

Halbjahresbericht (Ungeprüft)

Legg Mason

Global Funds Plc

Ein Dachfonds mit getrennter
Haftung zwischen den Teilfonds

Für die sechs Monate bis 31. August 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 Esemplia Emerging Markets Select Equity Fund, Legg Mason Congruix 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, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund und Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund wurde der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht nicht gemäß § 310 KAGB (Kapitalanlagegesetzbuch) gemeldet.

Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Informationen	3
Brief an die Anteilhaber	16
Anlagen – Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	17
Anlagen – Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	18
Anlagen – Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	30
Anlagen – Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	48
Anlagen – Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	52
Anlagen – Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	56
Anlagen – Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	61
Anlagen – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	66
Anlagen – Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	70
Anlagen – Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	73
Anlagen – Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	76
Anlagen – Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	78
Anlagen – Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	81
Anlagen – Legg Mason Western Asset Global Credit Fund [^]	87
Anlagen – Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	91
Anlagen – Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	99
Anlagen – Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	108
Anlagen – Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	112
Anlagen – Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	120
Anlagen – Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	123
Anlagen – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	130
Anlagen – Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	135
Anlagen – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	137
Anlagen – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	141
Anlagen – Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]	143
Anlagen – Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	145
Anlagen – Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	148
Anlagen – Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	152
Anlagen – Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	154
Anlagen – Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	156
Anlagen – Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	158
Anlagen – Legg Mason ClearBridge Value Fund	160
Anlagen – Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	162
Anlagen – Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	163
Anlagen – Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	164
Anlagen – Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	165
Anlagen – Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	167
Anlagen – Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]	169
Anlagen – Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	170
Anlagen – Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	172
Anlagen – Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^]	173
Anlagen – Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	174
Anlagen – Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	178
Anlagen – Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	180
Anlagen – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	181
Anlagen – Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	182
Anlagen – Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]	184
Anlagen – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	185
Anlagen – Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	186
Anlagen – Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	187
Anlagen – Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	188
Anlagen – Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	190
Anlagen – Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	191
Bilanz – Legg Mason Global Funds Plc	192
Gesamtergebnisrechnung – Legg Mason Global Funds Plc	212
Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – Legg Mason Global Funds Plc	222
Anhang – Legg Mason Global Funds Plc	248
Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) – Legg Mason Global Funds Plc	269
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	276
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	276
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	276
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	277
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	277
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	278
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	278
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	279
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	280
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	280
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	281
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	281
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	281
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	281
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Global Credit Fund [^]	282

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	282
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	283
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	283
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	283
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	284
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	284
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	285
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	285
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	285
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	286
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	286
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]	286
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	287
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	287
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	288
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	288
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	288
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	289
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason ClearBridge Value Fund	289
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	290
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	290
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	290
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	291
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	291
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]	292
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	292
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	292
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^]	293
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	293
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	293
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	294
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	294
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	295
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	295
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	296
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	296
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	297
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	297
Erklärung zu wesentlichen Portfolioveränderungen – Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	297
Anhang: EU-Verordnung zur Erhöhung der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTR-Verordnung)	299

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Allgemeine Informationen

Verwaltungsrat

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

Geschäftssitz

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

Secretary

Bradwell Limited
 Ten Earlsfort Terrace, Dublin 2
 Irland

Hauptvertriebs- und Hauptinformationsstelle

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

Weitere Vertriebs- und Informationsstellen

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

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

Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited
 (Handel eingestellt am 1. Juli 2022)
 Suites 1202-03
 12/F, York House
 15 Queen's Road Central
 Hongkong

Franklin Templeton Investments (Asia) Limited
 (wirksam am 1. Juli 2022)
 17/F, Chater House,
 8 Connaught Road Central
 Hongkong

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

Berichtsfondsstatus und Ausschüttungsfondsstatus (nur für britische Anteilhaber)

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

Weitere Informationen finden Sie im Nachtragsprospekt für Investoren aus dem Vereinigten Königreich, oder kontaktieren Sie Franklin Templeton International Services S.à r.l.

Schweizer Vertreter

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

Schweizer Zahlstelle

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

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

Irischer Rechtsberater

Arthur Cox LLP
 Ten Earlsfort Terrace, Dublin 2
 Irland

Verwahrstelle

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

Unabhängige Wirtschaftsprüfer

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

Verwaltungsstelle

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

Verwalter und Promoter

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund*	27. Februar 2004	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund*	24. Februar 2004	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p>
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund^{^*b}	21. Oktober 2011 (Handel eingestellt am 21. Juni 2022)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 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, #23-01 Singapur, 049145</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Präs. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasilien</p>
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund*	20. April 2007	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p>
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^{^*p}	20. April 2007 (Handel eingestellt am 8. November 2019)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^{^*b}	3. Dezember 2010 (Handel eingestellt am 21. Juni 2022)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p>
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^{^*}	5. September 2013	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 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, #23-01 Singapur, 049145</p>
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^{^*b}	16. Dezember 2015 (Handel eingestellt am 10. Dezember 2019)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^{^*}	16. Dezember 2015	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Präs. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasilien</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan</p>

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^{^p}	31. Dezember 2015 (Handel eingestellt am 13. November 2019)	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan</p> <p>Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australien</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Präs. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasilien</p>
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^{^*}	13. Januar 2016	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^{^*}	13. Januar 2016	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^{^*}	17. November 2016	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p>

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund^{^*}	17. November 2016	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
Legg Mason Western Asset Infrastructure Debt Fund^{^*^}		<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 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, #23-01 Singapur, 049145</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Präs. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasilien</p>
Legg Mason Western Asset Short-Dated High Yield Fund^{^*^}		<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>
Legg Mason Western Asset Asian Income Fund^{^*}		<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145</p>
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^{^*}	11. Januar 2021	<p>Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Großbritannien</p> <p>Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA</p>

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^{^**}	31. Dezember 2015	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^{^*}	6. April 2017	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global — US High Yield Fund^{*^b}	30. Oktober 2017 (Handel eingestellt 29. Januar 2020)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^{*^*}	16. August 2018	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global — EM Macro Bond Fund^{*^*}		Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason ClearBridge Value Fund^{**}	23. März 1998	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Growth Fund^{^***b}	25. Februar 2004 (Handel eingestellt am 15. Februar 2019)	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^{^***b}	1. September 2006 (Handel eingestellt am 22. November 2019)	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund^{^***b}	15. September 2014 (Handel eingestellt am 22. Juli 2019)	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund^{**}	20. April 2007	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund^{**}	20. April 2007	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund^{**}	20. April 2007	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund^{**}	3. Juni 2013	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^{^***}	30. September 2015	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund**^	29. Juni 2018	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Global SRI Equity Fund†**^		Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund**^	9. Dezember 2016	Anlageverwalter: ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund**^	31. März 2017	Anlageverwalter: ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund**^	30. April 2021	Anlageverwalter: ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund**	8. November 2002	Anlageverwalter: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund**	1. März 2004	Anlageverwalter: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
Royce Global Small Cap Premier Fund^***	1. Dezember 2021	Anlageverwalter: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^*** ^b	30. August 2002 (Handel eingestellt am 11. Juli 2022)	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund**	25. Februar 2004	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^*** ^b	20. April 2007 (Handel eingestellt am 25. Februar 2015)	
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^*** ^b	28. April 2008 (Handel eingestellt am 14. April 2021)	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^*** ^b	29. Dezember 2010 (Handel eingestellt am 27. April 2022)	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Legg Mason QS US Large Cap Fund^+***		Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

† Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

μ Money Market Fund.

* Rentenfonds (Fonds, die überwiegend in Rentenwerte und verzinsliche Wertpapiere investieren).

** Aktienfonds (Fonds, die überwiegend in Aktien investieren).

*** Multi-Asset Fund (jeder Fonds, der als „Multi-Asset Fund“ im jeweiligen Nachtrag des Prospekts definiert wurde).

b Bis zum Widerruf der Genehmigung durch die Zentralbank.

Weitere Informationen

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

Für professionelle Anleger in Europa (außer VK und Schweiz)

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

www.franklinresources.com

Für zugelassene Broker in Nord-, Süd- und Mittelamerika

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

www.franklintempletonoffshore.com

Auf den jeweiligen Internetseiten finden Sie Informationen über:

- Tägliche Quotierungen
- Literatur, einschließlich Datenblätter sowie die neuesten Informationen über die einzelnen Fonds
- Weitere Informationen über die Tochtergesellschaften von Franklin Templeton im Bereich Vermögensverwaltung, die die Fonds verwalten

Brief an die Anteilsinhaber

Sehr geehrte Anteilsinhaberin, sehr geehrter Anteilsinhaber,

Wir freuen uns, Ihnen den Halbjahresbericht für Legg Mason Global Funds Plc (die „Gesellschaft“) für den am 31. August 2022 zu Ende gegangenen Sechsmonatszeitraum vorzustellen. In diesem Bericht heben wir die Haupttreiber der Entwicklung der Anleihe- und Aktienmärkte während des Berichtszeitraums hervor.

Bericht über die Weltwirtschaft

Die Weltwirtschaft schwächte sich im Berichtszeitraum ab, da sie weiterhin von COVID-19 und seinen Varianten, einer erhöhten und anhaltenden Inflation, einer Straffung der Geldpolitik der Zentralbank und den Auswirkungen des Krieges in der Ukraine beeinträchtigt wurde. In seinem Juli 2022 *World Economic Outlook (Weltwirtschaftsausblick)* meldete der Internationale Währungsfonds („IWF“): „Auf eine zaghafte Erholung im Jahr 2021 folgten zunehmend düstere Entwicklungen im Jahr 2022. Die Performance war im ersten Quartal etwas besser als erwartet, aber Schätzungen zufolge ist das weltweite reale BIP im zweiten Quartal – dem ersten Rückgang seit 2020 – aufgrund des wirtschaftlichen Abschwungs in China und Russland geschrumpft. Abwärtsrisiken, die im *Weltwirtschaftsausblick* vom April 2022 erörtert wurden, kommen zu Tage. Dazu gehören eine weltweit höhere Inflation, insbesondere in den Vereinigten Staaten und den großen europäischen Volkswirtschaften, die eine drastische Verschärfung der globalen Finanzbedingungen nach sich zieht; eine stärker als erwartete Konjunkturabschwächung in China als Antwort auf die COVID-19-Ausbrüche und Lockdowns und weitere negative grenzüberschreitende Auswirkungen des Krieges in der Ukraine.“ Vor diesem Hintergrund hat der IWF seine Prognosen für das globale Wachstum im Jahr 2022 nach unten korrigiert. Aus regionaler Sicht geht der IWF davon aus, dass der BIP in den USA 2022 um 3,3 % wachsen wird, verglichen mit einem Wachstum von 5,2 % Prozent im 2021. Darüber hinaus erwartet der IWF für das Jahr 2022 ein BIP-Wachstum in der Eurozone, im Vereinigten Königreich und in Japan von jeweils 2,8 %, 3,7 % bzw. 2,4 %. Zum Vergleich: Im Jahr 2021 lag das BIP-Wachstum dieser Volkswirtschaften bei jeweils 5,3 %, 7,4 % bzw. 1,6 %.

Marktüberblick – Rentenmärkteⁱ

Der globale Rentenmarkt erzielte im Berichtszeitraum insgesamt schwache Ergebnisse. Da die Inflation stark ansteigt, hat das Federal Reserve Board (die „Fed“)ⁱⁱ begonnen, die Zinssätze aggressiv zu erhöhen und trieb die Federal Funds Rate von einer Spanne zwischen 0,00 % und 0,25 % auf eine Spanne zwischen 2,25 % und 2,50 %. Auch die Zentralbanken einiger anderer Länder, darunter die Europäische Zentralbank und die Bank of England, erhöhten im Berichtszeitraum die Zinsen. Vor diesem Hintergrund stiegen die Renditen auf globale Staatsanleihen deutlich an (Renditen und Preise bewegen sich in die entgegengesetzte Richtung). Beispielsweise lagen die Renditen der zehnjährigen US-Staatsanleihen zu Anfang des Berichtszeitraums bei 1,83 % und an dessen Ende bei 3,15 %. Alles in allem verzeichneten die Spread-Sektoren (Nicht-US-Treasuries) negative Renditen. Dazu gehören: Investment-Gradeⁱⁱⁱ Unternehmensanleihen,^{iv} niedriger bewertete Unternehmensanleihen und auf US-Dollar lautende Staatsanleihen aus Schwellenländern.

Marktüberblick – Globale Aktien^v

Der globale Aktienmarkt entwickelte sich ebenfalls schwach während des Berichtszeitraums. Der Markt wurde zunächst durch die Einführung der COVID-19-Impfmaßnahmen, geld- und fiskalpolitische Maßnahmen und insgesamt solide Unternehmensgewinne gestützt. Dies wurde jedoch durch Phasen der Risikoaversion der Anleger mehr als ausgeglichen, die teilweise durch aggressive Zinserhöhungen der Zentralbanken und die potenziellen Auswirkungen auf die Wirtschaft und die Unternehmensgewinne ausgelöst wurden. Erhöhte Inflation, Engpässe in den Lieferketten, der Krieg in der Ukraine und andere geopolitische

Ereignisse belasteten die Anlegerstimmung ebenfalls. Alles in allem fielen die US-Aktien stark und traten in einen Bärenmarkt ein (ein Verlust von mehr als 20 % gegenüber einem jüngsten Hoch). Auch Aktien aus Industrie- und Schwellenländern entwickelten sich im Berichtszeitraum sehr schwach.

Wir danken Ihnen für Ihr anhaltendes Vertrauen.

Mit freundlichen Grüßen

Franklin Templeton International Services S.à r.l.
September 2022

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

Alle Daten entsprechen dem Stand vom 31. August 2022, sofern nichts anderes angegeben ist.

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

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

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

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

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

Herausgegeben und genehmigt durch die Franklin Templeton International Services S.à r.l., 8A, rue Albert Borschette, L-1246 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg, mit offiziellem Sitz in Luxemburg und reguliert durch die Commission de Surveillance du Secteur Financier.

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

ⁱ Rentenwerte – Anleihen.

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

ⁱⁱⁱ Investment Grade – ein Kreditrating, das bedeutet, dass eine Staats- oder Unternehmensanleihe ein relativ geringes Ausfallrisiko hat.

^{iv} Unternehmensanleihe – eine Anleihe, die von einem Unternehmen begeben wird, um zur Expansion seines Geschäfts effektiv Geld zu beschaffen.

^v Aktien – Eigentumsbeteiligung an einer Gesellschaft in Form von Stammaktien oder Vorzugsaktien.

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 10,61 % (28. Februar 2022: 9,40 %)					
180	174	0,10	93	90	0,05
ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Serie 2003-NC1, Serie 2003 NC1, Klasse A1, 3,124 %, fällig am 25.07.2033 *					
307	296	0,16	395	373	0,20
Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Serie 2019 1A, Klasse A2I, 144A, 4,194 %, fällig am 05.06.2049					
415	390	0,21	97	94	0,05
Argent Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Certificates Serie 2003-W7, Serie 2003 W3, Klasse M1, 3,569 %, fällig am 25.09.2033 *					
500	495	0,27	389	424	0,23
Benefit Street Partners CLO VIII Ltd, Serie 2015 8A, Klasse A1AR, 144A, 3,810 %, fällig am 20.01.2031 *					
600	590	0,32	529	515	0,28
BlueMountain CLO XXII Ltd, Serie 2018 22A, Klasse A1, 144A, 3,592 %, fällig am 15.07.2031 *					
630	620	0,34	187	177	0,10
Canyon CLO 2020-1 Ltd, Serie 2020 1A, Klasse AR, 144A, 3,692 %, fällig am 15.07.2034 *					
270	265	0,14	559	520	0,28
Cayuga Park CLO Ltd, Serie 2020 1A, Klasse AR, 144A, 3,860 %, fällig am 17.07.2034 *					
500	497	0,27	490	478	0,26
CBAM 2017-1 Ltd, Serie 2017 1A, Klasse A1, 144A, 3,960 %, fällig am 20.07.2030 *					
82	79	0,04	660	653	0,36
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Serie 2001 HE22, Klasse A1, 2,924 %, fällig am 25.02.2032 *					
34	33	0,02	320	315	0,17
CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2007-13, Serie 2007 13, Klasse 2A2, 3,244 %, fällig am 25.10.2047 *					
158	151	0,08	Asset-Backed Securities insgesamt (Anschaffungskosten 19.894 USD)		
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 36,20 % (28. Februar 2022: 25,49 %)					
33	30	0,02	510	508	0,28
CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2006-F, Serie 2006 F, Klasse 2A1A, 2,531 %, fällig am 15.07.2036 *					
253	233	0,13	90	24	0,01
CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2006-I, Serie 2006 I, Klasse 1A, 2,531 %, fällig am 15.01.2037 *					
172	159	0,09	630	624	0,34
CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2006-I, Serie 2006 I, Klasse 2A, 2,531 %, fällig am 15.01.2037 *					
534	517	0,28	43	43	0,02
Domino's Pizza Master Issuer LLC, Serie 2018 1A, Klasse A2I, 144A, 4,116 %, fällig am 25.07.2048					
227	225	0,12	10.878	219	0,12
EFS Volunteer No 2 LLC, Serie 2012 1, Klasse A2, 144A, 3,794 %, fällig am 25.03.2036 *					
160	158	0,09	879	854	0,47
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Serie 2018 4, Klasse A, 4,060 %, fällig am 15.11.2030					
420	405	0,22	330	326	0,17
Golub Capital Partners Clo 57M Ltd, Serie 2021 57A, Klasse A1, 144A, 4,273 %, fällig am 25.10.2034 *					
250	247	0,13	100	97	0,05
Greenwood Park CLO Ltd, Serie 2018 1A, Klasse A2, 144A, 3,522 %, fällig am 15.04.2031 *					
320	317	0,17	130	126	0,07
Greywolf CLO V Ltd, Serie 2015 1A, Klasse A1R, 144A, 3,943 %, fällig am 27.01.2031 *					
739	735	0,40	3.930	130	0,07
Grippen Park CLO Ltd, Serie 2017 1A, Klasse A, 144A, 3,970 %, fällig 20.01.2030 *					
430	418	0,23	700	674	0,37
HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Klasse A, 144A, 3,437 %, fällig am 16.06.2036 *					
860	844	0,46	418	386	0,21
Home Equity Asset Trust 2006-4, Serie 2006 4, Klasse 2A4, 3,004 %, fällig am 25.08.2036 *					
752	716	0,39	150	148	0,08
Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Serie 2004 1, Klasse M1, 3,194 %, fällig am 25.02.2034 *					
301	292	0,16	10	10	0,01
Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-4, Serie 2004 4, Klasse M1, 3,344 %, fällig am 25.02.2034 *					
470	457	0,25	145	2	-
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Serie 2004-WMC5, Serie 2004 WMC5, Klasse M1, 3,374 %, fällig am 25.07.2035 *					
27	27	0,01	68	67	0,04
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Serie 2006-HE1, Serie 2006 HE1, Klasse M1, 3,029 %, fällig am 25.12.2036 *					
500	496	0,27	200	196	0,11
MKS CLO 2017-2 Ltd, Serie 2017 2A, Klasse A, 144A, 3,900 %, fällig am 20.01.2031 *					
455	431	0,24	320	320	0,17
Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2004-NC8, Serie 2004 NC8, Klasse M1, 3,359 %, fällig am 25.09.2034 *					
132	131	0,07	100	96	0,05
Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-NC2, Serie 2005 NC2, Klasse M4, 3,359 %, fällig am 25.03.2035 *					
1.480	1.455	0,79	340	319	0,17
Navient Private Education Refi Loan Trust 2018-C, Serie 2018 CA, Klasse B, 144A, 4,220 %, fällig am 16.06.2042					
181	179	0,10	420	388	0,21
Navient Student Loan Trust 2017-1, Serie 2017 1A, Klasse A3, 144A, 3,594 %, fällig am 26.07.2066 *					
370	368	0,20	394	362	0,20
Navient Student Loan Trust 2017-3, Serie 2017 3A, Klasse A3, 144A, 3,494 %, fällig am 26.07.2066 *					
800	782	0,43	1.019	903	0,49
Navient Student Loan Trust 2018-EA, Serie 2018 EA, Klasse B, 144A, 4,440 %, fällig am 15.12.2059					
350	346	0,19	153	156	0,09
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd, Serie 2018 29A, Klasse A1, 144A, 3,868 %, fällig am 19.10.2031 *					
109	106	0,06	7	7	-
NovaStar Mortgage Funding Trust Serie 2003-3, Serie 2003 3, Klasse A1, 3,154 %, fällig am 25.12.2033 *					
480	468	0,26	1	-	-
Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Klasse AR, 144A, 3,732 %, fällig am 15.10.2034 *					
240	236	0,13	9	1	-
Ocean Trails Clo XI, Serie 2021 11A, Klasse A, 144A, 3,930 %, fällig am 20.07.2034 *					
440	435	0,24	9	2	-
OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, Serie 2018 1A, Klasse A1A, 144A, 3,770 %, fällig am 20.01.2031 *					
600	595	0,32	7	-	-
Owl Rock CLO I Ltd, Serie 2019 1A, Klasse A, 144A, 4,784 %, fällig am 20.05.2031 *					
440	430	0,23	400	344	0,19
Point Au Roche Park CLO Ltd, Serie 2021 1A, Klasse A, 144A, 3,790 %, fällig am 20.07.2034 *					
			1.800	1.608	0,88
			400	370	0,20

