die bei der fairen Bewertung von Wertpapieren verwendet werden, auf monatlicher Basis, einschließlich eines Vergleichs der beizulegenden Zeitwerte mit dem letzten Marktpreis und dem nächsten verfügbaren Marktpreis, wie z. B. dem nextday-Eröffnungspreis.

Die Gesellschaft hat die Bewertungen zum Marktwert im Rahmen einer Marktwerthierarchie klassifiziert, die die Signifikanz von Inputs reflektiert, die bei einer Bewertung zum Marktwert herangezogen werden. Die Marktwerthierarchie kennt folgende Stufen:

Eingabewerte der Stufe 1 sind unbereinigte notierte Kurse in aktiven Märkten für gleichartige Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten, welche dem Unternehmen am Bewertungstag zugänglich sind.

Eingabewerte der Stufe 2 sind andere notierte Kurse als die in aktiven Märkten der Stufe 1, welche für die betreffenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten direkt oder indirekt beobachtbar sind (d. h. unter Verwendung von Marktdaten entwickelt werden).

Eingabewerte der Stufe 3 sind nicht beobachtbare Parameter für die Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten (d. h., es sind keine Marktdaten verfügbar).

Jede Kapitalanlage wird stets insgesamt 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.

In der folgenden Tabelle werden die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds zum 28. Februar 2022 gemäß der Fair-Value-Hierarchie analysiert

	Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	151
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	784	6.335	567	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(1.751)	(10.440)	(590)	–
	–	(967)	(4.105)	(23)	151
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 669.444	\$ 229.242	\$ 1.443.084	€ 145.806	\$ 49.581
Geldmarktinstrumente	270.000	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	5.470	34.088	808	65
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	2.494	15.164	131	1
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(471)	(11.070)	(1.315)	(29)
	939.444	236.735	1.481.266	145.430	49.618
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ 154	\$ 880	€ –	\$ 921
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	154	880	–	921
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 939.444</b>	<b>\$ 235.922</b>	<b>\$ 1.478.041</b>	<b>€ 145.407</b>	<b>\$ 50.690</b>

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (d) Sonstiges Preisrisiko – beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US High Yield Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	438	2.853	–	–	1
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	104	47	–	1	51
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(1.281)	(72)	(89)	(27)	–
	<b>(739)</b>	<b>2.828</b>	<b>(89)</b>	<b>(26)</b>	<b>52</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 254.048	\$ 250.188	\$ 33.229	\$ 27.090	\$ 69.150
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	28.957	1.490	4.048	–	6.632
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	4.595	112	164	9	193
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(2.922)	(60)	(188)	(39)	(139)
	<b>284.678</b>	<b>251.730</b>	<b>37.253</b>	<b>27.060</b>	<b>75.836</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 2	\$ 683	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	662	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>2</b>	<b>1.345</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 283.941</b>	<b>\$ 255.903</b>	<b>\$ 37.164</b>	<b>\$ 27.034</b>	<b>\$ 75.888</b>
	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	315	–	2.194	837	437
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(236)	(1.113)	(181)	(1.170)	(44)
	<b>79</b>	<b>(1.113)</b>	<b>2.013</b>	<b>(333)</b>	<b>393</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 54.893	\$ 480.459	\$ 438.717	\$ 179.636	\$ 73.736
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	3.010	12.311	6.636	20.460	718
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	379	8.133	4.176	1.939	827
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(586)	(594)	(4.645)	(3.423)	(509)
	<b>57.696</b>	<b>500.309</b>	<b>444.884</b>	<b>198.612</b>	<b>74.772</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>1</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 57.775</b>	<b>\$ 499.196</b>	<b>\$ 446.897</b>	<b>\$ 198.280</b>	<b>\$ 75.165</b>

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Markttrisiko – (Fortsetzung)

##### (d) Sonstiges Preisrisiko – beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup> zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup> zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	397	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	216.746	1.065	502	1.640
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(303.469)	(2.253)	(2.083)	(666)
	–	<b>(86.723)</b>	<b>(791)</b>	<b>(1.581)</b>	<b>974</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	€ 32.768	\$ 3.650.302	\$ 341.497	\$ 989.198	\$ 1.264.416
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	2	165.431	11.276	36.257	18.650
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	8	364.851	5.643	4.045	1.296
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(66)	(400.163)	(7.975)	(5.374)	(14)
	<b>32.712</b>	<b>3.780.421</b>	<b>350.441</b>	<b>1.024.126</b>	<b>1.284.348</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ 10.679	\$ 2.684	\$ 29.159	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	2.349	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	<b>10.679</b>	<b>5.033</b>	<b>29.159</b>	–
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>€ 32.712</b>	<b>\$ 3.704.377</b>	<b>\$ 354.683</b>	<b>\$ 1.051.704</b>	<b>\$ 1.285.322</b>

	Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	59	202	196	21	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(10)	(158)	(614)	–	–
	<b>49</b>	<b>44</b>	<b>(418)</b>	<b>21</b>	–
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	£ 70.140	\$ 162.165	\$ 19.848	\$ 9.371	\$ 210.973
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	11.779	1.216	64	4.135
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	8	143	573	270	4.267
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(35)	(1.739)	(257)	(26)	(4.493)
	<b>70.113</b>	<b>172.348</b>	<b>21.380</b>	<b>9.679</b>	<b>214.882</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	\$ 78	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	<b>78</b>	–	–	–
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>£ 70.162</b>	<b>\$ 172.470</b>	<b>\$ 20.962</b>	<b>\$ 9.700</b>	<b>\$ 214.882</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (d) Sonstiges Preisrisiko – beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^ Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	33
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	1.272	–	–	–	86
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(4.865)	–	–	(1.309)	(81)
	<b>(3.593)</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>(1.309)</b>	<b>38</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 728.006	\$ 10.878	\$ 239.295	\$ 1.481.384	\$ 49.895
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	752	538	3.333	40.689	1.925
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	21.946	147	2.854	31.828	233
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(22.185)	(32)	(4.074)	(17.153)	(145)
	<b>728.519</b>	<b>11.531</b>	<b>241.408</b>	<b>1.536.748</b>	<b>51.908</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 724.926</b>	<b>\$ 11.531</b>	<b>\$ 241.408</b>	<b>\$ 1.535.439</b>	<b>\$ 51.946</b>

	Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Value Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	2.157	878.948	207.470
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	1.151	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(1.426)	–	–	–
	<b>–</b>	<b>(275)</b>	<b>2.157</b>	<b>878.948</b>	<b>207.470</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 9.283	\$ 96.648	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	882	4.248	79	2.840	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	80	3.520	1	14	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(208)	(4.556)	(29)	(641)	–
	<b>10.037</b>	<b>99.860</b>	<b>51</b>	<b>2.213</b>	<b>–</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 10.037</b>	<b>\$ 99.585</b>	<b>\$ 2.208</b>	<b>\$ 881.161</b>	<b>\$ 207.470</b>

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (d) Sonstiges Preisrisiko – beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	1.756.332	536.471	41.374	1.618.990	14.292
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>1.756.332</b>	<b>536.471</b>	<b>41.374</b>	<b>1.618.990</b>	<b>14.292</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ 836	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	4.603	113	20	145	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(1.709)	(123)	(38)	(2.099)	–
	<b>2.894</b>	<b>(10)</b>	<b>818</b>	<b>(1.954)</b>	<b>–</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 1.759.226</b>	<b>\$ 536.461</b>	<b>\$ 42.192</b>	<b>\$ 1.617.036</b>	<b>\$ 14.292</b>

	Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	648.298	2.667	164.133	891.617	86.980
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>648.298</b>	<b>2.667</b>	<b>164.133</b>	<b>891.617</b>	<b>86.980</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	41.913	1.480
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	3.195	–	82	1.468	1
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(438)	(30)	(332)	(1.791)	(5)
	<b>2.757</b>	<b>(30)</b>	<b>(250)</b>	<b>41.590</b>	<b>1.476</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>€ 651.055</b>	<b>\$ 2.637</b>	<b>\$ 163.883</b>	<b>\$ 933.207</b>	<b>\$ 88.456</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (d) Sonstiges Preisrisiko – beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>μ</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	4.410	27.800	25.897	–	12.372
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>4.410</b>	<b>27.800</b>	<b>25.897</b>	<b>–</b>	<b>12.372</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	140	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	162	34	–	7
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(23)	(139)	–	(1)
	<b>140</b>	<b>139</b>	<b>(105)</b>	<b>–</b>	<b>6</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	34	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>34</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 4.550</b>	<b>€ 27.973</b>	<b>\$ 25.792</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 12.378</b>
	Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup> zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Global Long- Term Unconstrained Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2022 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	15.463	170.458	27.613	47.571	302.551
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>15.463</b>	<b>170.458</b>	<b>27.613</b>	<b>47.571</b>	<b>302.551</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	197	11	–	281
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(2.114)	(10)	–	(69)
	<b>–</b>	<b>(1.917)</b>	<b>1</b>	<b>–</b>	<b>212</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	68	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>68</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 15.463</b>	<b>\$ 168.541</b>	<b>\$ 27.614</b>	<b>\$ 47.639</b>	<b>€ 302.763</b>

<sup>μ</sup> Mit Wirkung vom 14. April 2021 stellte der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (d) Sonstiges Preisrisiko – beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

In der folgenden Tabelle werden die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds zum 28. Februar 2021 unter der Fair-Value-Hierarchie analysiert:

	Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	454
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	395	3.591	855	58
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(1.303)	(7.715)	(540)	(50)
	–	(908)	(4.124)	315	462
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 738.476	\$ 309.661	\$ 1.702.328	€ 103.651	\$ 25.074
Geldmarktinstrumente	172.000	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	12.610	27.476	1.423	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	4.072	19.543	259	3
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(247)	(3.736)	(292)	–
	910.476	326.096	1.745.611	105.041	25.077
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ 158	\$ 3.498	€ –	\$ 476
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	158	3.498	–	476
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 910.476</b>	<b>\$ 325.346</b>	<b>\$ 1.744.985</b>	<b>€ 105.356</b>	<b>\$ 26.015</b>

	Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US High Yield Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	283	3.516	–	–	551
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	1.115	–	77	65	52
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(501)	(85)	–	–	–
	897	3.431	77	65	603
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 544.219	\$ 209.365	\$ 20.208	\$ 39.436	\$ 93.048
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	64.890	5.196	2.084	–	9.076
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	9.809	67	70	15	158
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(2.105)	(27)	(39)	(8)	(76)
	616.813	214.601	22.323	39.443	102.206
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 935	\$ 3.462	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	34	702	–	–	34
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	969	4.164	–	–	34
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 618.679</b>	<b>\$ 222.196</b>	<b>\$ 22.400</b>	<b>\$ 39.508</b>	<b>\$ 102.843</b>

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (d) Sonstiges Preisrisiko – bezulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	281	–	1.417	1.236	128
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(117)	(1.195)	(6)	(823)	(147)
	<b>164</b>	<b>(1.195)</b>	<b>1.411</b>	<b>413</b>	<b>(19)</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 46.387	\$ 597.704	\$ 480.330	\$ 254.343	\$ 80.256
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	940	22.984	24.052	28.758	940
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	231	310	7.530	2.183	110
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(119)	(948)	(2.565)	(1.236)	(829)
	<b>47.439</b>	<b>620.050</b>	<b>509.347</b>	<b>284.048</b>	<b>80.477</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ 71
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	<b>2</b>	<b>71</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 47.603</b>	<b>\$ 618.855</b>	<b>\$ 510.758</b>	<b>\$ 284.463</b>	<b>\$ 80.529</b>

	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ zum 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ zum 28. Februar 2021 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	6.195	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	129.300	2.457	–	1.252
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(211.694)	(2.821)	(492)	(1.278)
	–	<b>(82.394)</b>	<b>5.831</b>	<b>(492)</b>	<b>(26)</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	€ 45.649	\$ 5.967.435	\$ 1.009.951	\$ 942.710	\$ 899.015
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	336	158.037	18.898	59.043	74.145
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	256	745.197	29.821	1.071	9
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(109)	(86.911)	(2.957)	(2.376)	(332)
	<b>46.132</b>	<b>6.783.758</b>	<b>1.055.713</b>	<b>1.000.448</b>	<b>972.837</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ 10.939	\$ 10.073	\$ 83.562	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	2.288	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	<b>10.939</b>	<b>12.361</b>	<b>83.562</b>	–
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>€ 46.132</b>	<b>\$ 6.712.303</b>	<b>\$ 1.073.905</b>	<b>\$ 1.083.518</b>	<b>\$ 972.811</b>

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (d) Sonstiges Preisrisiko – beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	489	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	38	48	72	–	545
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(65)	(197)	(179)	–	–
	<b>(27)</b>	<b>340</b>	<b>(107)</b>	<b>–</b>	<b>545</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	£ 74.495	\$ 178.495	\$ 23.686	\$ 354.723	\$ 682.231
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	9.727	1.473	15.295	42.056
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	49	3.544	611	4.100	19.726
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(48)	(73)	(2.715)	(4.911)
	<b>74.544</b>	<b>191.718</b>	<b>25.697</b>	<b>371.403</b>	<b>739.102</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	\$ 80	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>80</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>£ 74.517</b>	<b>\$ 192.138</b>	<b>\$ 25.590</b>	<b>\$ 371.403</b>	<b>\$ 739.647</b>

	Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	3.612
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	234	41
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(723)	–	(379)	(79)
	<b>–</b>	<b>(723)</b>	<b>–</b>	<b>(145)</b>	<b>3.574</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 11.671	\$ 558.129	\$ –	\$ 392.058	\$ 45.500
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	216	32.385	–	35.025	2.540
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	316	2.835	926	12.466	355
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(38)	(3.975)	(1.932)	(1.778)	(346)
	<b>12.165</b>	<b>589.374</b>	<b>(1.006)</b>	<b>437.771</b>	<b>48.049</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 12.165</b>	<b>\$ 588.651</b>	<b>\$ (1.006)</b>	<b>\$ 437.626</b>	<b>\$ 51.623</b>

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (d) Sonstiges Preisrisiko – beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Value Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	1.848	493.419	203.955
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	998	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(1.176)	–	–	–
	<b>–</b>	<b>(178)</b>	<b>1.848</b>	<b>493.419</b>	<b>203.955</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 11.223	\$ 350.319	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	430	16.560	55	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	250	5.291	3	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(37)	(1.896)	–	(1)	–
	<b>11.866</b>	<b>370.274</b>	<b>58</b>	<b>(1)</b>	<b>–</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 11.866</b>	<b>\$ 370.096</b>	<b>\$ 1.906</b>	<b>\$ 493.418</b>	<b>\$ 203.955</b>
	Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^ Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	1.810.957	789.786	36.040	635.560	10.927
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>1.810.957</b>	<b>789.786</b>	<b>36.040</b>	<b>635.560</b>	<b>10.927</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ 993	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	1.202	141	16	1.741	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(2.409)	(32)	(2)	(45)	–
	<b>(1.207)</b>	<b>109</b>	<b>1.007</b>	<b>1.696</b>	<b>–</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 1.809.750</b>	<b>\$ 789.895</b>	<b>\$ 37.047</b>	<b>\$ 637.256</b>	<b>\$ 10.927</b>

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

##### (d) Sonstiges Preisrisiko – beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	607.551	2.726	1.157.007	88.681	33.006
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>607.551</b>	<b>2.726</b>	<b>1.157.007</b>	<b>88.681</b>	<b>33.006</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	91.807	1.422	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	230	4	503	3	7
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(558)	–	(611)	(3)	(15)
	<b>(328)</b>	<b>4</b>	<b>91.699</b>	<b>1.422</b>	<b>(8)</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>€ 607.223</b>	<b>\$ 2.730</b>	<b>\$ 1.248.706</b>	<b>\$ 90.103</b>	<b>€ 32.998</b>
	Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup> zum 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	30.642	14.431	12.688	77.091	36.537
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	13	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>30.642</b>	<b>14.444</b>	<b>12.688</b>	<b>77.091</b>	<b>36.537</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	210	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	43	–	5	–	424
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(29)	–	–	–	(778)
	<b>14</b>	<b>210</b>	<b>5</b>	<b>–</b>	<b>(354)</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	5	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	<b>5</b>	–	–	–
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 30.656</b>	<b>\$ 14.659</b>	<b>\$ 12.693</b>	<b>\$ 77.091</b>	<b>€ 36.183</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (d) Sonstiges Preisrisiko – beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

	Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup> Stand: 28. Februar 2021 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>				
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	98.926	26.321	40.978	108.300
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–
	<b>98.926</b>	<b>26.321</b>	<b>40.978</b>	<b>108.300</b>
<b>Stufe 2</b>				
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	36	3	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(1)	–	–
	<b>36</b>	<b>2</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Stufe 3</b>				
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 98.962</b>	<b>\$ 26.323</b>	<b>\$ 40.978</b>	<b>€ 108.300</b>

Wertpapiere, die vom Manager oder dem jeweiligen Investmentmanager zum 28. Februar 2022 zum beizulegenden Zeitwert bewertet wurden, sind im Portfolio der Anlagen vermerkt. Sofern kein Preis von einem Kursdienst zur Verfügung steht, kann der Bewertungsausschuss eine oder mehrere Notierungen von anerkannten Broker-Dealern besorgen.

Das Matrix Pricing wird für Fonds verwendet, bei denen der Bewertungsausschuss für ein Wertpapier keine Notierungen eines oder mehrerer Broker-Dealer besorgen kann und für die auch kein Preis von Kurssdiensten zur Verfügung steht. Matrixschätzt den aktuellen Marktwert eines US-amerikanischen Dollar-d-Wertpapiers, indem das aktuellste von einem Broker-Dealer erhaltene Angebot verwendet und der Preis durch die Änderung der Rendite des US-amerikanischen Treasury-Wertpapiers angepasst wird, die der Laufzeit des bewerteten Wertpapiers am ähnlichsten ist.

Die folgenden Tabellen stellen den Wert der Wertpapiere für jeden Fonds dar, die unter Verwendung von Einzelmaklerquellen bewertet und vom Bewertungsausschuss zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 bewertet wurden:

Stand: 28. Februar 2022	Einzelmakler zum Preis (in Tsd.)	Fair Value vom Bewertungsausschuss (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	\$154	\$154
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	\$880	\$880
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	\$2	\$2
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	\$662	\$662
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	–	\$7.755
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	\$1	\$1
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	\$10.679	\$10.679
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	\$2.349	\$2.551
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	–	\$29.940
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund	–	€34
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	–	\$68

Stand: 28. Februar 2021	Einzelmakler zum Preis (in Tsd.)	Fair Value vom Bewertungsausschuss (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	\$158	\$158
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	\$2.722	\$2.722
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	\$4	\$38
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	\$645	\$702
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	–	\$34
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	–	\$12.729
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	\$2	\$2
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	\$10.939	\$10.939
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	\$3.938	\$3.938
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	\$4.814	\$58.832
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>^</sup>	–	\$215

Einzelheiten zu derivativen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die zum Handel gehalten wurden und zum 28. Februar 2022 zum beizulegenden Zeitwert bewertet wurden, finden Sie im Portfolio der Anlagen.

Unter bestimmten Umständen nutzt das Unternehmen die durch ICE-Datendienste („ICE“) angepasste Preisgestaltung bei der Bewertung von nicht-US-amerikanischen Aktien. ICE berechnet und liefert einen bereinigten Schlusskurs, der als beizulegender Zeitwert verwendet werden kann.

Zum 28. Februar 2022 ICE-bereinigte Preise wurden auf den Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund angewendet, Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup>, 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<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund, Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund, Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup>, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund, Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund, Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup> und Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup> (Am 28. Februar 2021 wurde die ICE-bereinigte Preisgestaltung auf den Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund angewendet, Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup>, 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

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

#### (d) Sonstiges Preisrisiko – beizulegender Zeitwert der finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten – (Fortsetzung)

Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>, Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund, Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund, Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup>, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund, Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup> und Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup>).

### 12.2 Kreditrisiko

Das Kreditrisiko bezeichnet das Risiko, dass eine Gegenpartei oder der Emittent eines Finanzinstruments eine mit einem Fonds eingegangene Verpflichtung oder Verbindlichkeit nicht erfüllt. Die Gesellschaft ist bei den Parteien, mit denen sie Geschäfte abschließt, dem Kreditrisiko ausgesetzt und trägt darüber hinaus das Risiko des Zahlungsausfalls. Der zuständige Anlagemanager und/oder Unteranlageverwalter/-berater minimiert die Konzentration des Kreditrisikos, indem er mit vielen Brokern und Kontrahenten an anerkannten Börsen mit gutem Ruf Geschäfte abschließt. Alle Transaktionen mit börsennotierten Wertpapieren werden bei Lieferung über anerkannte Makler abgewickelt bzw. bezahlt. Das Risiko eines Zahlungsausfalls gilt als äußerst gering, da die verkauften Wertpapiere erst ausgehändigt werden, wenn die Zahlung beim Makler eingegangen ist. Bei einem Kauf werden die Wertpapiere erst bezahlt, wenn sie beim Makler eingetroffen sind. Erfüllt eine Partei ihre Verpflichtungen nicht, kommt das Geschäft nicht zustande.

Jeder Fonds geht bei Kontrahenten, mit denen er Geschäfte über nicht an einer anerkannten Börse gehandelte Optionen, Terminkontrakte und andere Derivate abschließt, ein Kreditrisiko ein. Solchen Instrumenten wird nicht derselbe Schutz gewährt wie Teilnehmern, die an einer geregelten Börse mit Swaps, Futures oder Optionen handeln, wie beispielsweise durch die Leistungsgarantie einer Clearingstelle. Für die Fonds besteht die Möglichkeit, dass die Gegenpartei, mit der die Fonds derartige Instrumente handeln, zahlungsunfähig wird, Konkurs beantragt oder in Verzug gerät, wodurch den betroffenen Fonds erhebliche Verluste entstehen können.

Die Gesellschaft ist bei den OTC-Gegenparteien, mit denen sie handelt, dem Kreditrisiko ausgesetzt. Alle OTC-Gegenparteien müssen folgende, in den OGAW-Verordnungen genannten Kriterien erfüllen:

- (i) ein Kreditinstitut gemäß Verordnung 7 der OGAW-Verordnungen der Zentralbank oder eine gemäß der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente in einem EWV-Mitgliedstaat zugelassene Investmentgesellschaft oder eine juristische Person sind, die der Regulierung als ein konsolidiertes beaufsichtigtes Unternehmen durch die Securities and Exchange Commission unterliegt, oder
- (ii) ein Mindestrating von A2 oder gleichwertig oder nach Ansicht des jeweiligen Anlageverwalters und/oder Unteranlageverwalters ein implizites Mindestrating von A2 oder gleichwertig haben.

Das Engagement bei einzelnen Kontrahenten darf normalerweise maximal 10 % des Nettoinventarwerts bei zugelassenen Kreditinstituten und 5 % des Nettoinventarwerts bei sonstigen Kontrahenten betragen.

Derivatgeschäfte werden üblicherweise mit Kontrahenten geschlossen, mit denen die Gesellschaft Globalverrechnungsverträge abgeschlossen hat. Globalverrechnungsverträge ermöglichen im Falle eines Zahlungsausfalls die Nettoabrechnung von Kontrakten für einen bestimmten Fonds mit ein und derselben Gegenpartei. Das mit Derivaten aus einem Globalverrechnungsvertrag verbundene Kreditrisiko wird nun eliminiert, wenn die derselben Gegenpartei geschuldeten finanziellen Verbindlichkeiten nach der Veräußerung der Vermögenswerte abgerechnet werden.

Sofern Transaktionen für einen Fonds zu großen nicht realisierten Gewinnen führen, kann es für einen Fonds erforderlich sein, eine von einem Makler erhaltene Sicherheit zu halten. In diesem Fall reduziert sich das Kreditrisiko des Fonds um den Wert der gehaltenen Sicherheit. Sollte der Makler Konkurs anmelden, so ist die in Verbindung mit bestimmten derivativen Finanzinstrumenten eingebrachte Sicherheit in den USA (wobei sich die Vorschriften in den verschiedenen Rechtssystemen unterscheiden können) von der bei Aufnahme des Konkursverfahrens angewandten automatischen Aussetzung ausgenommen. Diese Ausnahme für Derivate würde es einem Fonds erlauben, die von der zahlungsunfähigen Partei eingebrachte Sicherheit sofort zwangsvollstrecken zu lassen, um die Forderungen gegen die zahlungsunfähige Partei zu befriedigen.

Der Wert der als Sicherheit erhaltenen Wertpapiere in Bezug auf den Handel mit Derivaten, die von den folgenden Fonds zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 gehalten werden, betrug wie folgt:

Fonds	Broker	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
		Marktwert der Sicherheiten Tausende	Marktwert der Sicherheiten Tausende
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Morgan Stanley	\$433	\$–
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	BNP Paribas	\$–	\$241
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	JP Morgan	\$464	\$–
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	Morgan Stanley	\$283	\$–
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	BNP Paribas	\$892	\$–
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	Goldman Sachs	\$–	\$17.470
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	JP Morgan	\$–	\$6.014
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	Morgan Stanley	\$5.363	\$2.132
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	Goldman Sachs	\$–	\$48
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	JP Morgan	\$–	\$232
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	Morgan Stanley	\$–	\$318
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	Credit Suisse	\$753	\$–
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	BNP Paribas	\$692	\$–
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	Morgan Stanley	\$71	\$–

Als „–“ angegebenen Beträge belaufen sich auf 0 USD oder auf weniger als 1.000 USD.

Die Gesellschaft überwacht ihr Risiko, indem sie die Bonität und die Finanzpositionen der Kontrahenten, mit denen die Fonds Geschäfte abschließen, regelmäßig überprüft. Die Fonds dürfen nur mit genehmigten Kontrahenten handeln. Es wird eine Liste genehmigter Gegenparteien geführt und die Fonds dürfen nur mit diesen genehmigten Gegenparteien handeln. Ergänzungen zu dieser Liste werden vierteljährlich überprüft und jährlich wird eine gründliche ree-Bewertung aller Gegenparteien durchgeführt. Die Überprüfung schließt die Analyse der Angemessenheit der Eigenkapitalausstattung, der Rentabilität, der Liquidität und anderer maßgeblicher Faktoren ein.

Für die Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung kann jeder Fonds gemäß den Bestimmungen und Beschränkungen der OGAW-Vorschriften der irischen Zentralbank Wertpapierpensionsgeschäfte und 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) muss täglich für den Markt gekennzeichnet sein;
- (ii) muss dem Wert des investierten Betrags oder der ausgeliehenen Wertpapiere jederzeit entsprechen oder diesen übersteigen;
- (iii) auf den Treuhänder oder seinen Vertreter übertragen werden muss; und
- (iv) muss dem System im Falle eines Verzugs dieser Einheit ohne Rückgriff auf die Gegenpartei sofort zur Verfügung stehen.

Jede von der Gesellschaft erhaltene unbare Sicherheit kann nicht verkauft oder weiterverpfändet werden, sondern muss zum Kreditrisiko des Kontrahenten gehalten und von einer vom Kontrahenten unabhängigen Stelle ausgegeben werden. Dem Kreditrisiko begegnet man durch diversifizierten Einsatz von Kontrahenten und Emittenten und durch Mindestratings für einzelne Wertpapiere und Durchschnittsratings für die Portfolios. Der jeweilige Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter kann Portfoliolimits festlegen und auf der Grundlage interner Parameter mit gemeinsam vereinbarten Limits, die zu Beginn eines Fonds festgelegt werden, investieren, einschließlich Emissions- und Emittentenlimits, Kreditminimum und einer durchschnittlichen Kreditqualität, und das Konto wird laufend überwacht, um sicherzustellen, dass es diese Parameter weiterhin erfüllt. Darüber hinaus können vor dem Kauf strenge unabhängige Analysen aller Anleihepapiere durchgeführt werden, unter anderem Finanzmodellierung, Szenarioanalysen sowie die Überwachung von Veränderungen des Risikoprofils. Generell dürfen zum Zeitpunkt des Kaufs maximal 5 % des Portfolios in ein und dasselbe emittierende Unternehmen angelegt sein.

Der Bewertungsausschuss trifft sich mindestens einmal monatlich und wenn die Umstände dies erfordern, um Fragen der Bewertung zu erörtern und unter anderem auch das Kreditrisiko zu prüfen. Der jeweilige Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter stellt dem Verwaltungsrat und dem Ausschuss eine Risikoanalyse auf Semiannual-Basis zur Verfügung.

Im Wesentlichen werden alle Barmittel und Wertpapiere, die von den Fonds gehalten werden, über die Verwahrstelle gehalten, die ein Kreditrating von AA- hat (28. Februar 2021: AA-). 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

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.2 Kreditrisiko – (Fortsetzung)

wird von renommierten Ratingagenturen als erstklassig eingestuft. Sollte sich die Bonität oder finanzielle Lage der Verwahrstelle erheblich verschlechtern, kann der jeweilige Anlagemanager und/oder Untieranlageverwalter den Barmittelbestand auf 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 gegenüber einer Gegenpartei gestellt hat, so kann der Fonds bei Insolvenz des Kontrahenten 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 abzurechnen. 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.

Die folgende Tabelle stellt den Marktwert der Wertpapiere dar, die zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 in Bezug auf den Derivatehandel als Sicherheit bei Brokern platziert wurden:

Fonds	Broker	Stand: 28. Februar 2022 Marktwert der Sicherheiten Tausende	Stand: 28. Februar 2021 Marktwert der Sicherheiten Tausende
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Citi	\$280	\$46
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Morgan Stanley	\$89	\$115
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	Citi	\$–	\$84
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	JP Morgan	\$314	\$331
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	Citi	\$–	\$8.834

Als „–“ angegebenen Beträge belaufen sich auf 0 USD oder auf weniger als 1.000 USD.

Zur Reduzierung des Kontrahentenausfallrisikos werden bestimmte außerbörsliche Derivate über zentrale Clearingstellen abgewickelt. Im Rahmen dieser Vereinbarung werden mit Kontrahenten abgeschlossene Transaktionen an Clearingstellen abgetreten, die nach der Annahme effektiv den Kontrahenten für die Risikoaspekte der Transaktion ersetzen.

Zum 28. Februar 2022 und 28. Februar 2021 waren Margin-Konten und eingeschränkte Barmittel und andere Forderungen einem Kreditrisiko ausgesetzt. Der Gesamtbetrag der dem Kreditrisiko ausgesetzten finanziellen Vermögenswerte entspricht ungefähr ihren Buchwerten in der Bilanz (ohne Aktien).

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Zusammenfassung des Kreditrisikos, das auf der Bonität der in den Rentenfonds enthaltenen Schuldtitel basiert.

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		
Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21
AAA	72,81 %	83,73 %	AAA	47,10 %	55,61 %	AAA	45,02 %	44,61 %	AAA	24,57 %	18,08 %
Nicht eingestuft	27,19 %	16,27 %	AA	11,07 %	6,97 %	AA	5,26 %	4,34 %	AA	22,15 %	20,13 %
			A	18,44 %	18,08 %	A	15,20 %	16,57 %	A	24,74 %	29,40 %
			BBB	19,94 %	16,31 %	BBB	19,35 %	19,40 %	BBB	24,89 %	27,70 %
			BB	0,67 %	0,56 %	BB	8,44 %	7,75 %	BB	2,67 %	3,63 %
			B	–	0,09 %	B	2,85 %	3,10 %	B	0,98 %	0,96 %
			CCC und darunter	–	0,01 %	CCC und darunter	1,78 %	2,00 %	Nicht eingestuft	–	0,10 %
			Nicht eingestuft	2,78 %	2,37 %	Nicht eingestuft	2,10 %	2,23 %			
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

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		
Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21
AAA	–	0,39 %	AAA	3,71 %	10,55 %	BBB	10,04 %	9,42 %	AAA	2,74 %	2,57 %
BBB	10,05 %	9,60 %	AA	1,22 %	1,54 %	BB	38,40 %	42,28 %	AA	1,62 %	2,07 %
BB	41,49 %	43,12 %	A	6,53 %	5,55 %	B	40,14 %	39,82 %	A	9,02 %	5,58 %
B	39,45 %	37,55 %	BBB	38,17 %	37,64 %	CCC und darunter	8,62 %	6,04 %	BBB	44,63 %	47,80 %
CCC und darunter	5,24 %	5,42 %	BB	31,77 %	27,68 %	Nicht eingestuft	2,80 %	2,44 %	BB	30,15 %	31,09 %
Nicht eingestuft	3,77 %	3,92 %	B	16,07 %	13,63 %				B	11,61 %	8,42 %
			CCC und darunter	2,51 %	1,61 %				CCC und darunter	0,23 %	–
			Nicht eingestuft	0,02 %	1,80 %				Nicht eingestuft	–	2,47 %
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

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		
Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21
AA	3,97 %	4,73 %	AAA	–	2,61 %	AAA	65,48 %	64,15 %	AAA	3,21 %	5,35 %
A	3,64 %	10,13 %	BBB	16,12 %	15,60 %	AA	10,87 %	7,66 %	AA	16,36 %	19,57 %
BBB	48,05 %	48,70 %	BB	47,45 %	59,23 %	A	10,52 %	14,13 %	A	32,21 %	28,08 %
BB	32,90 %	29,49 %	B	29,73 %	18,77 %	BBB	11,66 %	12,19 %	BBB	31,43 %	31,73 %
B	11,00 %	6,95 %	CCC und darunter	5,95 %	3,79 %	BB	1,47 %	1,75 %	BB	–	0,51 %
CCC und darunter	0,44 %	–	Nicht eingestuft	0,75 %	–	Nicht eingestuft	–	0,12 %	B	–	0,28 %
									Nicht eingestuft	16,79 %	14,48 %
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund			Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>			Legg Mason Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>			Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund		
Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21
AAA	18,78 %	22,65 %	AAA	37,05 %	34,45 %	AAA	2,96 %	6,56 %	AA	0,32 %	–
AA	25,34 %	24,34 %	AA	9,75 %	11,22 %	AA	2,90 %	2,47 %	BBB	4,67 %	12,12 %
A	55,38 %	53,01 %	A	27,60 %	26,99 %	A	28,97 %	31,96 %	BB	44,13 %	47,82 %
BBB	0,50 %	–	BBB	20,71 %	22,26 %	BBB	53,75 %	52,03 %	B	46,14 %	33,92 %
			BB	4,16 %	4,61 %	BB	10,00 %	6,54 %	CCC und darunter	4,74 %	5,13 %
			B	0,73 %	0,29 %	B	0,25 %	0,44 %	Nicht eingestuft	–	1,01 %
			Nicht eingestuft	–	0,18 %	Nicht eingestuft	1,17 %	–			
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>			Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>			Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup> <sup>β</sup>			Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>		
Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21
AAA	0,78 %	6,98 %	AAA	7,10 %	3,96 %	AAA	0,49 %	0,93 %	AAA	97,64 %	98,52 %
AA	1,98 %	4,93 %	AA	1,21 %	1,26 %	AA	0,25 %	0,31 %	AA	–	0,07 %
A	8,85 %	9,42 %	A	1,83 %	2,79 %	A	2,74 %	2,46 %	A	0,53 %	0,39 %
BBB	58,67 %	50,00 %	BBB	20,53 %	25,54 %	BBB	3,69 %	4,11 %	BBB	0,96 %	0,33 %
BB	21,03 %	16,34 %	BB	32,48 %	26,61 %	BB	8,44 %	4,21 %	Nicht eingestuft	0,87 %	0,69 %
B	2,97 %	2,24 %	B	22,98 %	24,34 %	B	12,67 %	13,01 %			
Nicht eingestuft	5,72 %	10,09 %	CCC und darunter	8,05 %	7,56 %	CCC und darunter	12,61 %	13,99 %			
			Nicht eingestuft	5,82 %	7,94 %	Nicht eingestuft	59,11 %	60,98 %			
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.2 Kreditrisiko – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>†</sup>			Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund <sup>†</sup>			Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund <sup>†</sup>			Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>†</sup>		
Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21
AAA	9,21 %	11,38 %	AAA	6,98 %	2,89 %	AAA	38,15 %	40,68 %	AAA	4,22 %	–
AA	10,55 %	11,87 %	AA	11,56 %	10,17 %	AA	2,44 %	2,01 %	AA	5,57 %	–
A	44,78 %	45,25 %	A	28,98 %	32,59 %	A	10,98 %	11,42 %	A	40,12 %	–
BBB	34,35 %	30,64 %	BBB	42,26 %	43,17 %	BBB	26,87 %	24,62 %	BBB	39,39 %	–
BB	1,11 %	0,86 %	BB	7,91 %	7,77 %	BB	12,83 %	16,50 %	BB	8,40 %	–
			B	4,13 %	3,21 %	B	4,13 %	3,21 %	Nicht eingestuft	2,30 %	–
			Nicht eingestuft	1,21 %	1,17 %	CCC und darunter	0,44 %	1,56 %			
						Nicht eingestuft	4,16 %	–			
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

  

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund			Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>†</sup>			Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund <sup>†</sup>			Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21
AAA	47,36 %	52,36 %	AAA	38,24 %	43,31 %	BBB	2,66 %	2,76 %	AAA	22,15 %	27,40 %
AA	18,30 %	17,84 %	AA	15,13 %	3,06 %	BB	43,83 %	32,51 %	AA	23,12 %	16,65 %
A	6,91 %	1,44 %	A	13,75 %	13,49 %	B	41,86 %	52,58 %	A	20,10 %	9,93 %
BBB	19,86 %	20,60 %	BBB	20,68 %	23,40 %	CCC und darunter	10,50 %	12,15 %	BBB	22,75 %	31,64 %
BB	7,57 %	7,76 %	BB	12,20 %	16,74 %	Nicht eingestuft	1,15 %	–	BB	11,86 %	14,36 %
									B	0,02 %	0,02 %
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

  

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund			Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>†</sup>			Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund <sup>†</sup>			Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>†</sup>		
Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21	Rating	Feb-22	Feb-21
AAA	16,94 %	5,54 %	AAA	16,25 %	7,83 %	BBB	2,07 %	3,72 %	AAA	9,45 %	23,29 %
AA	0,67 %	–	AA	2,30 %	3,11 %	BB	47,97 %	46,50 %	AA	18,21 %	1,87 %
A	5,77 %	4,40 %	A	17,22 %	15,08 %	B	49,24 %	48,99 %	A	17,92 %	5,97 %
BBB	34,90 %	38,93 %	BBB	13,24 %	9,52 %	CCC & Below	0,72 %	0,79 %	BBB	31,87 %	45,46 %
BB	20,58 %	26,54 %	BB	17,77 %	9,01 %				BB	22,55 %	23,41 %
B	15,64 %	16,49 %	B	11,71 %	6,00 %						
CCC und darunter	5,11 %	5,05 %	CCC und darunter	5,74 %	11,61 %						
Nicht eingestuft	0,39 %	3,05 %	Nicht eingestuft	15,77 %	37,84 %						
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

<sup>†</sup> Das Portfolio wird auf Basis von Bottom-up-Basis unter Verwendung des fundamentalen Wertprozesses von Western Asset erstellt. Das Investmentteam verlässt sich nicht auf die Forschung von Rating-Agenturen, wertet dennoch auch ihre Arbeits- und Verbesserungsstufen bei Wertpapieren aus. Für Wertpapiere, die nicht von einer national anerkannten statistischen Ratingorganisation (NRSRO) bewertet werden, weist das Anlageteam auf Grundlage der Fundamentalanalyse des Anlageteams ein internes Kreditrating zu.

### 12.3 Liquiditätsrisiko

Der Verkaufsprospekt der Gesellschaft sieht die tägliche Ausgabe und Einziehung von Anteilen vor. Daraus resultiert für die Gesellschaft ein Liquiditätsrisiko, da sie die Rücknahmen von Anteilshabern jederzeit erfüllen muss.

Der Verwalter überwacht das Zeichnungs- und Rücknahmevolumen täglich und benachrichtigt den jeweiligen Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter gegebenenfalls über bedeutende Transaktionen und ungewöhnliche Trends. Wenn die Rücknahmeanträge an einem Handelstag (wie im Prospekt definiert) 10 % der im Hinblick auf einen Fonds in Umlauf befindlichen Anteile übersteigen, kann die Gesellschaft beschließen, die Gesamtanzahl der an diesem Handelstag zurückgenommenen Anteile auf 10 % der umlaufenden Anteile des Fonds zu beschränken. In diesem Fall werden alle relevanten Rücknahmeanträge anteilig reduziert. Die Gesellschaft wird die Anträge auf eine übermäßige Rücknahme aufschieben und die aufgeschobenen Anträge so behandeln, als ob sie für jeden nachfolgenden Handelstag eingegangen wären (in Bezug auf den die Gesellschaft die gleiche Aufschubbefugnis zum dann geltenden Limit hat), bis alle Anteile, auf die sich der ursprüngliche Antrag bezieht, zurückgenommen wurden. In solchen Fällen darf die Gesellschaft am nächsten und dem darauf folgenden Handelstag Anfragen anteilmäßig reduzieren, um der obigen Frist Wirkung zu verleihen.

Die Gesellschaft kann die Bestimmung des Nettoinventarwerts eines Fonds sowie den Verkauf oder die Rücknahme von Anteilen zu folgenden Zeiten vorübergehend aussetzen:

- (i) wenn ein Markt geschlossen wird, der der Hauptmarkt für einen wesentlichen Teil der Anlagen des Fonds ist, oder wenn der Handel darauf eingeschränkt oder ausgesetzt ist;
- (ii) wenn ein Notfall vorliegt, aufgrund dessen die Veräußerung von Anlagen durch die Gesellschaft, die einen wesentlichen Teil der Vermögenswerte des Fonds ausmachen, praktisch nichtsmöglich angesehen wird;
- (iii) wenn aus irgendeinem Grund die Preise von Anlagen des Fonds vom Fonds nicht angemessen, unverzüglich oder genau ermittelt werden können;
- (iv) wenn die Überweisung von Geldern, die an der Realisierung oder Zahlung von Anlagen des Fonds beteiligt sein werden oder sein könnten, nach Ansicht der Verwaltungsratsmitglieder nicht zu normalen Wechselkursen durchgeführt werden kann; oder
- (v) wenn Erlöse aus dem Verkauf oder der Rücknahme der Anteile nicht auf oder von den Konten des Fonds übertragen werden können.