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinven- tarwert		
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)							
100	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 % ±	101	0,05	377	Fannie Mae Pool 'BU0051', 2,500 %, fällig 09.01.2051	338	0,18
2	Fannie Mae Pool '888795', 5,500 %, fällig am 01.11.2036	2	–	96	Fannie Mae Pool 'BU2599', 2,500 %, fällig 01.01.2052	86	0,05
36	Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, fällig am 01.10.2044	37	0,02	98	Fannie Mae Pool 'BV3089', 2,500 %, fällig 02.01.2052	88	0,05
45	Fannie Mae Pool '890827', 3,500 %, fällig am 01.12.2037	44	0,02	98	Fannie Mae Pool 'BV5389', 3,000 %, fällig 04.01.2052	91	0,05
24	Fannie Mae Pool 'AB9594', 4,000 %, fällig 06.01.2043	24	0,01	195	Fannie Mae Pool 'BV7697', 2,500 %, fällig 04.01.2042	178	0,10
231	Fannie Mae Pool 'AH4536', 4,000 %, fällig 02.01.2041	230	0,13	99	Fannie Mae Pool 'BV8546', 3,500 %, fällig 05.01.2052	95	0,05
9	Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, fällig 05.01.2040	10	0,01	347	Fannie Mae Pool 'CA1692', 4,000 %, fällig 05.01.2048	345	0,19
72	Fannie Mae Pool 'AL9397', 3,000 %, fällig 10.01.2046	68	0,04	79	Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500 %, fällig 07.01.2048	80	0,04
57	Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, fällig 11.01.2046	56	0,03	242	Fannie Mae Pool 'CA4979', 3,000 %, fällig 01.01.2050	225	0,12
42	Fannie Mae Pool 'AL9631', 3,000 %, fällig 12.01.2046	40	0,02	380	Fannie Mae Pool 'CA5164', 3,500 %, fällig 02.01.2050	368	0,20
20	Fannie Mae Pool 'AM8674', 2,810 %, fällig 04.01.2025	19	0,01	82	Fannie Mae Pool 'CA7257', 2,500 %, fällig 10.01.2050	74	0,04
96	Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930 %, fällig 06.01.2030	91	0,05	280	Fannie Mae Pool 'CA9390', 2,500 %, fällig 03.01.2051	250	0,14
58	Fannie Mae Pool 'AN4927', 3,450 %, fällig 03.01.2029	57	0,03	88	Fannie Mae Pool 'CB0114', 2,500 %, fällig 04.01.2041	81	0,04
59	Fannie Mae Pool 'AN5386', 3,250 %, fällig 05.01.2029	57	0,03	86	Fannie Mae Pool 'CB0414', 2,500 %, fällig 05.01.2051	77	0,04
45	Fannie Mae Pool 'AO7501', 4,000 %, fällig 06.01.2042	44	0,02	177	Fannie Mae Pool 'CB0470', 2,500 %, fällig 05.01.2041	162	0,09
26	Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, fällig 09.01.2042	25	0,01	88	Fannie Mae Pool 'CB0517', 2,500 %, fällig 05.01.2051	78	0,04
20	Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, fällig 06.01.2043	19	0,01	279	Fannie Mae Pool 'CB1273', 2,000 %, fällig 08.01.2051	241	0,13
44	Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, fällig 07.01.2043	41	0,02	277	Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000 %, fällig 10.01.2051	257	0,14
46	Fannie Mae Pool 'AS6328', 3,500 %, fällig 12.01.2045	45	0,02	95	Fannie Mae Pool 'CB2375', 2,500 %, fällig 12.01.2051	85	0,05
260	Fannie Mae Pool 'AS7313', 3,000 %, fällig 06.01.2046	252	0,14	380	Fannie Mae Pool 'CB2869', 2,500 %, fällig 02.01.2052	340	0,19
97	Fannie Mae Pool 'AS7738', 3,000 %, fällig 08.01.2046	92	0,05	192	Fannie Mae Pool 'CB3031', 2,500 %, fällig 03.01.2052	172	0,09
62	Fannie Mae Pool 'AS7844', 3,000 %, fällig 09.01.2046	59	0,03	99	Fannie Mae Pool 'CB3044', 2,500 %, fällig 03.01.2052	89	0,05
24	Fannie Mae Pool 'AS8740', 3,500 %, fällig 02.01.2037	24	0,01	195	Fannie Mae Pool 'CB3126', 3,500 %, fällig 03.01.2052	188	0,10
43	Fannie Mae Pool 'AS8745', 3,000 %, fällig 02.01.2047	40	0,02	98	Fannie Mae Pool 'CB3614', 4,000 %, fällig 05.01.2052	96	0,05
48	Fannie Mae Pool 'AS9588', 4,000 %, fällig 05.01.2047	47	0,03	99	Fannie Mae Pool 'CB3833', 3,000 %, fällig 06.01.2052	92	0,05
22	Fannie Mae Pool 'AT4281', 4,000 %, fällig 06.01.2043	22	0,01	197	Fannie Mae Pool 'CB3918', 4,500 %, fällig 06.01.2052	197	0,11
28	Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, fällig 10.01.2043	27	0,01	56	Fannie Mae Pool 'FM0068', 3,500 %, fällig 02.01.2040	55	0,03
65	Fannie Mae Pool 'AW9453', 3,500 %, fällig 08.01.2044	63	0,03	45	Fannie Mae Pool 'FM0071', 3,500 %, fällig 02.01.2040	44	0,02
45	Fannie Mae Pool 'BC0884', 3,000 %, fällig 05.01.2046	43	0,02	223	Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, fällig 09.01.2049	230	0,13
73	Fannie Mae Pool 'BC1509', 3,000 %, fällig 08.01.2046	69	0,04	112	Fannie Mae Pool 'FM2761', 5,000 %, fällig 03.01.2050	114	0,06
102	Fannie Mae Pool 'BC2817', 3,000 %, fällig 09.01.2046	97	0,05	156	Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500 %, fällig 05.01.2047	151	0,08
40	Fannie Mae Pool 'BD2455', 3,000 %, fällig 01.01.2047	38	0,02	140	Fannie Mae Pool 'FM3572', 4,500 %, fällig 09.01.2049	142	0,08
43	Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000 %, fällig 10.01.2046	41	0,02	222	Fannie Mae Pool 'FM3773', 3,500 %, fällig 11.01.2048	215	0,12
101	Fannie Mae Pool 'BE2981', 3,000 %, fällig 02.01.2032	99	0,05	73	Fannie Mae Pool 'FM3978', 4,000 %, fällig 07.01.2050	72	0,04
206	Fannie Mae Pool 'BF0104', 4,000 %, fällig 02.01.2056	205	0,11	80	Fannie Mae Pool 'FM4577', 2,500 %, fällig 10.01.2050	72	0,04
235	Fannie Mae Pool 'BF0133', 4,000 %, fällig 08.01.2056	233	0,13	277	Fannie Mae Pool 'FM4595', 3,000 %, fällig 09.01.2050	258	0,14
52	Fannie Mae Pool 'BF0163', 5,000 %, fällig 11.01.2046	53	0,03	610	Fannie Mae Pool 'FM4650', 2,000 %, fällig 10.01.2040	588	0,30
93	Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000 %, fällig 01.01.2057	92	0,05	49	Fannie Mae Pool 'FM4737', 3,500 %, fällig 09.01.2050	47	0,03
202	Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, fällig 06.01.2057	199	0,11	56	Fannie Mae Pool 'FM4925', 3,000 %, fällig 11.01.2050	52	0,03
120	Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500 %, fällig 09.01.2057	123	0,07	162	Fannie Mae Pool 'FM5423', 2,500 %, fällig 01.01.2051	146	0,08
42	Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, fällig 08.01.2058	43	0,02	78	Fannie Mae Pool 'FM5713', 2,500 %, fällig 02.01.2051	70	0,04
38	Fannie Mae Pool 'BJ0685', 4,000 %, fällig 04.01.2048	38	0,02	57	Fannie Mae Pool 'FM5783', 3,000 %, fällig 06.01.2038	54	0,03
38	Fannie Mae Pool 'BL2454', 3,160 %, fällig 05.01.2029	37	0,02	67	Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, fällig 02.01.2051	60	0,03
67	Fannie Mae Pool 'BM1948', 6,000 %, fällig 07.01.2041	72	0,04	157	Fannie Mae Pool 'FM5931', 2,500 %, fällig 02.01.2051	141	0,08
157	Fannie Mae Pool 'BM3473', 3,500 %, fällig 11.01.2047	152	0,08	151	Fannie Mae Pool 'FM5944', 2,500 %, fällig 01.01.2051	135	0,07
16	Fannie Mae Pool 'BM3904', 3,000 %, fällig 05.01.2048	17	0,01	111	Fannie Mae Pool 'FM6134', 3,000 %, fällig 03.01.2040	107	0,06
443	Fannie Mae Pool 'BM4579', 3,000 %, fällig 04.01.2047	418	0,23	82	Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, fällig 03.01.2051	74	0,04
40	Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, fällig 03.01.2043	39	0,02	90	Fannie Mae Pool 'FM6871', 2,500 %, fällig 04.01.2051	81	0,04
279	Fannie Mae Pool 'BM6898', 2,149 %, fällig 01.02.2032 *	243	0,13	372	Fannie Mae Pool 'FM7210', 2,000 %, fällig 04.01.2051	321	0,18
1.084	Fannie Mae Pool 'BN3898', 4,500 %, fällig 12.01.2048	1.096	0,60	92	Fannie Mae Pool 'FM7304', 2,500 %, fällig 05.01.2051	82	0,04
105	Fannie Mae Pool 'BO7625', 3,000 %, fällig 03.01.2050	98	0,05	80	Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, fällig 06.01.2051	72	0,04
113	Fannie Mae Pool 'BP2319', 3,000 %, fällig 02.01.2050	105	0,06	85	Fannie Mae Pool 'FM7741', 2,500 %, fällig 05.01.2051	76	0,04
67	Fannie Mae Pool 'BP8713', 3,000 %, fällig 08.01.2050	62	0,03	59	Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000 %, fällig 01.01.2049	59	0,03
65	Fannie Mae Pool 'BP9421', 3,000 %, fällig 07.01.2050	61	0,03	69	Fannie Mae Pool 'FM7796', 4,000 %, fällig 06.01.2048	68	0,04
77	Fannie Mae Pool 'BQ1150', 2,500 %, fällig 10.01.2050	70	0,04	88	Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, fällig 07.01.2051	80	0,04
84	Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500 %, fällig 11.01.2050	76	0,04	91	Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, fällig 07.01.2051	82	0,04
88	Fannie Mae Pool 'BQ9224', 2,000 %, fällig 01.01.2051	76	0,04	69	Fannie Mae Pool 'FM7929', 3,500 %, fällig 08.01.2050	67	0,04
84	Fannie Mae Pool 'BQ9226', 2,000 %, fällig 01.01.2051	73	0,04	920	Fannie Mae Pool 'FM8210', 3,000 %, fällig 04.01.2050	861	0,47
76	Fannie Mae Pool 'BR0757', 2,500 %, fällig 01.01.2051	68	0,04	446	Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000 %, fällig 02.01.2050	421	0,23
84	Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000 %, fällig 02.01.2051	73	0,04	175	Fannie Mae Pool 'FM8577', 3,000 %, fällig 08.01.2051	165	0,09
77	Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000 %, fällig 02.01.2051	67	0,04	184	Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, fällig 10.01.2051	166	0,09
78	Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000 %, fällig 02.01.2051	68	0,04	87	Fannie Mae Pool 'FM9044', 3,000 %, fällig 10.01.2051	82	0,04
80	Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, fällig 02.01.2051	70	0,04	93	Fannie Mae Pool 'FM9195', 2,500 %, fällig 10.01.2051	83	0,05
82	Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, fällig 02.01.2051	71	0,04	185	Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000 %, fällig 11.01.2051	174	0,09
82	Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000 %, fällig 03.01.2051	71	0,04	93	Fannie Mae Pool 'FM9335', 2,500 %, fällig 10.01.2051	83	0,05
173	Fannie Mae Pool 'BR3290', 2,000 %, fällig 03.01.2051	149	0,08	93	Fannie Mae Pool 'FM9365', 3,000 %, fällig 11.01.2051	88	0,05
87	Fannie Mae Pool 'BR4035', 2,000 %, fällig 02.01.2051	75	0,04	541	Fannie Mae Pool 'FM9993', 3,500 %, fällig 07.01.2051	520	0,28
89	Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, fällig 03.01.2051	77	0,04	89	Fannie Mae Pool 'FS0024', 2,500 %, fällig 09.01.2051	81	0,04
81	Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000 %, fällig 03.01.2051	70	0,04	95	Fannie Mae Pool 'FS0034', 3,000 %, fällig 12.01.2051	90	0,05
85	Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000 %, fällig 03.01.2051	74	0,04	85	Fannie Mae Pool 'FS0037', 3,000 %, fällig 08.01.2051	79	0,04
79	Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000 %, fällig 03.01.2051	69	0,04	95	Fannie Mae Pool 'FS0240', 3,000 %, fällig 01.01.2052	90	0,05
89	Fannie Mae Pool 'BR5458', 2,000 %, fällig 03.01.2051	77	0,04	95	Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000 %, fällig 01.01.2052	88	0,05
87	Fannie Mae Pool 'BR5577', 2,000 %, fällig 03.01.2051	75	0,04	193	Fannie Mae Pool 'FS0349', 2,000 %, fällig 01.01.2052	166	0,09
85	Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000 %, fällig 03.01.2051	74	0,04	97	Fannie Mae Pool 'FS0352', 2,000 %, fällig 01.01.2052	84	0,05
88	Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000 %, fällig 03.01.2051	76	0,04	96	Fannie Mae Pool 'FS0366', 2,500 %, fällig 01.01.2052	86	0,05
97	Fannie Mae Pool 'BR5634', 2,000 %, fällig 03.01.2051	75	0,04	192	Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, fällig 01.01.2052	173	0,09
90	Fannie Mae Pool 'BR5649', 2,000 %, fällig 03.01.2051	78	0,04	98	Fannie Mae Pool 'FS0504', 2,000 %, fällig 02.01.2042	86	0,05
87	Fannie Mae Pool 'BR6462', 2,000 %, fällig 03.01.2051	75	0,04	193	Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500 %, fällig 02.01.2052	173	0,09
92	Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500 %, fällig 07.01.2051	82	0,04	98	Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, fällig 02.01.2052	88	0,05
90	Fannie Mae Pool 'BT3244', 2,500 %, fällig 07.01.2051	81	0,04	97	Fannie Mae Pool 'FS0583', 2,500 %, fällig 02.01.2052	87	0,05
92	Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500 %, fällig 08.01.2051	82	0,04	97	Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 02.01.2052	84	0,05
92	Fannie Mae Pool 'BT3303', 2,500 %, fällig 08.01.2051	83	0,05	386	Fannie Mae Pool 'FS0605', 2,500 %, fällig 02.01.2052	346	0,19
				97	Fannie Mae Pool 'FS1014', 2,000 %, fällig 02.01.2052	84	0,05

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
194 Fannie Mae Pool 'FS1015', 2,000 %, fällig 02.01.2052	168	0,09	43 Freddie Mac Gold Pool 'Q45560', 3,000 %, fällig am 01.01.2047	41	0,02
583 Fannie Mae Pool 'FS1074', 3,000 %, fällig 03.01.2052	547	0,30	87 Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000 %, fällig am 01.01.2047	82	0,04
94 Fannie Mae Pool 'FS1107', 2,500 %, fällig 12.01.2051	85	0,05	48 Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000 %, fällig am 01.01.2047	46	0,02
391 Fannie Mae Pool 'FS1112', 2,000 %, fällig 03.01.2052	340	0,19	17 Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, fällig am 10.01.2042	17	0,01
94 Fannie Mae Pool 'FS1186', 3,500 %, fällig 01.01.2050	90	0,05	54 Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500 %, fällig am 03.01.2045	53	0,03
97 Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000 %, fällig 03.01.2052	92	0,05	90 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates Q006, Klasse A2, 4,325 %, fällig 25.04.2028 *	82	0,04
96 Fannie Mae Pool 'FS1462', 3,500 %, fällig 01.01.2052	92	0,05	80 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,098 %, fällig am 01.03.2047 *	78	0,04
295 Fannie Mae Pool 'FS1556', 3,500 %, fällig 05.01.2052	284	0,15	410 Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,008 %, fällig am 01.11.2048 *	398	0,22
98 Fannie Mae Pool 'FS1877', 3,000 %, fällig 05.01.2052	91	0,05	129 Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 2,874 %, fällig am 01.11.2047 *	127	0,07
98 Fannie Mae Pool 'FS1938', 2,500 %, fällig 02.01.2052	88	0,05	132 Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,084 %, fällig am 01.02.2050 *	129	0,07
99 Fannie Mae Pool 'FS2061', 4,000 %, fällig 06.01.2052	98	0,05	82 Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, fällig am 11.01.2050	74	0,04
394 Fannie Mae Pool 'FS2066', 4,000 %, fällig 06.01.2052	388	0,21	80 Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, fällig am 11.01.2050	72	0,04
199 Fannie Mae Pool 'FS2185', 4,000 %, fällig 06.01.2052	195	0,11	79 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig am 02.01.2051	68	0,04
900 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, fällig 06.01.2049	871	0,47	338 Freddie Mac Pool 'QB9087', 2,000 %, fällig am 02.01.2051	294	0,16
33 Fannie Mae Pool 'MA1217', 4,000 %, fällig 10.01.2042	33	0,02	81 Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000 %, fällig am 03.01.2051	70	0,04
17 Fannie Mae Pool 'MA1253', 4,000 %, fällig 11.01.2042	17	0,01	95 Freddie Mac Pool 'QC0297', 2,000 %, fällig am 04.01.2051	82	0,04
24 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, fällig 09.01.2043	24	0,01	93 Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, fällig am 07.01.2051	84	0,05
47 Fannie Mae Pool 'MA2110', 3,500 %, fällig 12.01.2034	46	0,02	89 Freddie Mac Pool 'QC4446', 2,500 %, fällig am 07.01.2051	80	0,04
32 Fannie Mae Pool 'MA2138', 3,500 %, fällig 01.01.2035	32	0,02	93 Freddie Mac Pool 'QC4690', 2,500 %, fällig am 08.01.2051	83	0,05
62 Fannie Mae Pool 'MA2320', 3,000 %, fällig 07.01.2035	60	0,03	93 Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, fällig am 08.01.2051	84	0,05
102 Fannie Mae Pool 'MA2523', 3,000 %, fällig 02.01.2036	98	0,05	278 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, fällig am 08.01.2051	250	0,14
75 Fannie Mae Pool 'MA2579', 3,000 %, fällig 04.01.2036	72	0,04	96 Freddie Mac Pool 'QC9154', 3,000 %, fällig am 10.01.2051	90	0,05
178 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, fällig 07.01.2036	171	0,09	99 Freddie Mac Pool 'QD5827', 2,000 %, fällig am 02.01.2052	85	0,05
254 Fannie Mae Pool 'MA2707', 3,000 %, fällig 08.01.2036	244	0,13	96 Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, fällig am 02.01.2052	87	0,05
381 Fannie Mae Pool 'MA2773', 3,000 %, fällig 10.01.2036	366	0,20	97 Freddie Mac Pool 'QD6093', 2,000 %, fällig am 02.01.2052	84	0,05
238 Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, fällig 12.01.2036	228	0,12	99 Freddie Mac Pool 'QE1075', 3,000 %, fällig am 04.01.2052	92	0,05
60 Fannie Mae Pool 'MA4120', 2,500 %, fällig 09.01.2050	54	0,03	100 Freddie Mac Pool 'QE4026', 4,000 %, fällig am 06.01.2052	98	0,05
78 Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000 %, fällig 10.01.2050	67	0,04	99 Freddie Mac Pool 'QE4043', 3,000 %, fällig am 06.01.2052	92	0,05
876 Fannie Mae Pool 'MA4305', 2,000 %, fällig 04.01.2051	755	0,41	104 Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000 %, fällig am 11.01.2049	99	0,05
178 Fannie Mae Pool 'MA4364', 2,000 %, fällig 06.01.2041	157	0,09	76 Freddie Mac Pool 'RA2114', 3,500 %, fällig am 02.01.2050	73	0,04
98 Fannie Mae Pool 'MA4606', 2,000 %, fällig 05.01.2042	86	0,05	204 Freddie Mac Pool 'RA2313', 3,500 %, fällig am 03.01.2050	196	0,11
197 Fannie Mae Pool 'MA4632', 2,000 %, fällig 06.01.2042	185	0,10	169 Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, fällig am 11.01.2050	147	0,08
10 Fannie Mae REMICS, Serie 2001 81, Klasse GE, 6,000 %, fällig am 25.01.2032	11	0,01	479 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, fällig am 11.01.2050	434	0,24
20 Fannie Mae REMICS, Serie 2005 29, Klasse ZA, 5,500 %, fällig am 25.04.2035	21	0,01	318 Freddie Mac Pool 'RA4175', 2,500 %, fällig am 12.01.2050	287	0,16
7 Fannie Mae REMICS, Serie 2011 87, Klasse SG, 4,106 %, fällig am 25.04.2040 *	–	–	161 Freddie Mac Pool 'RA4414', 2,500 %, fällig am 01.01.2051	145	0,08
21 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 101, Klasse AI, 3,000 %, fällig am 25.06.2027	1	–	257 Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, fällig am 02.01.2051	222	0,12
79 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 134, Klasse SK, 3,706 %, fällig am 25.12.2042 *	10	0,01	504 Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, fällig am 05.01.2051	436	0,24
6 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 46, Klasse BA, 6,000 %, fällig am 25.05.2042	7	–	374 Freddie Mac Pool 'RA5155', 2,000 %, fällig am 05.01.2051	323	0,18
7 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 75, Klasse NS, 4,156 %, fällig am 25.07.2042 *	1	–	91 Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000 %, fällig am 06.01.2051	78	0,04
431 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 96, Klasse SB, 3,606 %, fällig am 25.09.2042 *	41	0,02	363 Freddie Mac Pool 'RA5576', 2,500 %, fällig am 07.01.2051	326	0,18
9 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse BC, 6,500 %, fällig am 25.07.2042	10	0,01	185 Freddie Mac Pool 'RA5731', 2,000 %, fällig am 08.01.2051	160	0,09
13 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse CB, 5,500 %, fällig am 25.04.2042	14	0,01	90 Freddie Mac Pool 'RA5921', 2,500 %, fällig am 09.01.2051	81	0,04
104 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 47, Klasse GZ, 2,000 %, fällig am 25.07.2050	72	0,04	94 Freddie Mac Pool 'RA6562', 2,500 %, fällig am 01.01.2052	85	0,05
163 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 56, Klasse DI, 2,500 %, fällig am 25.08.2050	27	0,01	99 Freddie Mac Pool 'RA7398', 4,000 %, fällig am 05.01.2052	97	0,05
81 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 74, Klasse EI, 2,500 %, fällig am 25.10.2050	13	0,01	367 Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, fällig am 09.01.2041	324	0,18
560 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 89, Klasse DI, 2,500 %, fällig am 25.12.2050	84	0,05	487 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig am 10.01.2041	412	0,22
457 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 97, Klasse AI, 2,000 %, fällig am 25.01.2051	60	0,03	57 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, fällig am 11.01.2041	48	0,03
763 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 3, Klasse QI, 2,500 %, fällig am 25.02.2051	113	0,06	95 Freddie Mac Pool 'RB5138', 2,000 %, fällig am 12.01.2041	84	0,05
49 Fannie Mae-Aces, Serie 2013 M6, Klasse 1AC, 3,454 %, fällig am 25.02.2043 *	48	0,03	289 Freddie Mac Pool 'RB5145', 2,000 %, fällig am 02.01.2042	255	0,14
400 Fannie Mae-Aces, Serie 2018 M15, Klasse 1A2, 3,700 %, fällig am 25.01.2036	389	0,21	174 Freddie Mac Pool 'SD0552', 2,000 %, fällig am 03.01.2051	150	0,08
187 Fannie Mae-Aces, Serie 2018 M9, Klasse APT2, 3,218 %, fällig am 25.04.2028 *	182	0,10	79 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig am 04.01.2051	68	0,04
588 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M36, Klasse X1, 1,552 %, fällig am 25.09.2034 *	50	0,03	90 Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500 %, fällig am 07.01.2051	81	0,04
26 Freddie Mac Gold Pool 'G91240', 4,500 %, fällig am 01.01.2029	26	0,01	93 Freddie Mac Pool 'SD0745', 2,000 %, fällig am 11.01.2051	80	0,04
10 Freddie Mac Gold Pool 'G06409', 6,000 %, fällig am 11.01.2039	11	0,01	95 Freddie Mac Pool 'SD0809', 3,000 %, fällig am 01.01.2052	89	0,05
5 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, fällig am 09.01.2039	5	–	97 Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, fällig am 01.01.2052	87	0,05
168 Freddie Mac Gold Pool 'G61637', 3,000 %, fällig am 09.01.2047	159	0,09	292 Freddie Mac Pool 'SD0958', 3,500 %, fällig am 04.01.2052	281	0,15
23 Freddie Mac Gold Pool 'Q17792', 3,500 %, fällig am 05.01.2043	23	0,01	100 Freddie Mac Pool 'SD1132', 4,000 %, fällig am 06.01.2052	98	0,05
43 Freddie Mac Gold Pool 'Q29184', 4,000 %, fällig am 10.01.2044	43	0,02	766 Freddie Mac Pool 'SD1143', 4,500 %, fällig am 09.01.2050	772	0,42
			1.063 Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, fällig am 07.01.2049	1.053	0,57
			52 Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, fällig am 11.01.2049	48	0,03
			155 Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, fällig am 10.01.2050	140	0,08
			165 Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, fällig am 02.01.2051	149	0,08
			945 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig am 11.01.2051	851	0,46
			52 Freddie Mac Pool 'ZA2489', 3,500 %, fällig am 01.01.2038	50	0,03
			8 Freddie Mac Pool 'Z17269', 5,000 %, fällig am 03.01.2038	8	–
			27 Freddie Mac Pool 'ZN0538', 3,500 %, fällig am 11.01.2042	27	0,01
			17 Freddie Mac Pool 'ZN1436', 5,000 %, fällig am 11.01.2048	18	0,01
			4 Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, fällig am 12.01.2038	5	–
			8 Freddie Mac Pool 'ZS3569', 6,000 %, fällig am 10.01.2036	9	–
			18 Freddie Mac Pool 'ZS4751', 3,500 %, fällig am 01.01.2048	18	0,01
			24 Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000 %, fällig am 10.01.2032	24	0,01
			107 Freddie Mac Pool 'ZS9316', 3,500 %, fällig am 01.01.2038	105	0,06
			52 Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, fällig am 01.01.2046	49	0,03
			172 Freddie Mac Pool 'ZT1493', 3,000 %, fällig am 09.01.2048	162	0,09

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
43	42	0,02	30	30	0,02
4	–	–	41	41	0,02
24	–	–	24	24	0,01
–	–	–	91	92	0,05
24	3	–	43	44	0,02
–	–	–	69	69	0,04
13	2	–	30	31	0,02
3	–	–	301	304	0,17
30	28	0,02	16	15	0,01
71	10	0,01	102	102	0,06
251	39	0,02	53	54	0,03
88	13	0,01	40	39	0,02
177	25	0,01	99	96	0,05
77	12	0,01	24	24	0,01
358	59	0,03	235	237	0,13
82	13	0,01	147	139	0,08
456	59	0,03	787	743	0,40
189	26	0,01	195	189	0,10
200	193	0,11	300	273	0,15
420	418	0,23	600	563	0,31
74	73	0,04	200	193	0,11
18	19	0,01	5	–	–
10	10	0,01	12	–	–
4	4	–	19	–	–
70	69	0,04	34	2	–
41	39	0,02	19	–	–
57	54	0,03	19	19	0,01
129	123	0,07	43	2	–
8	9	–	21	2	–
7	7	–	21	21	0,01
5	5	–	79	74	0,04
17	18	0,01	107	74	0,04
9	9	0,01	21	–	–
15	14	0,01	81	80	0,04
494	497	0,27	43	1	–
14	13	0,01	8	8	–
130	122	0,07	12	–	–
28	27	0,01	50	1	–
61	54	0,03	256	2	–
92	80	0,04	496	492	0,27
98	92	0,05	49	9	–
99	92	0,05	33	7	–
99	95	0,05	626	7	–
197	183	0,10	317	12	0,01
30	29	0,02	84	12	0,01
32	31	0,02	166	24	0,01
87	85	0,05	82	12	0,01
43	44	0,02	86	13	0,01
117	110	0,06	87	13	0,01
64	60	0,03	160	13	0,01
31	31	0,02	85	13	0,01
11	11	0,01			
118	116	0,06			
63	62	0,03			
16	16	0,01			
49	48	0,03			
16	16	0,01			
94	90	0,05			
18	18	0,01			
21	20	0,01			
23	22	0,01			
169	169	0,09			
143	140	0,08			
97	97	0,05			
13	12	0,01			
64	64	0,03			
12	11	0,01			
113	110	0,06			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
348			150		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Klasse YI, 2,500 %, fällig am 20.10.2050	51	0,03	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Serie 2016 C36, Klasse A3, 2,807 %, fällig am 15.11.2059	139	0,08
4.475			1.449		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 178, Klasse IO, 1,422 %, fällig am 16.10.2060 *	435	0,24	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Serie 2016 C36, Klasse XA, 1,322 %, fällig am 15.11.2059 *	54	0,03
3.273			460		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 179, Klasse IO, 1,007 %, fällig am 16.09.2062 *	244	0,13	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41, Serie 2017 C41, Klasse B, 4,188 %, fällig am 15.11.2050 *	425	0,23
413			1.570		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 181, Klasse WI, 2,000 %, fällig am 20.12.2050	45	0,02	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C23, Serie 2014 C23, Klasse XA, 0,702 %, fällig am 15.10.2057 *	14	0,01
1.752			26		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 195, Klasse IO, 0,956 %, fällig am 16.12.2062 *	130	0,07	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Serie 2014 LC14, Klasse ASB, 3,522 %, fällig am 15.03.2047	26	0,01
286			Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 71.441 USD)		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Klasse MI, 3,500 %, fällig am 20.04.2050	45	0,02	66.441	36,20	
77			Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 40,48 % (28. Februar 2022: 39,60 %)		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Klasse NI, 3,500 %, fällig am 20.04.2050	12	0,01	Australien — 0,35 % (28. Februar 2022: 0,30 %)		
200			140 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,00 %, fällig 30.09.2043		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 H04, Klasse FP, 2,298 %, fällig am 20.06.2069 *	198	0,11	260		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 H09, Klasse FL, 2,948 %, fällig am 20.05.2070 *	199	0,11	Glencore Funding LLC, 144A, 4,125 %, fällig 12.03.2024	258	0,14
130			260		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 H09, Klasse NF, 3,048 %, fällig am 20.04.2070 *	131	0,07	Glencore Funding LLC, 144A, 3,875 %, fällig am 27.10.2027	247	0,13
68				647	0,35
Government National Mortgage Association, Serie 2020 H13, Klasse FA, 2,248 %, fällig am 20.07.2070 *	66	0,04	Belgien — 0,74 % (28. Februar 2022: 0,61 %)		
6.074			120 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650 %, fällig 01.02.2026		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 10, Klasse IO, 0,983 %, fällig am 16.05.2063 *	474	0,26	140		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 115, Klasse MI, 2,500 %, fällig am 20.05.2051	20	0,01	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000 %, fällig 13.04.2028	139	0,08
5.201			530		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 5, Klasse IO, 1,111 %, fällig am 16.01.2061 *	418	0,23	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,750 %, fällig 23.01.2029	541	0,29
200			60		
Government National Mortgage Association, Serie 2022 3, Klasse B, 1,850 %, fällig am 16.02.2061	138	0,08	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 01.06.2030	57	0,03
890			180		
Government National Mortgage Association, Serie 2022 3, Klasse IO, 0,640 %, fällig am 16.02.2061 *	51	0,03	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	164	0,09
100			20		
Government National Mortgage Association, Serie 2022 63, Klasse LM, 3,500 %, fällig am 20.10.2050	93	0,05	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048	18	0,01
478			100		
GS Mortgage Securities Corp II, Serie 2018 SRP5, Klasse A, 144A, 4,191 %, fällig am 15.09.2031 *	414	0,23	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439 %, fällig 06.10.2048	89	0,05
828			30		
GS Mortgage Securities Corp II, Serie 2018 SRP5, Klasse B, 144A, 5,391 %, fällig am 15.09.2031 *	661	0,36	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, fällig 23.01.2049	31	0,02
570			230		
GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, Serie 2018 3PCK, Klasse B, 144A, 4,891 %, fällig am 15.09.2031 *	572	0,31	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01.06.2050	209	0,11
10				1.366	0,74
GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16, Serie 2013 GC16, Klasse B, 5,161 %, fällig am 11.10.2046 *	10	0,01	Brasilien — 0,91 % (28. Februar 2022: 0,81 %)		
78			10 Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig am 17.03.2024		
HarborView Mortgage Loan Trust 2005-9, Serie 2005 9, Klasse 2A1B, 3,108 %, fällig am 20.06.2035 *	73	0,04	50		
Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig am 05.06.2115	43	0,02	690		
450			Suzano Austria GmbH, 6,000 %, fällig 15.01.2029	692	0,38
Independence Plaza Trust 2018-INDP, Serie 2018 INDP, Klasse A, 144A, 3,763 %, fällig am 10.07.2035	433	0,24	270		
Vale Overseas Ltd, 6,250 %, fällig 10.08.2026	284	0,15	20		
10			Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 21.11.2036	21	0,01
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, Serie 2013 C17, Klasse B, 5,049 %, fällig am 15.01.2047 *	10	0,01	600		
Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 10.11.2039	624	0,34		1.674	0,91
120			Kanada — 0,81 % (28. Februar 2022: 0,63 %)		
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23, Serie 2014 C23, Klasse AS, 4,202 %, fällig am 15.09.2047 *	117	0,06	240 Bank of Montreal, 1,850 %, fällig am 01.05.2025		
11.872			30		
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2018-C8, Serie 2018 C8, Klasse XA, 0,746 %, fällig am 15.06.2051 *	251	0,14	Bank of Montreal, 3,803 %, fällig am 15.12.2032 *	27	0,02
430			180		
Mill City Mortgage Trust 2015-2, Serie 2015 2, Klasse M3, 144A, 3,645 %, fällig am 25.09.2057 *	423	0,23	Bank of Nova Scotia/The, 3,450 %, fällig am 11.04.2025	176	0,10
100			130		
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18, Serie 2014 C18, Klasse AS, 4,110 %, fällig am 15.10.2047 *	97	0,05	Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, fällig am 11.06.2025	120	0,07
70			70		
Morgan Stanley Capital I Trust 2017-ASHF, Serie 2017 ASHF, Klasse A, 144A, 3,241 %, fällig am 15.11.2034 *	222	0,12	Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, fällig am 04.05.2037 *	63	0,03
550			40		
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse A, 144A, 3,047 %, fällig am 15.08.2036	521	0,28	Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig am 30.05.2041	41	0,02
187			110		
New Residential Mortgage Loan Trust 2015-2, Serie 2015 2A, Klasse A1, 144A, 3,750 %, fällig am 25.08.2055 *	179	0,10	Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950 %, fällig am 15.10.2039	116	0,06
279			350		
New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Serie 2016 3A, Klasse A1B, 144A, 3,250 %, fällig am 25.09.2056 *	264	0,14	Canadian Pacific Railway Co, 2,450 %, fällig am 02.12.2031	299	0,16
268			80		
New Residential Mortgage Loan Trust 2017-2, Serie 2017 2A, Klasse B1, 144A, 4,500 %, fällig am 25.03.2057 *	260	0,14	Canadian Pacific Railway Co, 3,000 %, fällig am 02.12.2041	63	0,03
314			130		
New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Serie 2018 3A, Klasse A1, 144A, 4,500 %, fällig am 25.05.2058 *	311	0,17	Royal Bank of Canada, 1,600 %, fällig am 17.04.2023	129	0,07
227			130		
New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQ2R, Klasse A3, 144A, 1,353 %, fällig am 25.10.2058 *	215	0,12	Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig am 10.06.2025	120	0,07
5			120		
Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-4, Serie 2007 4, Klasse 1A1, 2,961 %, fällig am 25.09.2037 *	5	-	Royal Bank of Canada, 3,875 %, fällig am 04.05.2032	114	0,06
300				1.494	0,81
UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C15, Serie 2018 C15, Klasse C, 5,370 %, fällig am 15.12.2051 *	274	0,15	Chile — 0,41 % (28. Februar 2022: 0,35 %)		
355			800 Corp Nacional del Cobre de Chile, 3,625 %, fällig am 01.08.2027		
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR6 Trust, Serie 2005 AR6, Klasse 2A1A, 2,904 %, fällig am 25.04.2045 *	341	0,19		758	0,41
1.016			China — 0,29 % (28. Februar 2022: 0,24 %)		
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1, Serie 2015 NXS1, Klasse XA, 1,213 %, fällig am 15.05.2048 *	21	0,01	80 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, fällig am 01.05.2025		
330			450		
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1, Serie 2016 BNK1, Klasse B, 2,967 %, fällig am 15.08.2049	289	0,16	Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 4,375 %, fällig am 10.04.2024	453	0,25
				529	0,29
			Kolumbien — 0,25 % (28. Februar 2022: 0,24 %)		
			650 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig am 28.05.2045		
				450	0,25
			Dänemark — 0,22 % (28. Februar 2022: 0,18 %)		
			200 Danske Bank A/S, 144A, 3,875 %, fällig am 12.09.2023		
			200 Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig am 12.01.2024		
				198	0,11
				202	0,11
				400	0,22

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
Finnland — 0,13 % (28. Februar 2022: 0,11 %)					
250 Nordea Bank Abp, 144A, 1,000 %, fällig am 09.06.2023	245	0,13	200 UBS Group AG, 144A, 3,126 %, fällig am 13.08.2030 *	175	0,10
Frankreich — 0,65 % (28. Februar 2022: 0,64 %)					
200 BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, fällig 10.01.2025 *	200	0,11	570 TSMC Arizona Corp, 2,500 %, fällig 25.10.2031	483	0,26
400 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *	369	0,20	Vereinigte Arabische Emirate — 0,39 % (28. Februar 2022: 0,63 %)		
200 BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14.08.2028	190	0,10	730 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, fällig am 25.09.2048	723	0,39
200 BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, fällig 10.01.2030 *	195	0,11	Vereinigtes Königreich — 1,58 % (28. Februar 2022: 1,45 %)		
250 Credit Agricole SA/London, 144A, 1,907 %, fällig 16.06.2026 *	230	0,13	200 Barclays Plc, 4,972 %, fällig am 16.05.2029 *	191	0,10
	1.184	0,65	60 BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig 15.08.2047	44	0,02
Indien — 0,11 % (28. Februar 2022: 0,11 %)					
270 Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, fällig am 12.01.2052	204	0,11	200 HSBC Holdings Plc, 2,633 %, fällig 07.11.2025 *	190	0,10
Indonesien — 0,34 % (28. Februar 2022: 0,30 %)					
700 Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 5,250 %, fällig am 24.10.2042	619	0,34	350 HSBC Holdings Plc, 4,300 %, fällig 08.03.2026	346	0,19
Irland — 0,21 % (28. Februar 2022: 0,18 %)					
230 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, fällig am 29.10.2026	203	0,11	200 HSBC Holdings Plc, 4,041 %, fällig 13.03.2028 *	188	0,10
210 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, fällig am 29.10.2028	179	0,10	200 HSBC Holdings Plc, 4,950 %, fällig 31.03.2030	194	0,11
	382	0,21	200 Lloyds Banking Group Plc, 2,907 %, fällig am 07.11.2023 *	199	0,11
Japan — 0,11 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
200 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,837 %, fällig 17.04.2026 *	195	0,11	200 Lloyds Banking Group Plc, 4,650 %, fällig am 24.03.2026	195	0,11
Kasachstan — 0,33 % (28. Februar 2022: 0,30 %)					
650 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig am 24.04.2030	608	0,33	200 Lloyds Banking Group Plc, 4,375 %, fällig am 22.03.2028	193	0,11
Kuwait — 0,37 % (28. Februar 2022: 0,31 %)					
400 Equate Petrochemical BV, 4,250 %, fällig am 03.11.2026	394	0,21	200 Nationwide Building Society, 144A, 4,363 %, fällig am 01.08.2024 *	199	0,11
320 Equate Petrochemical BV, 144A, 2,625 %, fällig 28.04.2028	287	0,16	200 Natwest Group Plc, 4,519 %, fällig am 25.06.2024 *	199	0,11
	681	0,37	200 Natwest Group Plc, 4,269 %, fällig am 22.03.2025 *	198	0,11
Macau — 0,10 % (28. Februar 2022: 0,08 %)					
200 Sands China Ltd, 5,625 %, fällig am 08.08.2025	183	0,10	200 Natwest Group Plc, 4,892 %, fällig am 18.05.2029 *	193	0,10
Mexiko — 0,59 % (28. Februar 2022: 0,55 %)					
700 Comision Federal de Electricidad, 144A, 3,875 %, fällig am 26.07.2033	540	0,30	270 Reynolds American Inc, 5,850 %, fällig 15.08.2045	229	0,12
200 Orbia Advance Corp SAB de CV, 144A, 2,875 %, fällig am 11.05.2031	166	0,09	140 Vodafone Group Plc, 4,375 %, fällig 30.05.2028	138	0,08
440 Petroleos Mexicanos, 6,625 %, fällig 15.06.2035	316	0,17		2.896	1,58
20 Petroleos Mexicanos, 6,375 %, fällig 23.01.2045	13	0,01	USA — 28,57 % (28. Februar 2022: 28,00 %)		
70 Petroleos Mexicanos, 5,625 %, fällig 23.01.2046	41	0,02	10 3M Co, 2,375 %, fällig am 26.08.2029	9	–
	1.076	0,59	90 3M Co, 3,700 %, fällig am 15.04.2050	73	0,04
Niederlande — 0,68 % (28. Februar 2022: 0,64 %)					
250 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, fällig am 04.08.2025	246	0,13	10 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig am 30.11.2036	11	0,01
300 Cooperatieve Rabobank UA, 3,750 %, fällig 21.07.2026	286	0,16	100 Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig am 30.11.2046	105	0,06
260 Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,375 %, fällig am 21.05.2025	255	0,14	100 AbbVie Inc, 3,800 %, fällig am 15.03.2025	99	0,05
120 Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030	108	0,06	20 AbbVie Inc, 3,600 %, fällig am 14.05.2025	20	0,01
10 Shell International Finance BV, 4,550 %, fällig 12.08.2043	10	–	90 AbbVie Inc, 2,950 %, fällig am 21.11.2026	85	0,05
140 Shell International Finance BV, 4,000 %, fällig 10.05.2046	125	0,07	920 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig am 21.11.2029	841	0,46
270 Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	214	0,12	10 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig am 14.11.2048	10	0,01
	1.244	0,68	20 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig am 21.11.2029	18	0,01
Peru — 0,61 % (28. Februar 2022: 0,58 %)					
400 Petroleos del Peru SA, 4,750 %, fällig am 19.06.2032	320	0,17	210 Adobe Inc, 2,300 %, fällig 01.02.2030	187	0,10
200 Petroleos del Peru SA, 144A, 5,625 %, fällig am 19.06.2047	138	0,08	10 Aetna Inc, 2,800 %, fällig 15.06.2023	10	0,01
680 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	656	0,36	10 Aetna Inc, 3,875 %, fällig 15.08.2047	8	–
	1.114	0,61	90 Air Lease Corp, 3,375 %, fällig am 01.07.2025	86	0,05
Südafrika — 0,15 % (28. Februar 2022: 0,13 %)					
290 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 10.04.2027	284	0,15	60 Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15.08.2030	49	0,03
Spanien — 0,49 % (28. Februar 2022: 0,42 %)					
200 Banco Santander SA, 3,848 %, fällig am 12.04.2023	200	0,11	70 Alphabet Inc, 1,900 %, fällig 15.08.2040	49	0,03
600 Banco Santander SA, 2,746 %, fällig 28.05.2025	564	0,31	40 Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15.08.2050	26	0,01
150 Telefonica Emissionen SA, 5,213 %, fällig am 08.03.2047	130	0,07	40 Altria Group Inc, 2,350 %, fällig am 06.05.2025	38	0,02
	894	0,49	68 Altria Group Inc, 4,400 %, fällig am 14.02.2026	68	0,04
Schweden — 0,11 % (28. Februar 2022: 0,08 %)					
200 Swedbank AB, 144A, 1,300 %, fällig am 02.06.2023	196	0,11	12 Altria Group Inc, 4,800 %, fällig am 14.02.2029	12	0,01
Schweiz — 0,72 % (28. Februar 2022: 0,84 %)					
310 Credit Suisse AG/New York NY, 1,000 %, fällig 05.05.2023	303	0,16	40 Altria Group Inc, 2,450 %, fällig am 04.02.2032	30	0,02
250 Credit Suisse AG/New York NY, 2,950 %, fällig 04.09.2025	237	0,13	20 Altria Group Inc, 5,800 %, fällig am 14.02.2039	19	0,01
500 Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, fällig am 04.01.2031 *	421	0,23	100 Altria Group Inc, 3,875 %, fällig am 16.09.2046	69	0,04
250 Credit Suisse Group AG, 144A, 3,091 %, fällig am 14.05.2032 *	189	0,10	390 Altria Group Inc, 5,950 %, fällig am 14.02.2049	351	0,19
			24 Altria Group Inc, 6,200 %, fällig am 14.02.2059	23	0,01
			200 Amazon.com Inc, 3,150 %, fällig 22.08.2027	193	0,11
			60 Amazon.com Inc, 3,450 %, fällig 13.04.2029	58	0,03
			100 Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	83	0,05
			80 Amazon.com Inc, 2,100 %, fällig 12.05.2031	69	0,04
			250 Amazon.com Inc, 3,600 %, fällig 13.04.2032	240	0,13
			80 Amazon.com Inc, 4,950 %, fällig 05.12.2044	84	0,05
			410 Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	286	0,16
			30 Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057	28	0,02
			210 American Express Co, 2,500 %, fällig 30.07.2024	204	0,11
			90 American Express Co, 4,050 %, fällig 03.05.2029	87	0,05
			70 American International Group Inc, 2,500 %, fällig 30.06.2025	67	0,04
			50 American International Group Inc, 4,750 %, fällig 01.04.2048	47	0,03
			30 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig am 15.01.2032	25	0,01
			11 Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15.06.2051	10	0,01
			310 Apple Inc, 1,125 %, fällig 11.05.2025	290	0,16
			200 Applied Materials Inc, 1,750 %, fällig am 01.06.2030	168	0,09
			70 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 15.02.2027	69	0,04
			260 AT&T Inc, 2,300 %, fällig am 01.06.2027	237	0,13
			130 AT&T Inc, 1,650 %, fällig am 01.02.2028	112	0,06
			40 AT&T Inc, 2,250 %, fällig am 01.02.2032	32	0,02
			60 AT&T Inc, 2,550 %, fällig am 01.12.2033	48	0,03
			10 AT&T Inc, 5,350 %, fällig am 01.09.2040	10	0,01
			10 AT&T Inc, 5,550 %, fällig 15.08.2041	10	0,01
			37 AT&T Inc, 4,350 %, fällig 15.06.2045	32	0,02
			178 AT&T Inc, 4,500 %, fällig am 09.03.2048	156	0,09
			30 AT&T Inc, 3,300 %, fällig am 01.02.2052	22	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — (Fortsetzung)					
10 AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15.09.2053	7	–	100 Chevron Corp, 2,954 %, fällig 16.05.2026	97	0,05
116 AT&T Inc, 3,550 %, fällig 15.09.2055	85	0,05	30 Chevron USA Inc, 3,850 %, fällig 15.01.2028	30	0,02
10 AT&T Inc, 3,800 %, fällig am 01.12.2057	8	–	150 Cigna Corp, 4,125 %, fällig 15.11.2025	149	0,08
63 AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2059	46	0,02	320 Cigna Corp, 4,375 %, fällig 15.10.2028	315	0,17
35 Bank of America Corp, 3,004 %, fällig am 20.12.2023 *	35	0,02	20 Cigna Corp, 4,900 %, fällig 15.12.2048	19	0,01
90 Bank of America Corp, 3,550 %, fällig am 05.03.2024 *	90	0,05	30 Cintas Corp No. 2, 3,700 %, fällig am 01.04.2027	30	0,02
310 Bank of America Corp, 4,000 %, fällig am 22.01.2025	308	0,17	60 Cintas Corp No. 2, 4,000 %, fällig am 01.05.2032	59	0,03
10 Bank of America Corp, 4,450 %, fällig am 03.03.2026	10	0,01	150 Citigroup Inc, 1,678 %, fällig am 15.05.2024 *	147	0,08
50 Bank of America Corp, 3,500 %, fällig am 19.04.2026	49	0,03	60 Citigroup Inc, 4,400 %, fällig 10.06.2025	60	0,03
400 Bank of America Corp, 1,319 %, fällig am 19.06.2026 *	364	0,20	120 Citigroup Inc, 5,500 %, fällig am 13.09.2025	123	0,07
320 Bank of America Corp, 4,250 %, fällig am 22.10.2026	315	0,17	90 Citigroup Inc, 3,106 %, fällig 08.04.2026 *	86	0,05
180 Bank of America Corp, 3,593 %, fällig am 21.07.2028 *	170	0,09	60 Citigroup Inc, 4,300 %, fällig am 20.11.2026	59	0,03
333 Bank of America Corp, 3,419 %, fällig am 20.12.2028 *	309	0,17	260 Citigroup Inc, 4,450 %, fällig am 29.09.2027	254	0,14
350 Bank of America Corp, 3,970 %, fällig am 05.03.2029 *	332	0,18	90 Citigroup Inc, 4,658 %, fällig am 24.05.2028 *	89	0,05
200 Bank of America Corp, 3,974 %, fällig am 07.02.2030 *	188	0,10	150 Citigroup Inc, 3,520 %, fällig am 27.10.2028 *	139	0,08
600 Bank of America Corp, 2,592 %, fällig am 29.04.2031 *	507	0,28	200 Citigroup Inc, 3,980 %, fällig am 20.03.2030 *	187	0,10
130 Bank of America Corp, 2,572 %, fällig am 20.10.2032 *	106	0,06	570 Citigroup Inc, 4,412 %, fällig am 31.03.2031 *	544	0,30
130 Bank of America Corp, 2,972 %, fällig am 04.02.2033 *	109	0,06	280 Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	234	0,13
140 Bank of America Corp, 5,000 %, fällig am 21.01.2044	136	0,07	190 Citigroup Inc, 3,785 %, fällig am 17.03.2033 *	171	0,09
290 Bank of America Corp, 3,946 %, fällig am 23.01.2049 *	247	0,13	30 Citigroup Inc, 4,910 %, fällig am 24.05.2033 *	29	0,02
300 Bank of America Corp, 4,083 %, fällig am 20.03.2051 *	258	0,14	400 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig am 15.07.2039	523	0,28
70 Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600 %, fällig 24.04.2025	66	0,04	77 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig am 30.07.2045	71	0,04
83 Becton Dickinson und Co, 4,685 %, fällig am 15.12.2044	79	0,04	10 Citigroup Inc, 4,750 %, fällig am 18.05.2046	9	–
130 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	123	0,07	60 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	46	0,03
430 Boeing Co/The, 4,875 %, fällig am 01.05.2025	431	0,23	30 Coca-Cola Co/The, 2,600 %, fällig 01.06.2050	22	0,01
320 Boeing Co/The, 5,150 %, fällig am 01.05.2030	315	0,17	120 Comcast Corp, 3,300 %, fällig 01.04.2027	116	0,06
340 Boeing Co/The, 3,250 %, fällig am 01.05.2035	262	0,14	140 Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15/10/2028	139	0,08
100 Boeing Co/The, 5,875 %, fällig am 15.02.2040	98	0,05	80 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	75	0,04
190 Boeing Co/The, 5,705 %, fällig am 01.05.2040	182	0,10	130 Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15/10/2030	128	0,07
140 Boeing Co/The, 3,750 %, fällig am 01.02.2050	101	0,05	121 Comcast Corp, 7,050 %, fällig 15/03/2033	143	0,08
240 Boeing Co/The, 5,805 %, fällig am 01.05.2050	231	0,13	140 Comcast Corp, 3,900 %, fällig 01.03.2038	126	0,07
30 Boeing Co/The, 5,930 %, fällig am 01.05.2060	29	0,02	10 Comcast Corp, 3,250 %, fällig 01.11.2039	8	–
40 BP Capital Markets America Inc, 3,410 %, fällig am 11.02.2026	39	0,02	40 Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	35	0,02
110 BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, fällig am 04.05.2026	107	0,06	20 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 15/07/2046	16	0,01
80 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig am 06.04.2030	76	0,04	20 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 15/08/2047	17	0,01
330 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig am 24.02.2050	241	0,13	20 Comcast Corp, 3,969 %, fällig 01.11.2047	17	0,01
19 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	18	0,01	20 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 01.03.2048	17	0,01
150 Bristol-Myers Squibb Co, 4,250 %, fällig 26.10.2049	139	0,08	10 Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01.11.2049	9	–
540 Broadcom Inc, 1,44A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	410	0,22	110 Comcast Corp, 3,450 %, fällig 01.02.2050	87	0,05
410 Cameron LNG LLC, 1,44A, 3,302 %, fällig am 15.01.2035	348	0,19	170 Comcast Corp, 2,800 %, fällig 15/01/2051	118	0,06
10 Carrier Global Corp, 3,577 %, fällig 05.04.2050	8	–	181 Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	128	0,07
580 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	578	0,31	54 Comcast Corp, 2,937 %, fällig 01.11.2056	37	0,02
460 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	434	0,24	10 Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15/10/2058	10	0,01
80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	77	0,04	20 ConocoPhillips Co, 6,950 %, fällig am 15.04.2029	23	0,01
170 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, fällig 01.04.2033	150	0,08	50 Consolidated Edison Co of New York Inc, Serie 20A, 3,350 %, fällig am 01.04.2030	47	0,03
160 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	141	0,08	30 Consolidated Edison Co of New York Inc, Serie 20B, 3,950 %, fällig am 01.04.2050	26	0,01
40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.03.2042	28	0,01	70 Constellation Brands Inc, 4,350 %, fällig am 09.05.2027	70	0,04
90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, fällig 23.10.2045	86	0,05	90 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig am 15.01.2028	85	0,05
10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.05.2047	9	–	170 Continental Resources Inc/OK, 1,44A, 5,750 %, fällig am 15.01.2031	163	0,09
100 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	89	0,05	100 Costco Wholesale Corp, 1,750 %, fällig am 20.04.2032	82	0,04
40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	33	0,02	210 Coterra Energy Inc, 1,44A, 3,900 %, fällig 15.05.2027	201	0,11
40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	31	0,02	390 Coterra Energy Inc, 1,44A, 4,375 %, fällig 15.03.2029	375	0,20
60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, fällig 01.04.2063	50	0,03	50 CVS Health Corp, 2,750 %, fällig 01.12.2022	50	0,03
			40 CVS Health Corp, 3,625 %, fällig 01.04.2027	39	0,02
			230 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	228	0,12
			110 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	103	0,06
			20 CVS Health Corp, 1,875 %, fällig 28.02.2031	16	0,01
			90 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15.09.2031	73	0,04
			100 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	95	0,05
			40 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	35	0,02
			40 CVS Health Corp, 5,125 %, fällig 20.07.2045	38	0,02
			390 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	376	0,20
			4 CVS Pass-Through Trust, 5,880 %, fällig am 10.01.2028	4	–
			110 Deere & Co, 3,750 %, fällig am 15.04.2050	102	0,06
			240 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 1,44A, 4,500 %, fällig am 20.10.2025	235	0,13
			220 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 1,44A, 4,750 %, fällig am 20.10.2028	210	0,11
			160 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	165	0,09
			18 Devon Energy Corp, 5,250 %, fällig 15.10.2027	18	0,01
			30 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	28	0,02
			40 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	40	0,02
			70 Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2042	63	0,03
			400 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	369	0,20
			170 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig am 01.12.2029	154	0,08
			40 Diamondback Energy Inc, 3,125 %, fällig 24.03.2031	35	0,02
			50 Duke Energy Corp, 3,150 %, fällig 15.08.2027	47	0,03
			50 Eaton Corp, 4,150 %, fällig 02.11.2042	45	0,02
			100 El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, fällig am 15.06.2032	119	0,06