Die Gesellschaft darf kurzfristig Mittel aufnehmen, um die Abwicklung sicherzustellen. Gemäß den OGAW-Vorschriften darf ein Fonds nur wie folgt Mittel aufnehmen:

- (a) kann ein Fonds Fremdwährungen durch ein „Bac-Ktob-ack“-Darlehen erwerben; und
- (b) kann ein Fonds folgende Kredite aufnehmen:
  - (i) bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts, vorausgesetzt, dass diese Kreditaufnahme vorübergehend erfolgt; und
  - (ii) bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts, sofern die Kreditaufnahme den Erwerb von Immobilien ermöglicht, die für den Zweck seiner Geschäftstätigkeit erforderlich sind;

vorausgesetzt, dass die in Unterabsatz b (i) und b (ii) genannte Kreditaufnahme insgesamt 15 % des Vermögens des Kreditnehmers nicht übersteigen darf.

#### Globale Kreditfazilität

Mit Wirkung zum 5. Februar 2021 schloss die Gesellschaft zusammen mit anderen in Europa und den USA registrierten Investmentfonds, die von Franklin Templeton Investments verwaltet werden (einzeln „Kreditnehmer“, zusammen „Kreditnehmer“), eine gemeinsame syndizierte vorrangige unbesicherte Kreditfazilität in Höhe von insgesamt 2.675 Millionen USD (die „globale Kreditfazilität“) ab, um den Kreditnehmern eine Quelle von Geldern für vorübergehende und Notfallzwecke bereitzustellen, einschließlich der Fähigkeit, zukünftige unvorhergesehene oder ungewöhnlich große Rücknahmeanträge zu erfüllen.

Gemäß den Bedingungen der globalen Kreditfazilität zahlt das Unternehmen zusätzlich zu den Zinsen, die für alle Kreditaufnahmen des Unternehmens und andere Kosten, die dem Unternehmen entstehen, berechnet werden, seinen Anteil an Gebühren und Ausgaben, die im Zusammenhang mit der Implementierung und Aufrechterhaltung der globalen Kreditfazilität anfallen, basierend auf seinem relativen Anteil am Gesamtvermögen aller Kreditnehmer, einschließlich einer jährlichen Verpflichtungsgebühr, die auf dem ungenutzten Anteil der globalen Kreditfazilität basiert.

Alle Fonds der Gesellschaft, mit Ausnahme des Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund, fallen in den Geltungsbereich der Global Credit Facility.

Zu den Aufgaben des Bewertungsausschusses gehört auch die Prüfung und Erörterung von Bewertungsfragen, unter anderem von illiquiden Wertpapieren. Die Gesellschaft kann von Zeit zu Zeit in derivative OTC-Kontrakte investieren, die nicht an einem organisierten öffentlichen Markt gehandelt werden und illiquide sein können. Folglich ist die Gesellschaft unter Umständen nicht in der Lage, ihre Anlagen in diesen Instrumenten schnell zu einem Preis zu veräußern, der ihrem angemessenen Wert entspricht, um ihren Liquiditätsbedarf zu decken oder um auf besondere Ereignisse, wie beispielsweise eine Verschlechterung der Kreditwürdigkeit eines bestimmten Emittenten, zu reagieren.

Die nachstehenden Tabellen wurden auf der Grundlage der nicht diskontierten Bruttobeträge in Bezug auf die jeweiligen finanziellen Verbindlichkeiten erstellt. Die in den folgenden Tabellen enthaltenen Devisenterminkontrakte werden brutto ausgeglichen. Einzelheiten zu den Bruttoabrechnungsbeträgen dieser Verträge entnehmen Sie bitte dem jeweiligen Anlageportfolio

<sup>†</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Nachfolgend eine Auflistung der vertraglichen Fälligkeiten der finanziellen Verbindlichkeiten der einzelnen Fonds:

Verbindlichkeiten (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	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>Geringer als 1 Monat</b>								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ –	\$ 659	\$ –	\$ 1.199	\$ 5	€ –	€ –
Margin-Konten und eingeschränkte Barmittel	–	–	2.642	4.191	2.114	5.760	508	361
Optionen	–	–	220	305	1.420	1.651	–	31
Swapkontrakte	–	–	421	247	3.508	1.290	743	105
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	50	–	820	83	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	34	1.273	755	84	184
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	19.972	28.840	5.654	38.192	44.980	179.021	1	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	6	6	55	50	48	57	–	–
Fällige Managementgebühr	55	22	141	185	668	802	2	3
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	22	21	17	18	78	81	10	7
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	16	20	31	53	1	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	1.814	119	3.508	23.242	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
rückkaufbarer und gewinnberechtigter Anteile	919.324	882.330	232.906	299.130	1.488.090	1.647.418	149.386	111.323
<b>1-3 Monate</b>								
Optionen	–	–	9	49	–	280	3	–
Swaptions	–	–	–	–	258	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	6.484	2.363	569	187
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Über 3 Monate</b>								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	1.522	915	7.691	5.029	506	325
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	379	393	86	85	283	245	52	54
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>\$ 939.758</b>	<b>\$ 911.612</b>	<b>\$ 246.212</b>	<b>\$ 343.540</b>	<b>\$ 1.562.509</b>	<b>1.868.135</b>	<b>€ 151.865</b>	<b>€ 112.580</b>

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>Geringer als 1 Monat</b>								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ 1	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 7
Margin-Konten und eingeschränkte Barmittel	51	52	–	–	–	–	181	144
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	13
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	286	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	109	13	–	–	–	–	149	20
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	36	16
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	158	3.209	–	–	–	–	–	1.156
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	29	28	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	72	89	–	–	–	–	9	6
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	9	9	5	5	2	2	7	6
Fällige Informationsstellengebühren	8	7	–	–	–	–	1	1
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	1.011	1.152	–	1	–	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
rückkaufbarer und gewinnberechtigter Anteile	81.978	102.562	–	–	–	–	59.525	48.798
<b>1-3 Monate</b>								
Optionen	–	–	–	–	–	–	2	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	30	63	–	–	–	–	149	78
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Über 3 Monate</b>								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	21
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	200	88
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	91	105	9	8	15	14	37	45
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>\$ 83.546</b>	<b>\$ 107.290</b>	<b>\$ 14</b>	<b>\$ 14</b>	<b>\$ 17</b>	<b>\$ 16</b>	<b>\$ 60.582</b>	<b>\$ 50.399</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

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	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
\$ –	\$ 3	\$ –	\$ 2.161	\$ 578	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
–	–	330	654	190	45	127	96	–	–
–	–	–	–	–	–	–	3	–	–
–	–	657	–	19	26	8	12	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
29	–	1.704	373	41	1	165	1	39	3
–	–	117	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
214	393	42	3.263	341	8.157	–	199	–	669
16	11	28	36	59	57	3	4	–	–
49	23	114	160	119	109	18	24	1	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
24	21	20	34	18	14	19	17	6	5
5	–	7	11	9	9	1	–	–	–
488	–	2.408	2.346	5.179	212	10	14	44	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
52.992	26.433	302.969	655.931	259.100	219.127	41.118	22.769	27.848	40.233
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	561	1.372	–	–	9	12	–	2
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	6	11	–	3
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	360	–	–	–	–	–	–
–	50	1.164	501	72	85	89	–	27	–
38	48	164	179	75	89	42	57	29	36
<b>\$ 53.855</b>	<b>\$ 26.982</b>	<b>\$ 310.285</b>	<b>\$ 667.381</b>	<b>\$ 265.800</b>	<b>\$ 227.931</b>	<b>\$ 41.615</b>	<b>\$ 23.219</b>	<b>\$ 27.994</b>	<b>\$ 40.951</b>

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 <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
\$ –	\$ 489	\$ 161	\$ 7	\$ 5	\$ –	\$ 9	\$ 77	€ –	€ 1
–	350	1.642	134	777	1.231	339	11	–	61
–	–	–	–	–	81	–	–	–	–
–	–	–	1.036	1.508	–	393	636	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
266	856	4.524	71	1.280	497	103	14	–	–
1.113	1.119	–	–	253	252	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
120	3.989	5.838	4.084	3.922	9.895	3	999	140	554
7	8	–	–	–	–	–	–	–	–
241	324	137	144	32	56	2	2	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
30	33	26	27	15	17	9	7	5	5
19	30	10	9	–	–	–	–	–	–
1.467	3.431	7.487	771	3.467	–	5	–	–	246
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
509.794	626.909	444.249	518.699	202.948	286.292	77.353	82.725	37.448	54.345
–	–	–	–	8	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
328	92	121	1.458	627	636	13	168	66	109
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	103	–	11	–	–
–	76	181	6	917	490	44	147	–	–
403	884	86	79	91	261	53	55	48	50
<b>\$ 513.788</b>	<b>\$ 638.590</b>	<b>\$ 464.462</b>	<b>\$ 526.525</b>	<b>\$ 215.850</b>	<b>\$ 299.811</b>	<b>\$ 78.326</b>	<b>\$ 84.852</b>	<b>€ 37.707</b>	<b>€ 55.371</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund <sup>^</sup>	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>Geringer als 1 Monat</b>								
Überziehung (Barmittel)	\$ 101.514	\$ 138.953	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 90	\$ –	\$ –
Margin-Konten und eingeschränkte Barmittel	266.033	520.034	–	–	836	3.962	–	–
Optionen	53.594	18.005	–	–	14	592	–	–
Swapkontrakte	239.384	30.745	–	–	572	1.784	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	43.262	11.290	–	–	3.533	8	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	5.137	19.467	–	–	43	534	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	14.790	146.253	–	–	2.415	22.201	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	4.149	6.299	–	–	27	21	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	243	341	5	5	22	52	–	5
Fällige Informationsstellengebühren	279	407	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	23.005	48.497	–	–	61	47	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
rückkaufbarer und gewinnberechtigter Anteile	4.183.834	6.646.080	–	–	371.899	1.081.858	–	–
<b>1-3 Monate</b>								
Optionen	72.352	15.527	–	–	163	328	–	–
Swaptions	528	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	54.894	28.168	–	–	3.707	941	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Über 3 Monate</b>								
Optionen	1.754	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	232.727	175.403	–	–	2.196	1.591	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	3.399	6.670	25	26	177	170	–	37
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>\$ 5.300.878</b>	<b>\$ 7.812.139</b>	<b>\$ 30</b>	<b>\$ 31</b>	<b>\$ 385.665</b>	<b>\$ 1.114.179</b>	<b>–</b>	<b>\$ 42</b>

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>Geringer als 1 Monat</b>								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ –	\$ 3	\$ 2.340	\$ 13	\$ 18.219	\$ 1	\$ –
Margin-Konten und eingeschränkte Barmittel	5	–	1.190	3.610	5.014	5.485	90	128
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	12	8
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	4	–	2.791	301	11.667	513	4	4
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	4.865	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	–	230	–	–	–	–	198
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	–	–	124	235	150	246	2	–
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	5	–	16	26	42	37	5	4
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	18	26	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	638	940	–	–	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
rückkaufbarer und gewinnberechtigter Anteile	9.866	–	215.635	367.907	752.718	728.674	11.590	12.059
<b>1-3 Monate</b>								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	22	–	1.692	2.285	10.197	4.398	16	26
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Über 3 Monate</b>								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	10	129	321	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	23	–	478	937	431	814	45	49
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>\$ 9.925</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 222.825</b>	<b>\$ 378.736</b>	<b>\$ 785.418</b>	<b>\$ 758.386</b>	<b>\$ 11.765</b>	<b>\$ 12.476</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund <sup>^</sup>		Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
\$ -	\$ 30	\$ 189	\$ 3	£ -	£ -	\$ 10	\$ -	\$ -	\$ -
380	-	2.408	196	-	-	280	4	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	67	6
592	1.514	-	332	-	-	-	-	68	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3.513	862	14	-	-	-	1.637	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	154	11
-	4.008	200.768	240.947	-	-	-	3.394	661	4.493
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
255	332	-	1	-	-	5	10	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
56	52	60	40	7	5	13	12	17	4
2	8	-	-	-	-	-	1	-	-
-	3.681	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.057.941	1.105.162	1.147.280	823.416	73.633	76.685	175.169	191.596	21.958	22.193
-	-	-	-	-	-	-	-	14	5
561	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	35	-	102	48	189	73
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
708	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2.083	492	666	1.278	10	65	158	197	379	157
309	278	207	156	39	38	57	53	40	37
<b>\$ 1.066.400</b>	<b>\$ 1.116.419</b>	<b>\$ 1.351.592</b>	<b>\$ 1.066.369</b>	<b>£ 73.724</b>	<b>£ 76.793</b>	<b>\$ 177.431</b>	<b>\$ 195.315</b>	<b>\$ 23.547</b>	<b>\$ 26.979</b>
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund <sup>^</sup>	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
\$ 4	\$ 10.267	\$ -	\$ 5.108	\$ 10.850	\$ -	\$ 325	\$ 750	\$ -	\$ -
610	5.780	-	90	2.390	3.823	20	120	-	49
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	12	8
2.089	756	-	1.932	11.105	1.080	-	209	182	5
-	-	-	-	-	-	40	-	-	-
-	-	-	-	61.079	1.070	-	-	-	-
-	-	-	-	37	16	-	-	-	-
119	188	-	-	998	272	46	38	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
17	35	-	8	83	22	7	10	5	3
1	1	-	-	107	32	1	1	-	-
1	111	-	79.242	3.099	188	-	12	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
244.396	585.721	-	-	1.608.073	453.285	52.386	52.020	10.163	11.774
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.970	3.149	-	-	6.048	698	145	137	14	24
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
15	70	-	-	-	-	-	-	-	-
-	723	-	-	1.309	379	41	79	-	-
166	491	253	386	71	84	67	79	38	47
<b>\$ 249.388</b>	<b>\$ 607.292</b>	<b>\$ 253</b>	<b>\$ 86.766</b>	<b>\$ 1.705.249</b>	<b>\$ 460.949</b>	<b>\$ 53.078</b>	<b>\$ 53.455</b>	<b>\$ 10.414</b>	<b>\$ 12.108</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Value Fund	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>Geringer als 1 Monat</b>								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ –
Margin-Konten und eingeschränkte Barmittel	–	–	630	1.037	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	3.495	212	29	–	641	1
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	903	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	–	508	–	–	–	304	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	–	–	5	19	–	–	567	281
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	–	3	12	24	5	4	67	36
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	–	–	–	–	56	19
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	5	–	–	701	55
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
rückkaufbarer und gewinnberechtigter Anteile	–	–	104.231	391.296	2.177	1.879	892.238	509.085
<b>1-3 Monate</b>								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	1.061	1.684	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Über 3 Monate</b>								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	523	1.176	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	13	115	893	29	32	110	102
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 16</b>	<b>\$ 111.485</b>	<b>\$ 396.346</b>	<b>\$ 2.240</b>	<b>\$ 1.915</b>	<b>\$ 894.685</b>	<b>\$ 509.579</b>

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund		Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>Geringer als 1 Monat</b>								
Überziehung (Barmittel)	\$ 397	\$ 1.096	\$ –	\$ –	\$ 8.610	\$ 2	\$ –	\$ 1
Margin-Konten und eingeschränkte Barmittel	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	123	32	38	2	2.099	45	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	2.179	–	207	–	1.602	–	–	313
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	391	546	38	31	694	246	7	4
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	61	64	8	7	106	33	6	4
Fällige Informationsstellengebühren	50	71	5	3	108	27	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	2.136	1.082	100	61	12.990	482	–	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividende zahlbar	–	–	–	–	–	–	–	–
rückkaufbarer und gewinnberechtigter Anteile	538.159	790.698	43.279	38.689	1.599.315	645.224	16.01	8
<b>1-3 Monate</b>								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
<b>Über 3 Monate</b>								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	318	341	46	52	62	25	20	20
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>\$ 543.814</b>	<b>\$ 793.930</b>	<b>\$ 43.721</b>	<b>\$ 38.845</b>	<b>\$ 1.625.586</b>	<b>\$ 646.084</b>	<b>\$ 16.051</b>	<b>\$ 11.431</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Legg Mason ClearBridge Growth Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 4	\$ 1	\$ 6.848
-	-	-	-	-	-	-	-	4.240	620
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	1.267	1.329
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	199	1.938	2.660
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	196	184	1.137	1.186
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	4	2	2	-	23	19	158	142
-	-	-	-	-	-	31	27	148	159
29	44	-	-	-	-	11.979	655	19.322	17.184
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	213.480	206.008	1.772.695	1.811.052
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	442	1.080
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
29	30	52	53	1	26	72	75	326	286
<b>\$ 58</b>	<b>\$ 74</b>	<b>\$ 57</b>	<b>\$ 57</b>	<b>\$ 1</b>	<b>\$ 28</b>	<b>\$ 225.781</b>	<b>\$ 207.171</b>	<b>\$ 1.801.674</b>	<b>\$ 1.842.533</b>

Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
€ 2	€ 6	\$ -	\$ -	\$ 14	\$ -	\$ 56	\$ 8	\$ 341	\$ -
340	250	-	-	-	-	1.170	1.310	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
367	496	30	-	332	-	1.654	483	5	3
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.204	50.148	-	69	2.075	-	14.230	12.581	99	1.554
-	1.725	-	-	-	-	-	-	-	-
549	457	2	-	186	-	747	963	91	91
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
53	50	5	4	14	-	68	71	12	9
69	50	-	-	42	-	130	164	15	15
1.968	1.534	-	-	368	-	15.803	5.816	249	94
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
671.424	605.013	2.665	2.725	173.394	-	916.209	1.288.870	87.935	91.096
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
71	62	-	-	-	-	137	128	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
95	101	47	63	29	-	200	202	64	66
<b>€ 676.142</b>	<b>€ 659.892</b>	<b>\$ 2.749</b>	<b>\$ 2.861</b>	<b>\$ 176.454</b>	<b>-</b>	<b>\$ 950.404</b>	<b>\$ 1.310.596</b>	<b>\$ 88.811</b>	<b>\$ 92.928</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>		Legg Mason PCM US Equity Fund <sup>^</sup>		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund		Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>Geringer als 1 Monat</b>								
Überziehung (Barmittel)	\$	\$	\$	\$	€	€	\$	\$
Margin-Konten und eingeschränkte Barmittel	-	-	-	-	-	-	182	482
Optionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Swapkontrakte	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	-	-	-	-	23	15	139	29
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	5	-	-	-	51	-	214	55
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-	-	-	-	-
Fällige Managementgebühr	-	-	-	-	29	29	30	36
Zahlbare Erfolgsprämien	-	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	4	-	-	-	5	6	8	7
Fällige Informationsstellengebühren	-	-	-	-	3	1	5	3
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-	49	120	20	285
Zinsverbindlichkeiten	-	-	-	-	-	-	-	-
Dividende zahlbar	-	-	-	-	-	-	-	-
rückkaufbarer und gewinnberechtigter Anteile	4.534	-	-	-	28.337	33.368	25.883	31.037
<b>1-3 Monate</b>								
Optionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Über 3 Monate</b>								
Optionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	21	-	23	23	79	107	184	215
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>\$ 4.564</b>	<b>-</b>	<b>\$ 23</b>	<b>\$ 23</b>	<b>€ 28.576</b>	<b>€ 33.646</b>	<b>\$ 26.665</b>	<b>\$ 32.149</b>

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund <sup>^</sup>	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>Geringer als 1 Monat</b>								
Überziehung (Barmittel)	\$	\$	€	€	\$	\$	\$	\$
Margin-Konten und eingeschränkte Barmittel	-	-	-	-	-	-	-	-
Optionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Swapkontrakte	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	-	-	-	244	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
Fällige Managementgebühr	-	-	-	53	-	-	-	-
Zahlbare Erfolgsprämien	-	-	3	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	4	5	3	11	-	-	3	3
Fällige Informationsstellengebühren	-	-	-	3	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	235	51	51	38	96
Zinsverbindlichkeiten	-	-	-	7	-	-	-	-
Dividende zahlbar	-	-	-	6	-	-	-	-
rückkaufbarer und gewinnberechtigter Anteile	-	-	-	40.343	-	-	-	-
<b>1-3 Monate</b>								
Optionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	-	-	-	42	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Über 3 Monate</b>								
Optionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	24	25	70	72	-	-	20	20
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>\$ 28</b>	<b>\$ 30</b>	<b>€ 76</b>	<b>€ 42.130</b>	<b>\$ 51</b>	<b>\$ 51</b>	<b>\$ 61</b>	<b>\$ 119</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

### 12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund <sup>^</sup>		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>^</sup>		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Congruix Japan Equity Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 5	\$ -	¥ -	¥ -	\$ -	\$ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	1	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	1.033	-	-	-	-	104
-	-	-	-	-	-	-	-	-	313
-	-	-	-	12	11	-	-	12	58
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	5	6	5	-	-	11	11
-	-	-	-	-	-	-	-	-	1
59	59	1	-	-	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	14.739	12.543	12.685	-	-	16.118	80.080
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	1	55	130	45	63	97.595	90.733	76	85
\$ 60	\$ 60	\$ 56	\$ 14.874	\$ 13.645	\$ 12.765	¥ 97.595	¥ 90.733	\$ 16.217	\$ 80.652

Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund		Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund <sup>^</sup>	
Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
¥ -	¥ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	2.114	-	10	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	6.577	-	280	-	-	98	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	105	34	19	17	36	26	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	76	17	10	6	4	9	7	-	2
-	-	12	2	5	3	2	2	-	-
-	-	15.197	-	-	-	443	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	169.381	104.349	27.934	26.576	47.838	41.801	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	1.264	38	36	141	98	213	202	-	20
-	¥ 1.340	\$ 193.441	\$ 104.431	\$ 28.395	\$ 26.699	\$ 48.541	\$ 42.136	-	\$ 22

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

#### 12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>	
	Stand: 28. Februar 2022	Stand: 28. Februar 2021
<b>Geringer als 1 Monat</b>		
Überziehung (Barmittel)	€ –	€ –
Margin-Konten und eingeschränkte Barmittel	–	–
Optionen	–	–
Swapkontrakte	–	–
Swaptions	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	26	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Differenzkontrakten	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	86	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–
Fällige Managementgebühr	99	30
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	34	20
Fällige Informationsstellengebühren	2	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	662	–
Zinsverbindlichkeiten	–	–
Dividende zahlbar	–	–
rückkaufbarer und gewinnberechtigter Anteile	303.590	111.371
<b>1-3 Monate</b>		
Optionen	–	–
Swaptions	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	43	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–
<b>Über 3 Monate</b>		
Optionen	–	–
Swaptions	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	19	20
<b>Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt</b>	<b>€ 304.561</b>	<b>€ 111.441</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 13. Offenlegung für Cross-Investitionen durch Fonds innerhalb der Gesellschaft

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

- die Marktwerte der zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen in den Gesamtbeträgen der Gesellschaft in der Bilanz eliminiert wurden;
- die realisierten Gewinne und Verluste, einschließlich der Entwicklung nicht realisierter Gewinne und Verluste, und die relevanten Dividenderträge und Ausschüttungen auf die Cross-Investments wurden in den gesamten Unternehmensbeträgen, die in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen sind, eliminiert; und
- die monetären Beträge der Käufe und Verkäufe von Anteilen an solchen Organismen für gemeinsame Anlagen wurden aus den Nettoerlösen aus dem Verkauf von Anteilen bzw. den Kosten der zurückerworbenen Anteile in der Gesamtsumme der Gesellschaft eliminiert, die in der Aufstellung der Änderungen des Nettovermögens, das den Inhabern rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile zuzuschreiben ist, ausgewiesen sind.

#### Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Der Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund hielt zum Jahresende null (2021: 115.764), 75.173 (2021: 84.658) bzw. 51.333 (2021: 74.291) Anteile an dem Legg Mason Western Asset US High Yield Fund, dem Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund bzw. dem Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund. Im Geschäftsjahr durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset US High Yield Fonds		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2021 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	\$123	\$778	\$354	\$344	\$-	\$-
Rücknahme von Anteilen	(10.502)	(8.580)	(1.293)	-	(5.037)	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	613	(977)	(98)	-	1.315	-
Erhaltene Ausschüttungen	123	778	354	344	-	-
Anschaffungskosten	-	9.766	7.696	8.733	8.323	12.045
Beizulegender Zeitwert	-	10.371	6.804	8.757	10.500	16.553
<b>Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten</b>	<b>\$-</b>	<b>\$605</b>	<b>\$(892)</b>	<b>\$24</b>	<b>\$2.177</b>	<b>\$4.508</b>

#### Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund hielt zum Jahresende 44.725 (2021: 20.150) Anteile am Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund. Im Geschäftsjahr durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2021 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	\$2.868	\$320
Rücknahme von Anteilen	(308)	(56)
Realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	28	-
Erhaltene Ausschüttungen	169	75
Anschaffungskosten	4.483	1.895
Beizulegender Zeitwert	4.048	2.084
<b>Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten</b>	<b>\$(435)</b>	<b>\$189</b>

#### Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Der Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund hielt zum Jahresende 20.491 (2021: 20.137) bzw. 18.300 (2021: 26.331) Anteile an dem Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund bzw. dem Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund. Im Geschäftsjahr durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2021 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2021 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	\$1.533	\$5.872	\$-	\$-
Rücknahme von Anteilen	(1.500)	(8.582)	(1.736)	-
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(4)	(412)	425	-
Erhaltene Ausschüttungen	83	72	-	-
Anschaffungskosten	2.119	2.090	2.988	4.299
Beizulegender Zeitwert	1.855	2.083	3.743	5.867
<b>Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten</b>	<b>\$(264)</b>	<b>\$(7)</b>	<b>\$755</b>	<b>\$1.568</b>

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 13. Offenlegung für Cross-Investitionen nach Fonds innerhalb der Gesellschaft – (Fortsetzung)

#### Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

Der Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup> hielt zum Jahresende 32.057 (2021: 91.922) Anteile am Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund. Im Geschäftsjahr durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2021 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	\$466	\$374
Rücknahme von Anteilen	(6.502)	–
Realisierter Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	248	–
Erhaltene Ausschüttungen	284	374
Anschaffungskosten	3.170	8.958
Beizulegender Zeitwert	2.902	9.508
<b>Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten</b>	<b>\$(268)</b>	<b>\$550</b>

#### Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup>

Der Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup> hielt zum Jahresende 29.816 (2021: 87.846) Anteile am Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>. Im Geschäftsjahr durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2021 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	\$–	\$–
Rücknahme von Anteilen	(7.509)	–
Realisierter Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	698	–
Erhaltene Ausschüttungen	–	–
Anschaffungskosten	3.500	10.311
Beizulegender Zeitwert	3.871	11.097
<b>Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten</b>	<b>\$371</b>	<b>\$786</b>

### 14. Wesentliche Ereignisse

Am 9. März 2021 wurde ein aktualisierter Haupt- und Fachprospekt von der Gesellschaft herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen. Die wesentlichen Änderungen umfassten Aktualisierungen, die beschrieben wurden, wie der Manager die Richtlinien der Anlageverwalter in Bezug auf die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken in seine Anlageentscheidung implementiert 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 stellte der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

Mit Wirkung zum 30. April 2021 begann der Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup> mit dem Handel.

Am 17. Mai 2021 wurde ein aktualisierter Hauptprospekt von der Gesellschaft herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen. Die bedeutendsten Änderungen sind:

- Aktualisierung der Anlagepolitik des Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund, des Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund, des Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund, des Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser, des Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund und des Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund;
- Benchmark-Änderungen für den Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund, den Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund und den Legg Mason ClearBridge Value Fund;
- Hinzufügung von neuen Währungen, HUF und CZK, zu bestimmten Zuschlägen;
- Entfernung des Schalenfonds – Legg Mason Western Asset US Dollar Liquidity Fund;
- Korrektur des Ersatzes von RARE durch ClearBridge im Fachprospekt des Unternehmens;
- Korrektur der Handelsfrist bis 16:00 Uhr EST am Legg Mason Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund (bisher nicht aufgelegt); und
- Klarstellung, dass das Kreditverbot eine Überziehungsfazilität auf den Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund nicht verhindert.

Mit Wirkung zum 20. Mai 2021 wurde Jane Trust zum Verwaltungsrat von FTIS ernannt.

Mit Wirkung zum 1. Juni 2021 stellte der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

Mit Wirkung zum 7. August 2021 hat Legg Mason Investments (Europe) Limited nicht mehr als Beteiligungsverwalter oder Vertriebsstelle der Gesellschaft tätig. Folglich novierte Legg Mason Investment (Europe) Limited seine jeweiligen Rechte und Pflichten gegenüber Franklin Distributors, LLC (früher bekannt als Legg Mason Investor Services, LLC), in Bezug auf die Beteiligungsdienstverträge und Vertriebsverträge, die jeweils mit Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited und Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Begrenzt.

Am 9. August 2021 wurde ein aktualisierter Hauptprospekt von der Gesellschaft herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen. Mit Wirkung zum selben 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 Verkaufsprospekts beinhalteten infolgedessen Änderungen der Namen der folgenden Fonds:

- Franklin MV European Equity Growth and Income Fund (früher 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); und
- Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund (früher Legg Mason QS MV Global Equity Growth and Income Fund).

Am 9. November 2021 wurde die Genehmigung für den Legg Mason Western Asset Global Credit Absolute Return Fund<sup>^</sup> und den Legg Mason Martin Currie North American Fund<sup>^</sup> auf Antrag der Gesellschaft durch die Zentralbank widerrufen.

Am 18. November 2021 wurde von der Gesellschaft eine Fondsergänzung zum Hauptprospekt für den Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup> herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 14. Signifikante Ereignisse – (Fortsetzung)

Am 29. November 2021 wurde ein aktualisierter Hauptprospekt von der Gesellschaft herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen.

Mit Wirkung zum 1. Dezember 2021 begann der Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup> mit dem Handel.

Am 9. Dezember 2021 wurden ein aktualisierter Haupt- und ein Fachprospekt von der Gesellschaft herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen. Die bedeutendste Änderung umfasste die Umsetzung der Taxonomieverordnung (EU) 2020/852 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 18. Juni 2020 zur Schaffung eines Rahmenwerks zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen und die Änderung der Verordnung (EU) 2019/2088 in der jeweils gültigen Fassung. Die Taxonomieverordnung ist in ihrer Anwendung zunächst auf nur zwei der sechs Umweltziele beschränkt – Klimaschutz und Klimaanpassung, wie sie in der Taxonomieverordnung definiert sind.

Mit Wirkung zum 10. Januar 2022 begann der Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup> mit dem Handel.

Am 11. Februar 2022 wurden aktualisierte Fondsnachträge für den Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, den Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup> und den Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup> von der Gesellschaft herausgegeben und von der Zentralbank notiert. Die wichtigsten Änderungen umfassten:

- Updates der Anlagerichtlinien zum Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund und Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup>;
- Zusatz der Klasse U zum Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup>; und
- Korrektur der maximalen jährlichen Verwaltungsgebühr für die Premier-Klasse des Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup> auf 0,750 %.

Während des Geschäftsjahres wirkte sich die Ausbreitung von COVID-19 weiterhin auf die Weltwirtschaft und die Finanzmärkte aus. Es ist zu früh, um die endgültigen Auswirkungen von COVID-19 zu bestimmen. Die Dauer und Tiefe des Abschwungs sowie die Auswirkungen der Finanzmärkte werden von einer Reihe von Faktoren bestimmt, darunter Bemühungen, die Kurve durch öffentliche Lockdowns, Quarantänen und soziale Distanzierung „abzufachen“. Währenddessen wurden weltweit aggressive geldpolitische und konjunkturpolitische Maßnahmen ergriffen.

Am 24. Februar 2022 begann Russland den Militäreinsatz im Hoheitsgebiet der Ukraine. Die aktuelle politische und finanzielle Unsicherheit rund um Russland und die Ukraine könnte die Marktvolatilität und das wirtschaftliche Risiko erhöhen, in Wertpapieren in diesen Ländern und anderen betroffenen Ländern innerhalb der Region zu investieren. Aufgrund der Sanktionen, Maßnahmen von Regierungen, Entwicklungen in der Ukraine selbst und anderer Umstände bewertet der Manager weiterhin die Auswirkungen auf die Bewertung und Liquidität und ergreift alle potenziell erforderlichen Maßnahmen in Übereinstimmung mit den Bewertungsrichtlinien und -verfahren des Fonds.

Im Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 gab es keine weiteren wesentlichen Ereignisse.

### 15. Getrennte Haftung

Die Gesellschaft ist ein Umbrellafonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds. Gemäß irischem Recht haftet das Vermögen jedes der 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. Nachfolgende Ereignisse

Mit Wirkung zum 27. April 2022 stellte Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund den Handel ein.

Mit Wirkung zum 21. Juni 2022 stellen der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund und der Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund den Handel ein.

Mit Wirkung zum 11. Juli 2022 stellt Franklin MV European Equity Growth and Income Fund den Handel ein.

Der Verwaltungsrat, aufgrund von Beschränkungen, die durch die Verordnung (EU) Nr. 833/2014 des Rates vom 31. Juli 2014 über restriktive Maßnahmen im Hinblick auf die Maßnahmen Russlands zur Destabilisierung der Situation in der Ukraine eingeführt wurden, in der jeweils gültigen Fassung, insbesondere durch die Verordnung (EU) 2022/328 des Rates vom 25. Februar 2022 zur Änderung der Verordnung Nr. 833/2014, und die neuen Beschränkungen, die durch die Verordnung (EU) 2022/398 des Rates zur Änderung der Verordnung (EG) Nr. 765/2006 über restriktive Maßnahmen im Hinblick auf die Situation in Weißrussland und die Beteiligung Weißrusslands an der russischen Klage gegen die Ukraine auferlegt werden, die den Umfang der EU-Sanktion auf Weißrussland ausweitet, beschlossen haben, eine Zeichnung des Fonds durch (i) eine in Russland/Weißrussland wohnhafte Person oder eine juristische Person zu verbieten, Unternehmen oder Körperschaft mit Sitz in Russland/Weißrussland („russische/weißrussische Person“), (ii) jede russische/weißrussische Person mit Wohnsitz in einem Nicht-EU-Mitgliedstaat und (iii) jeder Investor, dessen wirtschaftlich Berechtigter eine russische/weißrussische Person ist.

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

### 17. Genehmigung des Geschäftsberichts und des geprüften Jahresabschlusses

Der Verwaltungsrat genehmigte den Geschäftsbericht und den geprüften Jahresabschluss am 16. Juni 2022.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft)

	Verhältnis der Gesamtbetriebsausgaben in CU(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in CU(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022**	Verhältnis der Gesamtbetriebsausgaben in CU(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in CU(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022**
<b>Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	0,07	
Klasse A USD Ausschüttend (D)	0,07	
Klasse B USD thesaurierend	0,07	
Klasse C USD thesaurierend	0,07	
Klasse C USD Ausschüttend (D)	0,07	
Klasse X USD ausschüttend (D)	0,07	
Klasse A (G) USD thesaurierend	0,07	
Klasse A (G) Ausschüttend USD (D)	0,07	
Klasse L (G) Ausschüttende USD (D)	0,07	
<b>Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund</b>		
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)	1,71	
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	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,41	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,41	
LM-Klasse USD thesaurierend	0,11	
Klasse GA USD thesaurierend	0,93	
Klasse GE USD thesaurierend	1,53	
<b>Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,39	
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,39	
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1,39	
Klasse AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,39	
Klasse A Euro 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)	0,82	
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert)	0,81	
Premier-Klasse kumulierend in USD	0,39	
Premier-Klasse, ausschüttend USD (M)	0,39	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,39	
Ausschüttende LM-Klasse in USD (M)	0,09	
LM-Klasse Euro thesaurierend	0,09	
LM-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,09	
Klasse A (G) USD thesaurierend	1,24	
Klasse A (G) Ausschüttende USD (D)	1,24	
Klasse B (G) Ausschüttende USD (D)	1,73	
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,74	
Klasse L (G) Ausschüttende USD (D)	1,74	
<b>Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund</b>		
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,26	
Ausschüttende Klasse A Euro (D)	1,26	
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,76	
Klasse F Euro ausschüttend (Q)	0,60	
Premier-Klasse Euro thesaurierend	0,41	
LM-Klasse Euro thesaurierend	0,11	
Klasse GA Euro thesaurierend	0,93	
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	0,93	
Klasse GE Euro thesaurierend	1,53	
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,39	
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,40	
Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,40	
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1,40	
Klasse AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,40	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,40	
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1,40	
Klasse B USD thesaurierend	1,65	
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	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,75	
Premier-Klasse, ausschüttend USD (M)	0,75	
Klasse A (G) USD thesaurierend	1,39	
Klasse A (G) Ausschüttende USD (D)	1,39	
Klasse B (G) Ausschüttende USD (D)	1,91	
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,89	
Klasse L (G) Ausschüttende USD (D)	1,89	
<b>Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund</b>		
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 AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,35	
Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	1,35	
Klasse A Euro 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	1,36	
Klasse E USD thesaurierend	1,95	
Klasse E USD Ausschüttend (D)	1,95	
Klasse E Euro thesaurierend (abgesichert)	1,95	
Klasse E Euro 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	
Premier-Klasse akkumuliert in USD	0,50	
Premier-Klasse, ausschüttend USD (M)	0,51	
Premier-Klasse CHF thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Premier-Klasse, ausschüttend in Euro (M) (abgesichert)	0,50	
Premier-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (M) (abgesichert)	0,50	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (M) (abgesichert) Plus (e)	0,50	
Premier-Klasse PLN akkumulierend (abgesichert)	0,50	
LM Klasse AUD Ausschüttend (M) (abgesichert)	0,10	
LM-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,09	
<b>Legg Mason Western Asset US High Yield Fund</b>		
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 Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	1,40	
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1,34	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,40	
Klasse B USD thesaurierend	1,65	
Klasse B USD Ausschüttend (D)	1,65	
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 Euro thesaurierend (abgesichert)	2,00	
Klasse F USD thesaurierend	0,80	
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,80	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,55	
Premier-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,61	
LM-Klasse USD thesaurierend	0,10	
Ausschüttende LM-Klasse in USD (M)	0,10	
LM-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,10	
Klasse A (G) USD thesaurierend	1,25	
Klasse A (G) Ausschüttend USD (D)	1,25	
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,75	
Klasse L (G) Ausschüttend USD (D)	1,75	
Klasse GF USD thesaurierend	1,05	
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,79	
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,79	
Klasse A USD ausschüttend (M)	1,79	
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1,79	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,79	
Klasse A Euro ausschüttend (D) (abgesichert)	1,79	
Ausschüttende GBP der Klasse A (D) (abgesichert)	1,79	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,78	
Klasse C USD thesaurierend	2,29	
Klasse C USD Ausschüttend (D)	2,29	
Klasse E USD Ausschüttend (D)	2,45	
Klasse E Euro thesaurierend (abgesichert)	2,44	
Klasse E Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	2,46	
Klasse F USD thesaurierend	1,00	
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,09	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,74	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,75	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (D) (abgesichert)	0,73	
Ausschüttende LM-Klasse in USD (M) (abgesichert)	0,14	
Klasse A (G) USD thesaurierend	1,45	
Klasse A (G) Ausschüttende USD (D)	1,45	
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,94	
Klasse L (G) Ausschüttende USD (D)	1,94	

## Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Verhältnis der Gesamtbetriebsausgaben in CU(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in CU(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022**	Verhältnis der Gesamtbetriebsausgaben in CU(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in CU(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022**
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,81	
Klasse A USD ausschüttend (M)	1,97	
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert)	1,04	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,71	
Ausschüttende LM-Klasse in USD (M)	0,16	
<b>Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,52	
Klasse A USD ausschüttend (D)	1,52	
Klasse A USD ausschüttend (M)	1,52	
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1,52	
Klasse AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,53	
Klasse A Euro thesaurierend	1,52	
Klasse A Euro ausschüttend (D) (abgesichert)	1,53	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,53	
Klasse B USD thesaurierend	1,77	
Klasse B USD Ausschüttend (D)	1,77	
Klasse C USD thesaurierend	2,02	
Klasse C USD Ausschüttend (D)	2,02	
Klasse E USD thesaurierend	2,12	
Klasse E USD Ausschüttend (D)	2,12	
Klasse E Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	2,12	
Klasse F USD thesaurierend	0,82	
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,82	
Klasse X USD Ausschüttend (D)	0,90	
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,90	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,58	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,57	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (D) (abgesichert)	0,57	
Klasse A (G) USD thesaurierend	1,37	
Klasse A (G) Ausschüttende USD (D)	1,38	
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,87	
Klasse L (G) Ausschüttende USD (D)	1,87	
<b>Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,19	
Klasse A USD ausschüttend (A)	1,19	
Klasse B USD thesaurierend	1,44	
Klasse C USD thesaurierend	1,68	
Klasse C USD Ausschüttend (A)	1,69	
Klasse F USD thesaurierend	0,73	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,48	
LM-Klasse USD thesaurierend	0,16	
Klasse A (G) USD thesaurierend	1,00	
Klasse A (G) Ausschüttende USD (A)	1,00	
Klasse L (G) Ausschüttende USD (A)	1,50	
<b>Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund</b>		
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 AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35	
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	1,35	
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35	
Klasse A Euro thesaurierend	1,35	
Klasse A Euro ausschüttend (A)	1,35	
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1,35	
Klasse A SGD akkumulierend (abgesichert)	1,35	
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35	
Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	1,35	
Klasse B USD thesaurierend	1,60	
Klasse B USD Ausschüttend (D)	1,60	
Klasse C USD thesaurierend	1,85	
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,85	
Klasse E USD thesaurierend	1,95	
Klasse E USD Ausschüttend (D)	1,95	
Klasse F USD thesaurierend	0,95	
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,95	
Klasse X USD thesaurierend	0,85	
Klasse X USD Ausschüttend (M)	0,85	
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert)	0,85	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,70	
Premier-Klasse Euro thesaurierend	0,70	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,70	
Ausschüttende Premier-Klasse in Euro (A)	0,70	
Ausschüttende Premier-Klasse in Euro (M)	0,70	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (M)	0,70	
LM-Klasse USD thesaurierend	0,10	
LM-Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	0,10	
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,09	
Klasse A USD ausschüttend (M)	1,09	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,10	
Klasse A SEK, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,95	
Klasse C USD thesaurierend	1,60	
Klasse C USD Ausschüttend (M)	1,60	
Klasse E USD thesaurierend	1,69	
Klasse E USD Ausschüttend (D)	1,70	
Klasse F USD thesaurierend	0,70	
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,70	
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert)	0,67	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,45	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,44	
Ausschüttende Premier-Klasse in Euro (M) (abgesichert)	0,44	
Premier-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (M) (abgesichert)	0,44	
Klasse S USD Ausschüttend (M) Plus (e)	0,34	
S Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,35	
S-Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,34	
Ausschüttende GBP-Klasse S (M) (abgesichert) Plus (e)	0,35	
LM-Klasse AUD thesaurierend (abgesichert)	0,10	
<b>Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD ausschüttend (A)	1,40	
Klasse X USD thesaurierend	0,81	
Premier-Klasse akkumuliert in USD	0,50	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Premier-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,55	
Premier-Klasse NZD, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
LM-Klasse USD thesaurierend	0,10	
LM-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,11	
KHK-Klasse LM, thesaurierend (abgesichert)	0,10	
<b>Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,29	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,29	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,49	
Premier-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,49	
LM-Klasse USD thesaurierend	0,14	
LM-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,14	
<b>Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund</b>		
Klasse A Euro ausschüttend (D)	1,46	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	0,85	
Premier-Klasse GBP kumulierend (abgesichert)	0,60	
LM-Klasse Euro thesaurierend	0,16	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Verhältnis der Gesamtbetriebsausgaben in CU(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in CU(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022**	Verhältnis der Gesamtbetriebsausgaben in CU(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in CU(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022**
<b>Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,74	
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1,74	
Ausschüttende Klasse A USD (S)	1,74	
AUD der Klasse A, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A CNH akkumulierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A Euro ausschüttend (A)	1,74	
Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A Euro ausschüttend (S) (abgesichert)	1,74	
Akkumulierendes GBP der Klasse A	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)	1,76	
Klasse A SEK akkumulierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A SGD akkumulierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,77	
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 Akkumulierend (abgesichert)	1,75	
Klasse E USD thesaurierend	2,34	
Klasse E USD Ausschüttend (S)	2,34	
Klasse E Euro 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 Euro thesaurierend	1,24	
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert)	1,24	
Klasse X Euro ausschüttend (A) (abgesichert)	1,24	
Klasse X Euro 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 akkumulierend (abgesichert)	1,24	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	1,09	
Premier-Klasse, ausschüttend USD (S)	1,09	
AUD der Premier-Klasse, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Ausschüttende Premier-Klasse AUD (S) (abgesichert)	1,09	
Premier-Klasse BRL, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Premier-Klasse CHF thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Ausschüttende Premier-Klasse CHF (S) (abgesichert)	1,09	
Premier-Klasse Euro thesaurierend	1,09	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Ausschüttende Premier-Klasse in Euro (S) (abgesichert)	1,09	
Premier-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (M) (abgesichert) Plus (e)	1,09	
Premier-Klasse JPY, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Premier-Klasse JPY, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,09	
Premier-Klasse PLN akkumulierend (abgesichert)	1,09	
Premier-Klasse, SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
S-Klasse USD thesaurierend	0,69	
S Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,69	
LM Klasse AUD Ausschüttend (S) (abgesichert)	0,09	
LM-Klasse Euro thesaurierend	0,09	
<b>Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,49	
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1,49	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,49	
Klasse C USD thesaurierend	2,05	
Klasse F USD thesaurierend	0,89	
Klasse X CHF Ausschüttend (M) (abgesichert)	0,86	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,69	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (M) (abgesichert) Plus (e)	0,69	
S Klasse USD thesaurierend	0,49	
S Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,49	
S-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,49	
LM-Klasse AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,09	
LM-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,09	
LM-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,09	
S Klasse CHF Ausschüttend (A)	0,51	
<b>Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse D Euro thesaurierend (abgesichert)	1,44	
Klasse D Euro ausschüttend (M) (abgesichert)	1,44	
Klasse D USD thesaurierend	1,44	
Klasse D USD Ausschüttend (M)	1,43	
Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus	1,43	
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 Euro thesaurierend (abgesichert)	0,85	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,69	
Premier-Klasse, ausschüttend USD (Q)	0,69	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,69	
Ausschüttende Premier-Klasse in Euro (Q) (abgesichert)	0,69	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (M) (abgesichert) Plus (e)	0,69	
Premier-Klasse JPY, thesaurierend (abgesichert)	0,69	
LM-Klasse USD thesaurierend	0,09	
<b>Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A, ausschüttende USD (M) Plus (e)	1,24	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,38	
LM-Klasse USD thesaurierend	0,09	
<b>Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A GBP thesaurierend	1,10	
Premier-Klasse GBP thesaurierend	0,49	
LM-Klasse GBP thesaurierend	0,11	
<b>Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,06	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,41	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,41	
LM-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,11	
<b>Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup></b>		
LM Klasse USD Ausschüttend (Q)	-	
<b>Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,15	
Klasse F USD thesaurierend	0,75	
Premier-Klasse akkumuliert in USD	0,50	
Premier-Klasse BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Premier-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,50	
S Klasse USD thesaurierend	0,40	
S Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,40	
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,36	
Klasse A USD ausschüttend (M)	1,36	
Klasse A USD ausschüttend (S)	1,36	
Klasse AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,36	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,36	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert) (IH)	1,36	
Klasse A Euro ausschüttend (A) (abgesichert)	1,36	
Klasse A Euro ausschüttend (S)	1,36	
Klasse A Euro ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1,36	
Klasse A GBP thesaurierend	1,36	
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	1,36	
Klasse A GBP Ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1,36	
Klasse A SGD akkumulierend	1,37	
Klasse B USD thesaurierend	1,61	
Klasse B USD Ausschüttend (S)	1,61	
Klasse C USD thesaurierend	1,86	
Klasse C USD Ausschüttend (S)	1,86	
Klasse E USD thesaurierend	1,96	
Klasse E Euro thesaurierend (abgesichert) (IH)	1,96	
Klasse F USD thesaurierend	0,96	
Klasse F USD Ausschüttend (S)	0,96	
Klasse R GBP Ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,96	
Klasse X USD thesaurierend	0,86	
Klasse X USD Ausschüttend (S)	0,86	
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert)	0,85	
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,86	
Klasse X Euro ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,86	
Klasse X GBP, thesaurierend	0,86	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,86	
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)	0,86	
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,86	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,71	
Premier-Klasse, ausschüttend USD (S)	0,71	
Premier-Klasse Euro thesaurierend	0,71	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,71	
Premier-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,69	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (M) (abgesichert)	0,71	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (S) (abgesichert) (IH)	0,71	
LM-Klasse USD thesaurierend	0,11	
LM-Klasse USD thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,11	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Verhältnis der Gesamtbetriebsausgaben in CU(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in CU(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022**	Verhältnis der Gesamtbetriebsausgaben in CU(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in CU(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022**
<b>Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,59	
Klasse A USD ausschüttend (A)	1,59	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,59	
Klasse A SEK akkumulierend (abgesichert)	0,95	
Klasse C USD thesaurierend	2,09	
Klasse E USD thesaurierend	2,19	
Klasse E, USD, ausschüttend (A)	2,18	
Klasse F USD thesaurierend	1,19	
Klasse X USD thesaurierend	1,14	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,14	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,14	
Premier-Klasse akkumuliert in USD	0,99	
Premier-Klasse USD ausschüttend (A)	0,99	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,99	
Ausschüttende Premier-Klasse in Euro (A) (abgesichert)	0,99	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (M) (abgesichert)	0,99	
LM-Klasse USD thesaurierend	0,09	
LM-Klasse AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,09	
<b>Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,40	
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,40	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,75	
Premier-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,75	
S-Klasse CAD Akkumulierend (abgesichert) (IH)	0,60	
<b>Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,40	
Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,40	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,45	
Klasse A SGD akkumulierend	1,42	
Klasse C USD thesaurierend	1,90	
Klasse E USD thesaurierend	2,00	
Klasse F USD thesaurierend	1,00	
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	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,75	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (M) (abgesichert) (IH)	0,75	
Premier-Klasse NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,75	
LM-Klasse Euro thesaurierend	0,10	
LM-Klasse NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,10	
<b>Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund</b>		
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	1,34	
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1,34	
AUD der Klasse A, thesaurierend (abgesichert)	1,34	
Klasse AUD ausschüttend (M) Plus (abgesichert)	1,34	
Klasse A CNH Ausschüttend (M) Abgesichert Plus	1,33	
Klasse A Euro thesaurierend	1,40	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,34	
Klasse A Euro ausschüttend (A) (abgesichert)	1,34	
Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34	
Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,34	
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34	
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,34	
Klasse A HKD, thesaurierend	1,34	
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1,34	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,34	
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 E Euro thesaurierend (abgesichert)	1,94	
Klasse F USD thesaurierend	0,89	
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,89	
Klasse X USD thesaurierend	0,79	
Klasse X USD ausschüttend (D)	0,79	
Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	0,79	
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)	0,79	
Klasse X CHF Ausschüttend (A) (abgesichert)	0,79	
Klasse X Euro thesaurierend	0,79	
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert)	0,79	
Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,79	
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,79	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,64	
Premier-Klasse, ausschüttend USD (M) Plus (e)	0,64	
Premier-Klasse BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,64	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,64	
Premier-Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,64	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (M) (abgesichert) Plus (e)	0,64	
Premier-Klasse SEK akkumulierend (abgesichert)	0,64	
S Klasse USD thesaurierend	0,44	
Klasse S USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	0,44	
S Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,44	
S-Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,44	
Ausschüttende GBP-Klasse S (M) (abgesichert) Plus (e)	0,44	
Ausschüttende LM-Klasse in USD (M)	0,09	
LM-Klasse Euro ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	0,11	
LM-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,09	
<b>Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,95	
Klasse X USD Ausschüttend (M)	1,45	
Premier-Klasse akkumuliert in USD	1,30	
LM-Klasse USD thesaurierend	0,15	
<b>Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1,35	
S-Klasse Euro ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)	0,55	
<b>Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup> □</b>		
Klasse A USD thesaurierend	2,26	
Klasse A SGD akkumulierend (abgesichert)	2,26	
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,42	
LM-Klasse AUD thesaurierend (abgesichert)	0,11	
<b>Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,70	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,75	
Premier-Klasse GBP thesaurierend	0,75	
S Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,50	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Verhältnis der Gesamtbetriebsausgaben in CU(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in CU(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022**	Verhältnis der Gesamtbetriebsausgaben in CU(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in CU(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022**
<b>Legg Mason ClearBridge Value Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,79	
Klasse A USD ausschüttend (A)	1,79	
Klasse A Euro thesaurierend	1,79	
Klasse A Euro ausschüttend (A) (abgesichert)	1,79	
Ausschüttende Klasse A GBP (A)	1,79	
SGD Klasse A, thesaurierend	1,79	
Klasse A SGD akkumulierend (abgesichert)	1,79	
Klasse C USD thesaurierend	2,29	
Klasse C USD ausschüttend (A)	2,29	
Klasse E, USD, thesaurierend	2,54	
Klasse F USD thesaurierend	1,19	
Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,19	
Klasse X USD ausschüttend (A)	1,11	
Klasse X Euro thesaurierend	1,12	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,76	
Premier-Klasse, ausschüttend USD (A)	0,77	
Premier-Klasse Euro thesaurierend	0,77	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,77	
Ausschüttende LM-Klasse in USD (A)	0,09	
<b>Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,71	
Klasse A USD ausschüttend (A)	1,71	
Klasse A Euro thesaurierend	1,71	
Klasse B USD thesaurierend	2,20	
Klasse B USD Ausschüttend (A)	2,21	
Klasse C USD thesaurierend	2,21	
Klasse C USD ausschüttend (A)	2,21	
Klasse E USD thesaurierend	2,46	
Klasse E, USD, ausschüttend (A)	2,46	
Klasse F USD thesaurierend	1,11	
Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,11	
Klasse X USD ausschüttend (A)	1,08	
Klasse X Euro thesaurierend	1,08	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,73	
Premier-Klasse, ausschüttend USD (A)	0,73	
Premier-Klasse Euro thesaurierend	0,73	
LM-Klasse USD thesaurierend	0,11	
LM-Klasse Euro thesaurierend	0,11	
Klasse A (G) USD thesaurierend	1,36	
Klasse B (G) USD thesaurierend	2,35	
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,86	
Klasse GA USD thesaurierend	1,53	
Klasse GA Euro thesaurierend	1,53	
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	1,53	
Klasse GE USD thesaurierend	2,28	
Klasse GE Euro thesaurierend	2,27	
<b>Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,69	
Klasse A USD ausschüttend (A)	1,69	
Klasse A Euro thesaurierend	1,69	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,69	
Klasse B USD thesaurierend	2,19	
Klasse B USD Ausschüttend (A)	2,19	
Klasse C USD thesaurierend	2,19	
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,19	
Klasse E USD thesaurierend	2,44	
Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,44	
Klasse F USD thesaurierend	1,09	
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,09	
Klasse U USD thesaurierend	0,62	
Klasse U Euro thesaurierend	0,62	
Klasse X USD thesaurierend	1,07	
Klasse X Euro thesaurierend	1,06	
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert)	1,06	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,07	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,72	
Premier-Klasse, ausschüttend USD (A)	0,72	
Premier-Klasse BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Premier-Klasse Euro thesaurierend	0,72	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Ausschüttende Premier-Klasse in Euro (A)	0,72	
Premier-Klasse GBP thesaurierend	0,72	
LM-Klasse USD thesaurierend	0,09	
LM-Klasse Euro 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 Euro thesaurierend	1,51	
<b>Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,74	
Klasse A USD ausschüttend (A)	1,74	
AUD der Klasse A, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A CNH akkumulierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A Euro thesaurierend	1,74	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A Euro ausschüttend (A) (abgesichert)	1,74	
Akkumulierendes GBP der Klasse A	1,74	
Klasse A HKD, thesaurierend	1,74	
Klasse A SEK akkumulierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A SGD akkumulierend (abgesichert)	1,74	
Klasse B USD thesaurierend	2,24	
Klasse B USD Ausschüttend (A)	2,24	
Klasse C USD thesaurierend	2,24	
Klasse C USD ausschüttend (A)	2,24	
Klasse E, USD, thesaurierend	2,49	
Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,49	
Klasse E Euro thesaurierend	2,48	
Klasse E Euro thesaurierend (abgesichert)	2,49	
Klasse F USD thesaurierend	1,14	
Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,14	
Klasse X USD thesaurierend	1,09	
Klasse X USD Ausschüttend (A)	1,09	
Klasse X Euro thesaurierend	1,09	
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,09	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,74	
Premier-Klasse Euro thesaurierend	0,74	
Ausschüttende Premier-Klasse in Euro (A)	0,74	
Premier-Klasse GBP thesaurierend	0,74	
Premier-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,74	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (A)	0,74	
Premier-Klasse PLN akkumulierend (abgesichert)	0,74	
LM-Klasse Euro thesaurierend	0,09	
Klasse A (G) USD thesaurierend	1,39	
Klasse B (G) USD thesaurierend	1,89	
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,89	
Klasse GA Euro thesaurierend	1,51	
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	1,51	
Klasse GE USD thesaurierend	2,26	
Klasse GE Euro thesaurierend	2,26	
<b>Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,75	
Klasse A USD ausschüttend (A)	1,75	
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1,75	
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1,75	
Klasse A USD ausschüttend (Q)	1,75	
Klasse AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,75	
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,75	
Klasse A Euro thesaurierend	1,75	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,75	
Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,75	
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1,75	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,75	
Klasse C USD thesaurierend	2,25	
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,25	
Klasse C USD Ausschüttend (Q)	2,25	
Klasse F USD thesaurierend	1,15	
Klasse F Euro thesaurierend	1,15	
Klasse F Euro ausschüttend (A)	1,15	
Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,13	
<b>Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,64	
Klasse A USD ausschüttend (A)	1,64	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,64	
Klasse A SEK akkumulierend	1,50	
Klasse F USD thesaurierend	1,04	
Klasse X USD thesaurierend	1,04	
Klasse X USD ausschüttend (A)	1,04	
Klasse X Euro thesaurierend	1,04	
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert)	1,03	
Klasse X GBP thesaurierend	1,04	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,03	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,69	
Premier-Klasse, ausschüttend USD (A)	0,69	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,69	
Premier-Klasse GBP akkumulierend	0,69	
S Klasse USD thesaurierend	0,49	
S Klasse Euro thesaurierend	0,49	
S Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,49	
S-Klasse GBP thesaurierend	0,49	
S-Klasse GBP thesaurierend (abgesichert)	0,49	
Ausschüttende GBP-Klasse S (Q)	0,49	
LM-Klasse Euro thesaurierend	0,09	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Verhältnis der Gesamtbetriebsausgaben in CU(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in CU(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022**	Verhältnis der Gesamtbetriebsausgaben in CU(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in CU(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022**
<b>Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,80	
Premier-Klasse kumulierend in USD	0,80	
<b>Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,95	
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	1,94	
Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,94	
Klasse A USD ausschüttend (Q)	1,94	
Klasse AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,94	
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,94	
Klasse A Euro thesaurierend	1,94	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert) (PH)	1,94	
Klasse A Euro 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 Euro thesaurierend	1,04	
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert) (PH)	1,04	
Klasse X GBP Ausschüttend (Q)	1,04	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,84	
Premier-Klasse BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,84	
Premier-Klasse CAD-Ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	0,84	
Premier-Klasse, CAD-Ausschüttend (Q) Plus (e)	0,84	
Premier-Klasse Euro thesaurierend	0,84	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert) (PH)	0,84	
Premier-Klasse GBP thesaurierend	0,84	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	0,84	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (Q)	0,84	
X GBP Ausschüttend (Q) (abgesichert)	1,04	
<b>Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	2,15	
Klasse A USD ausschüttend (Q)	2,15	
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert)	1,35	
Klasse X GBP Ausschüttend (Q)	1,35	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	1,15	
<b>Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,97	
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1,97	
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1,97	
Klasse AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,97	
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,96	
Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,97	
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2,00	
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1,96	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,97	
Klasse X ausschüttende USD (M) Plus (e)	1,22	
Klasse X Euro ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	1,22	
Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	1,23	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,90	
Premier-Klasse USD ausschüttend (M) Plus	0,89	
Ausschüttende Premier-Klasse in Euro (M) (abgesichert)	0,87	
S-Klasse USD thesaurierend	0,52	
Klasse S USD Ausschüttend (M) Plus	0,52	
<b>Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,95	
Klasse A USD ausschüttend (A)	1,94	
Klasse AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,94	
Klasse A CNH akkumulierend (abgesichert)	1,94	
Klasse A Euro thesaurierend	1,95	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,94	
Klasse A Euro ausschüttend (A) (abgesichert)	1,95	
Klasse A GBP thesaurierend (abgesichert)	1,95	
Ausschüttende Klasse A GBP (A)	1,95	
Klasse A SEK akkumulierend (abgesichert)	1,94	
SGD der Klasse A akkumulierend	1,95	
Klasse A SGD akkumulierend (abgesichert)	1,95	
Klasse B USD thesaurierend	2,45	
Klasse B USD Ausschüttend (A)	2,45	
Klasse C USD thesaurierend	2,45	
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,45	
Klasse E, USD, thesaurierend	2,70	
Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,70	
Klasse E Euro thesaurierend	2,70	
Klasse E Euro thesaurierend (abgesichert)	2,69	
Klasse F USD thesaurierend	1,35	
Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,35	
Klasse R USD thesaurierend	1,44	
Klasse R Euro thesaurierend	1,44	
Klasse X USD thesaurierend	1,19	
Klasse X USD ausschüttend (A)	1,20	
Klasse X Euro thesaurierend	1,19	
Klasse X Euro thesaurierend (abgesichert)	1,20	
Klasse X GBP thesaurierend	1,20	
Klasse X GBP Ausschüttend (A)	1,20	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,85	
Premier-Klasse BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,85	
Premier-Klasse Euro thesaurierend	0,85	
Premier-Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,84	
Premier-Klasse GBP thesaurierend	0,84	
Premier-Klasse PLN akkumulierend (abgesichert)	0,85	
<b>Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,98	
Klasse A USD ausschüttend (A)	1,98	
Klasse A Euro thesaurierend	1,98	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,98	
Klasse A Euro ausschüttend (A)	1,98	
Ausschüttende Klasse A GBP (A)	1,98	
Klasse A SEK akkumulierend (abgesichert)	1,98	
Klasse C USD thesaurierend	2,48	
Klasse C USD ausschüttend (A)	2,48	
Klasse E USD thesaurierend	2,73	
Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,73	
Klasse E Euro thesaurierend	2,73	
Klasse F USD thesaurierend	1,39	
Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,39	
Klasse R USD thesaurierend	1,48	
Klasse X USD thesaurierend	1,23	
Klasse X USD ausschüttend (A)	1,23	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,88	
Premier-Klasse, ausschüttend USD (A)	0,88	
Ausschüttende Premier-Klasse in GBP (A)	0,88	
LM-Klasse Euro thesaurierend	0,14	
Klasse A (G) USD thesaurierend	1,38	
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,88	
<b>Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup> ◊</b>		
Klasse A USD thesaurierend	2,00	
Klasse X USD thesaurierend	1,25	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,90	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Verhältnis der Gesamtbetriebsausgaben in CU(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in CU(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022**	Verhältnis der Gesamtbetriebsausgaben in CU(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in CU(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022**
<b>Franklin MV European Equity Growth and Income Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,80	
Klasse A USD kumulierend (abgesichert)	1,80	
Klasse A USD ausschüttend (A)	1,80	
Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,80	
Klasse AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,81	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,79	
Klasse A Euro thesaurierend	1,80	
Klasse A Euro ausschüttend (A)	1,80	
Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus	1,80	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,82	
Klasse B USD thesaurierend	2,32	
Klasse B ausschüttend USD (A)	2,30	
Klasse C USD thesaurierend	2,30	
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,30	
Klasse E, USD, thesaurierend (abgesichert)	2,54	
Klasse F USD thesaurierend	1,21	
Klasse X Euro thesaurierend	1,18	
Premier-Klasse Euro thesaurierend	0,79	
Premier-Klasse PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,78	
LM-Klasse Euro thesaurierend	0,13	
Klasse A (G) USD thesaurierend	1,48	
Klasse B (G) USD thesaurierend	2,02	
Klasse L (G) USD thesaurierend	1,98	
Klasse GA USD thesaurierend	1,55	
Klasse GA Euro thesaurierend	1,55	
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	1,55	
Klasse GE USD thesaurierend	2,30	
<b>Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,84	
Klasse A USD ausschüttend (A)	1,84	
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1,84	
Klasse AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,84	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,84	
Klasse A Euro thesaurierend	1,83	
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1,84	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,84	
Klasse B USD Ausschüttend (A)	2,34	
Klasse C USD thesaurierend	2,34	
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,34	
Klasse E USD thesaurierend	2,69	
Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,67	
Klasse F USD thesaurierend	1,32	
Premier-Klasse PLN akkumulierend (abgesichert)	0,89	
Klasse GA USD thesaurierend	1,84	
Klasse GA Euro thesaurierend	1,84	
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	1,85	
Klasse GE USD thesaurierend	2,59	
<b>Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund</b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,85	
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1,85	
Klasse AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,85	
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1,84	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,85	
Klasse X USD thesaurierend	1,18	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,82	
Klasse GA USD thesaurierend	1,79	
Klasse GA Euro thesaurierend	1,79	
Klasse GA Euro ausschüttend (A)	1,79	
Klasse GE USD thesaurierend	2,54	
Klasse GE Euro thesaurierend	2,54	
<b>Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,98	
Klasse M GBP Ausschüttend (A)	1,20	
Klasse F USD thesaurierend	1,40	
Klasse M USD Ausschüttend (A)	1,19	
Klasse M Euro ausschüttend (A)	1,20	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,78	
Premier-Klasse GBP thesaurierend	0,77	
<b>Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,96	
Klasse A Euro thesaurierend	1,96	
Klasse A Euro thesaurierend (abgesichert)	1,96	
Klasse C USD thesaurierend	2,46	
Klasse E, USD, thesaurierend	2,71	
Klasse F USD thesaurierend	1,35	
Klasse X USD thesaurierend	1,20	
Klasse X Euro thesaurierend	1,21	
Klasse X GBP thesaurierend	1,21	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,21	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,86	
Premier-Klasse GBP kumulierend (abgesichert)	0,86	
S Klasse USD thesaurierend	0,51	
S Klasse Euro thesaurierend (abgesichert)	0,51	
S-Klasse GBP thesaurierend	0,51	
<b>Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund</b>		
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	2,00	
Klasse AUD Ausschüttend (M) Plus	2,00	
Klasse A Euro 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	
AUD der Klasse X, die sich ansammelt	1,25	
Klasse X USD thesaurierend	1,25	
S-Klasse GBP thesaurierend	0,59	
Ausschüttende GBP-Klasse S (M) Plus (e)	0,59	
Akkumulierende LM-Klasse AUD	0,15	
<b>Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend	1,99	
Klasse E USD thesaurierend	2,74	
Klasse F USD thesaurierend	1,39	
Klasse X USD thesaurierend	1,24	
Premier-Klasse, USD, thesaurierend	0,89	
S-Klasse USD thesaurierend	0,69	
S Klasse Euro thesaurierend	0,69	
<b>Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	1,93	
Klasse A Euro thesaurierend	1,94	
Klasse E USD thesaurierend (abgesichert)	2,67	
Klasse X Euro thesaurierend	1,19	
Premier-Klasse BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,84	
Premier-Klasse Euro thesaurierend	0,84	
S Klasse Euro thesaurierend	0,44	
S-Klasse GBP thesaurierend	0,44	
S Klasse USD thesaurierend	0,44	

Die Berechnungsmethode der Total Expense Ratios (TER) ist auf der Website Asset Management Association Switzerland (AMAS, ehemals Swiss Funds & Asset Management Association, SFAMA) beschrieben ([www.am-switzerland.ch](http://www.am-switzerland.ch)).

(1) CU = Währungseinheiten in der Rechnungslegungswährung des Fonds.

\*\* Annualisiert für Zeiträume von weniger als einem Jahr.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Ergänzende Informationen – Fondsperformancedaten (ungeprüft)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegung Datum	Klasse CCY	Geschäftsjahr seit		3 Jahre kumulativ	10 Jahre Leistung
				Jahresbeginn	Kalender		
				01/03/21-28/02/22	01/01/21-31/12/21	01/01/19-31/12/21	01/03/12-28/02/22
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	Klasse A USD, thesaurierend	08/05/2007	USD	0,01 %	0,01 %	1,78 %	3,77 %
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	27/02/2004	USD	0,01 %	0,01 %	1,78 %	3,85 %
	Klasse B USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	0,01 %	0,02 %	1,24 %	2,36 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	0,01 %	0,01 %	0,92 %	1,69 %
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	27/02/2004	USD	0,01 %	0,01 %	0,92 %	1,78 %
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	10/10/2018	USD	0,01 %	0,01 %	1,97 %	–
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	0,01 %	0,01 %	1,78 %	3,78 %
	Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	20/04/2007	USD	0,01 %	0,01 %	1,78 %	3,76 %
	Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	20/04/2007	USD	0,02 %	0,02 %	1,78 %	3,76 %
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	Klasse A USD, thesaurierend	09/05/2007	USD	(4,38) %	(2,70) %	15,62 %	27,53 %
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	30/08/2002	USD	(4,38) %	(2,70) %	15,68 %	26,86 %
	Klasse B USD, ausschüttend (D)	24/02/2004	USD	(4,61) %	(2,94) %	15,13 %	24,02 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	(4,87) %	(3,19) %	13,90 %	21,34 %
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	24/02/2004	USD	(4,87) %	(3,19) %	13,96 %	20,67 %
	Klasse E USD, thesaurierend	16/08/2019	USD	(4,96) %	(3,28) %	–	–
	Klasse F USD, thesaurierend	09/08/2013	USD	(3,86) %	(2,16) %	17,55 %	–
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	27/02/2017	USD	(3,86) %	(2,16) %	17,63 %	–
	Klasse X USD, thesaurierend	13/05/2016	USD	(3,93) %	(2,24) %	17,29 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	03/05/2016	USD	(3,95) %	(2,25) %	17,30 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	19/04/2017	USD	(3,63) %	(1,93) %	18,44 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	01/03/2019	EUR	(4,46) %	(2,78) %	–	–
	Klasse GA USD, thesaurierend	27/08/2010	USD	(4,11) %	(2,43) %	16,60 %	30,44 %
	Klasse GE USD, thesaurierend	27/08/2010	USD	(4,70) %	(3,00) %	14,53 %	22,83 %
	Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	(4,52) %	(2,56) %	17,07 %
Klasse A USD, ausschüttend (D)		20/04/2007	USD	(4,53) %	(2,56) %	17,10 %	28,31 %
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		19/02/2016	USD	(4,53) %	(2,55) %	17,09 %	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		19/02/2016	AUD	(4,83) %	(2,88) %	14,30 %	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		12/06/2018	EUR	(5,42) %	(3,47) %	10,79 %	–
Klasse B USD, ausschüttend (D)		20/04/2007	USD	(4,77) %	(2,80) %	16,34 %	25,23 %
Klasse C USD, thesaurierend		15/11/2007	USD	(5,00) %	(3,05) %	15,33 %	22,09 %
Klasse C USD, ausschüttend (D)		20/04/2007	USD	(5,00) %	(3,04) %	15,37 %	22,05 %
Klasse E USD, thesaurierend		03/02/2012	USD	(5,09) %	(3,14) %	14,99 %	20,82 %
Klasse F USD, thesaurierend		05/04/2013	USD	(3,81) %	(1,82) %	19,74 %	–
Klasse F USD, ausschüttend (D)		31/10/2018	USD	(3,80) %	(1,82) %	19,93 %	–
Klasse X USD, thesaurierend		20/03/2015	USD	(3,97) %	(2,01) %	19,11 %	–
Klasse X USD, ausschüttend (D)		28/11/2017	USD	(3,98) %	(1,99) %	19,16 %	–
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		10/10/2019	EUR	(4,89) %	(2,94) %	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		14/09/2010	USD	(3,56) %	(1,58) %	20,64 %	41,78 %
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)		29/09/2011	USD	(3,56) %	(1,58) %	20,55 %	41,67 %
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		02/03/2016	EUR	(4,45) %	(2,48) %	14,07 %	–
Klasse LM EUR, thesaurierend		05/04/2016	EUR	4,08 %	5,92 %	22,46 %	–
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		19/11/2010	GBP	(3,52) %	(1,55) %	17,92 %	37,63 %
Klasse A (G) USD, thesaurierend		20/04/2007	USD	(4,38) %	(2,41) %	17,61 %	30,23 %
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		20/04/2007	USD	(4,38) %	(2,41) %	17,62 %	30,10 %
Klasse B (G) Ausschüttende USD (D)		20/04/2007	USD	(4,80) %	(2,85) %	15,98 %	24,09 %
Klasse L (G) USD, thesaurierend		20/04/2007	USD	(4,86) %	(2,90) %	15,84 %	23,87 %
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	20/04/2007	USD	(4,85) %	(2,90) %	15,88 %	23,80 %	
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Klasse A USD, ausschüttend (D)	24/02/2004	USD	(11,24) %	(9,67) %	7,74 %	2,46 %
	Klasse A EUR, ausschüttend (D)	30/09/2003	EUR	(4,48) %	(3,09) %	8,45 %	25,34 %
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	24/02/2004	USD	(11,56) %	(10,02) %	6,43 %	0,85 %
	Klasse F EUR, ausschüttend (Q)	03/12/2010	EUR	(3,82) %	(2,41) %	10,68 %	35,01 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	01/03/2019	EUR	(3,66) %	(2,26) %	–	–
	Klasse LM EUR, thesaurierend	02/05/2017	EUR	(3,36) %	(1,97) %	12,26 %	–
	Klasse GA EUR, thesaurierend	27/08/2010	EUR	(4,15) %	(2,77) %	9,53 %	29,52 %
	Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	27/08/2010	EUR	(4,15) %	(2,77) %	9,53 %	29,52 %
	Klasse GE EUR, thesaurierend	27/08/2010	EUR	(4,73) %	(3,35) %	7,57 %	21,98 %
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	Klasse A USD, thesaurierend	09/05/2007	USD	1,19 %	4,24 %	19,38 %	38,38 %
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	24/02/2004	USD	1,22 %	4,29 %	19,34 %	37,22 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	08/01/2008	USD	1,18 %	4,25 %	19,38 %	38,39 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	23/03/2017	USD	1,19 %	4,25 %	19,39 %	–
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	23/03/2017	AUD	0,84 %	3,88 %	16,40 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	08/05/2008	EUR	0,33 %	3,35 %	13,23 %	21,24 %
	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	23/03/2017	HKD	1,94 %	4,85 %	18,84 %	–
	Klasse B USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	0,93 %	3,98 %	18,44 %	34,89 %
	Klasse B USD, ausschüttend (D)	24/02/2004	USD	0,92 %	4,00 %	18,41 %	33,71 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	0,68 %	3,72 %	17,60 %	31,62 %
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	24/02/2004	USD	0,69 %	3,74 %	17,55 %	30,50 %
	Klasse F USD, thesaurierend	31/01/2020	USD	1,60 %	4,66 %	–	–
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	1,20 %	4,22 %	19,08 %	37,18 %
	Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	20/04/2007	USD	1,19 %	4,22 %	18,99 %	36,87 %
	Klasse B (G) Ausschüttende USD (D)	20/04/2007	USD	0,68 %	3,69 %	17,17 %	30,06 %
	Klasse L (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	0,69 %	3,70 %	17,31 %	30,48 %
	Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	20/04/2007	USD	0,69 %	3,72 %	17,24 %	30,19 %

## Ergänzende Informationen – Fondsperformancedaten (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegung Datum	Klasse CCY	Geschäftsjahr seit		3 Jahre kumulativ	10 Jahre Leistung	
				Jahresbeginn	Kalender			
				01/03/21-28/02/22	01/01/21-31/12/21	01/01/19-31/12/21	01/03/12-28/02/22	
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Klasse A USD, thesaurierend	09/05/2007	USD	(3,91) %	(1,12) %	17,26 %	25,87 %	
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	30/08/2002	USD	(3,90) %	(1,12) %	17,27 %	25,71 %	
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	19/02/2008	USD	(3,91) %	(1,12) %	17,26 %	25,85 %	
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	19/01/2017	USD	(3,90) %	(1,12) %	17,28 %	-	
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	19/01/2017	AUD	(4,23) %	(1,48) %	14,09 %	-	
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	12/02/2008	EUR	(4,78) %	(2,03) %	10,94 %	10,55 %	
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	28/04/2008	EUR	(4,78) %	(2,03) %	10,92 %	10,54 %	
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	02/04/2013	EUR	(4,77) %	(2,03) %	10,90 %	-	
	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	29/05/2008	GBP	(4,09) %	(1,36) %	13,47 %	18,75 %	
	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	07/09/2017	HKD	(3,19) %	(0,55) %	16,75 %	-	
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	26/05/2009	SGD	(3,88) %	(1,17) %	15,76 %	23,15 %	
	Klasse B USD, ausschüttend (D)	24/02/2004	USD	(4,14) %	(1,36) %	16,42 %	22,62 %	
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	(4,39) %	(1,61) %	15,52 %	19,74 %	
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	24/02/2004	USD	(4,38) %	(1,61) %	15,53 %	19,57 %	
	Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	26/04/2018	ZAR	0,03 %	3,12 %	31,75 %	-	
	Klasse E USD, thesaurierend	21/01/2010	USD	(4,48) %	(1,71) %	15,17 %	18,53 %	
	Klasse E USD, ausschüttend (D)	21/01/2010	USD	(4,48) %	(1,71) %	15,18 %	18,38 %	
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	19/05/2011	EUR	(5,34) %	(2,61) %	8,94 %	4,05 %	
	Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	02/08/2013	EUR	(5,35) %	(2,62) %	8,96 %	-	
	Klasse F USD, thesaurierend	04/02/2010	USD	(3,32) %	(0,53) %	19,39 %	33,65 %	
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	21/01/2010	USD	(3,34) %	(0,53) %	19,39 %	33,47 %	
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	03/07/2013	USD	(3,39) %	(0,57) %	19,22 %	-	
	Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	27/06/2016	GBP	(3,59) %	(0,83) %	15,46 %	-	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	10/09/2008	USD	(3,08) %	(0,28) %	20,29 %	37,02 %	
	Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	06/02/2009	USD	(3,08) %	(0,28) %	20,30 %	37,03 %	
	Klasse Premier CHF, thesaurierend (Abgesichert)	27/10/2015	CHF	(4,14) %	(1,41) %	12,72 %	-	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	17/12/2009	EUR	(3,96) %	(1,19) %	13,84 %	20,60 %	
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	23/11/2012	EUR	(3,96) %	(1,17) %	13,80 %	-	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	03/12/2010	GBP	(3,28) %	(0,54) %	16,43 %	28,99 %	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	18/04/2008	GBP	(3,26) %	(0,52) %	16,40 %	28,56 %	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	05/02/2013	GBP	(3,28) %	(0,53) %	16,35 %	-	
	Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	08/10/2015	PLN	(2,92) %	(0,42) %	18,03 %	-	
	Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	03/12/2010	AUD	(3,01) %	(0,25) %	18,55 %	54,81 %	
	Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	03/12/2010	GBP	(2,88) %	(0,11) %	17,89 %	34,31 %	
	Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	Klasse A USD, thesaurierend	09/05/2007	USD	0,14 %	4,76 %	28,92 %	56,85 %
		Klasse A USD, ausschüttend (D)	27/02/2004	USD	0,14 %	4,76 %	28,88 %	56,59 %
		Klasse A USD, ausschüttend (M)	20/12/2010	USD	0,13 %	4,76 %	28,92 %	56,82 %
		Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	21/11/2012	USD	0,13 %	4,76 %	28,91 %	-
		Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	19/12/2012	EUR	(0,70) %	3,85 %	21,98 %	-
		Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	31/01/2013	SGD	0,24 %	4,83 %	27,31 %	-
		Klasse B USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	(0,11) %	4,51 %	27,96 %	52,98 %
		Klasse B USD, ausschüttend (D)	27/02/2004	USD	(0,14) %	4,48 %	27,88 %	52,68 %
		Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	(0,36) %	4,24 %	26,99 %	49,20 %
		Klasse C USD, ausschüttend (D)	27/02/2004	USD	(0,37) %	4,23 %	26,93 %	48,87 %
		Klasse E USD, thesaurierend	21/01/2010	USD	(0,46) %	4,13 %	26,60 %	47,68 %
		Klasse E USD, ausschüttend (D)	21/01/2010	USD	(0,46) %	4,14 %	26,55 %	47,54 %
		Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	25/09/2019	EUR	(1,31) %	3,23 %	-	-
		Klasse F USD, thesaurierend	04/01/2011	USD	0,74 %	5,39 %	31,26 %	66,49 %
		Klasse F USD, ausschüttend (D)	04/01/2011	USD	0,80 %	5,44 %	30,97 %	80,47 %
Klasse Premier USD, thesaurierend		08/11/2010	USD	0,99 %	5,65 %	32,24 %	70,73 %	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		09/08/2019	GBP	0,79 %	5,37 %	-	-	
Klasse LM USD, thesaurierend		19/11/2010	USD	1,44 %	6,13 %	34,04 %	78,59 %	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		27/05/2008	USD	1,45 %	6,13 %	34,04 %	78,61 %	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		12/06/2020	GBP	1,26 %	5,88 %	-	-	
Klasse A (G) USD, thesaurierend		20/04/2007	USD	0,29 %	4,92 %	29,49 %	59,18 %	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		20/04/2007	USD	0,28 %	4,91 %	29,43 %	58,82 %	
Klasse L (G) USD, thesaurierend		20/04/2007	USD	(0,22) %	4,40 %	27,56 %	51,42 %	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)		20/04/2007	USD	(0,21) %	4,39 %	27,50 %	51,10 %	
Klasse GF USD, thesaurierend		19/11/2010	USD	0,49 %	5,13 %	30,27 %	62,41 %	
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund		Klasse A USD, thesaurierend	04/05/2007	USD	(8,88) %	(3,32) %	14,66 %	17,62 %
		Klasse A USD, ausschüttend (D)	24/02/2004	USD	(8,87) %	(3,32) %	14,64 %	17,20 %
		Klasse A USD, ausschüttend (M)	03/01/2008	USD	(8,88) %	(3,33) %	14,66 %	17,63 %
		Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	21/11/2012	USD	(8,88) %	(3,32) %	14,73 %	-
		Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	05/01/2010	EUR	(9,65) %	(4,16) %	8,69 %	3,07 %