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinven- tarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — (Fortsetzung)					
30			90 Intel Corp., 4,750 %, fällig 25.03.2050	86	0,05
170			20 Intel Corp., 3,050 %, fällig 12.08.2051	14	0,01
40			130 Johnson & Johnson, 3,700 %, fällig am 01.03.2046	116	0,06
120			380 JPMorgan Chase & Co, 1,514 %, fällig 01.06.2024 *	372	0,20
80			230 JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, fällig 05.12.2024 *	229	0,12
40			220 JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, fällig 22.04.2026 *	206	0,11
40			70 JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, fällig 15.12.2026	69	0,04
50			270 JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, fällig 01.10.2027	267	0,15
490			110 JPMorgan Chase & Co, 3,625 %, fällig 01.12.2027	105	0,06
10			260 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	250	0,14
90			180 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05.12.2029 *	174	0,09
50			440 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	373	0,20
210			40 JPMorgan Chase & Co, 2,580 %, fällig 22.04.2032 *	33	0,02
350			195 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01.06.2045	187	0,10
20			50 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	36	0,02
60			30 Kimberly-Clark Corp, 3,100 %, fällig 26.03.2030	28	0,02
20			40 Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig am 01.06.2025	40	0,02
20			360 Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig am 01.03.2028	352	0,19
20			70 Kinder Morgan Inc, 5,550 %, fällig am 01.06.2045	58	0,03
20			120 L3Harris Technologies Inc, 4,854 %, fällig 27.04.2035	71	0,04
20			40 L3Harris Technologies Inc, 5,054 %, fällig 27.04.2045	117	0,06
20			240 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig am 08.08.2024	39	0,02
170			20 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig am 25.06.2025	227	0,12
20			127 Lehman Escrow Receipt, Nullcoupon, fortwährend t [∞]	18	0,01
20			104 Lehman Swap Receipt, Nullcoupon, fortwährend t [∞]	1	–
10			50 Lockheed Martin Corp, 3,900 %, fällig 15.06.2032	–	–
30			100 Lockheed Martin Corp, 4,500 %, fällig 15.05.2036	49	0,03
10			250 Lockheed Martin Corp, 4,150 %, fällig 15.06.2053	99	0,05
30			110 Lowe's Cos Inc, 1,700 %, fällig 15.09.2028	234	0,13
140			50 Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig 15.04.2030	94	0,05
160			30 Magallanes Inc, 1,444, 3,755 %, fällig 15.03.2027	49	0,03
320			60 Magallanes Inc, 1,444, 4,054 %, fällig 15.03.2029	28	0,02
100			340 Magallanes Inc, 1,444, 4,279 %, fällig 15.03.2032	55	0,03
130			20 Magallanes Inc, 1,444, 5,050 %, fällig 15.03.2042	297	0,16
100			240 Magallanes Inc, 1,444, 5,141 %, fällig 15.03.2052	16	0,01
130			260 Mars Inc, 1,444, 3,200 %, fällig am 01.04.2030	192	0,10
100			400 MassMutual Global Funding II, 1,444, 0,850 %, fällig 09.06.2023	242	0,13
50			250 Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	391	0,21
180			30 McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.03.2027	227	0,12
200			50 McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.07.2027	30	0,02
50			30 McDonald's Corp, 3,800 %, fällig 01.04.2028	49	0,03
280			80 McDonald's Corp, 2,125 %, fällig 01.03.2030	29	0,02
40			80 McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	69	0,04
30			180 McDonald's Corp, 4,875 %, fällig 09.12.2045	76	0,04
100			20 McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	177	0,10
22			15 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	16	0,01
10			40 Medtronic Inc, 4,625 %, fällig 15.03.2045	35	0,02
10			80 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	15	0,01
30			215 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	66	0,04
120			270 Metropolitan Life Global Funding I, 1,444, 0,900 %, fällig am 08.06.2023	221	0,12
30			60 Microsoft Corp, 2,525 %, fällig 06.01.2050	264	0,14
100			100 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	44	0,02
100			140 MidAmerican Energy Co, 3,650 %, fällig 15.04.2029	79	0,04
150			20 Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC, 1,444, 4,100 %, fällig am 15.05.2028	136	0,07
140			290 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig am 04.05.2025	19	0,01
140			370 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig am 28.04.2026 *	272	0,15
90			290 Morgan Stanley, 3,772 %, fällig 24.01.2029 *	348	0,19
40			400 Morgan Stanley, 2,699 %, fällig am 22.01.2031 *	274	0,15
500			200 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig am 01.04.2031 *	346	0,19
780			190 MPLX LP, 4,000 %, fällig 15.03.2028	183	0,10
30			100 MPLX LP, 4,500 %, fällig am 15.04.2038	182	0,10
440			40 MPLX LP, 5,200 %, fällig 01.03.2047	89	0,05
10			60 MPLX LP, 5,200 %, fällig 01.12.2047	37	0,02
50			180 MPLX LP, 4,700 %, fällig am 15.04.2048	55	0,03
10			100 New York Life Global Funding, 1,444, 0,950 %, fällig am 24.06.2025	154	0,08
50			100 Newell Brands Inc, 4,450 %, fällig am 01.04.2026	91	0,05
4			110 NIKE Inc, 2,850 %, fällig 27.03.2030	94	0,05
30			60 NIKE Inc, 3,250 %, fällig 27.03.2040	101	0,06
80			10 NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	51	0,03
180			20 Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig 15.01.2028	8	–
110			530 Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01.05.2050	19	0,01
20			270 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	558	0,30
120			110 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	232	0,13
30			270 Oracle Corp, 1,650 %, fällig 25/03/2026	90	0,05
20			20 Oracle Corp, 2,950 %, fällig 01.04.2030	244	0,13
130			310 Oracle Corp, 2,875 %, fällig 25/03/2031	17	0,01
180			60 Otis Worldwide Corp, 2,056 %, fällig 05.04.2025	257	0,14
30			50 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig am 01.08.2027	57	0,03
150			70 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig am 01.02.2031	42	0,02
				54	0,03

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
Panama — (Fortsetzung)					
200 Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 15.05.2047	161	0,09			
620 Panama Government International Bond, 4,300 %, fällig 29.04.2053	476	0,26			
	863	0,47			
Peru — 0,10 % (28. Februar 2022: 0,30 %)					
40 Peruvian Government International Bond, 3,550 %, fällig 10.03.2051	30	0,02			
210 Peruvian Government International Bond, 3,600 %, fällig 15.01.2072	145	0,08			
	175	0,10			
Polen — 0,27 % (28. Februar 2022: 0,28 %)					
500 Republic of Poland Government International Bond, 4,000 %, fällig 22.01.2024	500	0,27			
Vereinigte Arabische Emirate — 0,68 % (28. Februar 2022: 0,63 %)					
1.250 Abu Dhabi Government International Bond, 2,500 %, fällig 11.10.2022	1.250	0,68			
USA — 6,82 % (28. Februar 2022: 18,21 %)					
1.390 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig am 28.10.2022	1.384	0,75			
310 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig am 18.11.2022	308	0,17			
20 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 30/04/2024	20	0,01			
70 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 31/03/2026	67	0,04			
760 United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, fällig 31/07/2029	729	0,40			
1.480 United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 31/08/2029	1.466	0,80			
10 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2032	10	–			
1.140 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15/08/2032	1.100	0,60			
170 United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 15/05/2042	163	0,09			
110 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/08/2045	97	0,05			
640 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/02/2048	586	0,32			
3.870 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	2.929	1,60			
1.300 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	832	0,45			
940 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	644	0,35			
450 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/02/2052	360	0,20			
960 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2052	885	0,48			
980 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/08/2052	929	0,51			
	12.509	6,82			
Uruguay — 0,39 % (28. Februar 2022: 0,38 %)					
390 Uruguay Government International Bond, 4,375 %, fällig 23.01.2031	400	0,22			
300 Uruguay Government International Bond, 5,100 %, fällig 18.06.2050	307	0,17			
	707	0,39			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 23.915\$)					
	20.227	11,02			
Organismen für gemeinsame Anlagen — 3,77 % (28. Februar 2022: 2,35 %)					
6.916 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	6.916	3,77			
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 6.916\$)					
	6.916	3,77			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 205.707\$)					
	187.328	102,08			
Kontrakte (in Tsd.)					
Gekaufte Optionen — 0,01 % (28. Februar 2022: 0,03 %)					
– U.S. 10 Year October 2022 Call 117,00, fällig 23.09.2022 — Goldman Sachs	14	0,01			
– U.S. 5 Year October 2022 Call 111,00, fällig 23.09.2022 — Goldman Sachs	8	–			
Gekaufte Optionen insgesamt (Kosten 24\$)					
	22	0,01			
Credit Default Swaps — 0,06 % (28. Februar 2022: 0,21 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	112	0,06			
Index-Swaps — 2,07 % (28. Februar 2022: 0,68 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	3.787	2,07			
Inflationsswaps — 0,10 % (28. Februar 2022: 0,06 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	180	0,10			
Zinsswaps — 0,18 % (28. Februar 2022: 0,12 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	322	0,18			
Futures — (0,03 %) (28. Februar 2022: 0,31 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	59	0,03			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
	191.810	104,53			
Geschriebene Optionen — (0,02 %) (28. Februar 2022: (0,10 %))					
– IMM Euro\$ December 2022 Call 96,50, fällig am 19.12.2022 — Goldman Sachs	(5)	–			
– IMM Euro\$ December 2022 Call 97,00, fällig am 19.12.2022 — Goldman Sachs	(9)	(0,01)			
– U.S. 10 Year October 2022 Call 120,50, fällig 23.09.2022 — Goldman Sachs	(1)	–			
– U.S. 10 Year October 2022 Call 122,00, fällig 23.09.2022 — Goldman Sachs	(1)	–			
– U.S. 10 Year October 2022 Put 115,50, fällig 23.09.2022 — Goldman Sachs	(7)	–			
– US 10 Year W2 September 2022 Put 116,00, fällig am 09.09.2022 — Goldman Sachs	(2)	–			
– U.S. 5 Year October 2022 Call 111,75, fällig 23.09.2022 — Goldman Sachs	(8)	(0,01)			
– U.S. 5 Year October 2022 Call 113,00, fällig 23.09.2022 — Goldman Sachs	(3)	–			
– US Long Bond W1 September 2022 Put 133,00, fällig am 02.09.2022 — Goldman Sachs	–	–			
Summe geschriebene Optionen (Kosten (204) USD)					
	(36)	(0,02)			
Index-Swaps — 0,09 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(159)	(0,09)			
Inflationsswaps — (0,09 %) (28. Februar 2022: (0,04 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(166)	(0,09)			
Zinsswaps — (0,40 %) (28. Februar 2022: (0,14 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(725)	(0,40)			
Devisenterminkontrakte — (0,02 %) (28. Februar 2022: (0,02 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(32)	(0,02)			
Futures — (0,74 %) (28. Februar 2022: (0,65 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.364)	(0,74)			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
	(2.482)	(1,36)			
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
	189.328	103,17			
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten					
	(5.821)	(3,17)			
Gesamtnettovermögen					
	183.507\$	100,00			
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, betreffen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 33.543.000\$ und machten 18,24 % des Nettovermögens aus.					
* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.					
† Nicht liquide.					
∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach Ermessen des Bewertungsausschusses.					
± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.					
ABKÜRZUNGEN:					
Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.					
REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.					
TBA – Wird noch bekanntgegeben.					
CNY – Chinesischer Renminbi					
Analyse des Gesamtvermögens					
					% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					90,77
Organismen für gemeinsame Anlagen					3,48
Finanzderivate					2,25
Sonstige Vermögenswerte					3,50
Gesamtvermögen					100,00

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzinheit – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkaufen	20.06.2027	33.637	\$ 112
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 489\$)				\$ 112
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 489\$)				\$ 112

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,820 %	06.04.2024	24.773	\$ (725)
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,350 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2028	3.289	322
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 288\$)				\$ 322
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (329)\$)				(725)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (41)\$)				\$ (403)

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzinheit	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,560 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20.07.2045	2.880	\$ 1.097
Goldman Sachs	Pay Fixed 0,710 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.05.2027	10.246	1.069
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,130 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.08.2028	2.084	213
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,220 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.08.2028	2.574	251
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20.11.2026	3.650	142
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2047	636	143
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,630 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.05.2047	1.390	288
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,650 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.08.2047	153	31
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,729 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2047	1.315	249
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,733 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20.10.2031	2.350	97
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,000 %, Receive Floating USD SOFR Compound	18.03.2032	1.215	95
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,500 %, Receive Floating USD SOFR Compound	21.04.2052	930	38
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,510 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2048	892	45
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,620 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2048	952	29
Goldman Sachs	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 1,550 %	03.04.2027	2.422	\$ (159)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1.592\$)				\$ 3.787
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				(159)
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1.592\$)				\$ 3.628

Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	USD – VPI Städtische Verbraucher	18.11.2023	3.220	\$ 112
Goldman Sachs	USD – VPI Städtische Verbraucher	20.10.2026	860	50
Goldman Sachs	USD – VPI Städtische Verbraucher	18.11.2026	3.220	(117)
Goldman Sachs	USD – SOFR Compound	15.02.2029	2.092	18
Goldman Sachs	USD – VPI Städtische Verbraucher	20.10.2031	860	(49)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 125\$)				\$ 180
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (92)\$)				(166)
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 33\$)				\$ 14

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	28	Verkauf	EUR	28	\$ –
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.034	Verkauf	USD	2.079	(32)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)								–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (50)\$)								(32)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (50)\$)								\$ (32)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Juni 2023	Goldman Sachs	1	\$ 240	\$ (1)
90 Day Euro\$ Dezember 2022	Goldman Sachs	160	38.374	(629)
90 Day Euro\$ Juni 2023	Goldman Sachs	57	13.667	(476)
90 Day Euro\$ September 2023	Goldman Sachs	13	3.122	(98)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Goldman Sachs	(28)	(3.273)	12
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2022	Goldman Sachs	(1)	(125)	1
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2022	Goldman Sachs	37	7.708	(13)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Goldman Sachs	140	15.515	(84)
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2022	Goldman Sachs	(34)	(4.619)	46
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2022	Goldman Sachs	158	23.621	(63)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 726\$)				\$ 59
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.522)\$)				(1.364)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (796)\$)				\$ (1.305)

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 7,27 % (28. Februar 2022: 9,12 %)					
139			1.550		
Aegis Asset Backed Sec Corp Mort Pass Thr Certs Serie 2003-3, Serie 2003 3, Klasse M2, 4,919 %, fällig am 25.01.2034 *					
	131	0,01	1.000	1.538	0,12
3.060			Owl Rock CLO I Ltd, Serie 2019 1A, Klasse A, 144A, 4,784 %, fällig am 20.05.2031 *		
Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Cfts Ser 2005-R8, Serie 2005 R8, Klasse M4, 3,314 %, fällig am 25.10.2035 *					
	3.001	0,24	3.368	977	0,08
2.059			Point Au Roche Park CLO Ltd, Serie 2021 1A, Klasse A, 144A, 3,790 %, fällig am 20.07.2034 *		
Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Serie 2019 1A, Klasse A21, 144A, 4,194 %, fällig am 05.06.2049					
	1.984	0,16	4.039	3.258	0,26
3.214			RASC Serie 2007-KS1 Trust, Serie 2007 KS1, Klasse A4, 2,664 %, fällig am 25.01.2037 *		
Asset Backed Securities Corp Home Equity Loan Trust Serie RFC 2007-HE1, Serie 2007 HE1, Klasse A4, 2,584 %, fällig am 25.12.2036 *					
	3.148	0,25	2.063	3.864	0,30
2.390			RASC Serie 2007-KS3 Trust, Serie 2007 KS3, Klasse A4, 2,784 %, fällig am 25.04.2037 *		
BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Serie 1996 1, Klasse B1, 7,875 %, fällig am 10.10.2026					
	117	0,01	2.010	1.931	0,15
1.500			Saxon Asset Securities Trust 2006-3, Serie 2006 3, Klasse A4, 2,684 %, fällig 25.10.2046 *		
BCRED MML CLO 2021-1 LLC, Serie 2021 1A, Klasse A, 144A, 3,992 %, fällig am 15.01.2035 *					
	1.459	0,12	131	1.696	0,13
1.630			SBA Small Business Investment Cos, Serie 2018 10B, Klasse 1, 3,548 %, fällig am 10.09.2028		
BCRED MML CLO 2022-1 LLC, Serie 2022 1A, Klasse A1, 144A, 2,245 %, fällig am 20.04.2035 *					
	1.592	0,13	3.074	127	0,01
1.740			SLM Private Education Loan Trust 2010-C, Serie 2010 C, Klasse A5, 144A, 7,141 %, fällig am 15.10.2041 *		
Cayuga Park CLO Ltd, Serie 2020 1A, Klasse AR, 144A, 3,860 %, fällig am 17.07.2034 *					
	1.710	0,13	542	3.354	0,26
18			SMB Private Education Loan Trust 2014-A, Serie 2014 A, Klasse A3, 144A, 3,891 %, fällig am 15.04.2032 *		
ContiMortgage Home Equity Loan Trust 1999-1, Serie 1999 1, Klasse B, 9,000 %, fällig am 25.04.2030					
	20	-	2	542	0,04
2.841			SMB Private Education Loan Trust 2015-A, Serie 2015 A, Klasse R, 144A, 0,000 %, fällig am 15.10.2048		
Countrywide Asset-Backed Certificates, Serie 2004 3, Klasse 1A, 2,864 %, fällig 25.08.2034 *					
	2.667	0,21	442	687	0,05
44			SMB Private Education Loan Trust, Serie 2020 B, Klasse A1A, 144A, 1,290 %, fällig am 15.07.2053		
CWABS Inc Asset-Backed Certificates Trust 2004-12, Serie 2004 13, Klasse MF1, 5,071 %, fällig am 25.04.2035 *					
	44	-	2.706	2.489	0,20
3.513			Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Klasse A, 144A, 2,675 %, fällig am 28.02.2033		
DB Master Finance LLC, Serie 2021 1A, Klasse A23, 144A, 2,791 %, fällig am 20.11.2051					
	2.861	0,23	1.220	1.179	0,09
273			Structured Asset Investment Loan Trust 2005-HE1, Serie 2005 HE1, Klasse M2, 3,164 %, fällig am 25.07.2035 *		
Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Serie 2018 2, Klasse A, 144A, 3,720 %, fällig am 20.12.2038					
	272	0,02	Asset-Backed Securities insgesamt (Kosten 96.365 USD)		
3.136			92.254		
Educational Funding Co LLC/The, Serie 2006 1A, Klasse A3, 144A, 3,133 %, fällig am 25.04.2033 *					
	2.345	0,19	7,27		
2.672			Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — 31,70 % (28. Februar 2022: 19,60 %)		
Encore Credit Receivables Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse M5, 3,404 %, fällig am 25.10.2035 *					
	2.591	0,20	60	47	-
179			Alternative Loan Trust 2005-14, Serie 2005 14, Klasse 2A2, 2,944 %, fällig am 25.05.2035 *		
Fannie Mae Grantor Trust 2017-T1, Serie 2017 T1, Klasse A, 2,898 %, fällig am 25.06.2027					
	172	0,01	200	181	0,01
8.581			Alternative Loan Trust 2005-56, Serie 2005 56, Klasse 4A1, 3,064 %, fällig am 25.11.2035 *		
Fieldstone Mortgage Investment Trust Serie 2005-2, Serie 2005 2, Klasse M3, 3,224 %, fällig am 25.12.2035 *					
	7.875	0,62	39	42	-
2.492			Alternative Loan Trust 2006-18CB, Serie 2006 18CB, Klasse A6, 18,825 %, fällig am 25.07.2036 *		
First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF15, Serie 2006 FF15, Klasse A2, 2,564 %, fällig am 25.11.2036 *					
	2.338	0,18	3.660	3.648	0,29
2.060			AREIT 2022-CRE7 LLC, Serie 2022 CRE7, Klasse A, 144A, 4,538 %, fällig am 17.06.2039 *		
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Serie 2018 4, Klasse A, 4,060 %, fällig am 15.11.2030					
	2.036	0,16	1.288	386	0,03
200			BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Serie 2016 GG10, Klasse AJA, 144A, 6,035 %, fällig am 10.08.2045 *		
Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates FRESR 2017-SR01, Serie 2017 SR01, Klasse A3, 3,089 %, fällig am 25.11.2027					
	191	0,02	2.233	1.995	0,16
2.980			Banc of America Funding 2014-R2 Trust, Serie 2014 R2, Klasse 2A2, 144A, 2,665 %, fällig am 26.05.2037 *		
Goldentree Loan Management US Clo 10 Ltd, Serie 2021 10A, Klasse A, 144A, 3,810 %, fällig am 25.12.2035 *					
	2.920	0,23	780	746	0,06
1.610			BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Klasse A5, 3,435 %, fällig am 15.09.2060		
Golub Capital Partners Clo 57M Ltd, Serie 2021 57A, Klasse A1, 144A, 4,273 %, fällig am 25.10.2034 *					
	1.553	0,12	12.255	335	0,03
2.729			BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Klasse XA, 0,854 %, fällig am 15.09.2060 *		
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Serie 2021 4GS, Klasse A, 144A, 1,930 %, fällig am 20.07.2048					
	2.272	0,18	1.500	1.428	0,11
1.100			BANK 2018-BNK15, Serie 2018 BN15, Klasse B, 4,812 %, fällig am 15.11.2061 *		
Greenwood Park CLO Ltd, Serie 2018 1A, Klasse A2, 144A, 3,522 %, fällig am 15.04.2031 *					
	1.087	0,09	2.570	2.313	0,18
1.890			BBCCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Klasse E, 144A, 4,715 %, fällig am 10.08.2033 *		
GSA Home Equity Trust 2005-6, Serie 2005 6, Klasse M4, 3,494 %, fällig am 25.06.2035 *					
	1.648	0,13	274	243	0,02
1.614			Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Klasse 1A1, 2,604 %, fällig am 25.01.2037 *		
Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Serie 2004 1, Klasse M1, 3,194 %, fällig 25.02.2034 *					
	1.538	0,12	3.100	2.988	0,24
2.000			BXP Trust 2017-CQHP, Serie 2017 CQHP, Klasse A, 144A, 3,241 %, fällig am 15.11.2034 *		
Magnetite XIV-R Ltd, Serie 2015 14RA, Klasse A2, 144A, 3,860 %, fällig am 18.10.2031 *					
	1.967	0,16	57	51	-
1.795			CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse 1A2, 3,024 %, fällig am 25.04.2035 *		
Magnolia Finance BV, 3,114 %, fällig 09.08.2024					
	1.755	0,14	300	290	0,02
3.140			Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27, Serie 2015 GC27, Klasse AS, 3,571 %, fällig am 10.02.2048		
MF1 2021-FL6 Ltd, Serie 2021 FL6, Klasse A, 144A, 3,477 %, fällig am 16.07.2036 *					
	3.038	0,24	75.266	2.481	0,20
3.000			Citigroup Mortgage Loan Trust 2016-C3, Serie 2016 C3, Klasse XA, 1,161 %, fällig am 15.11.2049 *		
National Collegiate II Commutation Trust, Serie 2005 AR15, Klasse AR15, 0,000 %, fällig am 01.06.2045					
	513	0,04	8.968	3.078	0,24
3.300			COLT 2021-RPL1 Trust, Serie 2021 RPL1, Klasse A1, 144A, 1,665 %, fällig am 25.09.2061 *		
National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Serie 2006 3, Klasse B, 2,804 %, fällig am 26.01.2032 *					
	2.476	0,20	20	19	-
2.000			COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Serie 2013 CR12, Klasse B, 4,762 %, fällig am 10.10.2046 *		
Nelnet Student Loan Trust 2014-2, Serie 2014 2A, Klasse B, 144A, 3,944 %, fällig am 25.06.2041 *					
	1.884	0,15	10	8	-
2.500			COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Serie 2013 CR12, Klasse C, 5,216 %, fällig am 10.10.2046 *		
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd, Serie 2018 29A, Klasse A1, 144A, 3,868 %, fällig am 19.10.2031 *					
	2.473	0,19	726	717	0,06
2.000			COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Serie 2015 DC1, Klasse B, 4,035 %, fällig am 10.02.2048 *		
Neuberger Berman Loan Advisers Clo 42 Ltd, Serie 2021 42A, Klasse A, 144A, 3,840 %, fällig 16.07.2035 *					
	1.955	0,15	90	86	0,01
1.500			COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Serie 2015 DC1, Klasse C, 4,441 %, fällig am 10.02.2048 *		
Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Klasse AR, 144A, 3,732 %, fällig am 15.10.2034 *					
	1.460	0,12	70	65	0,01
1.280			COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Serie 2015 PC1, Klasse A5, 3,902 %, fällig am 10.07.2050		
Ocean Trails Clo XI, Serie 2021 11A, Klasse A, 144A, 3,930 %, fällig am 20.07.2034 *					
	1.260	0,10	314	1.424	0,11
2.500			Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Klasse 1M2, 144A, 4,544 %, fällig am 25.10.2039 *		
Octagon Investment Partners 36 Ltd, Serie 2018 1A, Klasse A1, 144A, 3,482 %, fällig am 15.04.2031 *					
	2.470	0,19	500	312	0,02
1.233			CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Serie 2015 C1, Klasse AS, 3,791 %, fällig am 15.04.2050 *		
Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Klasse 1A1, 5,866 %, fällig am 25.01.2037					
	1.068	0,08	1.050	481	0,04
342			CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse A2, 144A, 3,953 %, fällig am 15.09.2037		
Origen Manufactured Housing Contract Trust 2006-A, Serie 2006 A, Klasse A2, 3,678 %, fällig am 15.10.2037 *					
	319	0,03	140	985	0,08
			CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse E, 144A, 4,373 %, fällig am 15.09.2037		
			5.170	111	0,01
			CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse F, 144A, 4,373 %, fällig am 15.09.2037		
			3.753	0,30	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert		
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)							
1.960	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Klasse M2, 144A, 2,958 %, fällig am 25.07.2057 *	1.668	0,13	65	Fannie Mae Pool 'AP9766', 4,000 %, fällig 10.01.2042	65	0,01
2.577	CSMC 2021-NQM8, Serie 2021 NQM8, Klasse A1, 144A, 1,841 %, fällig am 25.10.2066 *	2.280	0,18	79	Fannie Mae Pool 'AP9862', 4,000 %, fällig 10.01.2042	78	0,01
600	CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Klasse G, 144A, 7,741 %, fällig am 15.07.2032 *	538	0,04	17	Fannie Mae Pool 'AQ0100', 4,000 %, fällig 10.01.2042	16	–
1.680	DBC G 2017-BBG Mortgage Trust, Serie 2017 BBG, Klasse A, 144A, 3,092 %, fällig am 15.06.2034 *	1.654	0,13	71	Fannie Mae Pool 'AQ1641', 4,000 %, fällig 10.01.2042	71	0,01
167	Deutsche Mortgage Securities Inc Mortgage Loan Trust Serie 2006-PR1, Serie 2006 PR1, Klasse 3AF1, 144A, 2,671 %, fällig am 15.04.2036 *	154	0,01	17	Fannie Mae Pool 'AQ3599', 4,000 %, fällig 11.01.2042	17	–
300	Fannie Mae 10 Year Pool, 3,740 %, fällig am 01.09.2032 ∞	306	0,02	25	Fannie Mae Pool 'AQ4078', 4,000 %, fällig 06.01.2043	25	–
365	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2014 C03, Klasse 1M2, 5,444 %, fällig am 25.07.2024 *	373	0,03	17	Fannie Mae Pool 'AQ4080', 4,000 %, fällig 06.01.2043	17	–
2.554	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Klasse 1B1, 6,194 %, fällig am 25.10.2030 *	2.572	0,20	29	Fannie Mae Pool 'AQ4555', 4,000 %, fällig 12.01.2042	29	–
560	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C05, Klasse 1B1, 6,694 %, fällig am 25.01.2031 *	585	0,05	23	Fannie Mae Pool 'AQ5137', 4,000 %, fällig 11.01.2042	23	–
13	Fannie Mae Interest Strip 390, Klasse C3, 6,000 %, fällig am 25.07.2038	3	–	51	Fannie Mae Pool 'AQ7003', 4,000 %, fällig 12.01.2042	52	–
7	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 22, 5,000 %, fällig am 25.01.2039	1	–	57	Fannie Mae Pool 'AQ7082', 4,000 %, fällig 01.01.2043	57	–
4	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 23, 5,000 %, fällig am 25.01.2039 *	1	–	122	Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, fällig 06.01.2043	116	0,01
7	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 27, 5,500 %, fällig am 25.01.2039 *	2	–	283	Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, fällig 07.01.2043	269	0,02
6	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 34, 5,000 %, fällig am 25.01.2038	1	–	24	Fannie Mae Pool 'AS0070', 4,000 %, fällig 08.01.2043	24	–
17	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 41, 6,000 %, fällig am 25.01.2038	4	–	95	Fannie Mae Pool 'AS3253', 4,000 %, fällig 09.01.2044	95	0,01
53	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C13, 3,500 %, fällig am 25.11.2041	8	–	24	Fannie Mae Pool 'AS4271', 4,500 %, fällig 01.01.2045	25	–
61	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C18, 4,000 %, fällig am 25.04.2042	11	–	42	Fannie Mae Pool 'AS4347', 4,000 %, fällig 01.01.2045	42	–
79	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C2, 3,000 %, fällig am 25.04.2027	4	–	444	Fannie Mae Pool 'AS6328', 3,500 %, fällig 12.01.2045	433	0,03
61	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C22, 4,500 %, fällig am 25.11.2039	11	–	114	Fannie Mae Pool 'AS6340', 3,500 %, fällig 12.01.2045	111	0,01
2.900	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 % ±	2.764	0,22	97	Fannie Mae Pool 'AS6541', 3,500 %, fällig 01.01.2046	94	0,01
2.700	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 % ±	2.636	0,21	74	Fannie Mae Pool 'AS6562', 3,500 %, fällig 01.01.2046	72	0,01
2.700	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 % ±	2.684	0,21	62	Fannie Mae Pool 'AS7844', 3,000 %, fällig 09.01.2046	59	–
6.300	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 % ±	5.422	0,43	205	Fannie Mae Pool 'AS8623', 3,000 %, fällig 01.01.2047	193	0,02
9.700	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 % ±	8.665	0,68	143	Fannie Mae Pool 'AS8740', 3,500 %, fällig 02.01.2037	141	0,01
6.600	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ±	6.112	0,48	810	Fannie Mae Pool 'AS8745', 3,000 %, fällig 02.01.2047	765	0,06
9	Fannie Mae Pool '254793', 5,000 %, fällig am 01.07.2033	10	–	485	Fannie Mae Pool 'AS8951', 3,500 %, fällig 03.01.2047	471	0,04
11	Fannie Mae Pool '555743', 5,000 %, fällig am 01.09.2033	12	–	19	Fannie Mae Pool 'AT7208', 4,000 %, fällig 06.01.2043	18	–
1	Fannie Mae Pool '725162', 6,000 %, fällig am 01.02.2034	1	–	26	Fannie Mae Pool 'AT8394', 4,000 %, fällig 06.01.2043	26	–
6	Fannie Mae Pool '745000', 6,000 %, fällig am 01.10.2035	7	–	73	Fannie Mae Pool 'AT9637', 4,000 %, fällig 07.01.2043	73	0,01
4	Fannie Mae Pool '843997', 2,477 %, fällig am 01.11.2035 *	5	–	56	Fannie Mae Pool 'AT9653', 4,000 %, fällig 07.01.2043	56	–
4	Fannie Mae Pool '865915', 2,622 %, fällig am 01.03.2036 *	4	–	45	Fannie Mae Pool 'AT9657', 4,000 %, fällig 07.01.2043	45	–
14	Fannie Mae Pool '888560', 6,000 %, fällig am 01.11.2035 *	15	–	284	Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, fällig 10.01.2043	270	0,02
32	Fannie Mae Pool '889117', 5,000 %, fällig am 01.10.2035	33	–	93	Fannie Mae Pool 'AV0318', 4,500 %, fällig 02.01.2044	93	0,01
31	Fannie Mae Pool '890248', 6,000 %, fällig am 01.08.2037	34	–	16	Fannie Mae Pool 'AV9453', 3,500 %, fällig 08.01.2044	16	–
383	Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, fällig am 01.10.2044	391	0,03	405	Fannie Mae Pool 'BC0884', 3,000 %, fällig 05.01.2046	385	0,03
134	Fannie Mae Pool '890827', 3,500 %, fällig am 01.12.2037	132	0,01	36	Fannie Mae Pool 'BC1509', 3,000 %, fällig 08.01.2046	34	–
7	Fannie Mae Pool '985626', 6,000 %, fällig am 01.04.2033	8	–	102	Fannie Mae Pool 'BC2817', 3,000 %, fällig 09.01.2046	97	0,01
15	Fannie Mae Pool '995072', 5,500 %, fällig am 01.08.2038	16	–	244	Fannie Mae Pool 'BC9077', 3,500 %, fällig 12.01.2046	236	0,02
36	Fannie Mae Pool 'AB9683', 4,000 %, fällig 06.01.2043	36	–	645	Fannie Mae Pool 'BD2455', 3,000 %, fällig 01.01.2047	610	0,05
34	Fannie Mae Pool 'AE0758', 7,000 %, fällig 02.01.2039	38	–	260	Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000 %, fällig 10.01.2046	247	0,02
27	Fannie Mae Pool 'AK8441', 4,000 %, fällig 04.01.2042	27	–	864	Fannie Mae Pool 'BF0104', 4,000 %, fällig 02.01.2056	859	0,07
–	Fannie Mae Pool 'AL2931', 6,000 %, fällig 06.01.2023	–	–	649	Fannie Mae Pool 'BF0163', 5,000 %, fällig 11.01.2046	665	0,05
356	Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, fällig 01.01.2043	348	0,03	509	Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000 %, fällig 01.01.2057	506	0,04
34	Fannie Mae Pool 'AL3026', 3,500 %, fällig 12.01.2042	34	–	890	Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, fällig 06.01.2057	874	0,07
26	Fannie Mae Pool 'AL3508', 4,000 %, fällig 04.01.2043	26	–	762	Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500 %, fällig 09.01.2057	781	0,06
19	Fannie Mae Pool 'AL4741', 4,500 %, fällig 01.01.2044	20	–	42	Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, fällig 08.01.2058	43	–
72	Fannie Mae Pool 'AL9397', 3,000 %, fällig 10.01.2046	68	0,01	298	Fannie Mae Pool 'BF0338', 4,500 %, fällig 01.01.2059	306	0,02
386	Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, fällig 11.01.2046	379	0,03	80	Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, fällig 12.01.2037	76	0,01
339	Fannie Mae Pool 'AL9631', 3,000 %, fällig 12.01.2046	321	0,03	759	Fannie Mae Pool 'BK7700', 4,500 %, fällig 10.01.2048	770	0,06
10	Fannie Mae Pool 'AM8674', 2,810 %, fällig 04.01.2025	10	–	182	Fannie Mae Pool 'BL2454', 3,160 %, fällig 05.01.2029	175	0,01
211	Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930 %, fällig 06.01.2030	200	0,02	761	Fannie Mae Pool 'BM1565', 3,000 %, fällig 04.01.2047	721	0,06
91	Fannie Mae Pool 'AN4677', 3,200 %, fällig 02.01.2029	88	0,01	235	Fannie Mae Pool 'BM1948', 6,000 %, fällig 07.01.2041	235	0,02
116	Fannie Mae Pool 'AN4927', 3,450 %, fällig 03.01.2029	113	0,01	44	Fannie Mae Pool 'BM3799', 3,000 %, fällig 08.01.2047	41	–
137	Fannie Mae Pool 'AN5386', 3,250 %, fällig 05.01.2029	133	0,01	253	Fannie Mae Pool 'BM4579', 3,000 %, fällig 04.01.2047	239	0,02
10	Fannie Mae Pool 'AO2711', 4,000 %, fällig 05.01.2042	10	–	42	Fannie Mae Pool 'BM4750', 3,500 %, fällig 02.01.2045	41	–
21	Fannie Mae Pool 'AO6086', 4,000 %, fällig 06.01.2042	21	–	279	Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, fällig 03.01.2043	273	0,02
9	Fannie Mae Pool 'AO9859', 4,000 %, fällig 07.01.2042	9	–	399	Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, fällig 12.01.2046	389	0,03
15	Fannie Mae Pool 'AP0692', 4,000 %, fällig 07.01.2042	15	–	188	Fannie Mae Pool 'BM6623', 2,500 %, fällig 10.01.2050	166	0,01
16	Fannie Mae Pool 'AP2530', 4,000 %, fällig 08.01.2042	16	–	578	Fannie Mae Pool 'BM6898', 2,149 %, fällig 01.02.2032 *	504	0,04
54	Fannie Mae Pool 'AP4710', 3,500 %, fällig 08.01.2042	53	–	199	Fannie Mae Pool 'BM6912', 2,500 %, fällig 01.01.2052	176	0,01
262	Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, fällig 09.01.2042	250	0,02	333	Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500 %, fällig 11.01.2048	337	0,03
27	Fannie Mae Pool 'AP4903', 4,000 %, fällig 09.01.2042	27	–	1.084	Fannie Mae Pool 'BN3898', 4,500 %, fällig 12.01.2048	1.096	0,09
59	Fannie Mae Pool 'AP7399', 4,000 %, fällig 09.01.2042	59	–	131	Fannie Mae Pool 'BO1858', 3,000 %, fällig 08.01.2049	122	0,01
17	Fannie Mae Pool 'AP9229', 4,000 %, fällig 10.01.2042	17	–	98	Fannie Mae Pool 'BO8932', 3,000 %, fällig 01.01.2050	92	0,01
				87	Fannie Mae Pool 'BP3484', 2,500 %, fällig 06.01.2051	78	0,01
				485	Fannie Mae Pool 'BP6715', 2,000 %, fällig 09.01.2050	419	0,03
				67	Fannie Mae Pool 'BP7887', 2,500 %, fällig 08.01.2050	60	–
				464	Fannie Mae Pool 'BQ1150', 2,500 %, fällig 10.01.2050	418	0,03
				62	Fannie Mae Pool 'BQ1402', 3,000 %, fällig 08.01.2050	58	–
				253	Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500 %, fällig 11.01.2050	229	0,02
				93	Fannie Mae Pool 'BQ6652', 2,500 %, fällig 10.01.2051	84	0,01
				98	Fannie Mae Pool 'BQ7435', 2,500 %, fällig 09.01.2051	88	0,01
				351	Fannie Mae Pool 'BQ9224', 2,000 %, fällig 01.01.2051	303	0,02
				421	Fannie Mae Pool 'BQ9226', 2,000 %, fällig 01.01.2051	364	0,03
				81	Fannie Mae Pool 'BR0001', 2,500 %, fällig 12.01.2050	72	0,01
				86	Fannie Mae Pool 'BR0663', 2,000 %, fällig 02.01.2051	74	0,01
				153	Fannie Mae Pool 'BR0757', 2,500 %, fällig 01.01.2051	137	0,01
				352	Fannie Mae Pool 'BR1001', 2,500 %, fällig 08.01.2051	318	0,03
				1.101	Fannie Mae Pool 'BR1035', 2,000 %, fällig 05.01.2051	950	0,07
				259	Fannie Mae Pool 'BR1823', 2,000 %, fällig 01.01.2051	224	0,02
				88	Fannie Mae Pool 'BR2303', 3,000 %, fällig 08.01.2051	82	0,01
				251	Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000 %, fällig 02.01.2051	218	0,02
				385	Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000 %, fällig 02.01.2051	334	0,03