## Ergänzende Informationen – Fondsperformancedaten (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegung Datum	Klasse CCY	Geschäftsjahr seit		3 Jahre kumulativ	10 Jahre Leistung
				Jahresbeginn	Kalender		
				01/03/21-28/02/22	01/01/21-31/12/21	01/01/19-31/12/21	01/03/12-28/02/22
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – (Fortsetzung)	Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	19/12/2012	EUR	(9,64) %	(4,15) %	8,73 %	–
	Klasse A GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	30/06/2010	GBP	(9,03) %	(3,55) %	11,37 %	11,10 %
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	18/01/2011	SGD	(8,92) %	(3,30) %	13,01 %	11,49 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	(9,34) %	(3,81) %	12,96 %	11,89 %
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	24/02/2004	USD	(9,33) %	(3,80) %	12,96 %	11,49 %
	Klasse E USD, ausschüttend (D)	04/01/2011	USD	(9,47) %	(3,99) %	12,13 %	9,61 %
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	13/10/2017	EUR	(10,22) %	(4,81) %	6,30 %	–
	Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	02/08/2013	EUR	(10,25) %	(4,83) %	6,27 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	20/04/2010	USD	(8,15) %	(2,59) %	17,15 %	26,74 %
	Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	19/12/2013	GBP	(8,41) %	(2,93) %	13,36 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	09/11/2020	USD	(7,91) %	(2,34) %	–	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	20/10/2011	EUR	(8,71) %	(3,21) %	11,88 %	14,21 %
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	19/02/2013	GBP	(8,09) %	(2,60) %	14,35 %	–
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	(8,56) %	(3,02) %	15,57 %	21,14 %
	Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	20/04/2007	USD	(8,56) %	(3,02) %	15,56 %	21,00 %
	Klasse L (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	(9,02) %	(3,51) %	13,84 %	15,21 %
	Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	20/04/2007	USD	(9,02) %	(3,49) %	13,85 %	15,11 %
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund	Klasse A USD, thesaurierend	04/03/2013	USD	(10,28) %	(3,30) %	14,80 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	21/10/2011	USD	(10,21) %	(3,24) %	17,45 %	20,49 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	22/01/2020	EUR	(10,00) %	(3,02) %	–	–
	Klasse LM USD, ausschüttend (M)	21/10/2011	USD	(8,73) %	(1,64) %	23,15 %	39,51 %
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	(4,25) %	0,94 %	22,50 %	41,03 %
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	20/04/2007	USD	(4,25) %	0,95 %	22,67 %	41,03 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	30/01/2008	USD	(4,25) %	0,92 %	22,46 %	40,93 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	21/11/2012	USD	(4,25) %	0,93 %	22,46 %	–
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	28/06/2010	AUD	(4,59) %	0,51 %	18,94 %	52,56 %
	Klasse A EUR, thesaurierend	23/05/2017	EUR	3,03 %	8,30 %	23,29 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	25/09/2012	EUR	(5,12) %	–	15,96 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	18/01/2011	SGD	(4,19) %	0,89 %	20,80 %	37,80 %
	Klasse B USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	(4,48) %	0,69 %	21,58 %	37,55 %
	Klasse B USD, ausschüttend (D)	20/04/2007	USD	(4,49) %	0,68 %	21,70 %	37,48 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	(4,72) %	0,44 %	20,67 %	34,16 %
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	20/04/2007	USD	(4,72) %	0,43 %	20,83 %	34,18 %
	Klasse E USD, thesaurierend	21/01/2010	USD	(4,82) %	0,33 %	20,28 %	32,72 %
	Klasse E USD, ausschüttend (D)	21/01/2010	USD	(4,81) %	0,33 %	20,45 %	32,73 %
	Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	02/08/2013	EUR	(5,68) %	(0,59) %	13,83 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	04/01/2011	USD	(3,58) %	1,64 %	25,05 %	51,24 %
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	04/01/2011	USD	(3,60) %	1,64 %	25,25 %	50,98 %
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	21/03/2018	USD	(3,63) %	1,57 %	25,04 %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	15/01/2013	GBP	(3,84) %	1,30 %	20,90 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	10/08/2009	USD	(3,34) %	1,89 %	26,00 %	54,96 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	12/10/2012	EUR	(4,19) %	0,97 %	19,19 %	–
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	12/08/2011	GBP	(3,54) %	1,63 %	21,94 %	45,47 %
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	(4,10) %	1,08 %	23,02 %	43,06 %
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	20/04/2007	USD	(4,11) %	1,06 %	23,17 %	42,97 %	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	(4,58) %	0,58 %	21,19 %	36,09 %	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	20/04/2007	USD	(4,58) %	0,58 %	21,33 %	36,10 %	
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	4,13 %	3,32 %	14,26 %	19,38 %
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	20/04/2007	USD	4,13 %	3,32 %	14,25 %	19,38 %
	Klasse B USD, thesaurierend	29/09/2016	USD	3,88 %	3,06 %	13,40 %	–
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	20/04/2007	USD	3,62 %	2,81 %	12,55 %	13,57 %
	Klasse LM USD, thesaurierend	04/01/2018	USD	5,22 %	4,37 %	17,78 %	–
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	4,35 %	3,54 %	14,99 %	22,61 %
	Klasse A (G) Ausschüttende USD (A)	20/04/2007	USD	4,34 %	3,52 %	14,94 %	22,58 %
	Klasse L (G) Ausschüttende USD (A)	20/04/2007	USD	3,83 %	3,02 %	13,23 %	16,60 %
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Klasse A USD, thesaurierend	02/07/2008	USD	(2,61) %	(3,72) %	13,79 %	18,14 %
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	02/07/2008	USD	(2,62) %	(3,71) %	13,74 %	17,97 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	07/01/2010	USD	(2,62) %	(3,73) %	13,78 %	18,14 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	21/11/2012	USD	(2,62) %	(3,73) %	13,77 %	–
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	28/09/2011	AUD	(2,89) %	(4,04) %	11,50 %	27,98 %
	Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	26/01/2015	CHF	(3,66) %	(4,81) %	6,82 %	–
	Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	20/06/2013	CNH	(0,29) %	(1,40) %	18,27 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	02/07/2008	EUR	4,73 %	3,27 %	14,48 %	40,16 %

# Ergänzende Informationen – Fondsperformancedaten (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegung Datum	Klasse CCY	Geschäftsjahr seit		3 Jahre kumulativ	10 Jahre Leistung	
				Jahresbeginn	Kalender			
				01/03/21-28/02/22	01/01/21-31/12/21	01/01/19-31/12/21	01/03/12-28/02/22	
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – (Fortsetzung)	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	19/05/2011	EUR	(3,44) %	(4,60) %	7,75 %	3,32 %	
	Klasse A EUR, ausschüttend (A)	01/04/2011	EUR	4,79 %	3,31 %	14,53 %	37,20 %	
	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	27/10/2015	HKD	(1,91) %	(3,20) %	13,14 %	–	
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	19/05/2009	SGD	(2,64) %	(3,76) %	12,54 %	15,16 %	
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	18/01/2011	SGD	(2,62) %	(3,78) %	12,49 %	14,84 %	
	Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	04/08/2010	SGD	(1,16) %	(1,92) %	12,09 %	27,17 %	
	Klasse B USD, thesaurierend	02/07/2008	USD	(2,86) %	(3,97) %	12,93 %	15,22 %	
	Klasse B USD, ausschüttend (D)	02/07/2008	USD	(2,87) %	(3,97) %	12,83 %	15,06 %	
	Klasse C USD, thesaurierend	02/07/2008	USD	(3,10) %	(4,20) %	12,09 %	12,38 %	
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	02/07/2008	USD	(3,11) %	(4,21) %	12,03 %	12,24 %	
	Klasse E USD, thesaurierend	21/01/2010	USD	(3,20) %	(4,30) %	11,76 %	11,26 %	
	Klasse E USD, ausschüttend (D)	21/01/2010	USD	(3,20) %	(4,30) %	11,72 %	11,11 %	
	Klasse F USD, thesaurierend	04/02/2010	USD	(2,23) %	(3,33) %	15,16 %	22,93 %	
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	21/01/2010	USD	(2,23) %	(3,34) %	15,13 %	22,92 %	
	Klasse X USD, thesaurierend	07/04/2020	USD	(2,17) %	(3,25) %	–	–	
	Klasse X USD, ausschüttend (M)	07/05/2015	USD	(2,13) %	(3,24) %	15,51 %	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	11/09/2020	EUR	(2,96) %	(4,11) %	–	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	02/07/2008	USD	(1,98) %	(3,10) %	16,03 %	26,08 %	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	03/09/2010	EUR	5,47 %	3,98 %	16,73 %	49,22 %	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	10/03/2011	EUR	(2,82) %	(3,98) %	9,92 %	10,48 %	
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	09/01/2013	EUR	5,47 %	3,99 %	16,78 %	–	
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (M)	08/09/2010	EUR	5,47 %	3,98 %	16,78 %	49,71 %	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M)	16/07/2010	GBP	1,87 %	(2,02) %	9,47 %	50,65 %	
	Klasse LM USD, thesaurierend	12/06/2008	USD	(1,39) %	(2,51) %	18,14 %	33,87 %	
	Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Klasse A USD, thesaurierend	25/06/2009	USD	(2,87) %	(1,55) %	8,16 %	13,78 %
		Klasse A USD, ausschüttend (M)	02/06/2009	USD	(2,87) %	(1,55) %	8,16 %	13,81 %
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		30/01/2014	EUR	(3,70) %	(2,42) %	2,69 %	–	
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)		23/06/2020	SEK	(3,40) %	(2,13) %	–	–	
Klasse A SEK, ausschüttend (M) (abgesichert)		23/06/2020	SEK	(3,15) %	(1,93) %	–	–	
Klasse C USD, thesaurierend		25/06/2009	USD	(3,35) %	(2,04) %	6,55 %	8,25 %	
Klasse C USD, ausschüttend (M)		25/06/2009	USD	(3,35) %	(2,04) %	6,54 %	8,26 %	
Klasse E USD, thesaurierend		21/01/2010	USD	(3,45) %	(2,14) %	6,23 %	7,30 %	
Klasse E USD, ausschüttend (D)		21/01/2010	USD	(3,45) %	(2,14) %	6,21 %	7,18 %	
Klasse F USD, thesaurierend		04/02/2010	USD	(2,48) %	(1,15) %	9,48 %	18,81 %	
Klasse F USD, ausschüttend (D)		22/06/2020	USD	(2,47) %	(1,15) %	–	–	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		17/06/2020	EUR	(3,28) %	(1,99) %	–	–	
Klasse Premier USD, thesaurierend		02/06/2009	USD	(2,24) %	(0,91) %	10,30 %	21,70 %	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		01/03/2019	EUR	(3,07) %	(1,80) %	–	–	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		02/06/2009	EUR	(3,10) %	(1,80) %	4,61 %	7,01 %	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		02/06/2009	GBP	(2,41) %	(1,16) %	7,21 %	15,04 %	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		02/06/2009	GBP	(2,41) %	(1,15) %	7,22 %	15,39 %	
Ausschüttende Klasse S USD (M) Plus (e)		15/12/2017	USD	(2,14) %	(0,81) %	10,64 %	–	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Å Plus (e)		12/12/2017	EUR	(2,98) %	(1,69) %	4,98 %	–	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Å Plus (e)		12/12/2017	GBP	(2,32) %	(1,07) %	7,56 %	–	
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD, ausschüttend (A)	05/03/2015	USD	(3,20) %	(1,81) %	13,74 %	–	
	Klasse X USD, thesaurierend	17/02/2015	USD	(3,02) %	(1,67) %	15,30 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	03/12/2010	USD	(2,73) %	(1,37) %	16,33 %	45,55 %	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	27/06/2014	EUR	(3,58) %	(2,27) %	10,20 %	–	
	Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert)	12/12/2017	NZD	(2,66) %	(1,39) %	14,57 %	–	
	Klasse LM USD, thesaurierend	28/03/2019	USD	(2,34) %	(0,98) %	–	–	
	Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	17/10/2018	CAD	(2,45) %	(1,13) %	16,07 %	–	
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD, thesaurierend	15/11/2011	USD	(4,93) %	(1,39) %	21,07 %	37,20 %	
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	15/11/2011	EUR	(5,75) %	(2,26) %	14,66 %	20,56 %	
	Klasse LM USD, thesaurierend	27/01/2011	USD	(3,84) %	(0,22) %	25,48 %	54,61 %	
	Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	15/01/2021	EUR	(4,68) %	–	–	–	
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund	Klasse A EUR, ausschüttend (D)	03/12/2010	EUR	(2,50) %	1,69 %	12,40 %	52,45 %	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	09/08/2019	GBP	(0,82) %	3,38 %	–	–	
	Klasse LM EUR, thesaurierend	03/12/2010	EUR	(1,22) %	3,02 %	16,98 %	72,62 %	
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD, thesaurierend	29/11/2013	USD	(7,98) %	(1,07) %	22,49 %	–	
	Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	01/08/2014	USD	(7,98) %	(1,07) %	22,49 %	–	
	Klasse A USD, ausschüttend (S)	08/04/2014	USD	(7,98) %	(1,08) %	22,47 %	–	
	Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	16/10/2017	AUD	(8,43) %	(1,46) %	18,68 %	–	
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	27/02/2015	AUD	(8,42) %	(1,47) %	18,69 %	–	
	Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	14/02/2014	CHF	(9,07) %	(2,27) %	14,67 %	–	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Ergänzende Informationen – Fondsperformancedaten (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegung Datum	Klasse CCY	Geschäftsjahr seit		3 Jahre kumulativ	10 Jahre Leistung
				Jahresbeginn	Kalender		
				01/03/21-28/02/22	01/01/21-31/12/21	01/01/19-31/12/21	01/03/12-28/02/22
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – (Fortsetzung)	Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	19/09/2014	CNH	(5,82) %	1,29 %	27,16 %	–
	Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	03/12/2014	CNH	(5,83) %	1,27 %	27,15 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	14/02/2014	EUR	(8,93) %	(2,01) %	15,72 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (A)	07/04/2015	EUR	(0,98) %	6,15 %	23,07 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	15/03/2019	EUR	(8,94) %	(2,02) %	–	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	07/04/2016	EUR	(8,96) %	(2,03) %	15,64 %	–
	Klasse A GBP, thesaurierend	23/12/2014	GBP	(4,43) %	–	15,25 %	–
	Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	14/02/2014	GBP	(8,30) %	(1,40) %	17,34 %	–
	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	18/08/2016	GBP	(8,28) %	(1,41) %	18,10 %	–
	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	04/06/2019	HKD	(7,38) %	(0,50) %	–	–
	Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	15/05/2015	SEK	(8,83) %	(1,82) %	15,70 %	–
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	10/03/2014	SGD	(8,08) %	(1,16) %	20,60 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	03/12/2014	SGD	(8,01) %	(1,15) %	20,79 %	–
	Klasse B USD, thesaurierend	15/09/2014	USD	(8,21) %	(1,32) %	21,58 %	–
	Klasse C USD, thesaurierend	05/05/2014	USD	(8,44) %	(1,56) %	20,67 %	–
	Klasse C USD, ausschüttend (S)	15/07/2014	USD	(8,45) %	(1,57) %	20,66 %	–
	Klasse A JPY Ausschüttend (M) Plus (e)	17/12/2019	JPY	(0,76) %	10,20 %	–	–
	Klasse A NOK, thesaurierend (abgesichert)	21/09/2017	NOK	(8,25) %	(1,38) %	17,56 %	–
	Klasse E USD, thesaurierend	13/05/2014	USD	(8,53) %	(1,66) %	20,31 %	–
	Klasse E USD, ausschüttend (S)	28/07/2014	USD	(8,53) %	(1,67) %	20,30 %	–
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	25/08/2014	EUR	(9,48) %	(2,60) %	13,65 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	18/06/2014	USD	(7,61) %	(0,67) %	23,97 %	–
	Klasse F USD, ausschüttend (S)	16/10/2014	USD	(7,61) %	(0,68) %	23,97 %	–
	Klasse X USD, thesaurierend	05/03/2014	USD	(7,52) %	(0,58) %	24,34 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	26/10/2015	USD	(7,51) %	(0,58) %	24,34 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (S)	03/02/2015	USD	(7,52) %	(0,58) %	24,34 %	–
	Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)	05/03/2014	CHF	(8,60) %	(1,78) %	16,40 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend	29/07/2014	EUR	(0,47) %	6,70 %	25,08 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	14/02/2014	EUR	(8,48) %	(1,52) %	17,47 %	–
	Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	11/08/2016	EUR	(8,48) %	(1,53) %	17,46 %	–
	Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	17/05/2016	EUR	(8,48) %	(1,51) %	17,48 %	–
	Klasse X GBP, thesaurierend	23/12/2014	GBP	(3,97) %	0,42 %	17,06 %	–
	Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	14/02/2014	GBP	(7,82) %	(0,91) %	19,90 %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	20/10/2015	GBP	(7,79) %	(0,88) %	19,93 %	–
	Klasse X SGD, thesaurierend (abgesichert)	10/03/2014	SGD	(7,60) %	(0,66) %	22,58 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	29/11/2013	USD	(7,38) %	(0,43) %	24,90 %	–
	Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	10/02/2015	USD	(7,38) %	(0,43) %	24,90 %	–
	Klasse Premier AUD, thesaurierend (abgesichert)	03/07/2017	AUD	(7,84) %	(0,83) %	21,06 %	–
	Klasse Premier AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	24/07/2015	AUD	(7,87) %	(0,87) %	20,94 %	–
	Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	22/12/2015	BRL	(3,75) %	2,22 %	29,17 %	–
	Klasse Premier CHF, thesaurierend (Abgesichert)	04/12/2014	CHF	(8,48) %	(1,63) %	16,90 %	–
	Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)	27/11/2015	CHF	(8,49) %	(1,66) %	16,89 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	03/07/2014	EUR	(0,34) %	6,83 %	25,59 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	26/03/2014	EUR	(8,34) %	(1,37) %	18,02 %	–
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	27/11/2015	EUR	(8,37) %	(1,39) %	17,97 %	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	01/12/2014	GBP	(7,68) %	(0,76) %	20,44 %	–
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	21/05/2014	GBP	(7,69) %	(0,77) %	20,42 %	–
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	01/12/2016	JPY	(7,85) %	(0,96) %	19,27 %	–	
Klasse Premier JPY, ausschüttend (S) (abgesichert)	10/09/2019	JPY	(7,86) %	(0,97) %	–	–	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	21/07/2017	PLN	(7,48) %	(0,66) %	22,15 %	–	
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	15/05/2015	SEK	(8,22) %	(1,17) %	17,91 %	–	
Klasse S USD, thesaurierend	29/11/2013	USD	(7,01) %	(0,03) %	26,41 %	–	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	29/11/2013	EUR	(7,99) %	(0,99) %	19,42 %	–	
Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	09/08/2016	AUD	(6,93) %	0,13 %	24,76 %	–	
Klasse LM EUR, thesaurierend	05/04/2016	EUR	0,66 %	7,92 %	29,48 %	–	
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD, thesaurierend	11/08/2016	USD	(1,69) %	1,83 %	16,75 %	–
	Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	16/12/2015	USD	(1,61) %	2,01 %	18,03 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	23/01/2017	EUR	(2,58) %	0,90 %	10,58 %	–
	Klasse C USD, thesaurierend	09/08/2016	USD	(1,75) %	1,78 %	16,43 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	09/08/2016	USD	(1,09) %	2,44 %	18,86 %	–
	Klasse X CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)	22/02/2017	CHF	(2,15) %	1,31 %	11,55 %	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	01/03/2019	EUR	(1,81) %	1,72 %	–	–	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Ergänzende Informationen – Fondsperformancedaten (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegung Datum	Klasse CCY	Geschäftsjahr seit		3 Jahre kumulativ	10 Jahre Leistung
				Jahresbeginn	Kalender		
				01/03/21-28/02/22	01/01/21-31/12/21	01/01/19-31/12/21	01/03/12-28/02/22
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup> – (Fortsetzung)	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	06/12/2019	GBP	(1,09) %	2,41 %	–	–
	Klasse S USD, thesaurierend	15/01/2021	USD	(0,70) %	–	–	–
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	18/11/2019	EUR	(1,59) %	1,93 %	–	–
	Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	20/11/2019	GBP	(0,89) %	2,60 %	–	–
	Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	13/08/2018	AUD	(0,62) %	2,89 %	18,88 %	–
	Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	25/07/2019	EUR	(1,19) %	2,34 %	–	–
	Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	16/12/2015	GBP	(0,50) %	3,01 %	18,06 %	–
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)	23/05/2018	EUR	0,32 %	2,03 %	(0,23) %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	13/06/2018	EUR	0,31 %	2,04 %	(0,16) %	–
	Klasse D USD, thesaurierend	24/01/2018	USD	1,16 %	2,96 %	5,10 %	–
	Klasse D USD, ausschüttend (M)	14/02/2018	USD	1,18 %	2,95 %	5,10 %	–
	Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus	30/05/2018	USD	1,18 %	2,96 %	5,11 %	–
	Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)	30/05/2018	CHF	0,67 %	2,38 %	0,68 %	–
	Klasse M GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	23/05/2018	GBP	1,59 %	3,32 %	4,47 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	08/11/2017	USD	1,32 %	3,11 %	5,59 %	–
	Klasse M USD, thesaurierend	18/09/2019	USD	1,79 %	3,57 %	–	–
	Klasse M USD, ausschüttend (M)	28/11/2018	USD	1,77 %	3,57 %	7,00 %	–
	Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)	31/01/2018	EUR	0,93 %	2,65 %	1,63 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	04/05/2016	USD	1,93 %	3,73 %	7,50 %	–
	Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)	13/12/2017	USD	1,94 %	3,73 %	7,50 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	04/05/2016	EUR	1,06 %	2,80 %	2,15 %	–
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert)	27/12/2017	EUR	1,06 %	2,79 %	2,09 %	–
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	18/04/2018	GBP	1,74 %	3,46 %	5,61 %	–
	Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	01/04/2020	JPY	1,50 %	3,23 %	–	–
Klasse LM USD, thesaurierend	13/01/2016	USD	2,55 %	4,35 %	9,45 %	–	
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	13/01/2016	USD	(3,72) %	(2,22) %	5,18 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	01/03/2019	EUR	(3,75) %	(2,27) %	–	–
	Klasse LM USD, thesaurierend	13/01/2016	USD	(2,60) %	(1,09) %	8,94 %	–
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup>	Klasse A GBP, thesaurierend	17/11/2016	GBP	(4,76) %	(3,38) %	14,63 %	–
	Klasse LM GBP, thesaurierend	17/11/2016	GBP	(3,98) %	(2,57) %	17,17 %	–
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD, thesaurierend	17/11/2016	USD	(3,78) %	(1,26) %	25,48 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	14/06/2019	USD	(3,12) %	(0,57) %	–	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	01/03/2019	EUR	(3,97) %	(1,46) %	–	–
	Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	17/11/2016	GBP	(2,99) %	(0,49) %	25,22 %	–
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	Ausschüttende LM-Klasse in USD (Q)	11/01/2021	USD	(5,72) %	–	–	–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	09/05/2007	USD	(7,60) %	(7,91) %	3,55 %	1,81 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	06/12/2010	USD	(7,59) %	(7,90) %	3,55 %	1,80 %
	Klasse A USD, ausschüttend (S)	01/10/2003	USD	(7,59) %	(7,91) %	3,55 %	1,81 %
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	28/07/2014	AUD	(8,10) %	(8,52) %	(0,13) %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	19/02/2013	EUR	(8,60) %	(8,93) %	(2,53) %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	18/01/2008	EUR	(4,26) %	(4,21) %	0,95 %	13,49 %
	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	07/06/2013	EUR	(8,66) %	(8,99) %	(2,55) %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (S)	14/10/2016	EUR	(0,57) %	(1,19) %	4,17 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	22/11/2010	EUR	(4,26) %	(4,22) %	1,07 %	13,54 %
	Klasse A GBP, thesaurierend	22/06/2018	GBP	(4,04) %	(6,96) %	(2,49) %	–
	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	14/11/2014	GBP	(7,93) %	(8,31) %	(0,54) %	–
	Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	07/02/2008	GBP	(3,64) %	(3,63) %	2,98 %	20,25 %
	Klasse A SGD, thesaurierend	08/06/2015	SGD	(6,34) %	(6,37) %	0,79 %	–
	Klasse B USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	(7,83) %	(8,13) %	2,78 %	(0,69) %
	Klasse B USD, ausschüttend (S)	24/02/2004	USD	(7,83) %	(8,14) %	2,74 %	(0,75) %
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	(8,07) %	(8,37) %	2,00 %	(3,16) %
	Klasse C USD, ausschüttend (S)	24/02/2004	USD	(8,07) %	(8,37) %	2,01 %	(3,17) %
	Klasse E USD, thesaurierend	08/09/2011	USD	(8,16) %	(8,46) %	1,70 %	(4,13) %
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	13/07/2012	EUR	(4,83) %	(4,78) %	(0,70) %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	14/09/2012	USD	(7,23) %	(7,54) %	4,80 %	–
	Klasse F USD, ausschüttend (S)	04/10/2012	USD	(7,23) %	(7,54) %	4,80 %	–
	Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	02/05/2013	GBP	(3,20) %	(3,20) %	4,41 %	–

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Ergänzende Informationen – Fondsperformancedaten (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegung Datum	Klasse CCY	Geschäftsjahr seit		3 Jahre kumulativ	10 Jahre Leistung
				Jahresbeginn	Kalender		
				01/03/21-28/02/22	01/01/21-31/12/21	01/01/19-31/12/21	01/03/12-28/02/22
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)	Klasse X USD, thesaurierend	04/06/2013	USD	(7,14) %	(7,45) %	5,12 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (S)	26/03/2013	USD	(7,14) %	(7,45) %	5,12 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	28/06/2013	EUR	(8,16) %	(8,49) %	(1,09) %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	19/08/2015	EUR	(3,78) %	(3,73) %	2,64 %	–
	Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	11/12/2017	EUR	(3,77) %	(3,73) %	2,51 %	–
	Klasse X GBP, thesaurierend	23/12/2014	GBP	(3,58) %	(6,52) %	(1,11) %	–
	Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	10/10/2014	GBP	(7,46) %	(7,84) %	1,02 %	–
	Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)	19/08/2015	GBP	(3,14) %	(3,15) %	4,44 %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)	25/02/2013	GBP	(7,47) %	(7,85) %	0,92 %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	15/07/2014	GBP	(3,15) %	(3,16) %	4,46 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	24/03/2011	USD	(7,00) %	(7,31) %	5,59 %	8,63 %
	Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	24/02/2012	USD	(7,00) %	(7,31) %	5,59 %	8,64 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	25/01/2011	EUR	0,07 %	(0,55) %	5,94 %	28,33 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	30/01/2013	EUR	(8,03) %	(8,37) %	(0,63) %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	04/11/2011	EUR	(3,65) %	(3,59) %	3,06 %	20,98 %
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	10/10/2014	GBP	(7,33) %	(7,71) %	1,38 %	–
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	14/08/2012	GBP	(3,00) %	(3,01) %	4,82 %	–
	Klasse LM USD, thesaurierend	28/03/2019	USD	(6,44) %	(6,75) %	–	–
	Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	25/11/2015	USD	(2,23) %	(2,14) %	10,65 %	–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD, thesaurierend	03/04/2012	USD	(2,84) %	(1,40) %	9,48 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	17/09/2013	USD	(2,83) %	(1,40) %	9,55 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	18/06/2013	EUR	(3,72) %	(2,30) %	3,48 %	–
	Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	13/05/2015	SEK	(2,34) %	(0,97) %	5,59 %	–
	Klasse C USD, thesaurierend	17/07/2013	USD	(3,32) %	(1,89) %	7,82 %	–
	Klasse E USD, thesaurierend	17/07/2013	USD	(3,42) %	(1,98) %	7,50 %	–
	Klasse E USD, ausschüttend (A)	27/08/2013	USD	(3,39) %	(1,95) %	7,53 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	29/07/2014	USD	(2,44) %	(1,00) %	10,77 %	–
	Klasse X USD, thesaurierend	16/03/2018	USD	(2,40) %	(0,95) %	10,89 %	–
	Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	16/06/2014	GBP	(2,59) %	(1,22) %	7,32 %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	21/01/2014	GBP	(2,62) %	(1,24) %	7,41 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	25/03/2013	USD	(2,24) %	(0,80) %	11,44 %	–
	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	13/05/2014	USD	(2,25) %	(0,80) %	11,33 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	02/07/2012	EUR	(3,14) %	(1,72) %	5,45 %	–
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	23/05/2013	EUR	(3,17) %	(1,75) %	5,39 %	–
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	25/03/2013	GBP	(2,44) %	(1,06) %	7,87 %	–
	Klasse LM USD, thesaurierend	12/06/2014	USD	(1,37) %	0,09 %	14,50 %	–
	Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	03/04/2012	AUD	(1,68) %	(0,31) %	11,54 %	–
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD, thesaurierend	14/10/2016	USD	(3,26) %	1,77 %	23,08 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	18/07/2016	USD	(3,26) %	1,77 %	22,90 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	30/11/2012	USD	(2,52) %	2,51 %	25,66 %	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	30/11/2012	GBP	(1,29) %	3,65 %	22,19 %	–
	Klasse S CAD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	23/02/2016	CAD	(1,09) %	3,90 %	24,84 %	–
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	06/05/2011	USD	(6,67) %	(6,67) %	11,00 %	15,60 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	25/06/2010	USD	(6,66) %	(6,67) %	10,99 %	15,57 %
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	04/04/2018	EUR	(7,64) %	(7,70) %	4,39 %	–
	Klasse A SGD, thesaurierend	17/04/2020	SGD	(5,10) %	(5,09) %	–	–
	Klasse C USD, thesaurierend	21/03/2012	USD	(7,12) %	(7,13) %	9,36 %	–
	Klasse E USD, thesaurierend	17/02/2012	USD	(7,23) %	(7,22) %	9,03 %	8,82 %
	Klasse F USD, thesaurierend	22/07/2014	USD	(6,29) %	(6,30) %	12,35 %	–
	Klasse F USD, ausschüttend (M)	19/07/2013	USD	(6,29) %	(6,29) %	12,35 %	–
	Klasse X USD, thesaurierend	03/05/2016	USD	(6,20) %	(6,20) %	12,69 %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	10/10/2014	GBP	(6,50) %	(6,59) %	8,17 %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	27/05/2020	GBP	(2,16) %	(1,85) %	–	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	06/01/2012	USD	(6,05) %	(6,07) %	13,19 %	23,31 %
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	24/06/2016	GBP	(2,01) %	(1,71) %	12,47 %	–
	Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	19/09/2012	NZD	(1,81) %	(1,55) %	13,67 %	–
	Klasse LM EUR, thesaurierend	05/04/2016	EUR	1,74 %	1,45 %	16,08 %	–
	Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	13/01/2012	NZD	(1,22) %	(0,97) %	15,79 %	82,11 %

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Ergänzende Informationen – Fondsperformancedaten (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegung Datum	Klasse CCY	Geschäftsjahr seit		3 Jahre kumulativ	10 Jahre Leistung
				Jahresbeginn	Kalender		
				01/03/21-28/02/22	01/01/21-31/12/21	01/01/19-31/12/21	01/03/12-28/02/22
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	Klasse A USD, thesaurierend	30/08/2013	USD	(2,75) %	0,24 %	26,93 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	26/08/2020	USD	(2,75) %	0,24 %	–	–
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	28/08/2020	USD	(2,73) %	0,30 %	–	–
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	15/01/2021	USD	(2,75) %	–	–	–
	Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	03/06/2013	USD	(2,76) %	0,24 %	26,94 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	25/11/2020	EUR	4,60 %	7,53 %	–	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	22/08/2016	EUR	(3,61) %	(0,66) %	19,86 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	19/05/2015	EUR	(3,66) %	(0,73) %	19,70 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	21/10/2013	EUR	(3,62) %	(0,69) %	19,84 %	–
	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	24/10/2013	GBP	(2,97) %	(0,05) %	22,82 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	21/10/2015	SGD	(2,80) %	0,17 %	24,78 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	17/02/2021	SGD	(2,75) %	–	–	–
	Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	29/01/2021	SGD	(1,42) %	–	–	–
	Klasse C USD, thesaurierend	23/09/2020	USD	(3,24) %	(0,26) %	–	–
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	24/11/2020	USD	(3,21) %	(0,21) %	–	–
	Klasse E USD, thesaurierend	21/04/2020	USD	(3,33) %	(0,36) %	–	–
	Klasse E USD, ausschüttend (D)	22/01/2021	USD	(3,30) %	–	–	–
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	03/04/2017	EUR	(4,19) %	(1,26) %	17,97 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	22/10/2020	USD	(2,32) %	0,69 %	–	–
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	24/07/2019	USD	(2,28) %	0,75 %	–	–
	Klasse X USD, thesaurierend	25/09/2020	USD	(2,21) %	0,80 %	–	–
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	18/07/2017	USD	(2,21) %	0,81 %	28,91 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	21/01/2014	USD	(2,22) %	0,79 %	29,07 %	–
	Klasse X CHF Ausschüttend (A) (abgesichert)	22/02/2021	CHF	(3,26) %	–	–	–
	Klasse X EUR, thesaurierend	17/02/2021	EUR	5,19 %	–	–	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	16/02/2021	EUR	(3,07) %	–	–	–
	Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	23/12/2013	EUR	(3,09) %	(0,15) %	21,84 %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	20/12/2013	GBP	(2,43) %	0,50 %	24,79 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	09/10/2020	USD	(2,06) %	0,94 %	–	–
	Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	03.06.2013	USD	(2,06) %	0,94 %	29,63 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	07/10/2014	EUR	(2,93) %	0,04 %	22,62 %	–
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	13/12/2013	EUR	(2,94) %	0,02 %	22,33 %	–
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	23/10/2014	GBP	(2,30) %	0,64 %	25,38 %	–
	Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	22/10/2014	SEK	(2,71) %	0,24 %	23,00 %	–
	Klasse S USD, thesaurierend	06/07/2020	USD	(1,88) %	1,14 %	–	–
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	10/04/2018	EUR	(2,74) %	0,22 %	22,96 %	–
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Å Plus (e)	18/09/2018	EUR	(2,76) %	0,21 %	22,96 %	–	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Å Plus (e)	01/02/2018	GBP	(2,09) %	0,85 %	26,00 %	–	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	09/10/2020	GBP	(1,75) %	1,19 %	–	–	
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD, thesaurierend	30/06/2014	USD	0,94 %	3,51 %	5,88 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	30/06/2014	USD	1,59 %	4,19 %	7,96 %	–
	Klasse LM USD, thesaurierend	30/06/2014	USD	2,77 %	5,40 %	11,77 %	–
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	06/04/2017	USD	(3,98) %	1,51 %	24,69 %	–
	Klasse S EUR, ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)	06/04/2017	EUR	(2,32) %	3,12 %	22,16 %	–
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD, thesaurierend	16/08/2018	USD	(8,26) %	(7,41) %	(6,65) %	–
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	16/09/2019	SGD	(8,47) %	(7,70) %	–	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	16/08/2018	GBP	(7,91) %	(7,15) %	(8,52) %	–
	Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	16/08/2018	AUD	(6,99) %	(6,27) %	(4,86) %	–
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD, thesaurierend	31/12/2015	USD	14,98 %	27,64 %	73,40 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	31/12/2015	USD	16,07 %	28,85 %	78,43 %	–
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	31/12/2015	EUR	15,08 %	27,73 %	69,93 %	–
Legg Mason ClearBridge Value Fund	Klasse A USD, thesaurierend	24/04/2007	USD	12,66 %	25,86 %	74,31 %	177,72 %
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	23/03/1998	USD	12,66 %	25,86 %	74,31 %	177,72 %
	Klasse A EUR, thesaurierend	12/06/2007	EUR	21,00 %	34,85 %	74,98 %	232,68 %
	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	02/09/2014	EUR	11,31 %	24,37 %	64,52 %	–
	Klasse A GBP, ausschüttend (A)	28/08/2014	GBP	16,54 %	26,80 %	63,52 %	–
	Klasse A SGD, thesaurierend	18/05/2007	SGD	14,46 %	28,21 %	72,20 %	200,22 %
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	10/09/2012	SGD	12,42 %	25,51 %	70,22 %	–
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	12,10 %	25,23 %	71,70 %	164,22 %

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Ergänzende Informationen – Fondsperformancedaten (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegung Datum	Klasse CCY	Geschäftsjahr seit		3 Jahre kumulativ	10 Jahre Leistung
				Jahresbeginn	Kalender		
				01/03/21-28/02/22	01/01/21-31/12/21	01/01/19-31/12/21	01/03/12-28/02/22
Legg Mason ClearBridge Value Fund – (Fortsetzung)	Klasse C USD, ausschüttend (A)	24/02/2004	USD	12,10 %	25,23 %	71,70 %	164,19 %
	Klasse F USD, thesaurierend	21/01/2010	USD	13,34 %	26,61 %	77,48 %	196,86 %
	Klasse F USD, ausschüttend (A)	19/10/2016	USD	13,33 %	26,61 %	77,48 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	07/10/2013	USD	13,42 %	26,71 %	77,87 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend	22/02/2021	EUR	21,96 %	–	–	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	01/07/2008	USD	13,82 %	27,15 %	79,75 %	207,27 %
	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	25/04/2014	USD	13,82 %	27,14 %	79,74 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	30/06/2014	EUR	22,45 %	36,44 %	80,33 %	–
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	11,69 %	21,79 %	75,14 %	191,14 %
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	20/04/2007	USD	11,69 %	21,79 %	75,15 %	191,15 %
	Klasse A EUR, thesaurierend	03/06/2008	EUR	20,23 %	30,72 %	76,27 %	245,92 %
	Klasse B USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	11,13 %	21,18 %	72,54 %	177,06 %
	Klasse B USD, ausschüttend (A)	20/04/2007	USD	11,13 %	21,18 %	72,53 %	177,00 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	11,13 %	21,18 %	72,54 %	176,93 %
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	20/04/2007	USD	11,13 %	21,18 %	72,53 %	176,91 %
	Klasse E USD, thesaurierend	21/01/2010	USD	10,86 %	20,88 %	71,24 %	170,01 %
	Klasse E USD, ausschüttend (A)	21/01/2010	USD	10,85 %	20,88 %	71,24 %	170,00 %
	Klasse F USD, thesaurierend	17/09/2012	USD	12,36 %	22,52 %	78,32 %	–
	Klasse F USD, ausschüttend (A)	04/02/2010	USD	12,36 %	22,52 %	78,32 %	209,01 %
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	07/10/2013	USD	12,39 %	22,54 %	78,45 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend	07/10/2013	EUR	20,94 %	31,49 %	79,66 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	06/05/2010	USD	12,78 %	22,97 %	80,33 %	220,55 %
	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	09/04/2009	USD	12,78 %	22,97 %	80,33 %	220,50 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	07/06/2010	EUR	21,41 %	31,99 %	81,24 %	280,46 %
	Klasse LM USD, thesaurierend	05/04/2016	USD	13,49 %	23,74 %	83,74 %	–
	Klasse LM EUR, thesaurierend	05/04/2016	EUR	22,12 %	32,79 %	84,91 %	–
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	12,08 %	22,21 %	76,99 %	201,40 %
	Klasse B (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	11,46 %	21,55 %	74,14 %	186,27 %
	Klasse L (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	11,52 %	21,60 %	74,36 %	186,72 %
	Klasse GA USD, thesaurierend	10/06/2011	USD	11,89 %	22,00 %	76,09 %	196,31 %
	Klasse GA EUR, thesaurierend	10/06/2011	EUR	20,40 %	30,91 %	77,15 %	252,74 %
	Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	10/06/2011	EUR	20,42 %	30,93 %	77,27 %	252,12 %
	Klasse GE USD, thesaurierend	10/06/2011	USD	11,05 %	21,09 %	72,16 %	174,90 %
	Klasse GE EUR, thesaurierend	10/06/2011	EUR	19,50 %	29,93 %	73,28 %	227,48 %
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	6,55 %	20,78 %	106,02 %	300,92 %
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	20/04/2007	USD	6,55 %	20,78 %	106,01 %	300,96 %
	Klasse A EUR, thesaurierend	27/08/2008	EUR	14,66 %	29,59 %	107,26 %	375,00 %
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	05/02/2016	EUR	5,38 %	19,53 %	95,05 %	–
	Klasse B USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	6,02 %	20,18 %	102,96 %	281,35 %
	Klasse B USD, ausschüttend (A)	20/04/2007	USD	6,02 %	20,18 %	102,95 %	281,39 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	6,02 %	20,18 %	102,95 %	281,38 %
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	20/04/2007	USD	6,02 %	20,18 %	102,95 %	281,39 %
	Klasse E USD, thesaurierend	14/01/2016	USD	5,76 %	19,88 %	101,44 %	–
	Klasse E USD, ausschüttend (A)	13/10/2015	USD	5,75 %	19,88 %	101,43 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	19/04/2016	USD	7,19 %	21,51 %	109,76 %	–
	Klasse F USD, ausschüttend (A)	04/11/2015	USD	7,20 %	21,50 %	109,75 %	–
	Klasse U USD, thesaurierend	02/03/2018	USD	7,70 %	22,08 %	112,76 %	–
	Klasse U EUR, thesaurierend	02/03/2018	EUR	15,88 %	30,93 %	114,16 %	–
	Klasse X USD, thesaurierend	29/09/2015	USD	7,22 %	21,53 %	109,91 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend	17/01/2018	EUR	15,20 %	30,32 %	110,99 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	27/07/2016	EUR	6,01 %	20,24 %	98,68 %	–
	Klasse X GBP, thesaurierend	04/12/2015	GBP	11,42 %	22,84 %	97,21 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	19/09/2014	USD	7,60 %	21,96 %	112,12 %	–
	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	21/02/2020	USD	7,60 %	21,96 %	–	–
	Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	15/02/2018	BRL	11,39 %	24,65 %	116,33 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	15/09/2016	EUR	15,75 %	30,84 %	113,48 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	02/03/2016	EUR	6,40 %	20,67 %	101,19 %	–
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	21/02/2020	EUR	15,71 %	30,80 %	–	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	02/12/2015	GBP	11,69 %	23,16 %	99,06 %	–
	Klasse LM USD, thesaurierend	05/04/2016	USD	8,27 %	22,72 %	116,14 %	–
	Klasse LM EUR, thesaurierend	05/04/2016	EUR	16,52 %	31,70 %	117,50 %	–
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	6,93 %	21,20 %	108,19 %	314,72 %
	Klasse L (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	6,39 %	20,60 %	105,09 %	294,51 %
	Klasse GA USD, thesaurierend	27/08/2010	USD	6,74 %	20,99 %	107,13 %	307,72 %
	Klasse GA EUR, thesaurierend	27/08/2010	EUR	14,86 %	29,83 %	108,48 %	385,37 %
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	(13,84) %	5,46 %	52,81 %	128,04 %
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	20/04/2007	USD	(13,84) %	5,46 %	52,81 %	128,14 %
	Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	03/06/2013	AUD	(14,76) %	4,31 %	44,56 %	–
	Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	23/10/2014	CHF	(15,01) %	4,02 %	43,72 %	–
	Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	14/11/2014	CNH	(11,94) %	7,77 %	57,35 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	07/09/2010	EUR	(7,27) %	13,17 %	53,64 %	170,12 %
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	02/04/2013	EUR	(14,82) %	4,26 %	44,61 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	28/08/2014	EUR	(14,84) %	4,24 %	44,18 %	–
	Klasse A GBP, thesaurierend	29/09/2014	GBP	(10,50) %	6,54 %	43,85 %	–
	Klasse A HKD, thesaurierend	27/10/2015	HKD	(13,20) %	6,04 %	51,83 %	–
	Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	31/01/2013	SEK	(14,95) %	4,11 %	41,76 %	–
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	31/01/2013	SGD	(14,03) %	5,12 %	49,42 %	–
	Klasse B USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	(14,27) %	4,93 %	50,61 %	117,04 %