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinven- tarwert
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
156 Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000 %, fällig 02.01.2051	135	0,01	931 Fannie Mae Pool 'CB1273', 2,000 %, fällig 08.01.2051	804	0,06
239 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, fällig 02.01.2051	209	0,02	1.383 Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000 %, fällig 10.01.2051	1.284	0,10
411 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, fällig 02.01.2051	357	0,03	283 Fannie Mae Pool 'CB2115', 2,500 %, fällig 11.01.2041	258	0,02
246 Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000 %, fällig 03.01.2051	214	0,02	97 Fannie Mae Pool 'CB2136', 3,000 %, fällig 11.01.2041	91	0,01
691 Fannie Mae Pool 'BR3290', 2,000 %, fällig 03.01.2051	596	0,05	187 Fannie Mae Pool 'CB2680', 3,500 %, fällig 01.01.2052	179	0,01
347 Fannie Mae Pool 'BR4035', 2,000 %, fällig 02.01.2051	300	0,02	1.441 Fannie Mae Pool 'CB3031', 2,500 %, fällig 03.01.2052	1.288	0,10
260 Fannie Mae Pool 'BR4080', 2,000 %, fällig 03.01.2051	224	0,02	789 Fannie Mae Pool 'CB3044', 2,500 %, fällig 03.01.2052	710	0,06
536 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, fällig 03.01.2051	463	0,04	681 Fannie Mae Pool 'CB3255', 3,500 %, fällig 04.01.2052	653	0,05
244 Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000 %, fällig 03.01.2051	211	0,02	98 Fannie Mae Pool 'CB3386', 3,500 %, fällig 04.01.2042	95	0,01
171 Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000 %, fällig 03.01.2051	148	0,01	197 Fannie Mae Pool 'CB3542', 3,000 %, fällig 05.01.2042	185	0,01
317 Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000 %, fällig 03.01.2051	274	0,02	977 Fannie Mae Pool 'CB3614', 4,000 %, fällig 05.01.2052	964	0,08
266 Fannie Mae Pool 'BR5458', 2,000 %, fällig 03.01.2051	230	0,02	597 Fannie Mae Pool 'CB3833', 3,000 %, fällig 06.01.2052	554	0,04
170 Fannie Mae Pool 'BR5487', 2,000 %, fällig 03.01.2051	147	0,01	1.688 Fannie Mae Pool 'CB4121', 4,000 %, fällig 07.01.2052	1.653	0,13
261 Fannie Mae Pool 'BR5577', 2,000 %, fällig 03.01.2051	225	0,02	390 Fannie Mae Pool 'FM0068', 3,500 %, fällig 02.01.2040	385	0,03
341 Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000 %, fällig 03.01.2051	296	0,02	135 Fannie Mae Pool 'FM0071', 3,500 %, fällig 02.01.2040	132	0,01
166 Fannie Mae Pool 'BR5589', 2,000 %, fällig 03.01.2051	144	0,01	1.142 Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, fällig 09.01.2049	1.178	0,09
440 Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000 %, fällig 03.01.2051	380	0,03	109 Fannie Mae Pool 'FM2158', 4,000 %, fällig 10.01.2049	108	0,01
349 Fannie Mae Pool 'BR5634', 2,000 %, fällig 03.01.2051	302	0,02	995 Fannie Mae Pool 'FM3123', 2,500 %, fällig 03.01.2038	923	0,07
452 Fannie Mae Pool 'BR5649', 2,000 %, fällig 03.01.2051	391	0,03	897 Fannie Mae Pool 'FM3141', 3,500 %, fällig 11.01.2048	868	0,07
260 Fannie Mae Pool 'BR6462', 2,000 %, fällig 03.01.2051	225	0,02	196 Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000 %, fällig 11.01.2048	194	0,02
87 Fannie Mae Pool 'BR6515', 2,000 %, fällig 04.01.2051	76	0,01	2.042 Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500 %, fällig 05.01.2047	1.980	0,16
352 Fannie Mae Pool 'BR6768', 2,500 %, fällig 06.01.2051	317	0,03	83 Fannie Mae Pool 'FM3542', 4,000 %, fällig 05.01.2049	82	0,01
86 Fannie Mae Pool 'BR7744', 2,000 %, fällig 04.01.2051	74	0,01	302 Fannie Mae Pool 'FM3572', 4,500 %, fällig 09.01.2049	306	0,02
243 Fannie Mae Pool 'BR7745', 2,000 %, fällig 04.01.2051	211	0,02	2.872 Fannie Mae Pool 'FM3773', 3,500 %, fällig 11.01.2048	2.783	0,22
84 Fannie Mae Pool 'BR8478', 2,000 %, fällig 04.01.2051	73	0,01	524 Fannie Mae Pool 'FM3830', 3,000 %, fällig 04.01.2050	490	0,04
162 Fannie Mae Pool 'BR8518', 2,000 %, fällig 04.01.2051	141	0,01	293 Fannie Mae Pool 'FM3978', 4,000 %, fällig 07.01.2050	290	0,02
100 Fannie Mae Pool 'BS5233', 3,520 %, fällig 06.01.2032	98	0,01	462 Fannie Mae Pool 'FM4252', 2,000 %, fällig 09.01.2050	400	0,03
100 Fannie Mae Pool 'BS5754', 3,900 %, fällig 06.01.2032	100	0,01	561 Fannie Mae Pool 'FM4577', 2,500 %, fällig 10.01.2050	505	0,04
100 Fannie Mae Pool 'BS5808', 3,830 %, fällig 07.01.2032	100	0,01	294 Fannie Mae Pool 'FM4737', 3,500 %, fällig 09.01.2050	282	0,02
100 Fannie Mae Pool 'BS5955', 3,730 %, fällig 06.01.2032	99	0,01	83 Fannie Mae Pool 'FM4868', 2,000 %, fällig 11.01.2050	72	0,01
100 Fannie Mae Pool 'BS5964', 3,670 %, fällig 06.01.2032	99	0,01	228 Fannie Mae Pool 'FM4925', 3,000 %, fällig 11.01.2050	208	0,02
100 Fannie Mae Pool 'BS6002', 3,560 %, fällig 07.01.2032	98	0,01	238 Fannie Mae Pool 'FM5018', 2,500 %, fällig 12.01.2050	214	0,02
100 Fannie Mae Pool 'BS6023', 3,860 %, fällig 07.01.2032	100	0,01	105 Fannie Mae Pool 'FM5280', 3,500 %, fällig 10.01.2050	101	0,01
100 Fannie Mae Pool 'BS6084', 4,185 %, fällig 07.01.2032	103	0,01	56 Fannie Mae Pool 'FM5434', 4,500 %, fällig 05.01.2046	57	–
100 Fannie Mae Pool 'BS6103', 4,060 %, fällig 07.01.2032	102	0,01	114 Fannie Mae Pool 'FM5592', 4,000 %, fällig 12.01.2050	112	0,01
100 Fannie Mae Pool 'BS6130', 4,130 %, fällig 07.01.2032	102	0,01	234 Fannie Mae Pool 'FM5713', 2,500 %, fällig 02.01.2051	209	0,02
100 Fannie Mae Pool 'BS6147', 3,880 %, fällig 07.01.2032	100	0,01	213 Fannie Mae Pool 'FM5743', 2,500 %, fällig 02.01.2051	192	0,02
300 Fannie Mae Pool 'BS6149', 3,840 %, fällig 08.01.2032	300	0,02	56 Fannie Mae Pool 'FM5754', 3,500 %, fällig 03.01.2037	55	–
100 Fannie Mae Pool 'BS6169', 4,110 %, fällig 07.01.2032	103	0,01	509 Fannie Mae Pool 'FM5783', 3,000 %, fällig 06.01.2038	489	0,04
100 Fannie Mae Pool 'BS6188', 4,340 %, fällig 07.01.2032	104	0,01	267 Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, fällig 02.01.2051	241	0,02
200 Fannie Mae Pool 'BS6215', 3,840 %, fällig 07.01.2032	201	0,02	705 Fannie Mae Pool 'FM5931', 2,500 %, fällig 02.01.2051	635	0,05
275 Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500 %, fällig 07.01.2051	247	0,02	529 Fannie Mae Pool 'FM5944', 2,500 %, fällig 01.01.2051	474	0,04
194 Fannie Mae Pool 'BT0972', 2,500 %, fällig 05.01.2051	172	0,01	114 Fannie Mae Pool 'FM6015', 3,500 %, fällig 08.01.2039	112	0,01
361 Fannie Mae Pool 'BT3244', 2,500 %, fällig 07.01.2051	325	0,03	445 Fannie Mae Pool 'FM6134', 3,000 %, fällig 03.01.2040	427	0,03
92 Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500 %, fällig 08.01.2051	82	0,01	330 Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, fällig 03.01.2051	298	0,02
186 Fannie Mae Pool 'BT3290', 2,500 %, fällig 08.01.2051	167	0,01	2.641 Fannie Mae Pool 'FM6597', 2,000 %, fällig 03.01.2041	2.335	0,18
185 Fannie Mae Pool 'BT3303', 2,500 %, fällig 08.01.2051	167	0,01	179 Fannie Mae Pool 'FM6816', 2,500 %, fällig 04.01.2051	161	0,01
283 Fannie Mae Pool 'BU0051', 2,500 %, fällig 09.01.2051	253	0,02	361 Fannie Mae Pool 'FM6871', 2,500 %, fällig 04.01.2051	323	0,03
383 Fannie Mae Pool 'BU2599', 2,500 %, fällig 01.01.2052	345	0,03	103 Fannie Mae Pool 'FM7141', 4,000 %, fällig 02.01.2047	103	0,01
196 Fannie Mae Pool 'BU2630', 2,000 %, fällig 02.01.2052	169	0,01	2.049 Fannie Mae Pool 'FM7210', 2,000 %, fällig 04.01.2051	1.767	0,14
88 Fannie Mae Pool 'BU3608', 3,000 %, fällig 11.01.2051	82	0,01	367 Fannie Mae Pool 'FM7304', 2,500 %, fällig 05.01.2051	328	0,03
94 Fannie Mae Pool 'BU5925', 3,000 %, fällig 12.01.2051	88	0,01	147 Fannie Mae Pool 'FM7382', 3,000 %, fällig 05.01.2051	136	0,01
392 Fannie Mae Pool 'BV3089', 2,500 %, fällig 02.01.2052	353	0,03	1.694 Fannie Mae Pool 'FM7518', 2,500 %, fällig 06.01.2051	1.522	0,12
198 Fannie Mae Pool 'BV3167', 3,500 %, fällig 05.01.2052	191	0,02	479 Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, fällig 06.01.2051	431	0,03
196 Fannie Mae Pool 'BV4142', 3,000 %, fällig 03.01.2052	184	0,01	179 Fannie Mae Pool 'FM7676', 2,500 %, fällig 06.01.2051	161	0,01
193 Fannie Mae Pool 'BV5373', 2,500 %, fällig 04.01.2052	174	0,01	87 Fannie Mae Pool 'FM7727', 2,500 %, fällig 06.01.2051	79	0,01
391 Fannie Mae Pool 'BV5389', 3,000 %, fällig 04.01.2052	363	0,03	423 Fannie Mae Pool 'FM7741', 2,500 %, fällig 05.01.2051	380	0,03
976 Fannie Mae Pool 'BV7697', 2,500 %, fällig 04.01.2042	889	0,07	896 Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000 %, fällig 01.01.2049	888	0,07
692 Fannie Mae Pool 'BV8546', 3,500 %, fällig 05.01.2052	663	0,05	137 Fannie Mae Pool 'FM7796', 4,000 %, fällig 06.01.2048	136	0,01
99 Fannie Mae Pool 'BV9499', 4,000 %, fällig 04.01.2052	98	0,01	86 Fannie Mae Pool 'FM7869', 2,500 %, fällig 01.01.2051	78	0,01
100 Fannie Mae Pool 'BV9808', 4,000 %, fällig 05.01.2052	98	0,01	354 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, fällig 07.01.2051	318	0,03
100 Fannie Mae Pool 'BV9900', 4,000 %, fällig 05.01.2052	98	0,01	455 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, fällig 07.01.2051	411	0,03
300 Fannie Mae Pool 'BW1515', 4,000 %, fällig 07.01.2052	293	0,02	360 Fannie Mae Pool 'FM8025', 2,500 %, fällig 07.01.2051	325	0,03
395 Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500 %, fällig 07.01.2048	400	0,03	253 Fannie Mae Pool 'FM8166', 3,000 %, fällig 06.01.2051	238	0,02
658 Fannie Mae Pool 'CA2199', 4,500 %, fällig 08.01.2048	666	0,05	168 Fannie Mae Pool 'FM8171', 3,000 %, fällig 06.01.2051	157	0,01
555 Fannie Mae Pool 'CA2798', 4,500 %, fällig 12.01.2048	562	0,04	722 Fannie Mae Pool 'FM8210', 3,000 %, fällig 04.01.2050	676	0,05
296 Fannie Mae Pool 'CA4819', 4,000 %, fällig 12.01.2049	293	0,02	1.635 Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000 %, fällig 02.01.2050	1.544	0,12
404 Fannie Mae Pool 'CA5220', 3,000 %, fällig 02.01.2050	375	0,03	1.136 Fannie Mae Pool 'FM8577', 3,000 %, fällig 08.01.2051	1.069	0,08
537 Fannie Mae Pool 'CA5522', 4,000 %, fällig 04.01.2050	530	0,04	815 Fannie Mae Pool 'FM8669', 3,500 %, fällig 09.01.2047	790	0,06
493 Fannie Mae Pool 'CA7257', 2,500 %, fällig 10.01.2050	446	0,04	177 Fannie Mae Pool 'FM8685', 3,000 %, fällig 09.01.2051	164	0,01
152 Fannie Mae Pool 'CA8955', 2,500 %, fällig 02.01.2051	137	0,01	2.224 Fannie Mae Pool 'FM8786', 2,500 %, fällig 10.01.2051	2.000	0,16
87 Fannie Mae Pool 'CA9344', 3,000 %, fällig 02.01.2041	82	0,01	225 Fannie Mae Pool 'FM8813', 3,500 %, fällig 09.01.2051	216	0,02
87 Fannie Mae Pool 'CA9358', 2,500 %, fällig 03.01.2041	79	0,01	737 Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, fällig 10.01.2051	664	0,05
1.678 Fannie Mae Pool 'CA9390', 2,500 %, fällig 03.01.2051	1.503	0,12	182 Fannie Mae Pool 'FM8977', 2,500 %, fällig 09.01.2051	165	0,01
439 Fannie Mae Pool 'CB0100', 2,500 %, fällig 04.01.2041	404	0,03	437 Fannie Mae Pool 'FM9044', 3,000 %, fällig 10.01.2051	409	0,03
178 Fannie Mae Pool 'CB0101', 2,500 %, fällig 04.01.2041	163	0,01	187 Fannie Mae Pool 'FM9174', 2,000 %, fällig 10.01.2051	162	0,01
708 Fannie Mae Pool 'CB0114', 2,500 %, fällig 04.01.2041	647	0,05	178 Fannie Mae Pool 'FM9205', 2,500 %, fällig 04.01.2051	161	0,01
258 Fannie Mae Pool 'CB0414', 2,500 %, fällig 05.01.2051	231	0,02	1.484 Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000 %, fällig 11.01.2051	1.390	0,11
874 Fannie Mae Pool 'CB0458', 2,500 %, fällig 05.01.2051	785	0,06	469 Fannie Mae Pool 'FM9299', 2,000 %, fällig 10.01.2051	405	0,03
1.501 Fannie Mae Pool 'CB0470', 2,500 %, fällig 05.01.2041	1.373	0,11	278 Fannie Mae Pool 'FM9335', 2,500 %, fällig 10.01.2051	249	0,02
175 Fannie Mae Pool 'CB0517', 2,500 %, fällig 05.01.2051	157	0,01	279 Fannie Mae Pool 'FM9365', 3,000 %, fällig 11.01.2051	263	0,02
			2.618 Fannie Mae Pool 'FM9993', 3,500 %, fällig 07.01.2051	2.517	0,20

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
358 Fannie Mae Pool 'FS0024', 2,500 %, fällig 09.01.2051	323	0,03	1.966 Fannie Mae Pool 'MA4280', 1,500 %, fällig 03.01.2051	1.612	0,13
852 Fannie Mae Pool 'FS0028', 2,500 %, fällig 09.01.2051	766	0,06	5.080 Fannie Mae Pool 'MA4305', 2,000 %, fällig 04.01.2051	4.378	0,34
477 Fannie Mae Pool 'FS0034', 3,000 %, fällig 12.01.2051	449	0,04	178 Fannie Mae Pool 'MA4364', 2,000 %, fällig 06.01.2041	157	0,01
338 Fannie Mae Pool 'FS0037', 3,000 %, fällig 08.01.2051	318	0,03	196 Fannie Mae Pool 'MA4606', 2,000 %, fällig 05.01.2042	172	0,01
172 Fannie Mae Pool 'FS0041', 3,000 %, fällig 11.01.2050	161	0,01	1.674 Fannie Mae Pool 'MA4632', 3,000 %, fällig 06.01.2042	1.571	0,12
667 Fannie Mae Pool 'FS0240', 3,000 %, fällig 01.01.2052	628	0,05	196 Fannie Mae Pool 'MA4643', 3,000 %, fällig 05.01.2042	185	0,01
667 Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000 %, fällig 01.01.2052	619	0,05	80 Fannie Mae REMICS, Serie 2005 29, Klasse ZA, 5,500 %, fällig am 25.04.2035	85	0,01
1.252 Fannie Mae Pool 'FS0349', 2,000 %, fällig 01.01.2052	1.082	0,09	325 Fannie Mae REMICS, Serie 2011 59, Klasse NZ, 5,500 %, fällig am 25.07.2041	343	0,03
388 Fannie Mae Pool 'FS0352', 2,000 %, fällig 01.01.2052	335	0,03	83 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 133, Klasse CS, 3,706 %, fällig am 25.12.2042 *	11	–
93 Fannie Mae Pool 'FS0357', 3,000 %, fällig 12.01.2051	88	0,01	9 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 28, Klasse B, 6,500 %, fällig am 25.06.2039	9	–
287 Fannie Mae Pool 'FS0366', 2,500 %, fällig 01.01.2052	259	0,02	162 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 35, Klasse SC, 4,056 %, fällig am 25.04.2042 *	22	–
279 Fannie Mae Pool 'FS0408', 3,000 %, fällig 01.01.2052	262	0,02	43 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 46, Klasse BA, 6,000 %, fällig am 25.05.2042	46	–
1.059 Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, fällig 01.01.2052	954	0,08	65 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 51, Klasse B, 7,000 %, fällig am 25.05.2042	73	0,01
281 Fannie Mae Pool 'FS0434', 2,500 %, fällig 11.01.2051	254	0,02	57 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 74, Klasse SA, 4,206 %, fällig am 25.03.2042 *	4	–
187 Fannie Mae Pool 'FS0483', 3,500 %, fällig 01.01.2052	180	0,01	168 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse BC, 6,500 %, fällig am 25.07.2042	184	0,01
98 Fannie Mae Pool 'FS0504', 2,000 %, fällig 02.01.2042	86	0,01	212 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse CB, 5,500 %, fällig am 25.04.2042	222	0,02
390 Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000 %, fällig 02.01.2052	365	0,03	1.149 Fannie Mae REMICS, Serie 2016 23, Klasse ST, 3,556 %, fällig am 25.11.2045 *	143	0,01
1.059 Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500 %, fällig 02.01.2052	953	0,08	185 Fannie Mae REMICS, Serie 2016 61, Klasse BS, 3,656 %, fällig am 25.09.2046 *	15	–
95 Fannie Mae Pool 'FS0534', 2,500 %, fällig 07.01.2051	86	0,01	843 Fannie Mae REMICS, Serie 2017 76, Klasse SB, 3,656 %, fällig am 25.10.2057 *	105	0,01
289 Fannie Mae Pool 'FS0551', 2,500 %, fällig 02.01.2052	260	0,02	232 Fannie Mae REMICS, Serie 2017 85, Klasse SC, 3,756 %, fällig am 25.11.2047 *	26	–
293 Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, fällig 02.01.2052	264	0,02	627 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 47, Klasse GZ, 2,000 %, fällig am 25.07.2050	430	0,03
290 Fannie Mae Pool 'FS0583', 2,500 %, fällig 02.01.2052	261	0,02	1.700 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 56, Klasse AQ, 2,000 %, fällig am 25.08.2050	1.393	0,11
97 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 02.01.2052	84	0,01	735 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 56, Klasse DI, 2,500 %, fällig am 25.08.2050	119	0,01
2.411 Fannie Mae Pool 'FS0605', 2,500 %, fällig 02.01.2052	2.164	0,17	406 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 74, Klasse EI, 2,500 %, fällig am 25.10.2050	66	0,01
97 Fannie Mae Pool 'FS0612', 2,000 %, fällig 02.01.2052	84	0,01	2.240 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 89, Klasse DI, 2,500 %, fällig am 25.12.2050	334	0,03
485 Fannie Mae Pool 'FS1014', 2,000 %, fällig 02.01.2052	419	0,03	1.370 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 97, Klasse AI, 2,000 %, fällig am 25.01.2051	180	0,01
1.455 Fannie Mae Pool 'FS1015', 2,000 %, fällig 02.01.2052	1.257	0,10	2.204 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 3, Klasse QI, 2,500 %, fällig am 25.02.2051	326	0,03
3.690 Fannie Mae Pool 'FS1074', 3,000 %, fällig 03.01.2052	3.464	0,27	2.117 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 69, Klasse II, 2,500 %, fällig am 25.01.2049	314	0,02
373 Fannie Mae Pool 'FS1104', 2,500 %, fällig 11.01.2051	337	0,03	247 Fannie Mae-Aces, Serie 2013 M6, Klasse 1AC, 3,454 %, fällig am 25.02.2043 *	242	0,02
753 Fannie Mae Pool 'FS1107', 2,500 %, fällig 12.01.2051	677	0,05	800 Fannie Mae-Aces, Serie 2018 M15, Klasse 1A2, 3,700 %, fällig am 25.01.2036	777	0,06
1.468 Fannie Mae Pool 'FS1112', 2,000 %, fällig 03.01.2052	1.275	0,10	843 Fannie Mae-Aces, Serie 2018 M9, Klasse APT2, 3,218 %, fällig am 25.04.2028 *	817	0,06
292 Fannie Mae Pool 'FS1207', 3,500 %, fällig 03.01.2052	280	0,02	481 Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M19, Klasse A2, 2,560 %, fällig am 25.09.2029	449	0,04
872 Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000 %, fällig 03.01.2052	826	0,07	1.861 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M36, Klasse X1, 1,552 %, fällig am 25.09.2034 *	157	0,01
282 Fannie Mae Pool 'FS1403', 3,000 %, fällig 01.01.2045	268	0,02	65 Flagstar Mortgage Trust 2018-2, Serie 2018 2, Klasse A4, 144A, 3,500 %, fällig am 25.04.2048 *	64	0,01
395 Fannie Mae Pool 'FS1425', 3,500 %, fällig 05.01.2052	379	0,03	68 Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, fällig am 04.01.2038	65	0,01
393 Fannie Mae Pool 'FS1429', 3,500 %, fällig 04.01.2052	375	0,03	129 Freddie Mac Gold Pool 'G06409', 6,000 %, fällig am 11.01.2039	139	0,01
591 Fannie Mae Pool 'FS1454', 3,500 %, fällig 04.01.2052	567	0,04	14 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, fällig am 09.01.2039	14	–
576 Fannie Mae Pool 'FS1462', 3,500 %, fällig 01.01.2052	554	0,04	3 Freddie Mac Gold Pool 'G13888', 5,000 %, fällig am 06.01.2025	3	–
380 Fannie Mae Pool 'FS1539', 3,000 %, fällig 11.01.2048	361	0,03	1.389 Freddie Mac Gold Pool 'G60985', 3,000 %, fällig am 05.01.2047	1.316	0,10
392 Fannie Mae Pool 'FS1542', 3,000 %, fällig 04.01.2042	369	0,03	1.009 Freddie Mac Gold Pool 'G61637', 3,000 %, fällig am 09.01.2047	954	0,08
96 Fannie Mae Pool 'FS1553', 2,500 %, fällig 11.01.2050	86	0,01	879 Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000 %, fällig am 10.01.2046	835	0,07
490 Fannie Mae Pool 'FS1555', 3,500 %, fällig 04.01.2052	469	0,04	24 Freddie Mac Gold Pool 'Q19135', 4,000 %, fällig am 06.01.2043	24	–
2.065 Fannie Mae Pool 'FS1556', 3,500 %, fällig 05.01.2052	1.987	0,16	24 Freddie Mac Gold Pool 'Q19254', 4,000 %, fällig am 06.01.2043	24	–
98 Fannie Mae Pool 'FS1628', 2,500 %, fällig 04.01.2052	89	0,01	28 Freddie Mac Gold Pool 'Q19611', 4,000 %, fällig am 07.01.2043	28	–
96 Fannie Mae Pool 'FS1726', 2,000 %, fällig 09.01.2041	85	0,01	25 Freddie Mac Gold Pool 'Q19615', 4,000 %, fällig am 07.01.2043	25	–
597 Fannie Mae Pool 'FS1866', 3,500 %, fällig 05.01.2052	570	0,04	7 Freddie Mac Gold Pool 'Q27298', 4,000 %, fällig am 07.01.2044	7	–
1.871 Fannie Mae Pool 'FS1877', 3,000 %, fällig 05.01.2052	1.734	0,14			
882 Fannie Mae Pool 'FS1924', 2,500 %, fällig 03.01.2051	791	0,06			
1.564 Fannie Mae Pool 'FS1938', 2,500 %, fällig 02.01.2052	1.404	0,11			
291 Fannie Mae Pool 'FS1950', 4,000 %, fällig 05.01.2052	285	0,02			
1.286 Fannie Mae Pool 'FS2061', 4,000 %, fällig 06.01.2052	1.268	0,10			
1.093 Fannie Mae Pool 'FS2185', 4,000 %, fällig 06.01.2052	1.072	0,08			
400 Fannie Mae Pool 'FS2496', 4,500 %, fällig 08.01.2052	398	0,03			
499 Fannie Mae Pool 'FS2528', 1,500 %, fällig 01.01.2051	409	0,03			
1.300 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, fällig 06.01.2049	1.259	0,10			
11 Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, fällig 04.01.2031	11	–			
45 Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, fällig 05.01.2031	45	–			
13 Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, fällig 06.01.2031	13	–			
20 Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, fällig 11.01.2031	20	–			
20 Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, fällig 12.01.2031	20	–			
73 Fannie Mae Pool 'MA1146', 4,000 %, fällig 08.01.2042	73	0,01			
18 Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500 %, fällig 09.01.2042	18	–			
529 Fannie Mae Pool 'MA1217', 4,000 %, fällig 10.01.2042	527	0,04			
118 Fannie Mae Pool 'MA1253', 4,000 %, fällig 11.01.2042	117	0,01			
319 Fannie Mae Pool 'MA1283', 3,500 %, fällig 12.01.2042	311	0,02			
226 Fannie Mae Pool 'MA1437', 3,500 %, fällig 05.01.2043	220	0,02			
25 Fannie Mae Pool 'MA1547', 4,000 %, fällig 08.01.2043	25	–			
48 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, fällig 09.01.2043	48	–			
43 Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500 %, fällig 10.01.2043	43	–			
21 Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500 %, fällig 11.01.2043	21	–			
45 Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500 %, fällig 12.01.2043	45	–			
139 Fannie Mae Pool 'MA2110', 3,500 %, fällig 12.01.2034	138	0,01			
97 Fannie Mae Pool 'MA2138', 3,500 %, fällig 01.01.2035	97	0,01			
62 Fannie Mae Pool 'MA2320', 3,000 %, fällig 07.01.2035	60	–			
590 Fannie Mae Pool 'MA2523', 3,000 %, fällig 02.01.2036	567	0,04			
451 Fannie Mae Pool 'MA2579', 3,000 %, fällig 04.01.2036	433	0,03			
888 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, fällig 07.01.2036	852	0,07			
369 Fannie Mae Pool 'MA2707', 3,000 %, fällig 08.01.2036	354	0,03			
1.932 Fannie Mae Pool 'MA2773', 3,000 %, fällig 10.01.2036	1.856	0,15			
951 Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, fällig 12.01.2036	914	0,07			
241 Fannie Mae Pool 'MA4120', 2,500 %, fällig 09.01.2050	216	0,02			
465 Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000 %, fällig 10.01.2050	403	0,03			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
346			399		
Freddie Mac Gold Pool 'Q45560', 3,000 %, fällig am 01.01.2047	327	0,03	Freddie Mac Pool 'QE6418', 4,000 %, fällig am 07.01.2052	391	0,03
869			83		
Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000 %, fällig am 01.01.2047	824	0,06	Freddie Mac Pool 'QK0701', 2,500 %, fällig am 04.01.2041	76	0,01
242			392		
Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000 %, fällig am 01.01.2047	229	0,02	Freddie Mac Pool 'QK1449', 2,500 %, fällig am 04.01.2042	357	0,03
216			289		
Freddie Mac Gold Pool 'Q45827', 3,000 %, fällig am 01.01.2047	205	0,02	Freddie Mac Pool 'QK1512', 3,000 %, fällig am 05.01.2042	272	0,02
84			98		
Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, fällig am 10.01.2042	84	0,01	Freddie Mac Pool 'QU7914', 2,500 %, fällig am 07.01.2051	86	0,01
51			731		
Freddie Mac Gold Pool 'U91254', 4,000 %, fällig am 04.01.2043	50	–	Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000 %, fällig am 05.01.2049	690	0,05
22			117		
Freddie Mac Gold Pool 'U95137', 4,000 %, fällig am 08.01.2043	22	–	Freddie Mac Pool 'RA2358', 4,000 %, fällig am 03.01.2050	115	0,01
611			67		
Freddie Mac Gold Pool 'U99054', 4,000 %, fällig am 06.01.2043	611	0,05	Freddie Mac Pool 'RA2729', 2,500 %, fällig am 06.01.2050	60	–
6.582			180		
Freddie Mac Multifamily Structured Pass-Through Certificates K058, Klasse X1, 1,045 %, fällig am 25.08.2026 *	198	0,02	Freddie Mac Pool 'RA3474', 3,000 %, fällig am 09.01.2050	167	0,01
60			763		
Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,098 %, fällig am 01.03.2047 *	58	–	Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, fällig am 11.01.2050	661	0,05
1.815			2.154		
Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,008 %, fällig am 01.11.2048 *	1.762	0,14	Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, fällig am 11.01.2050	1.951	0,15
614			559		
Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 2,874 %, fällig am 01.11.2047 *	601	0,05	Freddie Mac Pool 'RA4142', 2,500 %, fällig am 12.01.2050	505	0,04
897			143		
Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,084 %, fällig am 01.02.2050 *	879	0,07	Freddie Mac Pool 'RA4349', 2,500 %, fällig am 01.01.2051	129	0,01
104			1.045		
Freddie Mac Pool 'QA5768', 3,000 %, fällig am 01.01.2050	96	0,01	Freddie Mac Pool 'RA4414', 2,500 %, fällig am 01.01.2051	941	0,07
48			72		
Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000 %, fällig am 01.01.2050	45	–	Freddie Mac Pool 'RA4527', 2,500 %, fällig am 02.01.2051	65	0,01
448			156		
Freddie Mac Pool 'QA7256', 3,000 %, fällig am 02.01.2050	416	0,03	Freddie Mac Pool 'RA4532', 2,500 %, fällig am 02.01.2051	141	0,01
132			1.368		
Freddie Mac Pool 'QA9685', 3,000 %, fällig am 05.01.2050	124	0,01	Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, fällig am 02.01.2051	1.184	0,09
62			3.094		
Freddie Mac Pool 'QB2667', 3,000 %, fällig am 08.01.2050	58	–	Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, fällig am 05.01.2051	2.679	0,21
69			1.965		
Freddie Mac Pool 'QB2927', 3,000 %, fällig am 09.01.2050	64	0,01	Freddie Mac Pool 'RA5155', 2,000 %, fällig am 05.01.2051	1.695	0,13
411			1.655		
Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, fällig am 11.01.2050	371	0,03	Freddie Mac Pool 'RA5276', 2,500 %, fällig am 05.01.2051	1.487	0,12
240			454		
Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, fällig am 11.01.2050	217	0,02	Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000 %, fällig am 06.01.2051	392	0,03
68			814		
Freddie Mac Pool 'QB5799', 2,500 %, fällig am 11.01.2050	61	–	Freddie Mac Pool 'RA5921', 2,500 %, fällig am 09.01.2051	729	0,06
239			251		
Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000 %, fällig am 02.01.2051	208	0,02	Freddie Mac Pool 'RA6212', 4,000 %, fällig am 12.01.2051	246	0,02
315			191		
Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig am 02.01.2051	274	0,02	Freddie Mac Pool 'RA6332', 2,000 %, fällig am 11.01.2051	165	0,01
151			564		
Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000 %, fällig am 02.01.2051	131	0,01	Freddie Mac Pool 'RA6562', 2,500 %, fällig am 01.01.2052	510	0,04
86			176		
Freddie Mac Pool 'QB9057', 2,000 %, fällig am 02.01.2051	75	0,01	Freddie Mac Pool 'RA6599', 3,500 %, fällig am 01.01.2052	169	0,01
1.352			484		
Freddie Mac Pool 'QB9087', 2,000 %, fällig am 02.01.2051	1.174	0,09	Freddie Mac Pool 'RA7378', 3,500 %, fällig am 05.01.2052	464	0,04
177			1.285		
Freddie Mac Pool 'QB9090', 2,000 %, fällig am 02.01.2051	153	0,01	Freddie Mac Pool 'RA7398', 4,000 %, fällig am 05.01.2052	1.261	0,10
243			2.108		
Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000 %, fällig am 03.01.2051	211	0,02	Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, fällig am 09.01.2041	1.863	0,15
163			992		
Freddie Mac Pool 'QB9484', 2,000 %, fällig am 03.01.2051	142	0,01	Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig am 10.01.2041	840	0,07
86			130		
Freddie Mac Pool 'QB9485', 2,000 %, fällig am 03.01.2051	74	0,01	Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, fällig am 11.01.2041	112	0,01
272			193		
Freddie Mac Pool 'QB9961', 2,000 %, fällig am 03.01.2051	235	0,02	Freddie Mac Pool 'RB5138', 2,000 %, fällig am 12.01.2041	167	0,01
231			1.061		
Freddie Mac Pool 'QC0160', 2,000 %, fällig am 03.01.2051	200	0,02	Freddie Mac Pool 'RB5145', 2,000 %, fällig am 02.01.2042	935	0,07
254			97		
Freddie Mac Pool 'QC0161', 2,000 %, fällig am 03.01.2051	219	0,02	Freddie Mac Pool 'SC0269', 2,000 %, fällig am 01.01.2042	86	0,01
284			127		
Freddie Mac Pool 'QC0297', 2,000 %, fällig am 04.01.2051	245	0,02	Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000 %, fällig am 07.01.2047	126	0,01
88			871		
Freddie Mac Pool 'QC0885', 2,000 %, fällig am 04.01.2051	77	0,01	Freddie Mac Pool 'SD0552', 2,000 %, fällig am 03.01.2051	752	0,06
162			236		
Freddie Mac Pool 'QC1164', 2,000 %, fällig am 04.01.2051	141	0,01	Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig am 04.01.2051	205	0,02
86			269		
Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500 %, fällig am 05.01.2051	78	0,01	Freddie Mac Pool 'SD0618', 3,000 %, fällig am 02.01.2051	251	0,02
280			464		
Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, fällig am 07.01.2051	252	0,02	Freddie Mac Pool 'SD0745', 2,000 %, fällig am 11.01.2051	402	0,03
182			4.031		
Freddie Mac Pool 'QC4818', 2,500 %, fällig am 08.01.2051	164	0,01	Freddie Mac Pool 'SD0777', 2,500 %, fällig am 11.01.2051	3.617	0,28
93			764		
Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, fällig am 08.01.2051	84	0,01	Freddie Mac Pool 'SD0809', 3,000 %, fällig am 01.01.2052	709	0,06
1.483			388		
Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, fällig am 08.01.2051	1.335	0,11	Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, fällig am 01.01.2052	350	0,03
189			285		
Freddie Mac Pool 'QC6303', 2,000 %, fällig am 09.01.2051	164	0,01	Freddie Mac Pool 'SD0926', 2,500 %, fällig am 07.01.2051	256	0,02
453			295		
Freddie Mac Pool 'QC6551', 2,500 %, fällig am 09.01.2051	408	0,03	Freddie Mac Pool 'SD0952', 3,000 %, fällig am 04.01.2052	276	0,02
185			98		
Freddie Mac Pool 'QC7127', 2,000 %, fällig am 09.01.2051	160	0,01	Freddie Mac Pool 'SD1035', 4,000 %, fällig am 05.01.2052	96	0,01
282			997		
Freddie Mac Pool 'QC7411', 2,500 %, fällig am 09.01.2051	254	0,02	Freddie Mac Pool 'SD1132', 4,000 %, fällig am 06.01.2052	978	0,08
385			5.459		
Freddie Mac Pool 'QC9154', 3,000 %, fällig am 10.01.2051	359	0,03	Freddie Mac Pool 'SD1143', 4,500 %, fällig am 09.01.2050	5.500	0,43
486			1.721		
Freddie Mac Pool 'QD0350', 2,000 %, fällig am 11.01.2051	419	0,03	Freddie Mac Pool 'SD1305', 5,000 %, fällig am 07.01.2052	1.752	0,14
391			699		
Freddie Mac Pool 'QD0652', 2,000 %, fällig am 11.01.2051	337	0,03	Freddie Mac Pool 'SD1345', 2,500 %, fällig am 10.01.2051	625	0,05
95			517		
Freddie Mac Pool 'QD1954', 3,000 %, fällig am 11.01.2051	88	0,01	Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, fällig am 11.01.2049	485	0,04
92			775		
Freddie Mac Pool 'QD2260', 3,000 %, fällig am 12.01.2051	85	0,01	Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, fällig am 10.01.2050	701	0,06
94			1.401		
Freddie Mac Pool 'QD4146', 2,500 %, fällig am 01.01.2052	84	0,01	Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, fällig am 02.01.2051	1.269	0,10
97			5.951		
Freddie Mac Pool 'QD5620', 2,000 %, fällig am 02.01.2052	83	0,01	Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig am 11.01.2051	5.362	0,42
97			127		
Freddie Mac Pool 'QD5628', 2,000 %, fällig am 02.01.2052	84	0,01	Freddie Mac Pool 'ZA5318', 3,500 %, fällig am 03.01.2048	123	0,01
97			1.138		
Freddie Mac Pool 'QD5960', 2,000 %, fällig am 02.01.2052	84	0,01	Freddie Mac Pool 'ZA6342', 4,500 %, fällig am 03.01.2049	1.152	0,09
97			108		
Freddie Mac Pool 'QD5961', 2,000 %, fällig am 02.01.2052	84	0,01	Freddie Mac Pool 'Z17269', 5,000 %, fällig am 03.01.2038	113	0,01
99			184		
Freddie Mac Pool 'QD6009', 2,000 %, fällig am 01.01.2052	85	0,01	Freddie Mac Pool 'ZM1278', 3,500 %, fällig am 06.01.2046	178	0,01
771			52		
Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, fällig am 02.01.2052	695	0,05	Freddie Mac Pool 'ZM5722', 3,500 %, fällig am 02.01.2048	51	–
194			51		
Freddie Mac Pool 'QD6093', 2,000 %, fällig am 02.01.2052	168	0,01	Freddie Mac Pool 'ZM0480', 3,500 %, fällig am 10.01.2042	50	–
195			3		
Freddie Mac Pool 'QD6139', 2,000 %, fällig am 02.01.2052	168	0,01	Freddie Mac Pool 'ZS0823', 5,000 %, fällig am 12.01.2034	3	–
99			6		
Freddie Mac Pool 'QD6142', 2,500 %, fällig am 02.01.2052	89	0,01	Freddie Mac Pool 'ZS2059', 5,500 %, fällig am 04.01.2038	6	–
295			20		
Freddie Mac Pool 'QD8675', 2,500 %, fällig am 03.01.2052	266	0,02	Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, fällig am 12.01.2038	21	–
397			91		
Freddie Mac Pool 'QE1075', 3,000 %, fällig am 04.01.2052	368	0,03	Freddie Mac Pool 'ZS3204', 5,000 %, fällig am 06.01.2041	95	0,01
195			56		
Freddie Mac Pool 'QE1492', 3,500 %, fällig am 05.01.2052	187	0,01	Freddie Mac Pool 'ZS3412', 5,500 %, fällig am 12.01.2038	59	–
94			117		
Freddie Mac Pool 'QE1689', 4,000 %, fällig am 05.01.2052	92	0,01	Freddie Mac Pool 'ZS8669', 3,000 %, fällig am 09.01.2032	114	0,01
395			122		
Freddie Mac Pool 'QE2057', 3,500 %, fällig am 05.01.2052	378	0,03	Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000 %, fällig am 10.01.2032	119	0,01
299			25		
Freddie Mac Pool 'QE4026', 4,000 %, fällig am 06.01.2052	293	0,02	Freddie Mac Pool 'ZS8779', 5,000 %, fällig am 07.01.2025	25	–
594			606		
Freddie Mac Pool 'QE4043', 3,000 %, fällig am 06.01.2052	551	0,04	Freddie Mac Pool 'ZS9316', 3,500 %, fällig am 01.01.2038	597	0,05
300			270		
Freddie Mac Pool 'QE5811', 4,000 %, fällig am 07.01.2052	293	0,02	Freddie Mac Pool 'ZT1107', 3,500 %, fällig am 03.01.2043	264	0,02
			25		
			Freddie Mac Pool 'ZT1159', 3,500 %, fällig am 02.01.2044	24	–
			362		
			Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, fällig am 01.01.2046	344	0,03
			775		
			Freddie Mac Pool 'ZT1493', 3,000 %, fällig am 09.01.2048	731	0,06
			680		
			Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500 %, fällig am 04.01.2033	670	0,05
			57		

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
442			123		
Freddie Mac REMICS 5013, Klasse IN, 2,500 %, fällig am 25.09.2050	65	0,01	Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000 %, fällig am 20.11.2046	117	0,01
883			93		
Freddie Mac REMICS 5018, Klasse MI, 2,000 %, fällig am 25.10.2050	123	0,01	Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, fällig am 20.02.2047	89	0,01
231			23		
Freddie Mac REMICS 5040, Klasse IB, 2,500 %, fällig am 25.11.2050	35	–	Ginnie Mae II Pool 'MA4381', 3,000 %, fällig am 20.04.2047	22	–
1.434			1.591		
Freddie Mac REMICS 5059, Klasse IB, 2,500 %, fällig am 25.01.2051	236	0,02	Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, fällig am 20.06.2047	1.586	0,12
493			280		
Freddie Mac REMICS 5069, Klasse MI, 2,500 %, fällig am 25.02.2051	75	0,01	Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500 %, fällig am 20.08.2047	286	0,02
1.323			17		
Freddie Mac REMICS 5140, Klasse NI, 2,500 %, fällig am 25.05.2049	180	0,01	Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000 %, fällig am 20.11.2047	16	–
1.200			632		
Freddie Mac REMICS 5224, Klasse HL, 4,000 %, fällig am 25.04.2052	1.158	0,09	Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, fällig am 20.11.2047	631	0,05
836			177		
Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Serie 2020 DNA2, Klasse M2, 144A, 4,294 %, fällig am 25.02.2050 *	838	0,07	Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000 %, fällig am 20.12.2047	168	0,01
1.640			271		
Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA6, Serie 2020 DNA6, Klasse M2, 144A, 4,183 %, fällig am 25.12.2050 *	1.641	0,13	Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, fällig am 20.12.2047	271	0,02
45			239		
Freddie Mac Strips 334, Klasse S7, 3,709 %, fällig am 15.08.2044 *	5	–	Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, fällig am 20.02.2048	239	0,02
373			177		
Freddie Mac Strips 353, Klasse S1, 3,609 %, fällig am 15.12.2046 *	42	–	Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, fällig am 20.03.2048	177	0,01
1.306			230		
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2015 HQ2, Klasse B, 10,394 %, fällig am 25.05.2025 *	1.332	0,10	Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000 %, fällig am 20.04.2048	228	0,02
31			423		
Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, fällig 15.04.2040	32	–	Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500 %, fällig am 20.04.2048	428	0,03
54			510		
Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, fällig 15.05.2040	57	–	Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, fällig am 20.05.2048	515	0,04
56			163		
Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000 %, fällig 15.09.2042	53	–	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, fällig am 20.07.2048	165	0,01
420			320		
Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15.06.2048	416	0,03	Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, fällig am 20.10.2048	320	0,03
82			185		
Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15.09.2042	78	0,01	Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000 %, fällig am 20.11.2048	189	0,01
182			142		
Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15.09.2042	173	0,01	Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, fällig am 20.12.2048	143	0,01
404			226		
Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15.10.2042	384	0,03	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, fällig am 20.03.2049	227	0,02
255			208		
Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, fällig 15.10.2042	243	0,02	Ginnie Mae II Pool 'MA5819', 5,000 %, fällig am 20.03.2049	212	0,02
2			106		
Ginnie Mae I Pool 'AB9205', 3,000 %, fällig 15.11.2042	1	–	Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, fällig am 20.04.2049	107	0,01
221			360		
Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, fällig 15.11.2042	211	0,02	Ginnie Mae II Pool 'MA6342', 5,000 %, fällig am 20.12.2049	369	0,03
18			224		
Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500 %, fällig am 20.10.2037	19	–	Ginnie Mae II Pool 'MA6413', 5,000 %, fällig am 20.01.2050	229	0,02
22			198		
Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500 %, fällig am 20.10.2040	22	–	Ginnie Mae II Pool 'MA6603', 5,000 %, fällig am 20.04.2050	203	0,02
25			503		
Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500 %, fällig am 20.05.2040	26	–	Ginnie Mae II Pool 'MA6999', 4,500 %, fällig am 20.11.2050	508	0,04
84			94		
Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000 %, fällig am 20.07.2040	88	0,01	Ginnie Mae II Pool 'MA7056', 4,500 %, fällig am 20.12.2050	95	0,01
16			3.026		
Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000 %, fällig am 20.08.2040	17	–	Ginnie Mae II Pool 'MA7589', 2,500 %, fällig am 20.09.2051	2.767	0,22
11			4.724		
Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000 %, fällig am 20.09.2040	12	–	Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, fällig am 20.09.2051	4.455	0,35
7			838		
Ginnie Mae II Pool '4871', 6,000 %, fällig am 20.11.2040	7	–	Ginnie Mae II Pool 'MA7649', 2,500 %, fällig am 20.10.2051	766	0,06
22			5.758		
Ginnie Mae II Pool '4905', 6,000 %, fällig am 20.12.2040	23	–	Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500 %, fällig am 20.02.2052	5.561	0,44
4			5.800		
Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000 %, fällig 20.01.2041	4	–	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 % ±	5.287	0,42
16			8.400		
Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, fällig 20.02.2041	17	–	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ±	7.888	0,62
184			3.500		
Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, fällig 20.03.2041	188	0,01	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,500 % ±	3.376	0,27
5			3.300		
Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000 %, fällig am 20.07.2040	5	–	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,000 % ±	3.253	0,26
56			2.600		
Ginnie Mae II Pool '783368', 4,500 %, fällig am 20.07.2041	57	–	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,500 % ±	2.601	0,20
117			200		
Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, fällig 20.01.2046	115	0,01	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 % ±	203	0,02
1.299			208		
Ginnie Mae II Pool '784674', 3,500 %, fällig am 20.04.2048	1.260	0,10	Government National Mortgage Association, Serie 2009 H01, Klasse FA, 3,518 %, fällig am 20.11.2059 *	209	0,02
97			5		
Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, fällig 20.10.2049	93	0,01	Government National Mortgage Association, Serie 2010 42, Klasse BS, 4,112 %, fällig am 20.04.2040 *	1	–
455			2		
Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, fällig 20.01.2050	427	0,03	Government National Mortgage Association, Serie 2010 85, Klasse HS, 4,282 %, fällig am 20.01.2040 *	–	–
83			375		
Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500 %, fällig 20.09.2048	81	0,01	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H11, Klasse FA, 3,300 %, fällig am 20.06.2060 *	376	0,03
1.471			353		
Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000 %, fällig 20.02.2052	1.387	0,11	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H20, Klasse AF, 2,128 %, fällig am 20.10.2060 *	350	0,03
384			4		
Ginnie Mae II Pool '786077', 3,000 %, fällig 20.03.2052	362	0,03	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H22, Klasse FE, 2,148 %, fällig am 20.05.2059 *	4	–
489			549		
Ginnie Mae II Pool '786082', 3,000 %, fällig am 20.11.2051	461	0,04	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H24, Klasse FA, 2,148 %, fällig am 20.10.2060 *	545	0,04
691			24		
Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000 %, fällig 20.04.2052	641	0,05	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H26, Klasse LF, 2,138 %, fällig am 20.08.2058 *	24	–
295			209		
Ginnie Mae II Pool '786107', 3,000 %, fällig 20.03.2052	278	0,02	Government National Mortgage Association, Serie 2011 H01, Klasse AF, 2,248 %, fällig am 20.11.2060 *	207	0,02
296			46		
Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500 %, fällig 20.03.2052	284	0,02	Government National Mortgage Association, Serie 2011 H09, Klasse AF, 2,298 %, fällig am 20.03.2061 *	46	–
1.083			316		
Ginnie Mae II Pool '786134', 3,000 %, fällig 20.04.2052	1.009	0,08	Government National Mortgage Association, Serie 2013 107, Klasse AD, 2,849 %, fällig am 16.11.2047 *	298	0,02
598			5.636		
Ginnie Mae II Pool '786216', 3,500 %, fällig am 20.06.2052	577	0,05	Government National Mortgage Association, Serie 2013 50, Klasse IO, 0,068 %, fällig am 16.10.2048 *	13	–
902			904		
Ginnie Mae II Pool 'AP6338', 4,000 %, fällig am 20.10.2045	900	0,07	Government National Mortgage Association, Serie 2014 169, Klasse IO, 0,631 %, fällig am 16.10.2056 *	22	–
241			38		
Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500 %, fällig 20.10.2047	234	0,02	Government National Mortgage Association, Serie 2014 17, Klasse AM, 3,537 %, fällig am 16.06.2048 *	37	–
183			232		
Ginnie Mae II Pool 'BD0384', 3,500 %, fällig 20.10.2047	177	0,01	Government National Mortgage Association, Serie 2014 176, Klasse IA, 4,000 %, fällig am 20.11.2044	41	–
96			1.947		
Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, fällig 20.02.2050	93	0,01	Government National Mortgage Association, Serie 2014 H20, Klasse FA, 2,228 %, fällig am 20.10.2064 *	1.931	0,15
114			519		
Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000 %, fällig am 20.10.2049	114	0,01	Government National Mortgage Association, Serie 2015 167, Klasse OI, 4,000 %, fällig am 16.04.2045	90	0,01
87			842		
Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000 %, fällig am 20.11.2049	85	0,01	Government National Mortgage Association, Serie 2015 183, Klasse IO, 0,541 %, fällig am 16.09.2057 *	23	–
96			211		
Ginnie Mae II Pool 'BS1728', 4,000 %, fällig am 20.01.2050	97	0,01	Government National Mortgage Association, Serie 2016 135, Klasse SB, 3,713 %, fällig am 16.10.2046 *	37	–
86			859		
Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, fällig 20.02.2050	87	0,01	Government National Mortgage Association, Serie 2016 21, Klasse ST, 3,782 %, fällig am 20.02.2046 *	118	0,01
350			400		
Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000 %, fällig am 20.03.2050	329	0,03	Government National Mortgage Association, Serie 2016 84, Klasse IG, 4,500 %, fällig am 16.11.2045	82	0,01
99			948		
Ginnie Mae II Pool 'C11513', 3,500 %, fällig am 20.03.2052	92	0,01	Government National Mortgage Association, Serie 2017 111, Klasse IO, 0,527 %, fällig am 16.02.2059 *	34	–
199			942		
Ginnie Mae II Pool 'CL5523', 3,000 %, fällig am 20.04.2052	184	0,01	Government National Mortgage Association, Serie 2017 157, Klasse IO, 0,503 %, fällig am 16.12.2059 *	33	–
167			976		
Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, fällig am 20.06.2044	163	0,01	Government National Mortgage Association, Serie 2017 28, Klasse IO, 0,659 %, fällig am 16.02.2057 *	38	–
45					
Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500 %, fällig am 20.03.2045	44	–			
70					
Ginnie Mae II Pool 'MA3375', 3,000 %, fällig am 20.01.2046	66	0,01			
59					
Ginnie Mae II Pool 'MA3521', 3,500 %, fällig am 20.03.2046	58	–			
267					
Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, fällig am 20.04.2046	261	0,02			
144					
Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, fällig am 20.05.2046	140	0,01			
244					
Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, fällig am 20.06.2046	239	0,02			
148					
Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, fällig am 20.07.2046	144	0,01			
90					
Ginnie Mae II Pool 'MA3937', 3,500 %, fällig am 20.09.2046	88	0,01			