# Ergänzende Informationen – Fondsperformancedaten (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegung Datum	Klasse CCY	Geschäftsjahr seit		3 Jahre kumulativ	10 Jahre Leistung	
				Jahresbeginn	Kalender			
				01/03/21-28/02/22	01/01/21-31/12/21	01/01/19-31/12/21	01/03/12-28/02/22	
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund – (Fortsetzung)	Klasse B USD, ausschüttend (A)	20/04/2007	USD	(14,27) %	4,93 %	50,54 %	116,94 %	
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	(14,27) %	4,93 %	50,54 %	116,94 %	
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	20/04/2007	USD	(14,27) %	4,93 %	50,53 %	116,93 %	
	Klasse E USD, thesaurierend	04/01/2011	USD	(14,48) %	4,67 %	49,41 %	111,53 %	
	Klasse E USD, ausschüttend (A)	04/01/2011	USD	(14,48) %	4,67 %	49,40 %	111,53 %	
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	10/09/2013	EUR	(15,48) %	3,45 %	41,26 %	–	
	Klasse F USD, thesaurierend	04/01/2011	USD	(13,32) %	6,09 %	55,58 %	142,28 %	
	Klasse F USD, ausschüttend (A)	04/01/2011	USD	(13,32) %	6,09 %	55,59 %	142,45 %	
	Klasse X USD, thesaurierend	17/05/2013	USD	(13,27) %	6,14 %	55,82 %	–	
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	13/02/2013	USD	(13,28) %	6,14 %	55,82 %	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend	21/01/2014	EUR	(6,68) %	13,89 %	56,85 %	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	19/02/2014	EUR	(14,30) %	4,90 %	47,35 %	–	
	Klasse X GBP, thesaurierend	24/04/2013	GBP	(9,95) %	7,21 %	46,60 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	17/03/2010	USD	(12,97) %	6,51 %	57,46 %	151,68 %	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	14/12/2010	EUR	(6,34) %	14,30 %	58,27 %	197,98 %	
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	07/07/2011	EUR	(6,35) %	14,30 %	58,48 %	195,55 %	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	27/02/2017	GBP	(9,62) %	7,61 %	48,13 %	–	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	22/04/2014	GBP	(13,44) %	5,83 %	50,49 %	–	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	13/12/2012	GBP	(9,61) %	7,61 %	48,16 %	–	
	Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	08/10/2015	PLN	(13,22) %	5,83 %	52,42 %	–	
	Klasse LM EUR, thesaurierend	05/04/2016	EUR	(5,73) %	15,04 %	61,57 %	–	
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	(13,54) %	5,82 %	54,42 %	136,12 %	
	Klasse B (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	(13,96) %	5,31 %	52,14 %	124,69 %	
	Klasse L (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	(13,97) %	5,30 %	52,12 %	124,62 %	
	Klasse GA EUR, thesaurierend	27/08/2010	EUR	(7,07) %	13,42 %	54,86 %	177,14 %	
	Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	27/08/2010	EUR	(7,07) %	13,42 %	54,82 %	176,93 %	
	Klasse GE USD, thesaurierend	27/08/2010	USD	(14,28) %	4,92 %	50,45 %	116,46 %	
	Klasse GE EUR, thesaurierend	27/08/2010	EUR	(7,76) %	12,57 %	51,40 %	157,64 %	
	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	13/08/2013	USD	15,06 %	22,64 %	57,16 %	–
		Klasse A USD, ausschüttend (A)	27/03/2015	USD	15,05 %	22,63 %	57,14 %	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		19/06/2014	USD	15,05 %	22,64 %	57,17 %	–	
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)		03/06/2013	USD	15,05 %	22,64 %	57,15 %	–	
Klasse A USD, ausschüttend (Q)		08/05/2015	USD	15,06 %	22,64 %	57,16 %	–	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		25/06/2014	AUD	14,13 %	21,58 %	49,00 %	–	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		28/07/2014	CNH	17,59 %	25,38 %	62,15 %	–	
Klasse A EUR, thesaurierend		27/03/2015	EUR	23,80 %	31,59 %	58,16 %	–	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		21/11/2014	EUR	13,72 %	21,30 %	48,39 %	–	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		27/02/2014	EUR	13,72 %	21,30 %	48,33 %	–	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		28/07/2014	HKD	15,87 %	23,31 %	56,22 %	–	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		28/07/2014	SGD	14,86 %	22,48 %	53,66 %	–	
Klasse C USD, thesaurierend		27/09/2013	USD	14,48 %	22,03 %	54,82 %	–	
Klasse C USD, ausschüttend (A)		27/03/2015	USD	14,48 %	22,03 %	54,82 %	–	
Klasse C USD, ausschüttend (Q)		29/08/2014	USD	14,48 %	22,03 %	54,81 %	–	
Klasse F USD, thesaurierend		27/03/2015	USD	15,75 %	23,38 %	60,01 %	–	
Klasse F EUR, thesaurierend		27/03/2015	EUR	24,55 %	32,38 %	61,01 %	–	
Klasse F EUR, ausschüttend (A)		27/03/2015	EUR	24,54 %	32,38 %	61,03 %	–	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		24/04/2017	EUR	14,43 %	22,06 %	51,13 %	–	
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^		Klasse A USD, thesaurierend	11/03/2020	USD	9,62 %	22,77 %	–	–
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	30/09/2015	USD	9,63 %	22,77 %	117,44 %	–	
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	30/09/2015	EUR	8,47 %	21,47 %	105,60 %	–	
	Klasse A SEK, thesaurierend	21/01/2020	SEK	23,14 %	35,01 %	–	–	
	Klasse F USD, thesaurierend	11/03/2020	USD	10,29 %	23,51 %	–	–	
	Klasse X USD, thesaurierend	30/07/2020	USD	10,28 %	23,52 %	–	–	
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	30/09/2015	USD	10,28 %	23,51 %	121,37 %	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	30/09/2015	EUR	9,06 %	22,12 %	109,09 %	–	
	Klasse X GBP, thesaurierend	22/12/2015	GBP	14,43 %	24,70 %	108,42 %	–	
	Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	18/12/2019	GBP	9,73 %	22,77 %	–	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	24/06/2020	USD	10,67 %	23,94 %	–	–	
	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	30/09/2015	USD	10,67 %	23,95 %	123,85 %	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	30/09/2015	EUR	9,50 %	22,64 %	111,51 %	–	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	30/09/2015	GBP	15,05 %	25,35 %	110,87 %	–	
	Klasse S USD, thesaurierend	11/07/2018	USD	10,90 %	24,19 %	126,43 %	–	
	Klasse S EUR, thesaurierend	13/07/2020	EUR	19,28 %	32,44 %	–	–	
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	13/07/2020	EUR	9,73 %	22,91 %	–	–	
	Klasse S GBP, thesaurierend	31/07/2019	GBP	15,10 %	25,29 %	–	–	
	Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	19/11/2019	GBP	10,35 %	23,45 %	–	–	
	Klasse S GBP, ausschüttend (M)	31/07/2019	GBP	15,02 %	25,31 %	–	–	
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^	Klasse A USD, thesaurierend	29/06/2018	USD	(1,81) %	11,23 %	93,10 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	29/06/2018	USD	(0,82) %	12,35 %	98,99 %	–	
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^	Klasse A USD, thesaurierend	10/11/2017	USD	12,37 %	10,15 %	42,45 %	–	
	Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	16/03/2017	USD	22,09 %	19,25 %	50,41 %	–	

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Ergänzende Informationen – Fondsperformancedaten (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegung Datum	Klasse CCY	Geschäftsjahr seit		3 Jahre kumulativ	10 Jahre Leistung
				Jahresbeginn	Kalender		
				01/03/21-28/02/22	01/01/21-31/12/21	01/01/19-31/12/21	01/03/12-28/02/22
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> – (Fortsetzung)							
	Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	19/06/2017	USD	22,07 %	19,29 %	50,33 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (Q)	12/12/2016	USD	12,71 %	10,43 %	43,41 %	–
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	24/10/2019	AUD	21,54 %	18,69 %	–	–
	Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	24/10/2019	CNH	24,97 %	22,03 %	–	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	12/12/2016	EUR	21,25 %	18,48 %	43,88 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	03/12/2019	EUR	15,63 %	13,09 %	–	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	22/10/2018	EUR	21,30 %	18,48 %	43,91 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	05/06/2017	SGD	22,09 %	19,24 %	47,99 %	–
	Klasse C USD, thesaurierend	26/09/2017	USD	11,85 %	9,61 %	40,85 %	–
	Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)	26/09/2017	USD	21,42 %	18,69 %	48,30 %	–
	Klasse E USD, thesaurierend	12/12/2016	USD	11,82 %	9,49 %	39,66 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	10/08/2017	USD	13,31 %	10,98 %	45,49 %	–
	Klasse F USD thesaurierend (abgesichert)	26/09/2017	USD	22,77 %	19,92 %	53,19 %	–
	Klasse X USD, thesaurierend	20/03/2019	USD	13,69 %	11,29 %	–	–
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	17/05/2017	USD	13,69 %	11,42 %	47,01 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend	24/10/2018	EUR	22,40 %	19,52 %	47,89 %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	30/05/2019	GBP	18,03 %	12,38 %	–	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	04/02/2014	USD	13,89 %	11,61 %	48,06 %	–
	Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	15/02/2018	BRL	28,47 %	23,87 %	62,11 %	–
	Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	16/06/2017	CAD	17,42 %	14,71 %	45,03 %	–
	Premier-Klasse, CAD-Ausschüttung (Q) Plus (e)	16.06.2017	CAD	13,38 %	10,95 %	36,77 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	11/05/2012	EUR	22,67 %	19,84 %	48,84 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	17/04/2019	EUR	16,87 %	14,20 %	–	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	30/06/2016	GBP	18,31 %	12,82 %	39,08 %	–
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	25/06/2009	GBP	17,00 %	14,24 %	43,31 %	114,47 %
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)	26/04/2018	GBP	18,18 %	12,75 %	39,07 %	–
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup>							
	Klasse A USD, thesaurierend	31/03/2017	USD	1,81 %	0,18 %	1,19 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (Q)	31/03/2017	USD	1,82 %	0,18 %	1,19 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	31/03/2017	EUR	1,69 %	0,02 %	(2,19) %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	31/03/2017	GBP	6,58 %	2,04 %	(2,38) %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	31/03/2017	EUR	1,88 %	0,23 %	(1,60) %	–
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund							
	Klasse A USD, thesaurierend	09/05/2007	USD	3,70 %	28,54 %	103,86 %	200,07 %
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	08/11/2002	USD	3,70 %	28,54 %	103,85 %	200,02 %
	Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	03/06/2013	AUD	2,26 %	26,51 %	88,35 %	–
	Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	05/12/2016	CNH	5,94 %	31,27 %	109,14 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	12/07/2007	EUR	11,46 %	37,78 %	104,85 %	255,84 %
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	20/02/2013	EUR	2,42 %	26,96 %	91,93 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	16/11/2016	EUR	2,15 %	26,59 %	91,17 %	–
	Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	20/12/2013	GBP	2,94 %	27,44 %	92,11 %	–
	Klasse A GBP, ausschüttend (A)	26/04/2011	GBP	7,67 %	29,85 %	91,96 %	258,39 %
	Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	31/01/2013	SEK	2,22 %	26,57 %	86,65 %	–
	Klasse A SGD, thesaurierend	16/02/2011	SGD	5,25 %	30,84 %	100,93 %	222,49 %
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	10/09/2012	SGD	3,36 %	28,00 %	98,05 %	–
	Klasse B USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	3,18 %	27,90 %	100,83 %	185,43 %
	Klasse B USD, ausschüttend (A)	24/02/2004	USD	3,17 %	27,89 %	100,73 %	185,16 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	3,18 %	27,90 %	100,83 %	185,43 %
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	24/02/2004	USD	3,18 %	27,90 %	100,82 %	185,42 %
	Klasse E USD, thesaurierend	04/01/2011	USD	2,92 %	27,58 %	99,32 %	178,36 %
	Klasse E USD, ausschüttend (A)	04/01/2011	USD	2,92 %	27,58 %	99,31 %	178,34 %
	Klasse E EUR thesaurierend	26/11/2010	EUR	10,58 %	36,71 %	100,34 %	232,15 %
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	23/09/2013	EUR	1,67 %	26,00 %	87,64 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	04/01/2011	USD	4,32 %	29,31 %	107,55 %	218,36 %
	Klasse F USD, ausschüttend (A)	04/01/2011	USD	4,32 %	29,31 %	107,55 %	218,70 %
	Klasse R USD, thesaurierend	01/02/2021	USD	4,30 %	–	–	–
	Klasse R EUR thesaurierend	09/12/2013	EUR	12,33 %	38,85 %	108,70 %	–
	Klasse X USD, thesaurierend	25/02/2013	USD	4,47 %	29,51 %	108,50 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	28/11/2016	USD	4,48 %	29,50 %	108,50 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend	11/10/2017	EUR	12,34 %	38,89 %	109,75 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	21/10/2013	EUR	3,22 %	27,91 %	96,02 %	–
	Klasse X GBP, thesaurierend	18/01/2013	GBP	8,45 %	30,75 %	96,07 %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (A)	23/04/2013	GBP	8,44 %	30,72 %	95,94 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	27/04/2010	USD	4,84 %	29,95 %	110,70 %	234,26 %
	Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	15/02/2018	BRL	8,25 %	32,03 %	106,19 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	07/06/2010	EUR	12,74 %	39,35 %	111,90 %	299,28 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	31/08/2015	EUR	3,61 %	28,37 %	98,33 %	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	15/02/2013	GBP	8,71 %	31,08 %	97,96 %	–
	Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	03/08/2018	PLN	4,45 %	28,94 %	101,77 %	–

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Ergänzende Informationen – Fondsperformancedaten (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegung Datum	Klasse CCY	Geschäftsjahr seit		3 Jahre kumulativ	10 Jahre Leistung
				Jahresbeginn	Kalender		
				01/03/21-28/02/22	01/01/21-31/12/21	01/01/19-31/12/21	01/03/12-28/02/22
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	Klasse A USD, thesaurierend	09/05/2007	USD	(0,78) %	23,48 %	73,20 %	104,28 %
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	01/03/2004	USD	(0,79) %	23,47 %	73,16 %	104,09 %
	Klasse A EUR, thesaurierend	01/10/2008	EUR	6,61 %	32,26 %	74,06 %	141,84 %
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	05/06/2013	EUR	(1,98) %	22,03 %	63,33 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (A)	09/02/2011	EUR	6,73 %	32,54 %	74,05 %	145,92 %
	Klasse A GBP, ausschüttend (A)	05/11/2009	GBP	3,04 %	24,74 %	62,99 %	141,98 %
	Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	31/01/2013	SEK	(2,10) %	21,91 %	59,97 %	–
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	(1,28) %	22,86 %	70,63 %	94,28 %
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	01/03/2004	USD	(1,28) %	22,85 %	70,58 %	94,14 %
	Klasse E USD, thesaurierend	21/01/2010	USD	(1,53) %	22,55 %	69,30 %	89,34 %
	Klasse E USD, ausschüttend (A)	03/06/2020	USD	(1,53) %	22,54 %	–	–
	Klasse E EUR thesaurierend	14/01/2019	EUR	5,96 %	31,55 %	–	–
	Klasse F USD, thesaurierend	21/01/2010	USD	(0,19) %	24,21 %	76,30 %	116,75 %
	Klasse F USD, ausschüttend (A)	04/02/2010	USD	(0,19) %	24,21 %	76,30 %	116,73 %
	Klasse R USD, thesaurierend	09/05/2014	USD	(0,29) %	24,08 %	75,78 %	–
	Klasse X USD, thesaurierend	08/02/2013	USD	(0,07) %	24,36 %	77,04 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	24/11/2009	USD	0,31 %	24,83 %	78,96 %	127,32 %
	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	18/02/2011	USD	0,30 %	24,83 %	78,96 %	127,36 %
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	20/05/2011	GBP	4,19 %	26,12 %	68,48 %	169,15 %
	Klasse LM EUR, thesaurierend	05/04/2016	EUR	8,76 %	34,94 %	84,08 %	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	(0,19) %	24,21 %	76,31 %	116,70 %	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	(0,69) %	23,59 %	73,67 %	106,13 %	
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	09/05/2007	USD	4,38 %	9,15 %	25,75 %	51,17 %
	Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	30/09/2014	USD	13,23 %	18,00 %	32,65 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	24/02/2004	USD	4,42 %	9,19 %	25,78 %	51,11 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	30/09/2014	USD	13,26 %	18,04 %	32,66 %	–
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	30/09/2014	AUD	12,70 %	17,40 %	27,56 %	–
	Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	28/10/2014	CNH	15,83 %	20,78 %	37,48 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	31/08/2010	EUR	12,40 %	17,19 %	26,71 %	79,63 %
	Klasse A EUR, ausschüttend (A)	30/08/2002	EUR	12,40 %	17,20 %	26,70 %	79,70 %
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	30/09/2014	EUR	12,41 %	17,19 %	26,71 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	08/07/2015	SGD	12,98 %	17,94 %	30,55 %	–
	Klasse B USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	4,02 %	8,76 %	23,99 %	43,99 %
	Klasse B USD, ausschüttend (A)	24/02/2004	USD	3,93 %	8,67 %	24,13 %	42,48 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	3,86 %	8,59 %	23,95 %	43,93 %
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	24/02/2004	USD	3,94 %	8,68 %	24,06 %	43,79 %
	Klasse F USD, thesaurierend	06/05/2016	USD	5,07 %	9,84 %	28,14 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	09/05/2014	EUR	13,55 %	18,39 %	30,60 %	–
	Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	09/03/2017	PLN	14,48 %	19,15 %	33,95 %	–
	Klasse LM EUR, thesaurierend	05/04/2016	EUR	14,30 %	19,14 %	33,08 %	–
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	4,78 %	9,53 %	26,96 %	55,92 %
	Klasse B (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	4,30 %	9,04 %	25,15 %	47,59 %
Klasse L (G) USD, thesaurierend	20/04/2007	USD	4,20 %	8,93 %	24,75 %	47,82 %	
Klasse GA USD, thesaurierend	27/08/2010	USD	4,71 %	9,47 %	26,72 %	55,95 %	
Klasse GA EUR, thesaurierend	27/08/2010	EUR	12,69 %	17,46 %	27,52 %	84,25 %	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	27/08/2010	EUR	12,69 %	17,46 %	27,52 %	84,26 %	
Klasse GE USD, thesaurierend	27/08/2010	USD	3,93 %	8,65 %	23,88 %	44,09 %	
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	09/05/2007	USD	3,30 %	6,32 %	12,62 %	46,92 %
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	25/02/2004	USD	3,30 %	6,32 %	12,62 %	46,28 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	30/09/2014	USD	3,30 %	6,32 %	12,61 %	–
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	21/07/2016	AUD	2,69 %	5,51 %	8,08 %	–
	Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	16/04/2018	CNH	5,66 %	8,80 %	16,47 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	31/10/2007	EUR	10,97 %	14,06 %	13,16 %	74,01 %
	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	30/09/2014	HKD	4,06 %	6,93 %	12,08 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	24/06/2016	SGD	3,22 %	6,24 %	10,64 %	–
	Klasse B USD, ausschüttend (A)	25/02/2004	USD	2,78 %	5,79 %	10,94 %	39,10 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15/11/2007	USD	2,78 %	5,79 %	10,96 %	39,66 %
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	25/02/2004	USD	2,78 %	5,79 %	10,94 %	39,08 %
	Klasse E USD, thesaurierend	21/01/2010	USD	2,45 %	5,42 %	9,91 %	35,20 %
	Klasse E USD, ausschüttend (A)	05/07/2017	USD	2,44 %	5,42 %	9,87 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	04/01/2011	USD	3,83 %	6,85 %	14,45 %	54,85 %
	Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	08/10/2015	PLN	4,38 %	7,12 %	13,14 %	–
	Klasse GA USD, thesaurierend	27/08/2010	USD	3,30 %	6,29 %	12,67 %	47,90 %
	Klasse GA EUR, thesaurierend	27/08/2010	EUR	11,15 %	14,07 %	13,40 %	75,80 %
	Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	27/08/2010	EUR	11,29 %	14,05 %	13,37 %	76,37 %
	Klasse GE USD, thesaurierend	27/08/2010	USD	2,53 %	5,50 %	10,17 %	37,20 %
	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	06/09/2012	USD	11,71 %	17,60 %	28,15 %
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		26/10/2015	USD	11,71 %	17,62 %	28,15 %	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		26/10/2015	AUD	10,95 %	16,78 %	22,24 %	–
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		26/10/2015	HKD	12,42 %	18,16 %	27,41 %	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		24/06/2016	SGD	11,64 %	17,61 %	25,56 %	–

## Ergänzende Informationen – Fondsperformancedaten (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegung Datum	Klasse CCY	Geschäftsjahr seit		3 Jahre kumulativ	10 Jahre Leistung	
				Jahresbeginn	Kalender			
				01/03/21-28/02/22	01/01/21-31/12/21	01/01/19-31/12/21	01/03/12-28/02/22	
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund – (Fortsetzung)	Klasse Premier USD, thesaurierend	03/02/2020	USD	12,86 %	18,81 %	–	–	
	Klasse GA USD, thesaurierend	10/06/2011	USD	11,78 %	17,62 %	28,02 %	96,78 %	
	Klasse GA EUR, thesaurierend	10/06/2011	EUR	20,27 %	26,20 %	28,77 %	133,69 %	
	Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	10/06/2011	EUR	20,27 %	26,22 %	28,85 %	133,73 %	
	Klasse GE USD, thesaurierend	10/06/2011	USD	10,94 %	16,74 %	25,16 %	82,56 %	
	Klasse GE EUR, thesaurierend	10/06/2011	EUR	19,38 %	25,24 %	25,93 %	116,76 %	
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD, thesaurierend	30/03/2016	USD	(16,58) %	(11,08) %	14,84 %	–	
	Klasse X GBP, ausschüttend (A)	11/03/2016	GBP	(12,73) %	(9,52) %	10,48 %	–	
	Klasse F USD, thesaurierend	30/03/2016	USD	(16,01) %	(10,49) %	17,05 %	–	
	Klasse M USD, ausschüttend (A)	11/03/2016	USD	(15,91) %	(10,39) %	17,44 %	–	
	Klasse M EUR, ausschüttend (A)	11/03/2016	EUR	(9,49) %	(3,82) %	18,86 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	06/06/2018	USD	(15,60) %	(10,03) %	18,89 %	–	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	09/05/2018	GBP	(12,32) %	(9,09) %	12,31 %	–	
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD, thesaurierend	28/06/2016	USD	(6,29) %	10,54 %	82,86 %	–	
	Klasse A EUR, thesaurierend	28/06/2016	EUR	0,81 %	18,57 %	84,42 %	–	
	Klasse E USD, thesaurierend	14/08/2019	USD	(7,00) %	9,71 %	–	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend	28/06/2016	EUR	1,61 %	19,55 %	88,29 %	–	
	Klasse X GBP, thesaurierend	28/06/2016	GBP	(1,95) %	12,52 %	76,13 %	–	
	Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	28/06/2016	GBP	(6,12) %	10,64 %	78,35 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	28/06/2016	USD	(5,26) %	11,76 %	88,98 %	–	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	16/04/2019	GBP	(5,80) %	11,01 %	–	–	
	Klasse S USD, thesaurierend	25/08/2020	USD	(4,93) %	12,15 %	–	–	
	Klasse S GBP, thesaurierend	28/06/2016	GBP	(1,30) %	13,28 %	80,13 %	–	
	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	28/06/2016	USD	7,12 %	5,26 %	15,23 %	–
		Klasse A AUD ausschüttend (M) Plus	28/06/2016	AUD	13,49 %	11,55 %	11,56 %	–
		Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus (e)	28/06/2016	EUR	15,28 %	12,97 %	15,97 %	–
Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus		12/09/2018	SGD	8,76 %	7,25 %	13,59 %	–	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		29/04/2020	AUD	6,80 %	4,80 %	–	–	
Klasse D CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		29/04/2020	CNH	10,02 %	8,14 %	–	–	
Klasse D HKD Ausschüttend (M) Plus		29/04/2020	HKD	8,40 %	6,37 %	–	–	
Klasse D SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		29/04/2020	SGD	7,32 %	5,56 %	–	–	
Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus		29/04/2020	USD	7,56 %	5,69 %	–	–	
Klasse D USD, thesaurierend		29/04/2020	USD	7,56 %	5,69 %	–	–	
Klasse X AUD, thesaurierend		31/05/2017	AUD	14,08 %	12,13 %	13,94 %	–	
Klasse X USD, thesaurierend		28/06/2016	USD	7,94 %	6,06 %	17,86 %	–	
Klasse S GBP, thesaurierend		28/06/2016	GBP	12,84 %	7,86 %	13,26 %	–	
Ausschüttende GBP-Klasse S (M) Plus (e)		28/06/2016	GBP	12,84 %	7,86 %	13,26 %	–	
Klasse LM AUD, thesaurierend		10/11/2017	AUD	15,62 %	13,65 %	17,45 %	–	
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	Klasse A USD, thesaurierend	24/11/2017	USD	(18,78) %	(5,17) %	49,44 %	–	
	Klasse E USD, thesaurierend	10/09/2018	USD	(19,39) %	(5,88) %	46,41 %	–	
	Klasse F USD, thesaurierend	13/11/2018	USD	(18,29) %	(4,61) %	52,31 %	–	
	Klasse X USD, thesaurierend	13/12/2017	USD	(18,17) %	(4,47) %	52,83 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	13/12/2017	USD	(17,88) %	(4,13) %	54,45 %	–	
	Klasse S USD, thesaurierend	29/10/2018	USD	(17,71) %	(3,94) %	55,37 %	–	
	Klasse S EUR, thesaurierend	16/01/2018	EUR	(11,46) %	3,09 %	56,28 %	–	
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>	Klasse A EUR, thesaurierend	09/11/2018	EUR	2,10 %	26,55 %	103,48 %	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend	09/11/2018	EUR	2,87 %	27,50 %	108,12 %	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	09/11/2018	EUR	3,23 %	27,94 %	110,31 %	–	
	Klasse S EUR, thesaurierend	07/05/2019	EUR	3,65 %	28,46 %	–	–	

In den Daten zur Wertentwicklung der Fonds sind die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen angefallenen Vermittlungsgebühren und Kosten nicht enthalten.

Die frühere Wertentwicklung bietet keine Gewähr für die aktuelle oder zukünftige Entwicklung.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft)

## Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022

Gemäß den OGAW-Verordnungen wird eine Aufstellung über die wichtigsten Veränderungen in der Zusammensetzung des Anlageportfolios jedes Fonds während des Berichtszeitraums vorgelegt, um zu gewährleisten, dass die 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 das Geschäftsjahr übersteigen. Es werden mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe aufgeführt. Sollte ein Fonds während des Geschäftsjahres weniger als zwanzig Käufe oder Verkäufe getätigt haben, sind alle Transaktionen aufgeführt.

### Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in 0.000s) \$	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 15/12/2021	173.857	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 15/12/2021	173.863
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 23/12/2021	82.704	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 23/12/2021	82.706
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 16/12/2021	63.927	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 16/12/2021	63.927
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 13/01/2021	58.825	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 17/06/2021	61.313
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 20/05/2021	56.403	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 13/01/2021	58.828
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 29/07/2021	49.997	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 20/05/2021	56.404
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 26/11/2021	49.995	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 26/08/2021	55.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 10/03/2022	49.993	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 29/04/2021	50.000
United States Treasury Bill, 1,500 %, fällig 31/01/2022	45.086	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 26/11/2021	50.000
United States Treasury Bill, 0,355 %, fällig 31/10/2021	45.041	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 29/07/2021	50.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 26/10/2021	41.971	United States Treasury Bill, 1,500 %, fällig 31/01/2022	45.034
United States Treasury Bill, 2,125 %, fällig 15/08/2021	41.170	United States Treasury Bill, 0,355 %, fällig 31/10/2021	45.001
United States Treasury Bill, 1,500 %, fällig 31/01/2022	40.127	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 19/08/2021	42.427
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 05/10/2021	40.050	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 26/10/2021	41.974
Federal Home Loan Banks FRN, 0,055 %, fällig 20/12/2021	40.000	United States Treasury Bill, 2,125 %, fällig 15/08/2021	40.818
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 26/08/2021	39.998	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 05/10/2021	40.052
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 14/09/2021	39.998	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 31/03/2021	40.021
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 08/02/2022	39.997	United States Treasury Bill, 1,125 %, fällig 05/10/2021	40.007
Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,050 %, fällig 09/06/2022	39.994	Federal Home Loan Banks FRN, 0,055 %, fällig 20/12/2021	40.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 19/10/2021	39.733	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 14/09/2021	40.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 01/03/2022	39.687	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 08/02/2022	39.999
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 13/07/2021	37.067	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 19/10/2021	39.735
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 17/06/2021	36.313	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 11/03/2021	39.190
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 01/02/2022	34.997	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 13/07/2021	37.071
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 25/01/2022	33.903	Federal Home Loan Banks, 0,050 %, fällig 23/08/2021	35.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 24/03/2022	33.635	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 01/02/2022	35.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 28/12/2021	33.392		

### 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)	96.494	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	103.635
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	14.881	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	14.958
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31/12/2026	10.838	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	13.349
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	9.057	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31/12/2026	9.223
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, 2,000 %	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
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	6.550	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	6.515
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2051	5.795	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2051	6.355
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	5.099	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	5.091
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	5.020	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 %	5.078
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 %	4.528	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	4.957
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31/01/2027	4.455	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 29/04/2021	4.770
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	4.350	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31/05/2025	4.516
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15/05/2031	4.232	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	4.350
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30/06/2028	4.106	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15/05/2031	4.174
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.985	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30/04/2028	4.042
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31/10/2026	3.964	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.995
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.959	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31/10/2026	3.958
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.918	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	3.948

### Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31/05/2026	103.704	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31/05/2025	106.660
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	59.033	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	60.657
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31/12/2026	50.483	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	59.326
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	36.825	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31/12/2026	45.417
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31/01/2027	34.841	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31/05/2026	41.253
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	33.417	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	34.157
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	30.394	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	33.431
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31/12/2026	30.370	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	30.040
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	28.769	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	28.797
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	28.681	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	28.559
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2051	28.301	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	22.681
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30/06/2028	22.969	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	22.387
Ginnie Mae, 30 year, TBA, Null-Coupon	22.680	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	22.247
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	22.391	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,300 %, fällig 15/10/2021	20.655
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	22.283	Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, Null-Coupon	18.807
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15/05/2051	21.414	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31/10/2028	17.481
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	20.827	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	17.427
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31/10/2028	19.140	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	17.390
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, Null-Coupon	18.753	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	17.130
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/11/2041	17.486	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/11/2041	17.088
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	17.473		
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	17.196		

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15/02/2031	13.043	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	6.229
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 0,000 %, fällig 25/11/2030	5.961	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15/02/2031	4.345
Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	5.580	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4,250 %, fällig 04/07/2039	1.833
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30/04/2025	5.081	United Kingdom Treasury Note/Bond, 2,500 %, fällig 22/07/2065	1.647
Bundesobligation, 0,000 %, fällig 14/04/2023	3.275	Australia Government Bond, 1,750 %, fällig 21/06/2051	1.054
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3,250 %, fällig 01/09/2046	2.783	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,000 %, fällig 01/12/2025	1.027
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 3,250 %, fällig 25/05/2045	2.743	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30/04/2025	976
Spain Government Bond, 2,700 %, fällig 31/10/2048	2.672	Wells Fargo & Co, 0,080 %, fällig 26/04/2021	930
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31/01/2026	2.128	Volkswagen Leasing GmbH, 0,000 %, fällig 06/07/2021	900
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4,250 %, fällig 04/07/2039	1.845	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15/08/2030	876
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15/08/2030	1.758	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,500 %, fällig 15/08/2046	800
JPMorgan Chase & Co, 0,625 %, fällig 25/01/2024	1.393	Romania Government International Bond, 2,000 %, fällig 28/01/2032	779
HSBC Holdings Plc, 3,000 %, fällig 30/06/2025	1.378	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/08/2050	729
Kingdom of Belgium Government Bond, 3,750 %, fällig 22/06/2045	1.162	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0,400 %, fällig 15/05/2050	679
Romania Government International Bond, 2,000 %, fällig 14/04/2033	1.152	Saudi Government International Bond, 2,000 %, fällig 09/07/2039	667
Annington Funding Plc, 1,650 %, fällig 12/07/2024	1.115	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,000 %, fällig 15/02/2049	600
FCA Bank SpA/Ireland, 0,500 %, fällig 13/09/2024	1.113	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,200 %, fällig 24/07/2025	564
General Electric Co, 0,875 %, fällig 17/05/2025	1.109	RCl Banque SA, 0,100 %, fällig 12/04/2021	540
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,500 %, fällig 15/02/2023	1.023	Indonesia Government International Bond, 0,900 %, fällig 14/02/2027	537
Intesa Sanpaolo SpA, 1,000 %, fällig 04/07/2024	972	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank, 0,750 %, fällig 25/07/2021	520
Euronext NV, 1,000 %, fällig 18/04/2025	970	BNP Paribas SA, 2,875 %, fällig 20/03/2026	460
Logicor Financing, 1,625 %, fällig 15/07/2027	968	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4,750 %, fällig 04/07/2028	445
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 0,750 %, fällig 25/05/2028	933	Aviva Plc, 6,125 %, fällig 05/07/2043	427
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15/02/2025	809	Romania Government International Bond, 2,000 %, fällig 14/04/2033	371
Volkswagen International Finance NV, 1,250 %, fällig 23/09/2032	781		

## Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, fällig 10/08/2026	831	Tenet Healthcare Corp, 6,750 %, fällig 15/06/2023	572
DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01/07/2026	793	HCA Inc, 5,375 %, fällig 01/02/2025	547
Bath & Body Works Inc, 5,250 %, fällig 01/02/2028	716	Bath & Body Works Inc, 6,694 %, fällig 15/01/2027	493
Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15/11/2028	712	Mozart Borrower LP, Null-Coupon, 30/09/2028	481
HCA Inc, 5,625 %, fällig 01/09/2028	677	Range Resources Corp, 9,250 %, fällig 01/02/2026	453
Oasis Petroleum Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01/06/2026	630	Service Properties Trust, 4,350 %, 01/10/2024	436
CSC Holdings LLC, 144A, 5,375 %, fällig 01/02/2028	625	Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, fällig 01/04/2026	430
Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, fällig 01/04/2026	616	NCL Corp Ltd, 144A, 12,250 %, fällig 15/05/2024	422
Vibrant Clo VII Ltd, Series 2017 7A, Class C, 144A, 3,854 %, fällig 15/09/2030	591	WP CityMD Bidco Llc, 4,750 %, fällig 13/08/2026	398
Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15/08/2026	576	RR Donnelley & Sons Co, 144A, 6,125 %, fällig 01/11/2026	375
Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, fällig 15/11/2025	526	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc, 4,375 %, fällig 15/01/2028	364
American Axle & Manufacturing Inc, 6,500 %, fällig 01/04/2027	523	Continental Resource Inc, 3,800 %, fällig 01/06/2024	346
Photo Holdings Merger Sub Inc, 144A, 8,500 %, fällig 01/10/2026	519	Greif Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01/03/2027	342
Consensus Cloud Solutions Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15/10/2026	510	Bath & Body Works Inc, 5,250 %, fällig 01/02/2028	329
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig 09/05/2027	510	Realogy Group LLC / Realogy Mitherausgeber Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15/06/2025	319
Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Mitherausgeber Inc, 144A, 2,875 %, fällig 15/10/2026	507	CSC Holdings LLC, 144A, 5,375 %, fällig 01/02/2028	312
American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 20/04/2026	497	Speedway Motorsports Llc, 4,875 %, fällig 01/11/2027	305
Bath & Body Works Inc, 6,694 %, fällig 15/01/2027	486	ATS Automation Tooling Systems Inc, 4,125 %, fällig 15/12/2028	297
Scientific Games International Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15/03/2026	482	HCA Inc, 5,375 %, fällig 01/09/2026	284
Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01/03/2028	482	Sprint Corp, 7,125 %, fällig 15/06/2024	283

## Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30/04/2026	16.382	United States Treasury Note/Bond, 0,875 %, fällig 15/11/2030	28.482
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, 0,875 %, fällig 15/11/2030	10.056	Franklin Templeton China Funds - Western Asset China Bond Fund - Class LM	14.053
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15/05/2031	6.911	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30/11/2025	12.793
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2041	6.381	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	11.946
China Government Bond, 4,290 %, fällig 22/05/2029	6.192	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2051	11.558
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15/05/2051	4.619	Legg Mason Global Funds Plc - Western Asset US High Yield Fund - LM Class US\$ Distributing (IM)	10.502
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30/04/2028	4.363	ING Groep NV, 6,875 %, Perpetual	8.326
United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 15/05/2024	3.953	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15/05/2031	6.883
China Government Bond, 3,100 %, fällig 29/06/2022	3.585	Indonesia Treasury Bond, Series FR59, 7,000 %, fällig 15/05/2027	6.579
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01/01/2025	3.475	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2041	6.338
Bank of America Corp, 3,311 %, fällig 22/04/2042	3.278	Australia Government Bond, Series 162, 1,750 %, fällig 21/06/2051	6.315
Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07/04/2026	3.240	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17/03/2024	5.400
Natwest Group Plc, 4,500 %, fällig 31/03/2070	3.226	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/11/2024	5.228
Allianz SE, 3,200 %, Perpetual	3.000	Legg Mason Global Funds Plc - Western Asset Euro High Yield Fund - LM Class Euro (Accumulating)	5.037
Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 3,900 %, fällig 01/09/2037	2.778	Indonesia Treasury Bond, Series FR78, 8,250 %, fällig 15/05/2029	4.573
Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, fällig 18/03/2031	2.550	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30/04/2028	4.355
Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15/02/2030	2.378	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/11/2046	4.210
ARD 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 %, fällig 14/11/2024	2.246		

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Legg Mason Western Asset US High Yield 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)	124.965	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	129.248
Mozart Debt Merger Sub Inc, 144A, 3,875 %, fällig 01/04/2029	4.250	Mozart Debt Merger Sub Inc, 144A, 3,875 %, fällig 01/04/2029	3.446
DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01/12/2028	2.840	Catalent Pharma Solutions Inc, 3,500 %, fällig 01/04/2030	1.941
CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01/04/2030	2.593	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01/05/2032	1.777
DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01/06/2029	2.410	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15/04/2029	1.499
Mozart Debt Merger Sub Inc, 144A, 5,250 %, fällig 01/10/2029	2.206	Silversea Cruise Finance Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 01/02/2025	1.452
Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15/07/2031	2.161	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15/02/2029	1.368
Catalent Pharma Solutions Inc, 3,500 %, fällig 01/04/2030	1.940	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 144A, 5,500 %, fällig 15/01/2028	1.295
CoreCivic Inc, 8,250 %, fällig 15/04/2026	1.928	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01/04/2030	1.284
Colgate Energy Partners III LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01/07/2029	1.845	Bath & Body Works Inc, 5,250 %, fällig 01/02/2028	1.270
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09/05/2029	1.784	Sensata Technologies BV, 4,000 %, fällig 15/04/2029	1.227
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01/05/2032	1.777	Starwood Property Trust Inc, 3,625 %, fällig 15/07/2026	1.206
Oasis Petroleum Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01/06/2026	1.739	United Airlines Inc, 4,500 %, fällig 14/04/2028	1.204
Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12/02/2032	1.732	Scientific Games International Inc, 7,000 %, fällig 15/05/2028	1.153
Directv Financing LLC / Directv Financing CoObligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15/08/2027	1.720	Altice France SA/France, 144A, 7,375 %, fällig 01/05/2026	1.124
Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01/09/2026	1.698	HCRX Investments HoldCo LP, 4,500 %, fällig 01/08/2029	1.116
Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01/04/2028	1.681	Vertical US Newco Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15/07/2027	1.111
United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/04/2029	1.606	Sprint Communications Inc, 11,500 %, fällig 15/11/2021	1.105
Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15/08/2026	1.564	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig 15/01/2031	1.096
Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13/11/2030	1.563	Netflix Inc, 6,375 %, fällig 15/05/2029	1.083

## Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Legg Mason Global Funds Plc - Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund - LM Class US\$ Distributing (M)	2.868	Qatar Energy, 3,300 %, fällig 12/07/2051	1.102
Qatar Energy, 3,300 %, fällig 12/07/2051	1.100	Qatar Energy, 2,250 %, fällig 12/07/2031	1.090
Qatar Energy, 2,250 %, fällig 12/07/2031	1.088	Russian Agricultural Bank OJSC Via RSHB Capital SA, 8,500 %, fällig 16/10/2023	700
ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27/04/2026	787	Prosus NV, 5,500 %, fällig 21/07/2025	614
Republic of Kenya Government International Bond, 6,300 %, fällig 23/01/2034	619	Chile Government International Bond, 2,550 %, fällig 27/07/2033	602
Guatemala Government Bond, 4,650 %, fällig 07/10/2041	614	Kenya Government International Bond, 7,250 %, fällig 28/02/2028	508
Türkiye İhracat Kredi Bankası AS, 5,750 %, fällig 06/07/2026	598	Chile Government International Bond, 3,100 %, fällig 22/01/2061	467
Türkiye İhracat Kredi Bankası AS, 5,750 %, fällig 06/07/2026	597	Ivory Coast Government International Bond, 4,875 %, fällig 30/01/2032	465
Instituto Costarricense de Electricidad, 6,750 %, fällig 07/10/2031	595	Chinalco Capital Holdings Ltd, 4,000 %, fällig 25/08/2021	460
Sasol Financing USA LLC, 4,375 %, fällig 18/09/2026	586	China Aoyuan Group Ltd, 7,950 %, fällig 19/02/2023	455
Bahamas Government International Bond, 5,750 %, fällig 16/01/2024	539	Klabina Austria GmbH, 3,200 %, fällig 12/01/2031	455
Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13/07/2031	530	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 01/04/2056	455
NBK Tier 1 Ltd, 3,625 %, Perpetual	525	GC Treasury Center Co Ltd, 2,980 %, fällig 18/03/2031	448
Dominican Republic International Bond, 144A, 4,875 %, fällig 23/09/2032	522	Wynn Macau Ltd, 5,625 %, fällig 26/08/2028	429
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao, 4,125 %, fällig 20/09/2031	500	Guatemala Government Bond, 4,650 %, fällig 07/10/2041	421
Senegal Government International Bond, 6,750 %, fällig 13/03/2048	476	Thaioil Treasury Center Co Ltd, 3,500 %, fällig 17/10/2049	417
Chile Government International Bond, 3,100 %, fällig 22/01/2061	475	Ukraine Government International Bond, 8,994 %, fällig 01/02/2024	412
Banco General SA, 5,250 %, Perpetual	469	Senegal Government International Bond, 5,375 %, fällig 08/06/2037	404
Sagicor Financial Co Ltd, 5,300 %, fällig 13/05/2028	468	Cemex SAB de CV, 5,125 %, fällig 08/09/2169	403
Ooredoo International Finance Ltd, 2,625 %, fällig 08/04/2031	462	Interchile SA, 4,500 %, fällig 30/06/2056	401
		Instituto Costarricense de Electricidad, 6,750 %, fällig 07/10/2031	397
		Cia de Minas Buenaventura SAA, 5,500 %, fällig 23/07/2026	394
		Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 16/04/2050	394
		Honduras Government International Bond, 6,250 %, fällig 19/01/2027	382
		Russian Federal Bond - OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19/01/2028	373
		Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig 19/08/2050	350
		Bahamas Government International Bond, 5,750 %, fällig 16/01/2024	329
		NBK Tier 1 Ltd, 3,625 %, Perpetual	320
		Hutama Karya Persero PT, 3,750 %, fällig 11/05/2030	316
		Lukoil International Finance BV, 6,656 %, fällig 07/06/2022	316
		Legg Mason Global Funds Plc - Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund - LM Class US\$ Distributing (M)	308

## Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
The Republic of Senegal, 5,375 %, fällig 08/06/2037	794	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17/03/2024	846
Cia de Minas Buenaventura, 5,500 %, fällig 23/07/2026	694	The Republic of Senegal, 5,375 %, fällig 08/06/2037	795
Kenya Government International Bond, 6,300 %, fällig 23/01/2034	670	Cia de Minas Buenaventura, 5,500 %, fällig 23/07/2026	693
Ukraine Government International Bond, 6,876 %, fällig 21/05/2029	620	Kenya Government International Bond, 6,300 %, fällig 23/01/2034	671
Sagicor Financial Co Ltd, 5,300 %, fällig 13/05/2028	606	Ukraine Government International Bond, 6,876 %, fällig 21/05/2029	621
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao, 4,125 %, fällig 20/09/2031	600	Investment Energy Resources Ltd, 6,250 %, fällig 26/04/2029	615
Banco GNB Sudameris SA VAR, 7,250 %, fällig 16/04/2031	600	Cemex SAB de CV VAR, 5,125 %, fällig 08/09/2169	605
Cemex SAB de CV VAR, 5,125 %, fällig 08/09/2169	600	Banco GNB Sudameris SA VAR, 7,250 %, fällig 16/04/2031	602
Investment Energy Resources Ltd, 6,250 %, fällig 26/04/2029	600	OverseaChinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, fällig 19/06/2024	572
Instituto Costarricense de Electricidad, 6,750 %, fällig 07/10/2031	595	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 21/06/2028	539
Chile Government International Bond, 3,100 %, fällig 22/01/2061	570	Goodman HK Finance, 4,375 %, fällig 19/06/2024	535
Frontera Energy Corp, 7,875 %, fällig 21/06/2028	536	Türkiye İhracat Kredi Bankası A/S, 5,750 %, fällig 06/07/2026	517
Türkiye İhracat Kredi Bankası A/S, 5,750 %, fällig 06/07/2026	527	Guatemala Government International Bond, 4,650 %, fällig 27/05/2025	440
OCP SA, 5,125 %, fällig 23/06/2051	511	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 5,650 %, fällig 19/03/2022	411
Dominican Republic International Bond, 5,500 %, fällig 22/02/2029	450	Country Garden Holdings Co Ltd, 4,750 %, fällig 28/09/2023	410
Eskom Holdings SOC Ltd, 6,350 %, fällig 10/08/2028	449	BOC Aviation Ltd, 2,750 %, fällig 18/09/2022	407
Guatemala Government International Bond, 4,650 %, fällig 07/10/2041	439	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21/07/2023	402
		KimberlyClark de Mexico SAB de CV, 2,431 %, fällig 01/07/2031	401

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

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

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Country Garden Holdings Co Ltd, 5,400 %, fällig 27/05/2025	430	QatarEnergy, 3,300 %, fällig 12/07/2051	401
First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 15/10/2027	430	Instituto Costarricense de Electricidad, 6,750 %, fällig 07/10/2031	397
Banco General SA VAR, 5,250 %, Perpetual	400	QatarEnergy, 2,250 %, fällig 12/07/2031	396
Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13/07/2031	400	Millicom International Cellular SA, 6,250 %, fällig 25/03/2029	392
QatarEnergy, 3,300 %, fällig 12/07/2051	400	Lukoil International Finance BV, 6,656 %, fällig 07/06/2022	391
Inversiones CMPC SA, 3,000 %, fällig 06/04/20313	398	DP World Plc, 5,625 %, fällig 25/09/2048	366
QatarEnergy, 2,250 %, fällig 12/07/2031	396		
Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6,000 %, fällig 25/10/2023	365		
Sasol Financing USA LLC, 4,375 %, fällig 18/09/2026	350		
Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 25/10/2023	337		
Huarong Finance 2019 Co Ltd, 2,125 %, fällig 30/09/2023	310		
Interchile S.A., 4,500 %, fällig 30/06/2056	300		
Mizrahi Tefahot Bank Ltd VAR, 144A, 3,077 %, fällig 07/04/2031	300		
Tullow Oil Plc, 10,250 %, fällig 15/05/2026	300		

## Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
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	United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 28/02/2026	2.299
United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 28/02/2026	2.315	Saga Plc, 3,375 %, fällig 12/05/2024	2.076
Saga Plc, 5,500 %, fällig 15/07/2026	2.125	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31/01/2026	1.748
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31/01/2026	1.769	Legg Mason Global Funds Plc - Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund - LM Class US\$ Distributing (M)	1.736
Legg Mason Global Funds Plc - Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund - LM Class US\$ Distributing (M)	1.533	Legg Mason Global Funds Plc - Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund - LM Class US\$ Distributing (M)	1.500
Mexico Government International Bond, 2,659 %, fällig 24/05/2031	1.450	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01/10/2026	1.389
Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01/02/2029	1.314	Mexico Government International Bond, 2,659 %, fällig 24/05/2031	1.262
Saga Plc, 3,375 %, fällig 12/05/2024	1.301	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30/04/2026	1.248
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30/04/2026	1.247	Delta Air Lines Inc, 5,750 %, fällig 29/04/2023	1.194
DIRECTV Financing LLC, 5,750 %, fällig 22/07/2027	1.148	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/04/2029	1.085
Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12/02/2032	1.095	United Airlines Holdings Inc, 4,250 %, fällig 01/10/2022	1.040
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,200 %, fällig 21/07/2021	1.000	Petrobras Global Finance BV, 7,375 %, fällig 17/01/2027	1.029
Ford Motor Credit Co Llc, 3,625 %, fällig 17/06/2031	962	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,200 %, fällig 21/07/2021	1.000
MGM China Holdings Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 01/02/2027	880	Indonesia Government International Bond, 1,850 %, fällig 12/03/2031	975
Peruvian Government International Bond, 1,862 %, fällig 01/12/2032	856	Ford Motor Credit Co Llc, 3,625 %, fällig 17/06/2031	963
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23/05/2029	798	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01/05/2025	900
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig 01/06/2028	791	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20/09/2025	801
Petroleos del Peru SA, 144A, 4,750 %, fällig 19/06/2032	773	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, 15/11/2031	774
VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, fällig 15/01/2032	773	Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 3,686 %, fällig 21/08/2026	744
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, 15/11/2031	770		

## Legg Mason Western Asset Global Inflation Management 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)	15.355	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	13.285
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15/04/2023	11.713	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15/01/2022	5.807
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 0,250 %, fällig 25/07/2024	3.103	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15/07/2021	2.497
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15/07/2021	2.538	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15/07/2022	2.457
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15/07/2022	2.450	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15/07/2025	2.444
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Series iL, 0,100 %, fällig 15/04/2023	2.096	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15/01/2030	1.379
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Series iL, 0,500 %, fällig 15/04/2030	2.033	Spain Government Inflation Linked Bond, 144A, 0,700 %, fällig 30/11/2033	1.173
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15/01/2022	1.508	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/08/2050	1.096
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
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15/01/2030	994	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Series iL, 0,100 %, fällig 15/04/2046	825
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CPI, 144A, 3,100 %, fällig 15/09/2026	949	French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 144A, 1,800 %, fällig 25/07/2040	782
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31/05/2026	818	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/02/2050	563
Japanese Government CPI Linked Bond, Series 23, 0,100 %, fällig 10/03/2028	535	United Kingdom Gilt, 2,500 %, fällig 22/07/2065	479
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,850 %, fällig 25/07/2027	424	Australia Government Bond, Series 162, 1,750 %, fällig 21/06/2051	434
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,100 %, fällig 25/07/2022	406	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,250 %, fällig 15/08/2048	369
Romanian Government International Bond, 2,000 %, fällig 14/04/2033	329	United Kingdom Gilt Inflation Linked, Series 3MO, 0,125 %, fällig 22/03/2068	347
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15/01/2027	321	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,500 %, fällig 15/08/2046	329
MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, fällig 10/03/2034	237	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2051	271
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 3,875 %, fällig 15/04/2029	196	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,250 %, fällig 01/09/2046	187
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15/07/2025	147	French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 144A, 0,100 %, fällig 25/07/2047	116

## Legg Mason Western Asset Asian 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)	125.028	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	130.863
Temasek Financial I Ltd, 2,800 %, fällig 17/08/2071	15.411	Korea Treasury Bond, Series 2912, 1,375 %, fällig 10/12/2029	16.412
China Development Bank, Series 2103, 3,300 %, fällig 03/03/2026	12.168	European Investment Bank, 7,400 %, fällig 24/01/2022	13.945
QNB Finance Ltd, 6,900 %, fällig 23/01/2025	9.922	Singapore Government Bond, 1,875 %, fällig 01/03/2050	11.614
China Government Bond, 1,990 %, fällig 09/04/2025	7.589	Korea Development Bank/The, 4,650 %, fällig 12/03/2021	10.617
National Environment Agency, 2,500 %, fällig 15/09/2051	6.147	China Government Bond, 1,990 %, fällig 09/04/2025	7.773
ExportImport Bank of Korea, 144A, 6,700 %, fällig 02/12/2024	3.599	Temasek Financial I Ltd, 2,800 %, fällig 17/08/2071	7.017
Bank Mandiri Persero Tbk PT, 2,000 %, fällig 19/04/2026	2.968	ExportImport Bank of Korea, 8,400 %, fällig 30/11/2021	5.586

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Country Garden Holdings Co Ltd, 3,125 %, fällig 22/10/2025	2.105	QNB Finance Ltd, 5,100 %, fällig 14/05/2021	5.435
International Bank for Reconstruction & Development, 4,300 %, fällig 13/09/2023	1.380	Chinalco Capital Holdings Ltd, 4,250 %, fällig 21/04/2022	5.021
Keppel REIT, 3,150 %, fällig 11/03/2170	1.274	Legg Mason Western Asset Asian Bond Trust - Class A (SGD) Accumulating	4.808
FLCT Treasury Pte Ltd, 2,180 %, fällig 26/07/2028	923	Huaneng Hong Kong Capital Ltd, 3,600 %, Perpetual	4.237
		Bank of East Asia Ltd/The, 4,000 %, fällig 03/11/2026	3.717
		Guotai Junan International Holdings Ltd, 2,900 %, fällig 12/05/2021	3.606
		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
		QNB Finance Ltd, 4,350 %, fällig 29/01/2022	2.621

## Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip 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)	155.456	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	172.872
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
Merck & Co Inc, 1,900 %, fällig 10/12/2028	7.127	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/02/2023	10.496
Roche Holdings Inc, 1,44A, 1,930 %, fällig 13/12/2028	7.000	Bank of New York Mellon Corp/The, 0,350 %, fällig 07/12/2023	4.985
Ecolab Inc, 2,125 %, fällig 01/02/2032	6.997	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/11/2027	4.457
NatWest Markets Plc, 1,375 %, fällig 02/03/2027	5.358	Intel Corp, 3,400 %, fällig 25/03/2025	4.244
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31/03/2026	5.312	Wells Fargo & Co, 3,196 %, fällig 17/06/2027	3.097
Credit Suisse AG/London, 1,125 %, fällig 15/12/2025	4.969	Comcast Corp, 3,100 %, fällig 01/04/2025	2.792
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1,000 %, fällig 25/02/2030	4.537	BHP Billiton Finance Ltd, Series 11, 3,250 %, fällig 25/09/2024	2.631
Public Storage, 0,500 %, fällig 09/09/2030	3.068	Abbott Ireland Financing DAC, 0,100 %, fällig 19/11/2024	2.588
Vonovia SE, 0,750 %, fällig 01/09/2032	2.923	Ontario Teachers Finance, 1,125 %, fällig 15/05/2026	2.428
Swedbank AB, 0,300 %, fällig 20/05/2027	2.712	UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, fällig 15/07/2025	2.324
Vonovia SE, 0,375 %, fällig 16/06/2027	2.678	TJX Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15/04/2025	2.200
Segro Capital Sarl, 0,500 %, fällig 22/09/2031	2.577	Honeywell International Inc, 2,500 %, fällig 01/11/2026	2.196
Coöperatieve Rabobank UA, 0,375 %, fällig 01/12/2027	2.567	Walmart Inc, 3,250 %, fällig 08/07/2029	2.155
Ontario Teachers Finance, 1,125 %, fällig 15/05/2026	2.502	Credit Suisse AG/New York NY, 2,800 %, fällig 08/04/2022	2.154
Mastercard Inc, 1,000 %, fällig 22/02/2029	2.270	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,625 %, fällig 22/01/2023	2.143
Nidec Corp, 0,046 %, fällig 30/03/2026	2.115	Walmart Inc, 2,375 %, fällig 24/09/2029	2.010
Banco Santander SA, 0,625 %, fällig 24/06/2029	2.017	Richemont International Holding SA, 0,750 %, fällig 26/05/2028	1.877
HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, 0,625 %, fällig 01/11/2028	1.739	Waste Management Inc, 3,500 %, fällig 15/05/2024	1.797

## Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31/01/2026	33.450	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31/01/2026	14.249
United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31/08/2025	19.475	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30/04/2025	12.669
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30/04/2025	10.698	Franklin Templeton China Funds - Western Asset China Bond Fund - Class LM	11.705
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	7.626	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31/08/2025	8.723
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30/04/2026	7.294	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	7.628
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15/11/2047	7.112	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15/02/2029	7.431
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	6.478	French Republic Government Bond OAT, 1,000 %, fällig 25/05/2027	7.276
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	6.452	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30/04/2026	7.241
United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 31/07/2021	5.973	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	6.533
United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 30/06/2025	5.934	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	6.413
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	5.800	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15/11/2047	6.365
United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig 30/09/2022	5.740	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 30/06/2025	6.176
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31/05/2026	5.618	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 31/07/2021	5.945
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	5.400	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	5.789
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/08/2050	5.071	United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig 30/09/2022	5.731
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23/05/2029	4.537	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30/04/2026	5.526
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	4.447	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	5.372
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	3.992	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15/08/2024	5.309
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	3.747	Indonesia Treasury Bond, Series FR79, 8,375 %, fällig 15/04/2039	5.038
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	3.686	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 30/11/2024	4.674
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	3.410	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	4.439
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	3.129	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2049	4.327
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	3.023	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15/08/2022	4.016
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	2.895	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	3.988
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	2.749	Australia Government Bond, Series 162, 1,750 %, fällig 21/06/2051	3.788
		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	3.736
		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	3.690
		United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/08/2050	3.502
		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	3.370

## Legg Mason Western Asset Global Credit 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)	20.721	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	20.943
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15/02/2028	1.227	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15/02/2028	1.429
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15/02/2030	1.056	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15/02/2030	1.248
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15/02/2027	735	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15/02/2027	722
Wells Fargo & Co, 1,000 %, fällig 02/02/2027	697	Wells Fargo & Co, 1,338 %, fällig 04/05/2025	694
Mexico Government International Bond, 3,500 %, fällig 12/02/2034	617	Vesteda Finance BV, 1,500 %, fällig 24/05/2027	589
Allianz SE, 3,200 %, Perpetual	600	Comcast Corp, 3,100 %, fällig 01/04/2025	539
FedEx Corp, 0,950 %, fällig 04/05/2033	539	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/08/2031	512

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Legg Mason Western Asset Global Credit Fund<sup>A</sup> – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/08/2031	521	Microsoft Corp, 3,700 %, fällig 08/08/2046	508
Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17/03/2052	508	GE Capital UK Funding Unlimited Co, 8,000 %, fällig 14/01/2039	484
EDP - Energias de Portugal SA, 1,875 %, fällig 02/08/2081	478	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10/01/2039	476
Neste Oyj, 0,750 %, fällig 25/03/2028	472	International Lease Finance Corp, 5,875 %, fällig 15/08/2022	470
Telefonica Europe BV, 2,376 %, Perpetual	471	Technip Energies NV, 1,125 %, fällig 28/05/2028	460
Technip Energies NV, 1,125 %, fällig 28/05/2028	462	Mercialys SA, 4,625 %, fällig 07/07/2027	430
Marks & Spencer Plc, 3,750 %, fällig 19/05/2026	429	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/02/2050	426
Netflix Inc, 3,625 %, fällig 15/06/2030	423	Williams Cos Inc/The, 4,300 %, fällig 04/03/2024	418
Orange SA, 5,000 %, Perpetual	422	Engie SA, 2,875 %, fällig 10/10/2022	414
Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Mitherausgeber Inc, 144A, 2,875 %, fällig 15/10/2026	421	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21/04/2023	412
General Electric Co, 4,125 %, fällig 19/09/2035	419	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual	410
AnheuserBusch InBev SA/NV, 3,700 %, fällig 02/04/2040	418	CNAC HK Finbridge Co Ltd, 1,750 %, fällig 14/06/2022	402

## Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
ZF Finance GmbH, 2,000 %, fällig 06/05/2027	1.000	FCE Bank Plc, 0,869 %, fällig 13/09/2021	1.090
Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07/04/2026	828	Telecom Italia SpA/Milano, 3,625 %, fällig 25/05/2026	1.052
Saga Plc, 5,500 %, fällig 15/07/2026	791	3AB Optique Developpement SAS, 4,000 %, fällig 01/10/2023	949
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 4,875 %, fällig 01/06/2028	579	Pinnacle Bidco Plc, 6,375 %, fällig 15/02/2025	819
PCF GmbH, 4,750 %, fällig 15/04/2026	566	Saga Plc, 3,375 %, fällig 12/05/2024	785
Douglas GmbH, 6,000 %, fällig 08/04/2026	560	ZF Finance GmbH, 3,000 %, fällig 21/09/2025	742
ARD Finance SA, 5,000 %, fällig 30/06/2027	543	Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250 %, fällig 15/05/2029	732
Next SpA, 1,625 %, fällig 30/04/2026	540	James Hardie International Finance DAC, 3,625 %, fällig 01/10/2026	726
Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, fällig 15/07/2026	506	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,125 %, fällig 15/10/2024	714
Picard Groupe SAS, 3,875 %, fällig 01/07/2026	500	Crystal Almond SARL, 4,250 %, fällig 15/10/2024	708
Renault SA, 2,500 %, fällig 01/04/2028	500	Miller Homes Group Holdings Plc, 5,500 %, fällig 15/10/2024	694
Ideal Standard International SA, 6,375 %, fällig 30/07/2026	495	Belden Inc, 4,125 %, fällig 15/10/2026	629
Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, fällig 18/09/2027	470	Netflix Inc, 3,625 %, fällig 15/06/2030	619
Vmed O2 UK Financing I Plc, 4,500 %, fällig 15/07/2031	467	PPF Telecom Group BV, 3,250 %, fällig 29/09/2027	587
CT Investment GmbH, 5,500 %, fällig 15/04/2026	410	Douglas GmbH, 6,000 %, fällig 08/04/2026	553
United Group BV, 5,250 %, fällig 01/02/2030	402	Smurfit Kappa Treasury ULC, 1,500 %, fällig 15/09/2027	548
Marcolin SpA, 6,125 %, fällig 15/11/2026	400	Ladbrokes Group Finance Plc, 5,125 %, fällig 08/09/2023	547
Grupo Antolin/rausa SA, 3,500 %, fällig 30/04/2028	350	ARD Finance SA, 5,000 %, fällig 30/06/2027	546
Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01/04/2028	339	IHO Verwaltungs GmbH, 3,750 %, fällig 15/09/2026	541
Altice Financing SA, 4,250 %, fällig 15/08/2029	331	Nexi SpA, 1,625 %, fällig 30/04/2026	537
Alyce Financing SA, 3,000 %, fällig 15/01/2028	326	Parts Europe SA, 6,500 %, fällig 16/07/2025	527
Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 3,000 %, fällig 15/06/2029	300	Schoeller Packaging BV, 6,375 %, fällig 01/11/2024	520
Bellis Acquisition Co Plc, 4,500 %, fällig 16/02/2026	293	ZF Finance GmbH, 2,000 %, fällig 06/05/2027	508
Castor SpA, 6,000 %, fällig 15/02/2029	290	doValue SpA, 5,000 %, fällig 04/08/2025	495
Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA, 5,250 %, fällig 01/04/2026	290	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4,375 %, fällig 15/01/2028	494
Faurecia SE, 2,375 %, fällig 15/06/2029	282	RCS & RDS SA, 3,250 %, fällig 05/02/2028	494
Casino Guichard Perrachon SA, 3,992 %, Perpetual	272	Altice France Holding SA, 8,000 %, fällig 15/05/2027	486
Neinor Homes SA, 4,500 %, fällig 15/10/2026	272	Ashtand Services BV, 2,000 %, fällig 30/01/2028	455
Transcom Holdings AB FRN, Null-Coupon, fällig 15/12/2026	239	Kapla Holding SAS, 3,375 %, fällig 15/12/2026	453
Premier Foods Finance Plc, 3,500 %, fällig 15/10/2026	232	Novafives SAS, 5,000 %, fällig 15/06/2025	376
CAB SELAS, 3,375 %, fällig 01/02/2028	227	Repsol International Finance BV, 4,500 %, fällig 25/03/2025	376
Promontoria Holding 264 BV, 6,375 %, fällig 01/03/2027	220	B&M European Value Retail SA, 3,625 %, fällig 15/07/2025	358
TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig 15/05/2026	214	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,624 %, Perpetual	350
Air FranceKLM, 3,875 %, fällig 01/07/2026	199	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	333
Heimstaden AB, 4,250 %, fällig 09/03/2026	198	Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, fällig 30/09/2025	329
Hestia Holding, 4,000 %, fällig 01/06/2027	194	Altice Financing SA, 3,000 %, fällig 15/01/2028	325
Nobel Bidco BV, 3,125 %, fällig 15/06/2028	190	Cirsa Finance International Sarl, 6,250 %, fällig 20/12/2023	303
International Design Group SPA, 4,250 %, fällig 15/05/2026	180	KME SE, 6,750 %, fällig 01/02/2023	294
Energizer Gamma Acquisition BV, 3,500 %, fällig 30/06/2029	170	Maxeda DIY Holding BV, 5,875 %, fällig 01/10/2026	287
		Petrobras Global Finance BV, 6,625 %, fällig 16/01/2034	286
		Faurecia SE, 2,375 %, fällig 15/06/2029	284

## Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>A</sup>

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)	3.322.206	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	3.390.015
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, 1,125 %, fällig 31/10/2026	175.707	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31/10/2026	175.458
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, 1,375 %, fällig 31/10/2028	138.814	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2051	164.270
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2051	124.846	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31/10/2028	138.847
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31/12/2026	123.932	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31/12/2026	123.684
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, 1,750 %, fällig 15/08/2041	114.695	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30/04/2028	113.825
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30/04/2028	112.678	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 15/08/2041	112.183
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/11/2051	105.787	Russian Federal Bond - OFZ, Series 6230, 7,700 %, fällig 16/03/2039	108.201
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	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/11/2051	106.336
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31/05/2028	95.117	Wachovia Capital Trust III, 5,570 %, Perpetual	106.289
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/11/2041	91.706	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31/08/2028	104.492
United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, fällig 31/07/2028	90.116	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15/11/2050	102.777
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 30/09/2028	88.981	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/05/2045	101.310

<sup>A</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/05/2041	76.548	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 29/02/2028	97.009
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31/12/2028	75.719	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31/05/2028	95.372
Franklin Templeton China Funds - Western Asset China Bond Fund - Class LM	65.390	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/11/2041	91.214
		United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, fällig 31/07/2028	90.363
		United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 30/09/2028	88.911

## Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 30/11/2023	22.708	United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig 31/07/2023	17.445
United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig 31/07/2023	17.478	Indonesia Treasury Bond, Series FR59, 7,000 %, fällig 15/05/2027	14.599
Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 3,900 %, fällig 01/09/2037	7.931	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 15/02/2031	13.605
Carnival Corp, 144A, 9,875 %, fällig 01/08/2027	4.952	Russian Federal Bond - OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19/01/2028	11.970
Viper Energy Partners LP, 144A, 5,375 %, fällig 01/11/2027	4.304	Apollo Commercial Real Estate Finance, Inc, 7,050 %, fällig 19/01/2028	7.110
NatWest Group Plc, 4,500 %, Perpetual	4.283	Petrobras Global Finance BV, 5,299 %, fällig 27/01/2025	6.606
United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15/01/2030	4.257	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10/01/2039	6.529
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 01/03/2026	4.178	Legg Mason Global Funds Plc - Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund - LM Class US\$ Distributing (M)	6.502
Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000 %, fällig 15/06/2029	4.161	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2051	6.253
Endo Luxembourg Finance Co I Sarl / Endo US Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01/04/2029	4.001	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc - Western Asset European Loan Fund - LM Class Euro Accumulating	6.202
Carnival Plc, 7,875 %, fällig 01/06/2027	3.994	CWGS Group LLC, 3,500 %, fällig 08/11/2023	5.686
CoreCivic Inc, 8,250 %, fällig 15/04/2026	3.992	Cheniere Energy Inc, 4,250 %, fällig 15/03/2045	5.548
Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01/06/2029	3.954	NGL PipeCo LLC, 144A, 7,768 %, fällig 15/12/2037	5.501
MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig 15/03/2031	3.812	Range Resources Corp, 7,768 %, fällig 01/02/2026	5.250
ParkOhio Industries Inc, 6,625 %, fällig 15/04/2027	3.719	Occidental Petroleum Corp, 7,150 %, fällig 15/05/2028	5.106
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15/10/2027	3.562	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15/03/2032	5.095
Mozart Debt Merger Sub Inc, 144A, 5,250 %, fällig 01/10/2029	3.445	FBR Securitization Trust 2005-2 FRN, 1,014 %, fällig 25/09/2023	4.895
NCR Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15/04/2029	3.430	Provincia de Buenos Aires, 6,500 %, fällig 15/02/2023	4.633
Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13/11/2030	3.400	NCL Corp Ltd, 12,250 %, fällig 15/05/2024	4.567
CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01/04/2030	3.333	Intesa Sanpaolo SpA, 5,170 %, fällig 26/06/2024	4.365

## Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>

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)	452.105	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	474.891
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30/04/2026	104.496	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30/04/2026	104.517
ZH Trust 2021-1, Series 2021 1, Class B, 144A, 3,262 %, fällig 18/02/2027	16.350	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Series 2019 BOLT, Class D, 144A, 6,662 %, fällig 15/07/2034	11.441
NRZ Excess Spread Collateralized Notes, Series 2021 FHT1, Class A, 144A, 3,104 %, fällig 25/07/2026	10.190	Banc of America Funding 2015-R5 Trust, Series 2015 R5, Class 1A3, 144A, 0,260 %, fällig 26/10/2036	8.601
MRA Issuance Trust 2021-EBO1, Series 2021 EBO1, Class A2X, 144A, 1,856 %, fällig 15/04/2022	10.000	SLM Student Loan Trust 2004-10, Series 2004 10, Class B, 0,588 %, fällig 25/01/2040	7.763
Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1B1, 144A, 3,149 %, fällig 25/10/2041	8.760	Palmetto Skilled Nursing, 6,250 %, fällig 11/01/2022	7.540
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2020 1A, Class D, 144A, 3,340 %, fällig 20/08/2026	8.500	Motel 6 Trust 2017-MTL6, Series 2017 MTL6, Class F, 144A, 4,362 %, fällig 15/08/2034	6.781
National Collegiate Student Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class B, 0,687 %, fällig 27/07/2037	8.489	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Class G, 144A, 4,441 %, fällig 15/12/2036	6.544
PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Series 2021 1R, Class A, 144A, 3,087 %, fällig 27/02/2024	8.224	DB Master Finance Llc, 2,791 %, fällig 20/11/2051	6.004
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Series 2021 DNA6, Class B2, 144A, 7,549 %, fällig 25/10/2041	7.520	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Class H, 144A, 6,941 %, fällig 15/12/2036	5.913
Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Series 2021 MN2, Class M2, 144A, 3,399 %, fällig 25/07/2041	6.840	JP Morgan Mortgage Trust 2013-2, Series 2013 2, Class B5, 144A, 3,606 %, fällig 25/05/2043	5.732
Home Partners of America 2021-2 Trust, Series 2021 2, Class F, 144A, 3,799 %, fällig 17/12/2026	6.450	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Class M2, 144A, 3,750 %, fällig 25/09/2055	5.585
PMT Credit Risk Transfer Trust 2020-1R, Series 2020 1R, Class A, 144A, 2,458 %, fällig 27/02/2023	6.166	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2019-BOLT, Series 2019 BOLT, Class C, 144A, 3,912 %, fällig 15/07/2034	5.535
DB Master Finance Llc, 2,791 %, fällig 20/11/2051	6.000	PMT Credit Risk Transfer Trust 2019-3R, Series 2019 3R, Class A, 144A, 2,808 %, fällig 27/10/2022	5.477
Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-2, Series 2018 2, Class BX, 3,768 %, fällig 25/11/2057	5.932	MRA Issuance Trust 2021-EBO1, Series 2021 EBO1, Class A2X, 144A, 1,856 %, fällig 15/04/2022	5.000
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Series 2021 DNA5, Class B2, 144A, 5,549 %, fällig 25/01/2034	5.530	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2019 1A, Class A2II, 144A, 4,723 %, fällig 05/06/2049	4.193
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SPI2, Class B, 144A, 3,804 %, fällig 25/05/2048	5.502	Redwood Funding Trust 2019-1, Series 2019 1, Class PT, 144A, 4,213 %, fällig 27/09/2024	4.155
Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class B, 144A, 3,821 %, fällig 28/02/2033	5.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Class 1B1, 144A, 3,437 %, fällig 25/01/2040	4.008
GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-LUAAU, Series 2018 LUAAU, Class G, 144A, 4,641 %, fällig 15/11/2032	4.994	Ashford Hospitality Trust 2018-KEYS, Series 2018 KEYS, Class C, 144A, 2,042 %, fällig 15/06/2035	3.984
TRTX 2022-FL5 Issuer Ltd, Series 2022 FL5, Class E, 144A, 4,400 %, fällig 15/02/2039	4.738	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SPI3, Class B, 144A, 4,146 %, fällig 25/08/2048	3.849

## Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	277.385	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	276.146
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	231.674	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	230.440
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, 0,000 %	155.969	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	156.173
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	151.322	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	150.821
Federal Home Loan Bank Discount Note, 0,000 %, fällig 13/12/2021	150.000	Federal Home Loan Bank Discount Note, 0,000 %, fällig 13/12/2021	150.000

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	147.302	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	147.310
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	130.851	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	145.369
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	130.843	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	130.560
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	115.465	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	128.725
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	109.795	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	116.194
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	106.771	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	109.376
United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 03/05/2022	104.613	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	106.471
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 02/09/2021	99.995	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 02/09/2021	100.000
Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	98.109	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 0,000 %	97.830
United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 01/11/2021	89.993	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %	94.791
Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	89.873	United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 01/11/2021	90.000
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 %	89.743	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 %	86.475
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	86.499	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, Null-Coupon, fällig 15/07/2021	80.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 15/07/2021	80.000	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 22/07/2021	80.000
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 22/07/2021	80.000	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 12/08/2021	80.000
United States Treasury Bill, Null-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, 2,000 %	75.573	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 %	70.061
United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 05/10/2021	69.996	United States Treasury Bill, Null-Coupon, fällig 05/10/2021	70.000
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	67.497	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 %	68.180
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	65.663	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 %	65.205
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	64.607	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 %	64.655
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	62.546	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 %	62.209
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	62.113	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 %	61.920
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 0,000 %	60.343	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 %	60.346
		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 %	54.865

## Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) £	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) £
UBS Group AG, 1,875 %, fällig 03/11/2029	927	Bank of America Corp, 6,125 %, fällig 15/09/2021	900
Banco Santander SA, 2,250 %, fällig 04/10/2032	796	European Investment Bank, 3,750 %, fällig 07/12/2027	820
Leeds Building Society, 1,375 %, fällig 06/10/2027	786	European Investment Bank, 5,375 %, fällig 07/06/2021	772
Derwent London Plc, 1,875 %, fällig 17/11/2031	746	United Kingdom Gilt, 2,750 %, fällig 07/09/2024	689
Nordea Bank Abp, 1,625 %, fällig 09/12/2032	598	BP Capital Markets Plc, 2,030 %, fällig 14/02/2025	662
Credit Suisse Group AG, 2,125 %, fällig 15/11/2029	578	Vodafone Group Plc, 3,375 %, fällig 08/08/2049	535
Vattenfall AB, 2,500 %, fällig 29/06/2083	570	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/London, 1,500 %, fällig 31/07/2022	474
Swedbank AB, 1,375 %, fällig 08/12/2027	550	Vodafone Group Plc, 3,000 %, fällig 12/08/2056	447
Annington Funding Plc, 2,308 %, fällig 06/10/2032	540	Close Brothers Group Plc, 2,750 %, fällig 26/04/2023	429
BPCE SA, 2,500 %, fällig 30/11/2032	498	Banco Santander SA, 2,750 %, fällig 12/09/2023	414
United Kingdom Gilt, 1,750 %, fällig 22/01/2049	461	United Kingdom Gilt, 1,500 %, fällig 22/07/2026	402
NatWest Group Plc, 2,105 %, fällig 28/11/2031	460	FCA Bank SpA/Ireland, 1,625 %, fällig 29/09/2021	397
United Kingdom Gilt, 3,250 %, fällig 22/01/2044	456	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd, 3,000 %, fällig 27/05/2022	394
United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07/12/2055	440	GE Capital UK Funding Unlimited Co, 8,000 %, fällig 14/01/2039	384
Omnicom Capital Holdings Plc, 2,250 %, fällig 22/11/2033	398	Svenska Handelsbanken AB, 2,375 %, fällig 18/01/2022	380
Paragon Treasury Plc, 2,000 %, fällig 07/05/2036	389	BMW International Investment BV, 1,000 %, fällig 17/11/2021	370
Holcim Sterling Finance Netherlands BV, 2,250 %, fällig 04/04/2034	381	Telerec Secured Finance Plc, 4,010 %, fällig 10/12/2031	369
National Australia Bank Ltd, 1,699 %, fällig 15/09/2031	380	Bank of Montreal, 1,375 %, fällig 29/12/2021	340
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,625 %, fällig 20/10/2028	340	Muenchener RueckversicherungsGesellschaft AG in Muenchen, 6,625 %, fällig 26/05/2042	307
Bank of America Corp, 1,667 %, fällig 02/06/2029	330	Swedbank AB, 1,250 %, fällig 29/12/2021	290
Close Brothers Group Plc, 2,000 %, fällig 11/09/2031	318	Bunzl Finance Plc, 2,250 %, fällig 11/06/2025	273
JPMorgan Chase & Co, 1,895 %, fällig 28/04/2033	300	United Kingdom Gilt, 1,000 %, fällig 22/04/2024	253
BNP Paribas SA, 2,000 %, fällig 24/05/2031	299	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,500 %, fällig 12/10/2021	247
Coventry Building Society, 2,000 %, fällig 20/12/2030	298	United Kingdom Gilt, 3,250 %, fällig 22/01/2044	246
Realty Income Corp, 1,875 %, fällig 14/01/2027	289	Credit Agricole SA, 7,500 %, Perpetual	245
London Stock Exchange Group Plc, 1,625 %, fällig 06/04/2030	277	United Kingdom Gilt, 4,750 %, fällig 07/12/2030	233
Assura Financing Plc, 1,625 %, fällig 30/06/2033	266	Orange SA, 5,750 %, Perpetual	230
United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig 22/07/2027	261	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10/01/2039	226
Prologis International Funding II SA, 2,750 %, fällig 22/02/2032	259	RSA Insurance Group Plc, 5,125 %, fällig 10/10/2045	218
Electricite de France SA, 1,000 %, fällig 29/11/2033	247	United Kingdom Gilt, 4,500 %, fällig 07/12/2042	208
Credit Agricole SA, 7,500 %, Perpetual	245	BUPA Finance Plc, 5,000 %, fällig 25/04/2023	206
Associated British Foods Plc, 2,500 %, fällig 16/06/2034	228	United Kingdom Gilt, 0,625 %, 07/06/2025	201
United Kingdom Gilt, 0,625 %, 07/06/2025	203	Bank of America Corp, 5,500 %, fällig 22/11/2021	174
Anglian Water Osprey Financing Plc, 2,000 %, fällig 31/07/2028	159	Berkeley Group Plc/The, 2,500 %, fällig 11/08/2031	152
Berkeley Group Plc/The, 2,500 %, fällig 11/08/2031	149	United Kingdom Gilt, 2,000 %, fällig 07/09/2025	148

## Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund<sup>^</sup>

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)	60.849	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	59.297
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, 2,000 %, fällig 15/08/2051	3.854	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15/05/2051	2.844
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15/05/2051	2.793	General Electric Co, 6,875 %, fällig 10/01/2039	2.558
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
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/11/2031	2.541	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2051	2.078
Verizon Communications Inc, 3,700 %, fällig 22/03/2061	1.729	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15/11/2050	1.963

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE		ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD		(in Tsd.) USD		(in Tsd.) USD	
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2051	1.638		Guardian Life Global Funding, 144A, 0,875 %, fällig 10/12/2025		1.958	
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/02/2052	1.447		Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,500 %, fällig 14/12/2023		1.831	
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31/01/2027	1.367		KeyBank NA/Cleveland OH, Series BKnt, 0,423 %, fällig 03/01/2024		1.830	
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/08/2031	1.196		Societe Generale SA, 144A, 1,488 %, fällig 14/12/2026		1.614	
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/05/2041	1.181		UniCredit SpA, 144A, 6,572 %, fällig 14/01/2022		1.290	
United States Treasury Note/Bond, 0,875 %, fällig 31/01/2024	1.062		United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/08/2051		1.247	
Citigroup Inc, 2,561 %, fällig 01/05/2032	1.010		Danske Bank A/S, 144A, 5,000 %, fällig 12/01/2022		1.211	
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31/03/2026	1.006		AbbVie Inc, 2,600 %, fällig 21/11/2024		1.207	
Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18/11/2038	957		United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/05/2041		1.206	
Energy Transfer LP, Series G, 7,125 %, Perpetual	809		United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/08/2031		1.190	
Verizon Communications Inc, 3,550 %, fällig 22/03/2051	806		United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31/03/2026		1.007	
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	

## Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE		ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD		(in Tsd.) USD		(in Tsd.) USD	
Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	9.120		Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)		9.808	
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	781		United States Cash Management Bill, Null-Coupon, fällig 04/05/2021		2.080	
Freddie Mac Pool 'SD0176', 3,500 %, fällig 01/12/2049	725		United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 31/12/2027		1.219	
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31/10/2026	719		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon		776	
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	707		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500 %		742	
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	700		United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31/10/2026		718	
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	696		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon		703	
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15/05/2051	671		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon		698	
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	605		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon		698	
Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	597		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon		613	
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	596		Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, 1,500 %		611	
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31/12/2026	580		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 %		604	
United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15/05/2031	572		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon		594	
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31/10/2028	567		United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31/12/2026		579	
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	510		United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2,125 %, fällig 15/02/2040		546	
Ginnie Mae, 30 year, TBA, Null-Coupon	509		Ginnie Mae, 30 year, TBA, Null-Coupon		509	
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	505		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon		506	
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	505		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon		506	
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon	501		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon		505	
Ginnie Mae, 30 year, TBA, Null-Coupon	415		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, Null-Coupon		505	
Ginnie Mae, 30 year, TBA, Null-Coupon	414		Ginnie Mae II Pool 'MA6283', 3,000 %, fällig 20/11/2049		427	
Ginnie Mae, 30 year, TBA, Null-Coupon	414					
Ginnie Mae, 30 year, TBA, Null-Coupon	414					
Ginnie Mae, 30 year, TBA, Null-Coupon	414					
Ginnie Mae, 30 year, TBA, Null-Coupon	413					
Ginnie Mae, 30 year, TBA, Null-Coupon	412					
Ginnie Mae, 30 year, TBA, Null-Coupon	410					
Ginnie Mae, 30 year, TBA, Null-Coupon	409					
Fannie Mae or Freddie Mac, 15 year, TBA, Null-Coupon	405					
Ginnie Mae, 30 year, TBA, Null-Coupon	402					
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30/04/2028	399					
Ginnie Mae 30 year, TBA, 2,500 %	396					

## Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE		ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD		(in Tsd.) USD		(in Tsd.) USD	
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/02/2025	399		Wells Fargo & Co, 1,338 %, fällig 04/05/2025		118	
UBS Group AG, 1,500 %, fällig 30/11/2024	233		United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/02/2025		111	
BNP Paribas SA, 3,052 %, fällig 13/01/2031	232		Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)		7	
Cooperatieve Rabobank UA, 3,250 %, fällig 29/12/2170	231					
HSBC Holdings PLC, 4,950 %, fällig 31/03/2030	230					
GELF Bond Issuer I SA, 1,125 %, fällig 18/07/2029	227					
Anglo American Capital Plc, 4,750 %, fällig 10/04/2027	220					
Danske Bank A/S, 5,375 %, fällig 12/01/2024	215					
Credit Suisse Group AG, 6,375 %, fällig 21/02/2171	214					
TSMC Arizona Corp, 3,250 %, fällig 25/10/2051	207					
Standard Chartered Plc, 2,608 %, fällig 12/01/2028	199					
Intesa Sanpaolo SpA, 4,198 %, fällig 01/06/2032	197					
Enel Finance International NV, 6,000 %, fällig 07/10/2039	195					
Allianz SE, 3,200 %, fällig 30/04/2170	189					
Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16/03/2037	164					
AnheuserBusch InBev SA/NV, 3,700 %, fällig 02/04/2040	150					
AerCap Ireland Capital DAC / AerCa, 3,300 %, fällig 30/01/2032	149					
Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, fällig 01/10/2024	141					
Tesco Corporate Treasury Services, 2,500 %, fällig 02/05/2025	139					
Marks & Spencer Plc, 3,750 %, fällig 19/05/2026	139					
Barclays Plc, 1,700 %, fällig 03/11/2026	134					
Associated British Foods Plc, 2,500 %, fällig 16/06/2034	134					
Lloyds Banking Group Plc, 1,985 %, fällig 15/12/2031	133					
Orange SA, 5,000 %, fällig 01/10/2170	133					
Muenchener RueckversicherungsGese, 3,250 %, fällig 26/05/2049	127					
Williams Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15/10/2051	126					
AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21/11/2029	126					

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15/09/2053	125
Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17/03/2052	122
AXA SA, 5,125 %, fällig 04/07/2043	121
Barclays Plc, 3,375 %, fällig 02/04/2025	121
ING Groep NV, 2,500 %, fällig 15/02/2029	118
Annington Funding Plc, 1,650 %, fällig 12/07/2024	117
Wells Fargo & Co, 1,338 %, fällig 04/05/2025	116
Wells Fargo & Co, 1,000 %, fällig 02/02/2027	116
JPMorgan Chase & Co, 1,090 %, fällig 11/03/2027	116
Ball Corp, 1,500 %, fällig 15/03/2027	115
Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, fällig 02/03/2028	115
alstria office REITAG, 1,500 %, fällig 15/11/2027	114
AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1,625 %, fällig 11/03/2081	114
Acciona Energia Financiacion Filia, 1,375 %, fällig 26/01/2032	113
UCB SA, 1,000 %, fällig 30/03/2028	113
Neste Oyj, 0,750 %, fällig 25/03/2028	113
Terna - Rete Elettrica Nazionale, 2,375 %, fällig 09/02/2171	113
EDP - Energias de Portugal SA, 1,875 %, fällig 02/08/2081	112
Sirius Real Estate Ltd, 1,125 %, fällig 22/06/2026	112
Terega SA, 0,875 %, fällig 17/09/2030	112
JCDecaux SA, 1,625 %, fällig 07/02/2030	111
Engie SA, 0,500 %, fällig 24/10/2030	111
Hannover Rueck SE, 1,125 %, fällig 09/10/2039	110
Prologis Euro Finance Llc, 1,000 %, fällig 06/02/2035	109
Equinix Inc, 1,000 %, fällig 15/03/2033	108
Vonovia SE, 0,750 %, fällig 01/09/2032	108

## Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	161.046
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,064 %, fällig 31/01/2023	54.497
Norway Government Bond, Series 475, 144A, 2,000 %, fällig 24/05/2023	28.120
Poland Government Bond, 2,250 %, fällig 25/04/2022	18.514
Republic of Poland Government Bond, Series 1023, 4,000 %, fällig 25/10/2023	18.286
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/11/2051	18.241
Korea Treasury Bond, 4,750 %, fällig 10/12/2030	17.993
Korea Treasury Bond, Series 4412, 2,750 %, fällig 10/12/2044	15.677
Czech Government Bond, 0,450 %, fällig 25/10/2023	13.922
United Kingdom Gilt, 0,250 %, fällig 31/07/2031	11.978
French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25/11/2031	11.323
Ontario PV, 2,600 %, fällig 02/06/2025	9.839
Canadian Government Bond, 0,250 %, fällig 01/11/2022	9.338
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023	8.254
Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480 %, fällig 15/03/2023	6.674
New Zealand Government Bond, Series 0423, 5,500 %, fällig 15/04/2023	6.553
Ontario PV, 2,850 %, fällig 02/06/2023	6.193
Australia Government Bond, Series 128, 5,750 %, fällig 15/07/2022	6.125
Colhsbusd, 0,000 %, fällig 31/12/2049	5.090
International Bank for Reconstruction & Development, 7,250 %, fällig 21/01/2027	4.547

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	172.207
United States Treasury Floating Rate Note, 0,085 %, fällig 31/07/2022	95.744
United Kingdom Gilt, 1,750 %, fällig 07/09/2022	53.292
United States Treasury Floating Rate Note, 0,079 %, fällig 31/01/2023	41.760
United States Treasury Floating Rate Note, 0,144 %, fällig 30/04/2022	25.798
Norway Government Bond, Series 475, 144A, 2,000 %, fällig 24/05/2023	19.511
Poland Government Bond, 2,250 %, fällig 25/04/2022	19.045
Korea Treasury Bond, 4,750 %, fällig 10/12/2030	17.920
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/05/2050	17.578
United States Treasury Floating Rate Note, 0,085 %, fällig 31/10/2022	15.513
Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15/03/2029	14.077
Czech Government Bond, 0,450 %, fällig 25/10/2023	14.061
Ontario PV, 2,600 %, fällig 02/06/2025	9.651
Canadian Government Bond, 0,250 %, fällig 01/11/2022	9.366
Ontario PV, 2,850 %, fällig 02/06/2023	6.165
Petroleos Mexicanos, 7,690 %, fällig 23/01/2050	5.390
Colhsbusd, 0,000 %, fällig 31/12/2049	5.090
Bundesrepublik Deutschland, 0,000 %, fällig 15/08/2050	4.855
Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31/05/2029	4.059
Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28/04/2028	3.620

## Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Institutional Class	479.935
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023	113.771
Korea Treasury Bond, Series 3012, 1,500 %, fällig 10/12/2030	77.197
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,064 %, fällig 31/01/2023	77.076
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,064 %, fällig 31/07/2023	75.996
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28/02/2048	42.306
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000 %, fällig 01/01/2031	41.165
Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07/11/2047	26.244
China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14/09/2050	25.318
Commonwealth Bank of Australia, 144A, 0,449 %, fällig 07/07/2025	17.736
Indonesia Treasury Bond, Series FR68, 8,375 %, fällig 15/03/2034	17.004
United Kingdom Gilt, 0,625 %, fällig 22/10/2050	16.571
Bundesrepublik Deutschland, 0,000 %, fällig 15/08/2050	14.469
Colombian TES, Series B, 7,250 %, fällig 26/10/2050	13.908
Capital One Financial Corp, 0,740 %, fällig 06/12/2024	13.630
National Australia Bank Ltd, 144A, 0,429 %, fällig 12/01/2025	11.433
Indonesia Treasury Bond, Series FR80, 7,500 %, fällig 15/06/2035	10.106
Caterpillar Financial Services Corp, 0,200 %, fällig 17/11/2022	9.020
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,079 %, fällig 30/04/2023	6.812
Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28/04/2028	6.189

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Institutional Class	521.239
United States Treasury Floating Rate Note, 0,144 %, fällig 30/04/2022	112.948
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,064 %, fällig 31/01/2023	72.725
United States Treasury Floating Rate Note, 0,085 %, fällig 31/07/2022	53.471
United States Treasury Floating Rate Note, 0,085 %, fällig 31/10/2022	30.772
Ford Motor Credit Co LLC, 1,048 %, fällig 05/04/2021	21.080
Republic of South Africa Government Bond, Series 2032, 8,250 %, fällig 31/03/2032	18.742
Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28/04/2028	18.457
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000 %, fällig 01/01/2027	17.014
Republic of South Africa Government Bond, Series R213, 7,000 %, fällig 28/02/2031	16.657
Bundesrepublik Deutschland, 0,000 %, fällig 15/08/2050	15.417
Petroleos Mexicanos, 6,750 %, fällig 21/09/2047	11.928
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28/02/2048	11.897
Caterpillar Financial Services Corp, 0,447 %, fällig 15/03/2021	10.380
Angel Oak Mortgage Trust 2020-1, Series 2020 1, Class A1, 144A, 2,466 %, fällig 25/12/2059	10.165
Korea Treasury Bond, Series 3012, 1,500 %, fällig 10/12/2030	9.825
General Motors Co, 5,950 %, fällig 01/04/2049	8.455
Anglo American Capital Plc, 144A, 5,625 %, fällig 01/04/2030	7.941
Southwest Airlines Co, 5,125 %, fällig 15/06/2027	7.456
Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15/03/2029	7.271

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund<sup>A</sup>

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	4.706	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	4.384
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTFN, 10,000 %, fällig 01/01/2027	230	Embraer Netherlands Finance BV, 144A, 6,950 %, fällig 17/01/2028	229
Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01/08/2026	216	Braskem Netherlands Finance BV, 8,500 %, fällig 23/01/2081	227
Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig 15/11/2029	206	Realogy Group LLC / Realogy Mitherausgeber Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15/06/2025	218
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	Vista Outdoor Inc, 5,875 %, fällig 01/10/2023	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	202
Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15/07/2031	200	Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21/04/2023	201
SierraCol Energy Andina LLC, 144A, 6,000 %, fällig 15/06/2028	199	Banco do Brasil SA/Cayman, 6,250 %, Perpetual	197
XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01/07/2026	198	Yapi ve Kredi Bankasi AS, 7,875 %, fällig 22/01/2031	196
Central Garden & Pet Co, 4,125 %, fällig 30/04/2031	145	Credito Real SAB de CV SOFOM ER, 144A, 8,000 %, fällig 21/01/2028	185
Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 30/03/2031	145	Turkey Government International Bond, 5,950 %, fällig 15/01/2031	179
MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15/06/2028	124	Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28/01/2060	148
Haemonetics Corp, 144A, Null-Coupon, fällig 01/03/2026	123	Clearway Energy Operating LLC, 5,000 %, fällig 15/09/2026	133
Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15/04/2029	122	Sunac China Holdings Ltd, 8,350 %, fällig 19/04/2023	131
Clearway Energy Operating LLC, 3,750 %, fällig 15/02/2031	120	Petrobras Global Finance BV, 5,600 %, fällig 03/01/2031	129
Michaels Cos Inc/The, 5,250 %, fällig 01/05/2028	118	Air Canada, 9,000 %, fällig 22/06/2024	126
Civitas Resources Inc, 7,500 %, fällig 30/04/2026	117	Clearway Energy Operating LLC, 3,750 %, fällig 15/02/2031	120
TMobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15/04/2031	115	Apache Corp, 4,875 %, fällig 15/11/2027	118
Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15/01/2026	114	Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15/01/2026	114
Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15/01/2026	114	Navistar International Corp, 9,500 %, fällig 01/05/2025	107
Navistar International Corp, 9,500 %, fällig 01/05/2025	111	Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15/09/2025	107
GPS Hospitality Holding Co LLC / GPS Finco Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15/08/2028	110	Tronox Inc, 6,500 %, fällig 15/04/2026	103

## Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Institutional Class	225.719	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Institutional Class	254.771
United States Treasury Floating Rate Note, 0,079 %, fällig 31/01/2023	70.097	United States Treasury Floating Rate Note, 0,079 %, fällig 31/01/2023	97.453
Norway Government Bond, Series 475, 144A, 2,000 %, fällig 24/05/2023	35.724	United States Treasury Floating Rate Note, 0,085 %, fällig 31/07/2022	86.166
Republic of Poland Government Bond, Series 1023, 4,000 %, fällig 25/10/2023	34.530	United Kingdom Gilt, 1,750 %, fällig 07/09/2022	84.282
Poland Government International Bond, Sovereign Issues, Poland, 2,250 %, fällig 25/04/2022	30.113	Poland Government International Bond, Sovereign Issues, Poland, 2,250 %, fällig 25/04/2022	31.048
Canadian Government, 1,500 %, fällig 01/02/2022	27.303	Canadian Government, 1,500 %, fällig 01/02/2022	27.619
United States Treasury Floating Rate Note, 0,084 %, fällig 31/07/2023	25.877	Norway Government Bond, Series 475, 144A, 2,000 %, fällig 24/05/2023	26.129
Korea Treasury Bond, Series 3106, 2,000 %, fällig 10/06/2031	16.919	United States Treasury Floating Rate Note, 0,149 %, fällig 31/07/2023	25.894
Czech Republic Government Bond, 0,450 %, fällig 25/10/2023	13.886	United States Treasury Floating Rate Note, 0,085 %, fällig 31/10/2022	25.478
United Kingdom Gilt, 0,250 %, fällig 31/07/2031	12.987	Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15/03/2029	15.321
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023	12.975	Czech Republic Government Bond, 0,450 %, fällig 25/10/2023	14.060
French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25/11/2031	12.316	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,925 %, fällig 23/02/2023	12.999
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/11/2051	11.157	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28/02/2048	11.737
Province of Ontario Canada, 2,600 %, fällig 02/06/2025	9.942	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	9.906
Australia Government Bond, Series 128, 5,750 %, fällig 15/07/2022	9.577	Province of Ontario Canada, 2,600 %, fällig 02/06/2025	9.818
China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14/09/2050	8.971	Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18/11/2038	8.730
New Zealand Government Bond, Series 0423, 5,500 %, fällig 15/04/2023	7.292	General Electric Co, 4,350 %, fällig 01/05/2050	8.290
Korea Treasury Bond, Series 5103, 1,875 %, fällig 10/03/2051	6.339	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31/05/2029	8.189
Athene Global Funding, 144A, 0,750 %, fällig 24/05/2024	5.647	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTFN, 10,000 %, fällig 01/01/2027	8.179
Commonwealth Bank of Australia, 144A, 0,449 %, fällig 07/07/2025	5.350	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023	8.040

## Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Institutional Class	936.973	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Institutional Class	931.309
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023	302.205	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023	108.899
Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07/11/2047	71.197	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07/11/2047	51.668
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,450 %, fällig 01/09/2050	48.211	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,450 %, fällig 01/09/2050	43.698
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTFN, 10,000 %, fällig 01/01/2027	47.763	United Kingdom Gilt, 0,250 %, fällig 31/07/2031	43.515
United Kingdom Gilt, 0,250 %, fällig 31/07/2031	44.249	French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 0,750 %, fällig 25/05/2052	32.035
Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-HQA2, Series 2020 HQA2, Class M2, 144A, 3,287 %, fällig 25/03/2050	38.728	United Kingdom Gilt, 0,625 %, fällig 22/10/2050	31.487
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 0,750 %, fällig 25/05/2052	34.940	Republic of Korea Government Bond, 1,500 %, fällig 10/12/2030	29.956
United Kingdom Gilt, 0,625 %, fällig 22/10/2050	30.800	Canadian Government Bond, 2,000 %, fällig 01/12/2051	18.031
Republic of Korea Government Bond, 1,500 %, fällig 10/12/2030	30.698	Spain Government Bond, 2,700 %, fällig 31/10/2048	17.704
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2021 DNA2, Class M2, 144A, 2,349 %, fällig 25/08/2033	19.745	Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-HQA2, Series 2020 HQA2, Class M2, 144A, 3,287 %, fällig 25/03/2050	16.458
Spain Government Bond, 2,700 %, fällig 31/10/2048	19.225	New Zealand Government Bond, 2,750 %, fällig 15/05/2051	14.334
Oaktown Re V Ltd, Series 2020 2A, Class M1B, 144A, 3,787 %, fällig 25/10/2030	18.897	Twitter Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15/12/2027	12.291
Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Class B1, 144A, 3,266 %, fällig 25/03/2058	18.426	United States Treasury Floating Rate Note, 0,085 %, fällig 31/10/2022	11.346
Hercules Capital Inc, 2,625 %, fällig 16/09/2026	18.314	TMobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15/02/2031	10.842
DiSH Network Corp, 3,375 %, fällig 15/08/2026	18.288	Egyptian Government Bond, 0,000 %, fällig 14/09/2021	10.334
Western Digital Corp, 1,500 %, fällig 01/02/2024	18.210	Egyptian Government Bond, 0,000 %, fällig 15/06/2021	10.003
Canadian Government Bond, 2,000 %, fällig 01/12/2051	18.137	Citrix Systems Inc, 1,250 %, fällig 01/03/2026	9.978
		Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 3,518 %, fällig 25/10/2039	9.725
		Egyptian Government Bond, 0,000 %, fällig 24/08/2021	9.721

<sup>A</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Towd Point Mortgage Trust 2016-2, Series 2016 2, Class B2, 144A, 3,401 %, fällig 25/08/2055	16.358
Twitter Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15/12/2027	15.675

## Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Institutional Class	54.266
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023	7.150
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1B1, 3,937 %, fällig 25/10/2030	2.881
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C14, Series C14, Class A5, 4,064 %, fällig 15/02/2047	2.014
American Credit Acceptance Receivables Trust 2019-3, Series 2019 3, Class F, 144A, 5,420 %, fällig 12/05/2026	2.572
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C01, Class 1M2, 2,437 %, fällig 25/07/2030	2.541
Connecticut Avenue Securities Trust, 3,742 %, fällig 25/02/2040	2.415
STACR Trust 2018-HRP1, Series 2018 HRP1, Class B1, 144A, 3,937 %, fällig 25/04/2043	2.308
Structured Agency Credit Risk Debt Notes Series 2022-DNA2, 0,000 %, fällig 25/02/2042	2.054
Westlake Automobile Receivables Trust 2020-3, Series 2020 3A, Class D, 144A, 1,650 %, fällig 17/02/2026	2.000
Freddie Mac STACR FRN 2018-HRP2 FRN, 4,306 %, fällig 25/02/2047	1.983
Connecticut Avenue Securities Trust, 4,434 %, fällig 25/04/2031	1.755
Freddie Mac STACR 2020-DNA4 FRN, 6,084 %, fällig 25/08/2050	1.741
China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14/09/2050	1.676
Eagle Re 2018-1 Ltd, 3,109 %, fällig 25/11/2028	1.583
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC17, Series 2013 GC17, Class C, 5,102 %, fällig 10/11/2046	1.509
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA5, 7,410 %, fällig 25/11/2050	1.370
Triangle Re 2020-1 Ltd, 5,686 %, fällig 25/10/2030	1.343
Republic of Korea, 1,875 %, fällig 10/03/2051	1.316
LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5, Series 2017 5, Class D, 144A, 4,676 %, fällig 10/03/2050	1.237
	1.219

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Institutional Class	54.882
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023	4.406
Freddie Mac Stacr Remic Trust 2019-DNA4, 6,342 %, fällig 25/10/2049	2.912
Fannie Mae CAS 2018-C05 FRN, 4,342 %, fällig 25/01/2031	2.879
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29, 4,151 %, fällig 10/04/2048	2.605
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, 3,734 %, fällig 15/02/2040	2.334
Structured Agency Credit Risk Debt Notes Series 2022-DNA2, 0,000 %, fällig 25/02/2042	2.008
Freddie Mac STACR FRN 2018-HRP2 FRN, 4,284 %, fällig 25/02/2047	1.765
Connecticut Avenue Securities Trust, 4,434 %, fällig 25/04/2031	1.742
Freddie Mac STACR 2021-DNA1 FRN, 2,700 %, fällig 25/01/2051	1.738
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA5, 7,445 %, fällig 25/11/2050	1.703
Freddie Mac STACR 2020-DNA4 FRN, 6,108 %, fällig 25/08/2050	1.648
Eagle Re 2018-1 Ltd, 3,092 %, fällig 25/11/2028	1.514
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1B1, 3,937 %, fällig 25/10/2030	1.441
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C15, 5,372 %, fällig 15/11/2045	1.431
Triangle Re 2020-1 Ltd, 5,689 %, fällig 25/10/2030	1.316
Fannie Mae - CAS 2018 C03, 2,256 %, fällig 25/10/2030	1.312
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K042, Class X1, 1,029 %, fällig 25/12/2024	1.257
Connecticut Avenue Securities Trust FRN, 4,259 %, fällig 25/08/2031	1.213
Republic of Korea, 1,875 %, fällig 10/03/2051	1.211

## Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	4.397
First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 15/10/2027	220
Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig 15/11/2029	205
NatWest Group Plc, 4,600 %, fällig 30/09/2170	202
ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27/04/2026	200
Gol Finance SA, 144A, 8,000 %, fällig 30/06/2026	200
Alcoa Nederland Holding BV, 4,125 %, fällig 31/03/2029	200
Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15/07/2031	200
SierraCol Energy Andina LLC, 144A, 6,000 %, fällig 15/06/2028	199
XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01/07/2026	198
Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01/08/2026	196
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTFN, 10,000 %, fällig 01/01/2027	195
Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 30/03/2031	140
Central Garden & Pet Co, 4,125 %, fällig 30/04/2031	135
Clearway Energy Operating Llc, 3,750 %, fällig 15/02/2031	120
Verde Bidco SpA, 4,625 %, fällig 01/10/2026	118
TMobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15/04/2031	115
MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15/06/2028	114
Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig 01/05/2028	112
Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15/04/2029	112
Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15/01/2026	109
Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15/01/2026	109
TEGNA Inc, 4,625 %, fällig 15/03/2028	105
Navistar International Corp, 9,500 %, fällig 01/05/2025	105
GPS Hospitality Holding Co LLC / GPS Finco Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15/08/2028	100

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	3.945
Sinclair Television Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15/03/2026	272
Embraer Netherlands Finance BV, 144A, 6,950 %, fällig 17/01/2028	229
Braskem Netherlands Finance BV, 8,500 %, fällig 23/01/2081	228
CSN Inova Ventures, 144A, 6,750 %, fällig 28/01/2028	211
BRF SA, 3,950 %, fällig 22/05/2023	208
Braskem Idesa SAPI, 7,450 %, fällig 15/11/2029	202
NatWest Group Plc, 4,600 %, fällig 30/09/2170	198
Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island, 6,125 %, Perpetual	197
Ford Motor Co, 8,500 %, fällig 21/04/2023	196
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	153
Sunac China Holdings Ltd, 8,350 %, fällig 19/04/2023	131
Air Canada, 144A, 7,750 %, fällig 15/04/2021	130
Iron Mountain Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15/03/2028	126
Petrobras Global Finance BV, 5,600 %, fällig 03/01/2031	124
Clearway Energy Operating LLC, 5,000 %, fällig 15/09/2026	123
Air Canada, 9,000 %, fällig 22/06/2024	121
Clearway Energy Operating Llc, 3,750 %, fällig 15/02/2031	120
Sirius XM Radio Inc, 5,375 %, fällig 15/07/2026	118
Antero Resources Corp, 5,000 %, fällig 01/03/2025	118
Apache Corp, 4,875 %, fällig 15/11/2027	116
GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,375 %, fällig 15/04/2026	114
Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15/01/2026	112
Gap Inc/The, 144A, 8,875 %, fällig 15/05/2027	111
TEGNA Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/03/2028	109
Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15/01/2026	109
TEGNA Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15/03/2028	105
Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15/09/2025	102
Navistar International Corp, 9,500 %, fällig 01/05/2025	102
Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15/03/2024	97
Dell International LLC / EMC Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15/06/2024	97

## Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
United States Treasury Floating Rate Note, 0,079 %, fällig 31/01/2023	40.120
Turkey Government Bond, 11,700 %, 13/11/2030	38.240
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,064 %, fällig 31/07/2023	22.208

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Floating Rate Note, 0,079 %, fällig 31/01/2023	58.050
Turkey Government Bond, 11,700 %, 13/11/2030	37.800
United States Treasury Floating Rate Note, 0,085 %, fällig 31/10/2022	36.184
Indonesia Treasury Bond, Series FR71, 9,000 %, fällig 15/03/2029	33.978

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Korea Treasury Bond, Series 3106, 2,000 %, fällig 10/06/2031	19.354	Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	28.579
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Institutional Class	17.775	United States Treasury Floating Rate Note, 0,085 %, fällig 31/07/2022	28.520
China Government Bond, 3,81 %, fällig 14/09/2050	10.789	Republic of South Africa Government Bond, Series 2048, 8,750 %, fällig 28/02/2048	21.746
Republic of Poland Government Bond, Series 0432, 1,750 %, fällig 25/04/2032	10.458	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund - Institutional Class	20.311
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,120 %, fällig 31/10/2023	7.986	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 0,064 %, fällig 31/07/2023	20.160
Korea Treasury Bond, Series 5103, 1,875 %, fällig 10/03/2051	7.656	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000 %, fällig 01/01/2029	16.827
Athene Global Funding, 144A, 0,750 %, fällig 24/05/2024	6.138	Korea Treasury Bond, Series 3106, 2,000 %, fällig 10/06/2031	13.252
Czech Republic Government Bond, Series 138, 1,750 %, fällig 23/06/2032	5.262	China Government Bond, 3,81 %, fällig 14/09/2050	11.183
Caterpillar Financial Services Corp, 0,200 %, fällig 17/11/2022	4.755	Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28/04/2028	10.032
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000 %, fällig 01/01/2031	4.459	Legg Mason Global Funds Plc - Brandywine Global Credit Opportunities Fund - LM Class US\$ Accumulating	7.509
Commonwealth Bank of Australia, 144A, 0,449 %, fällig 07/07/2025	2.190	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07/11/2047	7.414
Capital One Financial Corp, 0,740 %, fällig 06/12/2024	1.920	Russian Federal Bond - OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10/04/2030	7.409
National Australia Bank Ltd, 144A, 0,429 %, fällig 12/01/2025	1.709	Mexican Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31/05/2029	7.070
Mexican Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13/11/2042	780	Mexican Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18/11/2038	6.940
Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28/02/2041	626	Ford Motor Credit Co LLC, 1,048 %, fällig 05/04/2021	5.580
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000 %, fällig 01/01/2029	509	Caterpillar Financial Services Corp, 0,447 %, fällig 15/03/2021	5.420
Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07/11/2047	385	Malaysia Government Bond, Series 0117, 3,882 %, fällig 10/03/2022	5.195
		Korea Treasury Bond, Series 5103, 1,875 %, fällig 10/03/2051	5.174
		Republic of South Africa Government Bond, Series R214, 6,500 %, fällig 28/02/2041	5.075
		Bank of Nova Scotia/The, 0,599 %, fällig 15/09/2023	5.063

## Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup>

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	350	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	325
Cigna Corp	103	General Motors Co	95
Nucor Corp	81	Intel Corp	91
iShares Russell 1000 Value ETF - ETF	79	Regeneron Pharmaceuticals Inc	78
JPMorgan Chase & Co	74	Lowe's Companies Inc	75
Lowe's Companies Inc	70	iShares Russell 1000 Value ETF - ETF	66
Quest Diagnostics Inc	62	eBay Inc	64
General Motors Co	56	Johnson Controls International plc	63
Steel Dynamics Inc	48	Cummins Inc	62
Mohawk Industries Inc	41	LyondellBasell Industries NV	52
Dollar Tree Inc	40	T Rowe Price Group Inc	50
Kohl's Corp	36	DR Horton Inc	42
Dominion Energy Inc	35	Newmont Corp	41
Anthem Inc	35	Biogen Inc	38
Berkshire Hathaway Inc 'B'	34	Discover Financial Services	38
Regeneron Pharmaceuticals Inc	34	State Street Corp	35
TD Synnex Corp	34	Lennar Corp	34
DaVita Inc	32	BlackRock Inc	33
DuPont de Nemours Inc	31	Toll Brothers Inc	33
Amdocs Ltd	27	Ameriprise Financial Inc	33
Advance Auto Parts Inc	27	United Rentals Inc	33
Corteva Inc	26	TD Synnex Corp	32
Textron Inc	25	AutoNation Inc	29
Tempur Sealy International Inc	25	MGM Resorts International	29
Wells Fargo & Co	25	Celanese Corp 'A'	27
CACI International Inc 'A'	24	Coteva Inc	26
		Eastman Chemical Co	25
		Textron Inc	24
		Fox Corp	24
		O'Reilly Automotive Inc	23

## Legg Mason ClearBridge Value Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Uber Technologies Inc	18.734	ON Semiconductor Corp	18.809
Signature Bank/New York NY	18.685	Merck & Co. Inc.	14.518
Cigna Corp	18.233	Eli Lilly and Co	13.702
Enbridge Inc	18.197	Carnival Corp	13.020
Zimmer Biomet Holdings Inc	16.084	Goldman Sachs Group Inc/The	12.545
Cisco Systems Inc/Delaware	15.741	KION Group AG	11.080
Bank of New York Mellon Corp/The	15.354	Walt Disney Co/The	10.673
Vertex Pharmaceuticals Inc	14.586	Liberty Media Corp/Liberty SiriusXM	10.668
Merck & Co. Inc.	14.541	Fidelity National Information Services Inc	9.901
Coty Inc 'A'	14.126	Micron Technology Inc	9.892
Fiserv Inc	13.183	CVS Health Corp	9.023
Safran SA	12.654	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	8.947
Fluence Energy Inc	11.747	Southwest Airlines Co	8.784
Devon Energy Corp	11.588	FedEx Corp	7.893
Schlumberger NV	11.246	Toll Brothers Inc	7.876
Biogen Inc	11.220	Hartford Financial Services Group Inc/The	7.788
BioMarin Pharmaceutical Inc	11.195	TJX Cos Inc/The	7.663
Unum Group	11.170	Darden Restaurants Inc	7.661

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

### Legg Mason ClearBridge Value Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
CNH Industrial NV	11.051	Oshkosh Corp	7.332
Bank of America Corp	10.723	Ulta Beauty Inc	7.311
Wells Fargo & Co	10.571	NXP Semiconductors NV	7.152
American International Group Inc	10.504	Eaton Corp Plc	6.979
Synchrony Financial	10.299	Cigna Corp	6.932
Splunk Inc	9.929	Comcast Corp	6.843
DXC Technology Co	9.783	Biogen Inc	6.765
Meta Platforms Inc 'A'	8.807	Northrop Grumman Corp	6.712
Equitable Holdings Inc	8.799	Newmont Corp	6.678
Medtronic Plc	8.248	Citigroup Inc	6.168
FreeportMcMoRan Inc	8.184	Alibaba Group Holdings Ltd	6.040
Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	8.117	AbbVie Inc	5.928
Quanta Services Inc	8.012	AnheuserBusch InBev	5.888
Bloomin' Brands Inc	7.978	CurtisWright Corp	5.780
AES Corp/The	7.787	Marriott International Inc.	5.649
Capri Holdings Ltd	7.782	Equitable Holdings Inc	5.236
EQT Corp	7.762	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	5.127
Simon Property Group Inc	7.574	Arista Networks Inc	4.818
Enphase Energy Inc	7.538	Synchrony Financial	4.649
AnheuserBusch InBev	7.510	Paramount Global	4.299
Carnival Corporation	7.481	Activision Blizzard Inc.	4.115
Gilead Sciences Inc	7.330	DXC Technology Co	4.097
Alibaba Group Holdings Ltd	7.286	Amazon.com Inc	4.076
UnitedHealth Group Inc	7.177	Volkswagen AG	3.829
Marubeni Corp	6.879		
OneMain Holdings Inc	6.871		
Air Liquide SA	6.839		

### Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Microsoft Corp	2.509	Microsoft Corp	5.015
Cisco Systems Inc/Delaware	2.062	Apple Inc	2.814
Amazon.com Inc	1.989	Chevron Corp	2.619
Activision Blizzard Inc	1.989	Pinterest Inc	2.408
Alphabet Inc 'A'	1.916	Medtronic Plc	2.389
Alphabet Inc	1.821	Meta Platforms Inc 'A'	2.246
Apple Inc	1.669	Berkshire Hathaway Inc	2.135
Pioneer Natural Resources Co	1.297	Adobe Inc	2.096
Eaton Corp Plc	1.269	Comcast Corp	1.901
Oracle Corp	1.202	Amazon.com Inc	1.845
Hartford Financial Services Group Inc/The	1.040	Cognizant Technology Solutions Corp	1.810
Enphase Energy Inc	996	PPG Industries Inc	1.710
Progressive Corp/The	985	Walt Disney Co/The	1.698
JPMorgan Chase & Co	954	Activision Blizzard Inc	1.622
Becton Dickinson and Co	933	Visa Inc 'A'	1.535
Home Depot Inc/The	926	Home Depot Inc/The	1.436
Bank of America Corp	820	JPMorgan Chase & Co	1.345
SVB Financial Group	815	International Business Machines Corp	1.308
Ball Corp	806	3M Co	1.209
Waste Management Inc	793	ASML Holding NV	1.177
Truist Financial Corp	746	Thermo Fisher Scientific Inc	1.166
PPG Industries Inc	742	United Parcel Service Inc 'B'	1.119
Toll Brothers Inc	698	Air Products & Chemicals Inc	960
Thermo Fisher Scientific Inc	691	Amgen Inc	958
Travelers Cos Inc/The	657	TMobile US Inc	905
Coca-Cola Co/The	653	UnitedHealth Group Inc	884
Visa Inc 'A'	630	Procter & Gamble Co/The	878
Fidelity National Information Services Inc	624	Honeywell International Inc	864
Honeywell International Inc	610	Arista Networks Inc	838
UnitedHealth Group Inc	595	Travelers Cos Inc/The	815
TJX Cos Inc/The	584	Johnson & Johnson	813
Merck & Co Inc	578	Eli Lilly & Co	792
Johnson & Johnson	576	Alphabet Inc	775
Comcast Corp	574	Oracle Corp	768
United Parcel Service Inc 'B'	567	Texas Instruments Inc	761
Meta Platforms Inc 'A'	564	Alphabet Inc 'A'	708
CME Group Inc	549	ArcelorMittal SA	677
PepsiCo Inc	499		
General Motors Co	469		

### Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Netflix Inc	54.772	QUALCOMM Inc	62.418
PayPal Holdings Inc	46.044	Home Depot Inc/The	46.691
NIKE Inc	34.468	Zoetis Inc	43.899
Sea Ltd ADR	32.608	Amgen Inc	41.028
Eaton Corp Plc	30.512	Apple Inc	36.459
CVS Health Corp	29.430	Ecolab Inc	27.639
Intuitive Surgical Inc	29.282	Akamai Technologies Inc	27.629

## Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

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

<b>WICHTIGE KÄUFE</b>	<b>KOSTEN (in Tsd.) USD</b>	<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	<b>ERLÖSE (in Tsd.) USD</b>
Dexcom Inc	21.930	Texas Instruments Inc	27.431
UiPath Inc	19.210	Alibaba Group Holding Ltd ADR	25.908
salesforce.com Inc	19.019	VMware Inc	25.477
Unity Software Inc	18.040	Comcast Corp	25.472
ASML Holding NV	14.680	Costco Wholesale Corp	17.333
Amazon.com Inc	12.359	Ulta Beauty Inc	17.326
Workday Inc 'A'	11.977	Nutanix Inc	16.346
Atlassian Corp Plc	9.195	ASML Holding NV	15.808
Tractor Supply Co	4.645	AnheuserBusch InBev SA/NV ADR	14.660
Monster Beverage Corp	4.014	UnitedHealth Group Inc	12.386
Meta Platforms Inc 'A'	2.981	Microsoft Corp	10.666
IHS Markit Ltd	2.856	Alexion Pharmaceuticals Inc	9.285
Uber Technologies Inc	2.706	Amazon.com Inc	9.090
		NXP Semiconductors NV	8.479
		Fidelity National Information Services Inc	7.392
		NVIDIA Corp	7.250
		Meta Platforms Inc 'A'	6.509
		Advance Auto Parts Inc	6.257

### Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund

<b>WICHTIGE KÄUFE</b>	<b>KOSTEN (in Tsd.) USD</b>	<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	<b>ERLÖSE (in Tsd.) USD</b>
DocuSign Inc 'A'	16.818	Nuance Communications Inc	43.431
HubSpot Inc	16.760	Comcast Corp	26.852
Meta Platforms Inc 'A'	16.684	Biogen Inc	15.995
CrowdStrike Holdings Inc	16.092	Seagate Technology Holdings Plc	15.717
Match Group Inc	15.214	Citrix Systems Inc	12.343
Etsy Inc	12.247	Amgen Inc	12.078
Charles River Laboratories International Inc	11.050	Liberty Media CorpLiberty SiriusXM	11.144
Lyft Inc	9.531	Liberty Media CorpLiberty SiriusXM	10.701
Insulet Corp	7.170	Discovery Inc	9.638
10X Genomics Inc	7.060	Liberty Broadband Corp	9.016
Unity Software Inc	4.101	Bausch Health Cos Inc	8.297
Guardant Health Inc	2.580	AMC Networks Inc	7.947
Doximity Inc	2.381	Core Laboratories NV	7.489
Ultranexx Pharmaceutical Inc	1.884	Wolfspeed Inc	6.964
		Agios Pharmaceuticals Inc	6.871
		Seagate Technology Plc	6.667
		Mandiant Inc	6.414
		NOV Inc	5.896
		Broadcom Inc	5.440
		Western Digital Corp	5.350
		Nucor Corp	5.340
		Medtronic Plc	4.558
		Liberty Broadband Corp	4.500
		UnitedHealth Group Inc	4.064
		Twitter Inc	3.966
		Intel Corp	3.883
		Madison Square Garden Entertainment Corp	3.832
		Cerence Inc	3.699
		Lions Gate Entertainment Corp	3.199
		Pentair Plc	3.138

### Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

<b>WICHTIGE KÄUFE</b>	<b>KOSTEN (in Tsd.) USD</b>	<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	<b>ERLÖSE (in Tsd.) USD</b>
Verizon Communications Inc	805	Broadcom Inc, Series A	1.076
Paramount Global, Series A	789	Microchip Technology Inc	667
Cisco Systems Inc/Delaware	692	B. Riley Financial Inc	658
B. Riley Financial Inc	685	KNOT Offshore Partners LP, MLP	644
Shenandoah Telecommunication	654	QUALCOMM Inc	566
Qurate Retail Inc	556	Qurate Retail Inc	493
Equitrans Midstream Corp	552	TE Connectivity Ltd	489
Weyerhaeuser Co	522	AGNC Investment Corp	457
Activision Blizzard Inc	486	Weyerhaeuser Co	398
TC Energy Corp	453	American Financial Group Inc	376
Intel Corp	447	Shenandoah Telecommunication	370
Blue Owl Capital Inc 'A'	432	Microsoft Corp	332
American Financial Group Inc	426	Verizon Communications Inc	331
DT Midstream Inc	331	Apple Inc	320
Enbridge Inc	318	NXP Semiconductors NV	293
Pfizer Inc	318	Williams Cos Inc/The	246
ONEOK Inc	289	AbbVie Inc	225
Williams Cos Inc/The	235	Otis Worldwide Corp	222
Gaming and Leisure Properties Inc	230	ASML Holding NV	201
Coca-Cola Co/The	228	Ares Capital Corp	196
Oracle Corp	227	Becton Dickinson and Co, Series B	191
Progressive Corp/The	218	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 15/06/2023	177
Ares Capital Corp	198	Crown Castle International Corp	152
South Jersey Industries Inc	197	TriplePoint Venture Growth BDC Corp	141
Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,250 %, fällig 15/06/2023	177	Merck & Co Inc	124
ASML Holding NV	170		

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Microsoft Corp	61.270	Amgen Inc	27.292
Apple Inc	49.081	Resideo Technologies Inc	26.652
Amazon.com Inc	42.533	Herman Miller Inc	22.969
WilliamsSonoma Inc	33.552	Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP	22.112
McCormick & Co Inc/MD	33.358	TMobile US Inc	18.185
Eaton Corp Plc	31.147	Autodesk Inc	17.578
Cisco Systems Inc/Delaware	30.796	Unilever Plc ADR	16.570
Thermo Fisher Scientific Inc	30.222	Comcast Corp	15.550
Bank of America Corp	30.089	Vestas Wind Systems A/S ADR	14.896
Walt Disney Co/The	28.788	Becton Dickinson and Co	13.844
Cooper Cos Inc/The	26.821	Apple Inc	13.799
Intel Corp	26.468	Lam Research Corp	11.384
CVS Health Corp	26.294	Charles Schwab Corp/The	10.100
Deere & Co	24.980	Bank of America Corp	9.559
UnitedHealth Group Inc	24.687	Shoals Technologies Group	9.424
Brookfield Renewable Corporation	24.318	Microsoft Corp	8.791
Morgan Stanley	23.400	Synopsys Inc	8.702
Home Depot Inc/The	23.075	CVS Health Corp	8.498
Regal Rexnord Corp	22.979	Aptiv Plc	8.058
TE Connectivity Ltd	22.714	Hartford Financial Services Group Inc/The	7.027
Progressive Corp/The	22.691	Trane Technologies Plc	6.387
Danaher Corp	22.524	Danaher Corp	6.363
Gilead Sciences Inc	22.065	Vital Farms Inc	5.964
Ball Corp	21.298	Regal Rexnord Corp	5.788
Visa Inc 'A'	21.271	Trex Co Inc	5.781
Costco Wholesale Corp	21.142	TE Connectivity Ltd	5.656
Booking Holdings Inc	21.124	Enphase Energy Inc	5.497
Hasbro Inc	20.874	Costco Wholesale Corp	5.465
Charles Schwab Corp/The	20.855	Morgan Stanley	5.364
Trane Technologies Plc	20.818	SunOpta Inc	5.216
salesforce.com Inc	20.692	Progressive Corp/The	5.094
ON Semiconductor Corp	20.528		
Progyny Inc	20.422		
Marriott International Inc/MD	19.983		
Hartford Financial Services Group Inc/The	19.962		
Resideo Technologies Inc	19.861		
Hain Celestial Group Inc/The	19.731		
First Republic Bank/CA	19.093		
Aptiv Plc	18.225		
Workday Inc 'A'	17.954		
Trex Co Inc	17.449		
NIKE Inc	17.409		
Comcast Corp	17.323		
Synopsys Inc	17.172		
NextEra Energy Inc	16.345		
Amgen Inc	16.218		
Keysight Technologies Inc	15.708		
BlackRock Inc	15.508		
BioMarin Pharmaceutical Inc	15.360		
Shoals Technologies Group	14.651		
Ecolab Inc	14.564		
Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP	13.382		

## Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
BNP Paribas SA	255	Ecolab Inc	257
Kroger Co/The	245	Hoya Corp	240
Old Dominion Freight Line Inc	233	Trex Co Inc	230
Air Liquide SA	229	salesforce.com Inc	200
Raymond James Financial Inc	228	Nintendo Co Ltd	199
Diageo Plc ADR	217	Arista Networks Inc	187
Hoya Corp	213	Cellnex Telecom SA, 144A	184
Recruit Holdings Co Ltd	213	Procter & Gamble Co/The	173
ICON Plc	212	Sea Ltd	171
Intesa Sanpaolo SpA	212	Tencent Holdings Ltd	168
United Rentals Inc	197	TMobile US Inc	156
UnitedHealth Group Inc	190	Legrand SA	136
Waste Management Inc	189	Tokyo Electron Ltd	136
Keyence Corp	184	Atlassian Corp Plc	132
Marvell Technology Inc	184	NextEra Energy Inc	132
Sandvik AB	177	Tesla Inc	123
Accenture Plc 'A'	176	McCormick & Co Inc	116
Nice Ltd ADR	176	Vestas Wind Systems AS	116
Progressive Corp/The	170	Apple Inc	112
Microsoft Corp	168	Roche Holding AG	112
Constellation Software Inc/Canada	166	Just Eat Takeaway.com NV, 144A	109
Apple Inc	165	Alcon Inc	106
DocuSign Inc 'A'	163	FANUC Corp	106
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	163	NVIDIA Corp	106
Coty Inc 'A'	162	Amadeus IT Group SA	103

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^ – (Fortsetzung)

<b>WICHTIGE KÄUFE</b>	<b>KOSTEN (in Tsd.) USD</b>	<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	<b>ERLÖSE (in Tsd.) USD</b>
EssilorLuxottica SA	162	Daiichi Sankyo Co Ltd	103
Bank of America Corp	156	Guardant Health Inc	103
Deutsche Boerse AG	155	Samsung Electronics Co Ltd	103
Insulet Corp	153	Merck & Co Inc	98
Sea Ltd	142	Ocado Group Plc	96
Nestle SA	132	TeamViewer AG, 144A	95
Canadian Imperial Bank of Commerce	124	Nihon M&A Center Inc	85
Netflix Inc	121	Equinix Inc	82
Marriott International Inc/MD	114	MercadoLibre Inc	81
Avantor Inc	109	Workday Inc 'A'	81
United Parcel Service Inc 'B'	104	MorphoSys AG ADR	80
McCormick & Co Inc	103	Adyen NV, 144A	79
Union Pacific Corp	95	Recruit Holdings Co Ltd	73
		Microsoft Corp	65
		XP Inc 'A'	65
		Spotify Technology SA	64
		InPost SA	62
		Ulta Beauty Inc	62

## Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^

<b>WICHTIGE KÄUFE</b>	<b>KOSTEN (in Tsd.) EUR</b>	<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	<b>ERLÖSE (in Tsd.) EUR</b>
Exelon Corp	32.030	Exelon Corp	30.756
Pembina Pipeline Corp	24.862	Cheniere Energy Inc	26.894
SBA Communications Corp 'NEW'	21.621	Sydney Airport	23.162
SBA Communications Corp 'A'	19.133	Enbridge Inc	22.584
Entergy Corp	18.494	Aeroports de Paris	21.111
Cellnex Telecom SA, 144A	17.332	SBA Communications Corp 'A'	20.213
East Japan Railway Co	16.186	Sempra Energy	20.204
Alliant Energy Corp	16.117	Atlantia SpA	20.092
Dominion Energy Inc	15.544	Alliant Energy Corp	17.956
Enbridge Inc	15.433	Orsted AS, 144A	17.923
Gibson Energy Inc	14.911	Vinci SA	16.503
Canadian National Railway Co	14.414	Pinnacle West Capital Corp	16.143
PG&E Corp	13.885	Canadian National Railway Co	15.881
CSX Corp	13.860	Union Pacific Corp	15.316
Ferrovial SA	13.578	Cellnex Telecom SA, 144A	14.711
Getlink SE	13.211	Brookfield Renewable Corporation	14.514
CenterPoint Energy Inc	12.867	Transurban Group	13.182
Iberdrola SA	11.880	Public Service Enterprise Group Inc	12.120
NextEra Energy Inc	11.570	CSX Corp	11.782
National Grid Plc	11.392	Atlas Arteria Ltd	11.495
EDP - Energias de Portugal SA	11.130	NextEra Energy Partners LP	11.006
Exelon Corp	9.558	SBA Communications Corp 'NEW'	10.266
SSE Plc	9.462	Ferrovial SA	10.116
Aena SME SA, 144A	9.267	Crown Castle International Corp	9.550
Aeroports de Paris	8.049	Exelon Corp	8.966
CSX Corp	7.487	Terna - Rete Elettrica Nazionale	8.562
CMS Energy Corp	6.907	Getlink SE	8.513
Williams Cos Inc/The	6.825	Clearway Energy Inc 'C'	8.383
Terna - Rete Elettrica Nazionale	5.823	Severn Trent Plc	8.243
Southern Co/The	5.656	American Tower Corp	7.575
Eiffage SA	5.050	SSE Plc	7.520
Severn Trent Plc	4.943	Snam SpA	6.820
Sydney Airport	4.877	NextEra Energy Inc	6.549

## Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^

<b>WICHTIGE KÄUFE</b>	<b>KOSTEN (in Tsd.) USD</b>	<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	<b>ERLÖSE (in Tsd.) USD</b>
China Resources Power Holdings Co Ltd	87	Gujarat Gas Ltd	121
China Longyuan Power Group Corp Ltd	68	China Gas Holdings Ltd	94
Shanghai International Port 'A'	58	ENN Energy Holdings Ltd	89
IHS Holding Ltd	57	Mahanagar Gas Ltd	61
China Power International Development Ltd	57	International Container Terminal Services Inc	57
Xinyi Energy Holdings Ltd	55	Telesites SAB de CV	55
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	44	Container Corp Of India Ltd	54
Cia Energetica de Sao Paulo	42	Shanghai International Airport Co Ltd	49
China Resources Gas Group Ltd	35	Tenaga Nasional Bhd	43
NTPC Ltd	30	Aguas Andinas SA	39
Power Grid Corp of India Ltd	29	Electricity Generating PCL	38
Airports of Thailand PCL	28	Indraprastha Gas Ltd	36
China Tower Corp Ltd, 144A	27	Power Grid Corp of India Ltd	32
Malaysia Airports Holdings Bhd	27	Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	26
Jasa Marga Persero Tbk PT	26	Petronet LNG Ltd	25
International Container Terminal Services Inc	23	Ratch Group PCL	25
China Gas Holdings Ltd	21	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA	22
Indraprastha Gas Ltd	21	Shanghai International Port 'A'	20
Gujarat State Petronet Ltd	19	Equatorial Energia SA	15
CCR SA	18	Shenzhen Expressway Corp Ltd	10
Jiangsu Expressway Co Ltd	15		
EcoRodovias Infraestruturas e Logistica SA	15		

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

### Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	15
Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV 'B'	14

### Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
SSE Plc	10.705	Exelon Corp	7.006
Enbridge Inc	10.413	AusNet Services Ltd	6.039
Public Service Enterprise Group Inc	10.221	Sydney Airport	5.923
Iberdrola SA	9.505	Enbridge Inc	5.858
Snam SpA	9.311	Williams Cos Inc/The	5.711
National Grid Plc	9.199	Southern Co/The	4.770
APA Group	9.068	United Utilities Group Plc	4.308
Southern Co/The	8.780	APA Group	4.184
Enagas SA	8.111	Enagas SA	3.845
Exelon Corp	7.877	Public Service Enterprise Group Inc	3.102
United Utilities Group Plc	7.733	SSE Plc	2.881
Atlas Arteria Ltd	6.997	Red Electrica Corp SA	2.727
Clearway Energy Inc 'C'	6.814	Eiffage SA	2.647
Crown Castle International Corp	6.470	Iberdrola SA	2.299
Williams Cos Inc/The	6.344	TC Energy Corp	2.255
Red Electrica Corp SA	6.274	Snam SpA	2.087
Pembina Pipeline Corp	6.095	Spark Infrastructure Group	2.079
NextEra Energy Partners LP	5.559	National Grid Plc	1.732
Aena SME SA, 144A	5.440	Clearway Energy Inc 'C'	1.292
Sydney Airport	5.241	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA	1.168
FirstEnergy Corp	5.066	Vinci SA	1.016
Entergy Corp	4.980	Crown Castle International Corp	949
EDP - Energias de Portugal SA	4.863	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	833
Getlink SE	4.736		
AusNet Services Ltd	4.701		
Brookfield Renewable Corporation	4.679		
Transurban Group	4.453		
Gibson Energy Inc	4.338		
Vinci SA	4.295		
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	3.777		
TC Energy Corp	3.749		
Ferrovial SA	3.392		
Emera Inc	3.294		
CPFL Energia SA	3.235		
Eiffage SA	2.618		

### Legg Mason Royal US Small Cap Opportunity 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)	347.495	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	397.390
Overstock.com Inc	12.571	Olin Corp	16.077
Skechers USA Inc	9.505	Lydall Inc	15.859
Texas Capital Bancshares Inc	8.876	Herc Holdings Inc	13.369
Emergent BioSolutions Inc	6.921	Surgery Partners Inc	13.336
VSE Corp	6.646	Alcoa Corp	13.214
MillerKnoll Inc	6.579	US Concrete Inc	12.793
Nordstrom Inc	5.943	Kraton Corp	12.500
Fabrinet	5.923	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	12.262
Astronics Corp	5.876	Avid Technology Inc	11.397
Victoria's Secret & Co	5.757	Community Health Systems Inc	11.363
Marcus Corp/The	5.616	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	11.009
American Public Education Inc	5.533	Owens & Minor Inc	10.804
Designer Brands Inc	5.519	Black Hills Corp	10.478
CIRCOR International Inc	5.500	Kimco Realty Corp	10.413
Univar Solutions Inc	5.468	Stewart Information Services Corp	10.286
Chesapeake Energy Corp	5.383	Walker & Dunlop Inc	10.236
Fossil Group Inc	5.371	Ferro Corp	10.188
Spectrum Brands Holdings Inc	5.343	Intrepid Potash Inc	10.151
Conn's Inc	5.306	Livent Corp	9.784

### 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)	40.522	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	40.464
Cohu Inc	2.462	CMC Materials Inc	3.121
Innospec Inc	2.150	Meritor Inc	2.709
Simulations Plus Inc	1.960	Insight Enterprises Inc	2.170
iShares Russell 2000 Value ETF - ETF	1.847	Kulicke & Soffa Industries Inc	2.105
White Mountains Insurance Group Ltd	1.840	iShares Russell 2000 Value ETF - ETF	2.010
Kulicke & Soffa Industries Inc	1.811	Heidrick & Struggles International Inc	1.999
Meridian Bioscience Inc	1.795	Houlihan Lokey Inc 'A'	1.879

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

### Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund – (Fortsetzung)

<b>WICHTIGE KÄUFE</b>	<b>KOSTEN (in Tsd.) USD</b>	<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	<b>ERLÖSE (in Tsd.) USD</b>
Ziff Davis Inc	1.784	BioTechne Corp	1.742
John Bean Technologies Corp	1.730	Pason Systems Inc	1.611
CMC Materials Inc	1.590	Inter Parfums Inc	1.555
Air Lease Corp 'A'	1.403	Colfax Corp	1.541
Meritor Inc	1.394	John Bean Technologies Corp	1.419
Great Lakes Dredge & Dock Corp	1.393	Meridian Bioscience Inc	1.397
Korn Ferry	1.390	Stellajones Inc	1.286
Movado Group Inc	1.376	Wolverine World Wide Inc	1.177
ESCO Technologies Inc	1.376	Korn Ferry	1.168
Computer Task Group Inc	1.374	Nova Ltd	1.166
ChannelAdvisor Corp	1.340	MAXIMUS Inc	1.046
Gibraltar Industries Inc	1.319	Ziff Davis Inc	1.040
Wolverine World Wide Inc	1.155		
Harmony Biosciences Holdings Inc	1.149		
MKS Instruments Inc	1.140		

### Royce Global Small Cap Premier Fund^

<b>WICHTIGE KÄUFE</b>	<b>KOSTEN (in Tsd.) USD</b>	<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	<b>ERLÖSE (in Tsd.) USD</b>
Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	646	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	506
Bravura Solutions Ltd	105	CMC Materials Inc	110
Hansen Technologies Ltd	103	Rogers Corporation	49
Innospec Inc	103	1-800-Flowers.com Inc	25
Ralph Lauren Corp 'A'	103	ESCO Technologies Inc	21
CMC Materials Inc	102	Innospec Inc	20
IPH Ltd	102	Ralph Lauren Corp 'A'	20
New Work SE	102	Colliers International Group Inc	15
TKC Corp	102	Meridian Bioscience Inc	13
KennedyWilson Holdings Inc	100	Meitec Corp	12
MKS Instruments Inc	98	Karnov Group AB	10
GVS SpA, 144A	97	USS Co Ltd	10
Kulicke & Soffa Industries Inc	96	MKS Instruments Inc	9
Quaker Chemical Corp	92	Morningstar Inc	9
Restore Plc	92	Inter Parfums Inc	8
John Bean Technologies Corp	89	Kulicke & Soffa Industries Inc	7
Landstar System Inc	89	Lincoln Electric Holdings Inc	7
Forward Air Corp	88	Dolby Laboratories Inc 'A'	6
Meitec Corp	88	UFP Industries Inc	6
Brunswick Corp/DE	84	Quaker Chemical Corp	5
Forrester Research Inc	84		
Lincoln Electric Holdings Inc	84		
Kadant Inc	83		
OBIC Business Consultants Co Ltd	82		
BML Inc	77		
UFP Industries Inc	77		
Asseco Poland SA	76		
Colliers International Group Inc	76		
FormFactor Inc	76		
Marel hf, 144A	76		
Morningstar Inc	76		
SEI Investments Co	76		
Alimak Group AB, 144A	75		
ESCO Technologies Inc	75		
Karnov Group AB	75		
Fukui Computer Holdings Inc	73		
Ziff Davis Inc	73		
IMCD NV	72		
SpiraxSarco Engineering Plc	72		
Dorman Products Inc	70		
DiscoverE Group Plc	69		
Gentex Corp	69		
DiaSorin SpA	65		
Arcosa Inc	64		
Carel Industries SpA, 144A	64		
FirstService Corporation	64		
Learning Technologies Group Plc	64		
Valmont Industries Inc	64		
Victrex Plc	64		
Diploma Plc	63		
Avid Technology Inc	62		
Technology One Ltd	60		

### Franklin MV European Equity Growth and Income Fund

<b>WICHTIGE KÄUFE</b>	<b>KOSTEN (in Tsd.) EUR</b>	<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	<b>ERLÖSE (in Tsd.) EUR</b>
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	477	Deutsche Telekom AG	616
SAP SE	460	ICA Gruppen AB	558
Volkswagen AG	402	Tate & Lyle Plc	473
Carrefour SA	390	Lloyds Banking Group Plc	458
SEB SA	380	Novo Nordisk A/S	441

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

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

<b>WICHTIGE KÄUFE</b>	<b>KOSTEN (in Tsd.) EUR</b>	<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	<b>ERLÖSE (in Tsd.) EUR</b>
Hargreaves Lansdown Plc	372	Snam SpA	425
BAE Systems Plc	353	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	408
ASML Holding NV	352	TOTAL SE	405
Persimmon Plc	338	LEG Immobilien AG	382
Securitas AB	332	Pandora A/S	374
Ageas SA/NV	325	Talanx AG	370
Yara International ASA	325	Quadiant SA	362
Koninklijke KPN NV	321	Royal Dutch Shell Plc 'A'	362
NN Group NV	315	Roche Holding AG	357
Electrolux AB	309	Hannover Rueck SE	356
PSP Swiss Property AG	302	Publicis Groupe SA	340
J Sainsbury Plc	299	Unilever Plc	337
DCC Plc	286	Helvetia Holding AG	329
Valmet Oyj	282	Swisscom AG	329
TAG Immobilien AG	273	CRH Plc	317
Cie de SaintGobain	271	Nordea Bank Abp	314
Rio Tinto Plc	156	Kesko Oyj	310
BHP Group Plc	136	Baloise Holding AG	296
Nordea Bank Abp	107	Evrax Plc	287
Telenet Group Holding NV	96	Vodafone Group Plc	280
		Klepierre SA	276
		Novartis AG	264
		Allianz SE	259
		CRH Plc	246
		Swiss Prime Site AG	243
		Coloplast A/S	229
		Swedish Match AB	225
		IG Group Holdings Plc	222
		Kuehne + Nagel International AG	217
		Koninklijke Ahold Delhaize NV	214
		GlaxoSmithKline Plc	213
		Logitech International SA	211
		Swedish Match AB	199
		Bunzl Plc	193
		Endesa SA	193
		Sanofi	175

### Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

<b>WICHTIGE KÄUFE</b>	<b>KOSTEN (in Tsd.) USD</b>	<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	<b>ERLÖSE (in Tsd.) USD</b>
iShares MSCI All Country Asia ex Japan ETF - ETF	2.132	iShares MSCI All Country Asia ex Japan ETF - ETF	2.159
Bank of China Ltd	415	Synnex Technology International Corp	467
PICC Property & Casualty Co Ltd	344	HCL Technologies Ltd	465
SK Hynix Inc	330	Globe Telecom Inc	417
RHB Bank Bhd	325	Guangdong Investment Ltd	384
CTBC Financial Holding Co Ltd	297	President Chain Store Corp	370
PetroChina Co Ltd	265	MISC Bhd	356
Realtek Semiconductor Corp	263	China Aircraft Leasing Group Holdings Ltd	332
JB HiFi Ltd	236	Huaneng Power International Inc	331
Longfor Group Holdings Ltd, 144A	201	HKT Trust & HKT Ltd	325
Asustek Computer Inc	189	Shanghai Pharmaceuticals Holding Co Ltd	323
POSCO	184	CGN Power Co Ltd, 144A	300
MicroStar International Co Ltd	168	CITIC Ltd	293
SinoPac Financial Holdings Co Ltd	157	AIA Group Ltd	274
Malayan Banking Bhd	151	SCI Pharmtech Inc	250
Lenovo Group Ltd	125	Nan Kang Rubber Tire Co Ltd	228
Sonic Healthcare Ltd	123	Infosys Ltd	226
KB Financial Group Inc	71	Public Bank Bhd	215
		Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	186
		LiteOn Technology Corp	182
		China Railway Group Ltd	179
		Lifestyle International Holdings Ltd	171
		China Shenhua Energy Co Ltd	169
		China Vanke Co Ltd	165
		SK Square Co Ltd	159
		Kindom Development Co Ltd	151
		Samsung Electronics Co Ltd	147
		Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	146
		NHPC Ltd	124
		Power Grid Corp of India Ltd	118
		China Medical System Holdings Ltd	116
		China Yuhua Education Corp Ltd, 144A	115
		Aboitiz Power Corp	110

### Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^

<b>WICHTIGE KÄUFE</b>	<b>KOSTEN (in Tsd.) USD</b>	<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	<b>ERLÖSE (in Tsd.) USD</b>
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

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)

### WICHTIGE KÄUFE

CP ALL PCL	17
Home Product Center PCL	15
Advanced Info Service PCL	8
Krung Thai Bank PCL	4
Siam Commercial Bank PCL/The	4
Thai Union Group PCL	3

### KOSTEN (in Tsd.) USD

### WICHTIGE VERKÄUFE

Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	106
Formosa Petrochemical Corp	106
Korea Electric Power Corp	96
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	96
Kweichow Moutai Co Ltd	95
Central Pattana PCL	93
China Petroleum & Chemical Corp	93
Sberbank of Russia PJSC	91
Dialog Group Bhd	91
Xiaomi Corp 'B', 144A	90
Astra International Tbk PT	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

### ERLÖSE (in Tsd.) USD

## Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund

### WICHTIGE KÄUFE

iShares MSCI ACWI ETF - ETF	591
iShares MSCI EAFE ETF - ETF	224
SPDR S&P 500 ETF Trust - ETF	219
Home Depot Inc/The	184
Merck & Co Inc	169
Texas Instruments Inc	149
American Financial Group Inc/OH	149
Orange SA	147
Caterpillar Inc	143
Cummins Inc	139
United Parcel Service Inc 'B'	135
Hewlett Packard Enterprise Co	122
Asustek Computer Inc	118
LiteOn Technology Corp	112
Juniper Networks Inc	112
AT&T Inc	74
Johnson & Johnson	63
Intel Corp	60
Cardinal Health Inc	56
Rio Tinto Ltd	40

### KOSTEN (in Tsd.) USD

### WICHTIGE VERKÄUFE

Muenchener RueckversicherungsGesellschaft AG in Muenchen	187
Assicurazioni Generali SpA	168
Prudential Financial Inc	167
Kimco Realty Corp	162
Starwood Property Trust Inc	157
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	153
Ford Motor Co	149
Deutsche Telekom AG	149
Talanx AG	149
Blackstone Mortgage Trust Inc 'A'	145
Canadian Utilities Ltd	139
Public Storage	137
AES Corp/The	135
Naturgy Energy Group SA	130
HKT Trust & HKT Ltd	129
Klepierre SA	128
KimberlyClark Corp	117
Tohoku Electric Power Co Inc	111
Petrobras Distribuidora SA	108
Southern Co/The	105
Gazprom PJSC ADR	105
Astro Malaysia Holdings Bhd	100
Target Corp	92
Sagen MI Canada Inc	87
CVS Health Corp	85
Huishang Bank Corp Ltd	83
Broadcom Inc	76
Pfizer Inc	73
Pinnacle West Capital Corp	68
Oesterreichische Post AG	67
Marubeni Corp	66
Legal & General Group Plc	65
Swedbank AB	63
Roche Holding AG	57
Snam SpA	53
Canadian Imperial Bank of Commerce	49
Mitsubishi Chemical Holdings Corp	48

### ERLÖSE (in Tsd.) USD

## Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>

### WICHTIGE KÄUFE

LG Chem Ltd	2.231
Tongcheng Travel Holdings Ltd	2.070
Alibaba Group Holding Ltd	1.476
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	1.326
Jardine Matheson Holdings Ltd	1.019
United Overseas Bank Ltd	768
TravelSky Technology Ltd	767
Tencent Holdings Ltd	512
Samsung Electronics Co Ltd	493
LG Energy Solution	466
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	429
HDFC Bank Ltd	410
AIA Group Ltd	395
Venture Corp Ltd	371
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	352
Feng TAY Enterprise Co Ltd	336
ENN Energy Holdings Ltd	216
Minth Group Ltd	186
Hero MotoCorp Ltd	177
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	174

### KOSTEN (in Tsd.) USD

### WICHTIGE VERKÄUFE

Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	5.755
Samsung Electronics Co Ltd	5.262
Tencent Holdings Ltd	4.426
HDFC Bank Ltd	3.205
Alibaba Group Holding Ltd	3.198
United Overseas Bank Ltd	3.118
ENN Energy Holdings Ltd	2.878
AIA Group Ltd	2.682
Tata Consultancy Services Ltd	2.471
Techtron Industries Co Ltd	2.383
Minth Group Ltd	2.199
Hero MotoCorp Ltd	2.050
Jardine Matheson Holdings Ltd	2.013
Singapore Technologies Engineering Ltd	1.935
Venture Corp Ltd	1.897
LG Chem Ltd	1.867
Shenzhou International Group Holdings Ltd	1.857
Coway Co Ltd	1.849
Guangdong Investment Ltd	1.667
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	1.633

### ERLÖSE (in Tsd.) USD

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

### Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Tata Consultancy Services Ltd	172	Orion Corp/Republic of Korea	1.562
Singapore Technologies Engineering Ltd	169	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	1.520
Guangdong Investment Ltd	163	Feng TAY Enterprise Co Ltd	1.499
Techtronic Industries Co Ltd	162	LG Household & Health Care Ltd	1.469
Orion Corp/Republic of Korea	156	Tongcheng Travel Holdings Ltd	1.462
		TravelSky Technology Ltd	1.370
		Godrej Consumer Products Ltd	1.284
		Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.148
		Telkom Indonesia Persero Tbk PT	974

### Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Aalberts SA	828	SGS SA	1.968
Legrand SA	816	Sika AG	1.963
TOMRA Systems ASA	433	Linde Plc	1.935
		Bureau Veritas SA	1.816
		BIM Birlesik Magazalar AS	1.634
		Cie de SaintGobain	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

### Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
NVIDIA Corp	8.801	Mettler Toledo International Inc	4.542
Farfetch Ltd	7.607	Alibaba Group Holding Ltd ADR	3.207
Autodesk Inc	6.636	Starbucks Corp	2.884
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	6.546	CyberArk Software Ltd	2.435
Kingspan Group Plc	5.989	Accenture Plc	2.346
Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	5.971	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.040
Microsoft Corp	5.859	Kingspan Group Plc	1.854
Veeva Systems Inc 'A'	5.685	Microsoft Corp	1.809
Atlas Copco AB	5.185	NVIDIA Corp	1.687
Masimo Corp	4.989	Atlas Copco AB	1.556
Moncler SpA	4.878	ResMed Inc	1.534
ResMed Inc	4.756	Moncler SpA	1.466
Linde Plc	4.690	L'Oreal SA	1.455
L'Oreal SA	4.637	Linde Plc	1.444
Adobe Inc	4.151	Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	1.418
Mastercard Inc	4.119	Mastercard Inc	1.319
Illumina Inc	4.040	Masimo Corp	1.290
ANSYS Inc	3.858	Illumina Inc	1.286
Assa Abloy AB	3.713	Hexagon AB	1.277
Kering SA	3.630	Veeva Systems Inc 'A'	1.230
Ferrari NV	3.618	Adobe Inc	1.222
AIA Group Ltd	3.477	Kering SA	1.201
CSL Ltd	3.398	Assa Abloy AB	1.164
Coloplast A/S	3.394	ANSYS Inc	1.129
Tencent Holdings Ltd	3.376	Ferrari NV	1.084
adidas AG	3.107	Coloplast A/S	1.070
Kerry Group Plc	3.081	CSL Ltd	1.057
Hexagon AB	3.072	AIA Group Ltd	1.037
Alibaba Group Holding Ltd ADR	2.153	Kerry Group Plc	941

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

## Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
adidas AG	937
Tencent Holdings Ltd	930
Farfetch Ltd	923
Autodesk Inc	834

## Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Guangdong Investment Ltd	597	AusNet Services	1.970
AGL Energy Ltd	551	Spark Infrastructure Group	981
Frasers Centrepoint Trust	551	Capitaland Integrated Commercial Trust	797
China Tower Corp Ltd, 144A	518	Hui Xian Real Estate Investment Trust	698
Capitaland Integrated Commercial Trust	492	Dexus	628
Transurban Group	476	Petronas Gas Bhd	556
China Merchants Port Holdings Co Ltd	471	APA Group	420
Scentre Group	406	CLP Holdings Ltd	361
AusNet Services	401	Fortune Real Estate Investment Trust	303
Link REIT	369	NHPC Ltd	219
Digital Telecommunications Infrastructure Fund327		Wharf Real Estate Investment Co Ltd	199
Embassy Office Parks REIT	298	Kiwi Property Group Ltd	192
Vicinity Centres	294	Power Grid Corp of India Ltd	172
Contact Energy Ltd	287	Aurizon Holdings Ltd	137
Stockland	265	Mapletree Industrial Trust	112
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	233	Link REIT	108
Manila Electric Co	206	Contact Energy Ltd	84
Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	196	Charter Hall Long Wale REIT	70
Spark Infrastructure Group	193	Stockland	41
CLP Holdings Ltd	172	Waypoint REIT Ltd	17
Dexus Property Group	168		
Transurban Group	148		
NHPC Ltd	113		
Ascendas India Trust	112		
Westports Holdings Bhd	84		

## Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Samsung Electronics Co Ltd	1.900	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.166
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.888	EPAM Systems Inc	986
Tencent Holdings Ltd	1.619	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	977
SK Hynix Inc	1.049	Titan Co Ltd	795
Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.042	Sberbank of Russia PJSC ADR	628
Sea Ltd ADR	956	Prosus NV	576
ICICI Bank Ltd	948	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	569
China Merchants Bank Co Ltd	916	China Gas Holdings Ltd	398
Al Rajhi Bank	891	Largan Precision Co Ltd	369
Meituan 'B', 144A	696	LG Chem Ltd	368
EPAM Systems Inc	649	Samsung Electronics Co Ltd	353
Globalwafers Co Ltd	634	Orbia Advance Corp	314
LG Chem Ltd	622	Tencent Holdings Ltd	284
Titan Co Ltd	620	Meituan 'B', 144A	227
HDFC Bank Ltd	612	Alibaba Group Holding Ltd ADR	206
WEG SA	585	Southern Copper Corp	191
OTP Bank Nyrt	574	TCS Group Holding Plc GDR	186
Delivery Hero SE, 144A	566	Asian Paints Ltd	182
Antofagasta Plc	532	Sea Ltd ADR	179
Kotak Mahindra Bank Ltd	511	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	179
AIA Group Ltd	489	Turkcell İletişim Hizmetleri AS	156
Reliance Industries Ltd	475	OTP Bank Nyrt	110
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	470		
Contemporary Amperex Technology Co Ltd	426		
Asian Paints Ltd	420		
NAVER Corp	401		
Prosus NV	386		
JD.com Inc ADR	367		
Samsung SDI Co Ltd	361		
Maruti Suzuki India Ltd	361		
Orbia Advance Corp SAB de CV	357		
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	327		
UltraTech Cement Ltd	322		
LUKOIL PJSC ADR	309		
Sunny Optical Technology Group Co Ltd	307		
Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	290		
TCS Group Holding Plc GDR	284		
Cosan SA	270		

## Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
ASML Holding NV	20.299	Moncler SpA	4.650
Ferrari NV	14.535	Temenos AG	4.548

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Wesentliche Portfolioveränderungen (ungeprüft) – (Fortsetzung)

### Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)

<b>WICHTIGE KÄUFE</b>	<b>KOSTEN (in Tsd.) EUR</b>	<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	<b>ERLÖSE (in Tsd.) EUR</b>
Kering SA	12.928	ASML Holding NV	3.174
Moncler SpA	12.090	CyberArk Software Ltd	2.658
Allfunds Group Plc	11.814	InPost SA	2.150
Infineon Technologies AG	10.822	THG Plc	2.074
MettlerToledo International Inc	10.673	Ferrari NV	813
Atlas Copco AB	10.307	Kering SA	668
Sartorius Stedim Biotech	10.130	MettlerToledo International Inc	607
Kingspan Group Plc	10.083	Infineon Technologies AG	592
Ambu A/S 'B'	9.579	Hexagon AB	565
Assa Abloy AB	9.517	Kingspan Group Plc	563
Oxford Nanopore Technologies Plc	9.359	Sartorius Stedim Biotech	559
L'Oreal SA	9.303	Atlas Copco AB	540
Linde Plc	9.076	Assa Abloy AB	508
Partners Group Holding AG	8.792	L'Oreal SA	503
adidas AG	8.687	Linde Plc	489
Nemetschek SE	8.686	Nemetschek SE	489
Farfetch Ltd	7.556	Dassault Systemes SE	481
Hexagon AB	6.332	Partners Group Holding AG	452
Kerry Group Plc	5.999	adidas AG	438
Coloplast A/S	5.863	Allfunds Group Plc	395
Dassault Systemes SE	5.552	JDE Peet's NV	322
Dr. Martens Plc	4.678	Kerry Group Plc	307
Dassault Systemes SE	3.034	Coloplast A/S	303
Hexagon AB	2.984	Oxford Nanopore Technologies Plc	297
THG Plc	2.808		

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Vergütungspolitik gemäß OGAW-V (ungeprüft)

### Vergütung

Franklin Templeton International Services S.à.r.l. („FTIS“) als OGAW-lizenzierte Verwaltungsgesellschaft (die „Verwaltungsgesellschaft“) verfügt über eine Vergütungsrichtlinie (die „Richtlinie“), die für alle OGAW-Fonds (jeweils ein „OGAW“ und zusammen die „OGAW“) unter ihrer Verwaltung gilt. Die Richtlinie wurde entwickelt, um übermäßige Risikobereitschaft zu verhindern und die Risikokriterien in ihre Leistungsmanagementsysteme zu integrieren, die speziell für die Geschäftsbereiche gelten, die sie abdeckt. Die Richtlinie verfügt über eine Governance-Struktur, die darauf abzielt, interne Interessenkonflikte zu verhindern.

Es gibt definierte Verfahren für die Erstellung, Aktualisierung, Überprüfung und Genehmigung der Richtlinie sowie für die Kommunikation und Umsetzung der Richtlinie. Die Geschäftsleitung, die Personalabteilung, die Compliance-Abteilung und andere Funktionen sind alle an diesem Prozess beteiligt, und die Richtlinie wird von der Geschäftsleitung und dem Vorstand der Verwaltungsgesellschaft genehmigt.

Feste Vergütung ist definiert als Grundgehalt plus andere Leistungen, die Rentenbeiträge, Lebensversicherungsprämien oder private Krankenversicherungsprämien umfassen können. Die Ebenen der festen Vergütung werden in Bezug auf die Komplexität der Arbeit, den Verantwortungsgrad, die Leistung und die Benchmarking-Daten des Marktes festgelegt. Diese Stufen werden regelmäßig überprüft.

Variable Vergütung ist definiert als Jahresboni, langfristige Prämien in Form von Performance Share Grants oder Sales Bonuszahlungen. Die Stufen der variablen Vergütung werden in Bezug auf die Gesamtleistung des Unternehmens und der Geschäftseinheit sowie die individuelle Leistung festgelegt.

Die vollständige Richtlinie ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft erhältlich. Quantitative Informationen, die für die Fonds relevant sind, sind nachfolgend aufgeführt:

Gesamtbetrag der festen Vergütung, die FTIS und seine Delegierten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2021 gezahlt haben*, **,***	€5.515.715
Gesamtbetrag der variablen Vergütung, die von FTIS und seinen Delegierten im Geschäftsjahr zum 30. September 2021 gezahlt wurde*, **,***	€2.795.417
Anzahl der Mitarbeiter von FTIS und seiner Delegierten zum 30. September 2021	480
Gesamtbetrag der Vergütung, die FTIS und seine Delegierten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2021 an leitende Manager gezahlt haben*, **,***	€3.660.065
Gesamtbetrag, der von FTIS und seinen Beauftragten an andere Mitarbeiter gezahlt wird, die während des am 30. September 2021* zu Ende gegangenen Geschäftsjahres einen wesentlichen Einfluss auf das Profil von OGAW haben*, **,***	€1.545.911

\* Der Gesamtbetrag der von FTIS gezahlten Vergütung wurde jedem OGAW auf der Grundlage seines anteiligen Anteils am durchschnittlichen Nettovermögen am Monatsende von FTIS für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 zugewiesen.

\*\* Der Gesamtbetrag der von den FTIS-Delegierten gezahlten Vergütung wurde jedem OGAW auf der Grundlage ihres anteiligen Anteils am durchschnittlichen Nettovermögen der FTIS-Delegierten zum Monatsende für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021 zugewiesen.

\*\*\* Delegierte sind Investmentmanagement-Unternehmen, die regulatorischen Anforderungen unterliegen, die genauso wirksam sind wie die gemäß Artikel 69(3)(a) der OGAW-Richtlinie.

## Anhang: Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFTR)

In den folgenden Tabellen sind der Gesamtnominalwert für umgekehrte Rückkaufvereinbarungen und Total Return Swaps sowie der absolute beizulegende Zeitwert als Anteil am Nettoinventarwert jedes Fonds, analysiert nach Gegenpartei, zum 28. Februar 2022 aufgeführt:

### Rückkaufvereinbarungen

#### Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund

Gegenpartei	Gründungsland	Brutto-Aggregation Nomineller Wert (‘000) \$	Absolut fair Wert (‘000) \$	% vom Netto Vermögenswert
Kanadische Imperial Bank of Commerce	Kanada	60.000	60.000	6,53
JP Morgan	Vereinigte Staaten	80.000	80.000	8,70
Königliche Bank von Kanada	Kanada	50.000	50.000	5,44
TD Securities (USA) LLC	Kanada	80.000	80.000	8,70
		270.000	270.000	29,37

### Total Return Swaps

#### Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

Gegenpartei	Gründungsland	Brutto-Aggregation Nomineller Wert (‘000) \$	Absolut fair Wert (‘000) \$	% vom Netto Vermögenswert
Citi	Vereinigte Staaten	3.842	3.842	0,75
JP Morgan	Vereinigte Staaten	3.913	3.913	0,77
		7.755	7.755	1,52

Die folgende Tabelle listet die zehn größten Sicherheitenemittenten auf der Grundlage des Werts der erhaltenen unbaren Sicherheiten und der Währung der erhaltenen unbaren Sicherheiten zum 28. Februar 2022 auf:

Fonds	Emittent der Sicherheit*	Währung	Aggregierter Wert von gehaltene Sicherheiten (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	USA***	US-Dollar	\$275.400

\* Bei weniger als zehn Emittenten von Sicherheiten zum 28. Februar 2022 wurden alle Emittenten einbezogen.

\*\* Zugrundeliegenden Anleihen und Schuldverschreibungen, die als Sicherheiten gehalten werden, werden vom US-Finanzministerium ausgegeben.

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Art und Qualität der erhaltenen nicht zahlungswirksamen Sicherheiten zum 28. Februar 2022:

Fonds	Art der Sicherheit	Qualität der Sicherheit	Aggregierter Wert von gehaltene Sicherheiten (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen	Investment Grade	\$275.400

Die untenstehende Laufzeitenanalyse basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitsdatum der Reverse Repurchase Agreements und Total Return Swaps und der damit verbundenen erhaltenen/(bereitgestellten) Sicherheiten zum 28. Februar 2022.

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 Reife (in Tsd.)	Summe (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	Umgekehrte Rückkaufvereinbarungen	-	\$270.000	-	-	-	-	-	\$270.000
	Nicht zahlungswirksame Sicherheiten erhalten	-	-	\$24.158	\$44.077	\$21.834	\$185.331	-	\$275.400
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Total Return Swaps	-	-	-	-	-	\$7.755	-	\$7.755

Reverse-Repurchase-Vereinbarungen, die im Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund gehalten werden, sind künstliche Vereinbarungen. Vom Fonds erhaltene Sicherheiten in Bezug auf die offenen umgekehrten Rückkaufvereinbarungen zum 28. Februar 2022 werden bei der Bank of New York Mellon auf getrennten Konten im Namen der Gesellschaft gehalten. Erhaltene Sicherheiten werden nicht weiterverwendet.

Total Return Swaps werden auf bilateraler Basis abgewickelt. Zum 28. Februar 2022 werden keine Sicherheiten in Bezug auf offene Total Return Swaps-Positionen bereitgestellt oder erhalten.

Alle Kosten und Erträge aus umgekehrten Rückkaufvereinbarungen und Total Return Swaps fallen den Fonds vollständig an.

## Anhang: Offenlegung verbundener Personen

Während des am 28. Februar 2022 zu Ende gegangenen Geschäftsjahres erbrachte Pershing Limited, eine Tochtergesellschaft der Bank of New York Mellon Corporation und eine verbundene Person der Depotstelle, brokerage-Dienstleistungen in Bezug auf den Wertpapierhandel an die in Hongkong registrierten Fonds, die über die Unteranlageverwalter der jeweiligen Fonds erlassen wurden. Der Gesamtwert der Transaktionen mit den verbundenen Personen der Depotstelle in Bezug auf den Wertpapierhandel belief sich auf 153 Millionen USD, was 0,09 % des Gesamtwerts solcher Transaktionen entspricht, die von diesen Fonds abgeschlossen wurden. Die Maklergebühren und Provisionen, die die Fonds an Pershing Limited in Bezug auf diesen Wertpapierhandel für das am 28. Februar 2022 endende Geschäftsjahr gezahlt haben, beliefen sich auf 108.352 USD mit einem durchschnittlichen Provisionssatz von 7 Bp. Diese sind in den Transaktionskosten für Käufe und Verkäufe relevanter Wertpapiere enthalten und werden in Erläuterung 4 dieses Jahresabschlusses offengelegt.

Während des am 28. Februar 2022 zu Ende gegangenen Geschäftsjahres handelten die Bank of New York Mellon (Institutional Bank) und die Bank of New York Mellon SA/NV, beide verbundene Personen der Verwahrstelle, in Verwahrung von Devisentransaktionen bzw. in Währungsverwaltungs-/Absicherungsprogrammen für die in Hongkong registrierten Fonds. Die gesamten Provisionen, die im Zusammenhang mit diesen Transaktionen gezahlt wurden, beliefen sich auf 977.234 USD mit einem durchschnittlichen Provisionssatz von 0,19 Basispunkten. Der Gesamtwert der Transaktionen mit den verbundenen Personen des Depositary betrug in dieser Hinsicht 50.298 Mio. USD, was 0,98 % des Gesamtwerts dieser von den Fonds abgeschlossenen Transaktionen entspricht.

Alle Geschäfte mit den verbundenen Personen der Verwahrstelle wurden im gewöhnlichen Geschäftsgang und zu normalen wirtschaftlichen Bedingungen abgeschlossen.