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
627	20	–	30	30	–
109	7	–	160	152	0,01
4.402	185	0,01	72	36	–
57	3	–	16	16	–
390	388	0,03	20	10	–
679	676	0,05	1.832	1.360	0,11
326	309	0,02	280	261	0,02
1.503	1.251	0,10	2.870	2.719	0,21
336	49	–	398	377	0,03
997	147	0,01	763	739	0,06
492	72	0,01	1.017	889	0,07
428	63	0,01	119	114	0,01
16.418	1.149	0,09	5	5	–
262	39	–	2.694	2.652	0,21
338	50	–	690	658	0,05
1.481	216	0,02	77.405	3.126	0,25
1.606	207	0,02	1.724	1.655	0,13
12.471	1.212	0,10	182	164	0,01
3.220	352	0,03	94	91	0,01
859	136	0,01	20	19	–
308	48	–	250	239	0,02
857	863	0,07	160	153	0,01
194	196	0,02	5.166	215	0,02
105	103	0,01	2.330	2.261	0,18
405	397	0,03	2.010	1.919	0,15
112	110	0,01	Summe Mortgage-Backed Securities (Anschaffungskosten 432.236 USD)	402.536	31,70
974	786	0,06	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 38,79 % (28. Februar 2022: 32,53 %)		
1.946	1.586	0,12	Australien — 0,26 % (28. Februar 2022: 0,21 %)		
26.582	2.139	0,17	300	305	0,02
1.500	1.483	0,12	200	176	0,01
1.781	102	0,01	210	202	0,02
200	187	0,01	10	10	–
2.926	2.529	0,20	2.270	2.255	0,18
2.217	1.771	0,14	430	413	0,03
80	79	0,01		3.361	0,26
882	10	–	Belgien — 0,55 % (28. Februar 2022: 0,36 %)		
16	16	–	1.990	1.957	0,15
3.980	752	0,06	1.220	1.160	0,09
4.070	3.323	0,26	680	673	0,05
1.929	1.877	0,15	280	263	0,02
189	176	0,01	1.610	1.467	0,12
			210	191	0,02
			1.060	1.105	0,09

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — (Fortsetzung)					
530			500		
Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	430	0,03	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	439	0,03
280			600		
Bank of America Corp, 3,300 %, fällig am 01.11.2023	280	0,02	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.03.2042	415	0,03
264			260		
Bank of America Corp, 3,004 %, fällig am 20.12.2023 *	263	0,02	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, fällig 23.10.2045	249	0,02
680			70		
Bank of America Corp, 3,550 %, fällig am 05.03.2024 *	677	0,05	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.05.2047	60	0,01
330			1.000		
Bank of America Corp, 4,000 %, fällig am 04.01.2024	331	0,03	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	892	0,07
520			240		
Bank of America Corp, 4,200 %, fällig am 26.08.2024	519	0,04	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	195	0,02
470			210		
Bank of America Corp, 4,000 %, fällig am 22.01.2025	466	0,04	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	165	0,01
130			440		
Bank of America Corp, 4,450 %, fällig am 03.03.2026	130	0,01	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, fällig 01.04.2063	369	0,03
830			400		
Bank of America Corp, 3,500 %, fällig am 19.04.2026	808	0,06	Cheniere Energy Inc, 4,625 %, fällig 15.10.2028	386	0,03
1.510			130		
Bank of America Corp, 1,319 %, fällig am 19.06.2026 *	1.374	0,11	Cheniere Energy Partners LP, 4,000 %, fällig am 01.03.2031	114	0,01
1.550			690		
Bank of America Corp, 4,250 %, fällig am 22.10.2026	1.528	0,12	Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig am 31.01.2032	553	0,04
1.600			700		
Bank of America Corp, 4,376 %, fällig am 27.04.2028 *	1.560	0,12	Chevron Corp, 1,554 %, fällig 11.05.2025	661	0,05
940			340		
Bank of America Corp, 3,593 %, fällig am 21.07.2028 *	886	0,07	Chevron Corp, 2,954 %, fällig 16.05.2026	330	0,03
1.770			240		
Bank of America Corp, 3,419 %, fällig am 20.12.2028 *	1.640	0,13	Chevron Corp, 1,995 %, fällig 11.05.2027	222	0,02
4.250			80		
Bank of America Corp, 3,970 %, fällig am 05.03.2029 *	4.026	0,32	Chevron Corp, 3,078 %, fällig 11.05.2050	64	0,01
1.800			950		
Bank of America Corp, 3,974 %, fällig am 07.02.2030 *	1.690	0,13	Chevron USA Inc, 3,850 %, fällig 15.01.2028	940	0,07
1.500			140		
Bank of America Corp, 2,884 %, fällig am 22.10.2030 *	1.304	0,10	Chubb INA Holdings Inc, 3,350 %, fällig 03.05.2026	137	0,01
3.090			232		
Bank of America Corp, 2,572 %, fällig am 20.10.2032 *	2.528	0,20	Cigna Corp, 3,750 %, fällig 15.07.2023	232	0,02
1.870			290		
Bank of America Corp, 2,972 %, fällig am 04.02.2033 *	1.573	0,12	Cigna Corp, 4,125 %, fällig 15.11.2025	288	0,02
560			3.510		
Bank of America Corp, 4,330 %, fällig am 15.03.2050 *	502	0,04	Cigna Corp, 4,375 %, fällig 15.10.2028	3.459	0,27
2.260			110		
Bank of America Corp, 4,083 %, fällig am 20.03.2051 *	1.942	0,15	Cigna Corp, 4,900 %, fällig 15.12.2048	105	0,01
380			90		
Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600 %, fällig 24.04.2025	358	0,03	Cigna Corp, 3,400 %, fällig 15.03.2050	68	0,01
30			270		
Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.11.2025	25	–	Cintas Corp No. 2, 3,700 %, fällig am 01.04.2027	266	0,02
435			300		
Becton Dickinson und Co, 3,363 %, fällig am 06.06.2024	430	0,03	Cintas Corp No. 2, 4,000 %, fällig am 01.05.2032	294	0,02
26			250		
Becton Dickinson und Co, 3,734 %, fällig am 15.12.2024	26	–	Citigroup Inc, 3,500 %, fällig am 15.05.2023	249	0,02
487			680		
Becton Dickinson und Co, 4,685 %, fällig am 15.12.2044	462	0,04	Citigroup Inc, 1,678 %, fällig am 15.05.2024 *	668	0,05
600			330		
Becton Dickinson und Co, 4,669 %, fällig am 06.06.2047	573	0,05	Citigroup Inc, 3,300 %, fällig am 27.04.2025	322	0,03
1.330			440		
Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	1.256	0,10	Citigroup Inc, 4,400 %, fällig 10.06.2025	438	0,03
2.010			220		
Boeing Co/The, 4,875 %, fällig am 01.05.2025	2.016	0,16	Citigroup Inc, 5,500 %, fällig am 13.09.2025	226	0,02
680			490		
Boeing Co/The, 2,196 %, fällig am 04.02.2026	623	0,05	Citigroup Inc, 3,106 %, fällig 08.04.2026 *	471	0,04
150			110		
Boeing Co/The, 3,100 %, fällig am 01.05.2026	142	0,01	Citigroup Inc, 4,300 %, fällig am 20.11.2026	109	0,01
320			2.130		
Boeing Co/The, 2,700 %, fällig am 01.02.2027	290	0,02	Citigroup Inc, 4,450 %, fällig am 29.09.2027	2.078	0,16
200			450		
Boeing Co/The, 2,800 %, fällig am 01.03.2027	182	0,01	Citigroup Inc, 4,658 %, fällig am 24.05.2028 *	444	0,04
690			60		
Boeing Co/The, 3,200 %, fällig am 01.03.2029	610	0,05	Citigroup Inc, 4,125 %, fällig am 25.07.2028	57	–
1.780			1.360		
Boeing Co/The, 5,150 %, fällig am 01.05.2030	1.754	0,14	Citigroup Inc, 3,520 %, fällig am 27.10.2028 *	1.263	0,10
2.220			1.750		
Boeing Co/The, 3,250 %, fällig am 01.05.2035	1.710	0,14	Citigroup Inc, 4,075 %, fällig am 23.09.2029 *	1.667	0,13
180			2.300		
Boeing Co/The, 3,550 %, fällig am 01.03.2038	136	0,01	Citigroup Inc, 3,980 %, fällig am 20.03.2030 *	2.153	0,17
810			1.590		
Boeing Co/The, 5,705 %, fällig am 01.05.2040	774	0,06	Citigroup Inc, 4,412 %, fällig am 31.03.2031 *	1.519	0,12
1.290			1.120		
Boeing Co/The, 3,750 %, fällig am 01.02.2050	927	0,07	Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	937	0,07
1.870			1.680		
Boeing Co/The, 5,805 %, fällig am 01.05.2050	1.797	0,14	Citigroup Inc, 2,520 %, fällig 03.11.2032 *	1.359	0,11
20			1.150		
Boeing Co/The, 5,930 %, fällig am 01.05.2060	19	–	Citigroup Inc, 3,785 %, fällig am 17.03.2033 *	1.035	0,08
330			540		
BP Capital Markets America Inc, 3,410 %, fällig am 11.02.2026	324	0,03	Citigroup Inc, 4,910 %, fällig am 24.05.2033 *	529	0,04
1.150			1.456		
BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, fällig am 04.05.2026	1.114	0,09	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig am 15.07.2039	1.905	0,15
440			255		
BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig am 06.04.2030	417	0,03	Citigroup Inc, 5,300 %, fällig 06.05.2044	249	0,02
1.400			390		
BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig am 24.02.2050	1.024	0,08	Citigroup Inc, Serie P, 5,950 %, fortwährend *	374	0,03
43			90		
Brighthouse Financial Inc, 4,700 %, fällig 22.06.2047	34	–	Citigroup Inc, Serie M, 6,300 %, unbefristet *	87	0,01
881			100		
Bristol-Myers Squibb Co, 2,900 %, fällig 26.07.2024	870	0,07	Citigroup Inc, 5,950 %, fortwährend *	99	0,01
532			720		
Bristol-Myers Squibb Co, 3,200 %, fällig 15.06.2026	522	0,04	Coca-Cola Co/The, 3,375 %, fällig 25.03.2027	712	0,06
705			670		
Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	673	0,05	Coca-Cola Co/The, 1,450 %, fällig 01.06.2027	606	0,05
2.120			20		
Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	1.608	0,13	Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	15	–
110			280		
Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, fällig am 01.02.2032	88	0,01	Coca-Cola Co/The, 2,600 %, fällig 01.06.2050	204	0,02
630			130		
Cameron LNG LLC, 144A, 2,902 %, fällig am 15.07.2031	554	0,04	Comcast Corp, 3,950 %, fällig 15.10.2025	130	0,01
850			640		
Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig am 15.01.2035	722	0,06	Comcast Corp, 3,150 %, fällig 01.03.2026	623	0,05
30			280		
Carrier Global Corp, 2,700 %, fällig 15.02.2031	26	–	Comcast Corp, 3,300 %, fällig 01.04.2027	271	0,02
50			2.140		
Carrier Global Corp, 3,577 %, fällig 05.04.2050	38	–	Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	2.123	0,17
370			390		
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig am 15.08.2030	59	–	Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	365	0,03
1.870			1.660		
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig am 01.05.2032	307	0,02	Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	1.635	0,13
360			60		
Centene Corp, 4,250 %, fällig am 15.12.2027	342	0,03	Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2033	58	–
520			60		
Centene Corp, 4,625 %, fällig am 15.12.2029	491	0,04	Comcast Corp, 5,650 %, fällig 15.06.2035	64	0,01
290			13		
Centene Corp, 3,375 %, fällig am 15.02.2030	249	0,02	Comcast Corp, 6,500 %, fällig 15.11.2035	15	–
50			1.540		
Centene Corp, 3,000 %, fällig am 15.10.2030	42	–	Comcast Corp, 3,900 %, fällig 01.03.2038	1.386	0,11
60			400		
Comcast Corp, 2,625 %, fällig 01.08.2031	48	–	Comcast Corp, 3,250 %, fällig 01.11.2039	326	0,03
2.210			300		
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	2.203	0,17	Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	261	0,02
1.550			80		
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	1.463	0,12	Comcast Corp, 3,400 %, fällig 15.07.2046	62	0,01
1.200			120		
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	1.157	0,09	Comcast Corp, 4,000 %, fällig 15.08.2047	104	0,01
760			224		
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, fällig 01.04.2033	673	0,05	Comcast Corp, 3,969 %, fällig 01.11.2047	193	0,02

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — (Fortsetzung)					
110 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 01.03.2048	95	0,01	130 Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, fällig am 15.02.2040	135	0,01
293 Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01.11.2049	251	0,02	640 Duke Energy Ohio Inc, 3,650 %, fällig am 01.02.2029	611	0,05
200 Comcast Corp, 3,450 %, fällig 01.02.2050	158	0,01	660 Eaton Corp, 2,750 %, fällig 02.11.2022	660	0,05
400 Comcast Corp, 2,800 %, fällig 15.01.2051	277	0,02	420 Eaton Corp, 4,150 %, fällig 02.11.2042	377	0,03
619 Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	437	0,03	36 El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, fällig am 15.06.2032	43	–
66 Comcast Corp, 4,049 %, fällig 01.11.2052	57	–	530 Elevance Health Inc, 2,950 %, fällig am 01.12.2022	529	0,04
477 Comcast Corp, 2,937 %, fällig 01.11.2056	324	0,03	200 Elevance Health Inc, 3,350 %, fällig am 01.12.2024	197	0,02
100 Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	98	0,01	730 Elevance Health Inc, 3,650 %, fällig am 01.12.2027	708	0,06
74 Comcast Corp, 2,987 %, fällig 01.11.2063	50	–	840 Elevance Health Inc, 4,100 %, fällig 15.05.2032	809	0,06
20 CommonSpirit Health, 4,350 %, fällig am 01.11.2042	18	–	360 Elevance Health Inc, 4,550 %, fällig 15.05.2052	339	0,03
300 CommScope Inc, 144A, 6,000 %, fällig am 01.03.2026	284	0,02	10 Energy Transfer LP, 7,600 %, fällig am 02.01.2024	10	–
130 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 01.09.2029	111	0,01	800 Energy Transfer LP, 4,500 %, fällig am 15.04.2024	798	0,06
85 ConocoPhillips Co, 6,950 %, fällig am 15.04.2029	97	0,01	210 Energy Transfer LP, 4,950 %, fällig am 15.06.2028	207	0,02
240 Consolidated Edison Co of New York Inc, Serie 20A, 3,350 %, fällig am 01.04.2030	226	0,02	530 Energy Transfer LP, 5,250 %, fällig am 15.04.2029	517	0,04
190 Consolidated Edison Co von New York Inc, Serie 20B, 3,950 %, fällig am 01.04.2050	165	0,01	1.530 Energy Transfer LP, 3,750 %, fällig am 15.05.2030	1.376	0,11
330 Constellation Brands Inc, 3,600 %, fällig am 09.05.2024	327	0,03	60 Energy Transfer LP, 5,300 %, fällig am 04.01.2044	53	–
640 Constellation Brands Inc, 4,750 %, fällig 15.11.2024	649	0,05	980 Energy Transfer LP, 5,400 %, fällig am 10.01.2047	875	0,07
450 Constellation Brands Inc, 4,350 %, fällig am 09.05.2027	449	0,04	750 Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig am 15.04.2049	736	0,06
300 Continental Resources Inc/OK, 4,500 %, fällig am 15.04.2023	300	0,02	300 Energy Transfer LP, Serie H, 6,500 %, fortwährend *	278	0,02
130 Continental Resources Inc/OK, 3,800 %, fällig am 01.06.2024	128	0,01	140 Energy Transfer LP, Serie A, 6,250 %, fortwährend*	117	0,01
290 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,268 %, fällig am 15.11.2026	256	0,02	650 Energy Transfer LP, Serie F, 6,750 %, fortwährend*	592	0,05
1.160 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15.01.2028	1.094	0,09	680 Energy Transfer LP, Serie G, 7,125 %, fortwährend*	620	0,05
390 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig am 15.01.2031	374	0,03	1.080 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig am 16.10.2028	1.060	0,08
100 Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, fällig am 01.06.2044	79	0,01	900 Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig am 31.01.2030	793	0,06
1.020 Costco Wholesale Corp, 1,375 %, fällig 20.06.2027	916	0,07	2.150 Enterprise Products Operating LLC, 4,200 %, fällig am 31.01.2050	1.827	0,14
340 Costco Wholesale Corp, 1,600 %, fällig am 20.04.2030	287	0,02	420 Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, fällig am 31.01.2051	330	0,03
210 Coterra Energy Inc, 144A, 4,375 %, fällig am 01.06.2024	209	0,02	90 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig am 31.01.2060	70	0,01
1.790 Coterra Energy Inc, 144A, 3,900 %, fällig 15.05.2027	1.709	0,13	220 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig am 15.02.2078 *	181	0,01
560 Coterra Energy Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.03.2029	539	0,04	240 EOG Resources Inc, 4,150 %, fällig 15.01.2026	240	0,02
300 CSC Funding LLC, 144A, 4,125 %, fällig am 01.12.2030	244	0,02	190 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	190	0,02
200 CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, fällig 15.02.2031	150	0,01	690 EOG Ressourcen Inc, 3,900 %, fällig am 01.04.2035	636	0,05
510 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	410	0,03	180 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	187	0,02
130 CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 144A, 3,875 %, fällig am 30.06.2028	110	0,01	50 EQM Midstream Partners LP, 5,500 %, fällig am 15.07.2028	46	–
220 CVS Health Corp, 2,750 %, fällig 01.12.2022	220	0,02	50 EQT Corp, 6,125 %, fällig 01.02.2025	51	–
761 CVS Health Corp, 3,875 %, fällig 20.07.2025	756	0,06	20 EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15.05.2026	19	–
220 CVS Health Corp, 3,625 %, fällig 01.04.2027	214	0,02	1.450 EQT Corp, 3,900 %, fällig 01.10.2027	1.375	0,11
268 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	265	0,02	200 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2029	196	0,02
530 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	499	0,04	420 EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.05.2031	371	0,03
160 CVS Health Corp, 1,875 %, fällig 28.02.2031	129	0,01	60 Exxon Mobil Corp, 1,571 %, fällig 15.04.2023	59	0,01
830 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15.09.2031	677	0,05	1.700 Exxon Mobil Corp, 2,992 %, fällig 19.03.2025	1.664	0,13
400 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	381	0,03	180 Exxon Mobil Corp, 3,043 %, fällig 01.03.2026	175	0,01
220 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	193	0,02	650 Exxon Mobil Corp, 3,482 %, fällig 19.03.2030	623	0,05
440 CVS Health Corp, 5,125 %, fällig 20.07.2045	423	0,03	1.130 Exxon Mobil Corp, 4,114 %, fällig 01.03.2046	1.042	0,08
3.800 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	3.666	0,29	80 Exxon Mobil Corp, 4,327 %, fällig 19.03.2050	76	0,01
70 CVS Health Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2050	60	0,01	270 FirstEnergy Corp, Serie A, 1,600 %, fällig am 15.01.2026	244	0,02
14 CVS Pass-Through Trust, 144A, 5,298 %, fällig am 11.01.2027	14	–	3.460 FirstEnergy Corp, Serie B, 4,400 %, fällig am 15.07.2027	3.283	0,26
17 CVS Pass-Through Trust, 6,036 %, fällig am 10.12.2028	17	–	1.000 FirstEnergy Corp, Serie C, 5,350 %, fällig am 15.07.2047	921	0,07
31 CVS Pass-Through Trust, 6,943 %, fällig am 10.01.2030	33	–	770 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	603	0,05
150 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig am 03.11.2036	151	0,01	570 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig am 19.08.2032	556	0,04
140 Deere & Co, 3,100 %, fällig am 15.04.2030	131	0,01	150 Ford Motor Co, 4,750 %, fällig am 15.01.2043	112	0,01
740 Deere & Co, 3,750 %, fällig am 15.04.2050	683	0,05	400 Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, fällig am 16.06.2025	391	0,03
190 Delta Air Lines Inc, 3,800 %, fällig am 19.04.2023	188	0,02	1.390 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig am 28.05.2027	1.307	0,10
410 Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig am 28.10.2024	385	0,03	600 Ford Motor Credit Co LLC, 4,125 %, fällig am 17.08.2027	542	0,04
4.240 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig am 01.05.2025	4.393	0,35	260 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig am 16.02.2028	218	0,02
810 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig am 15.01.2026	827	0,07	200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig am 10.02.2029	162	0,01
330 Devon Energy Corp, 8,250 %, fällig 01.08.2023	339	0,03	810 Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, fällig am 03.05.2029	750	0,06
530 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	548	0,04	890 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig am 13.11.2030	745	0,06
260 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	247	0,02	500 Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, fällig am 17.06.2031	405	0,03
40 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	40	–	340 Fox Corp, 4,030 %, fällig 25.01.2024	339	0,03
520 Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2042	469	0,04	2.040 Fox Corp, 5,476 %, fällig 25.01.2039	2.009	0,16
1.950 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	1.800	0,14	10 Freeport-McMoRan Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2023	10	–
50 Diamondback Energy Inc, 3,250 %, fällig am 01.12.2026	48	–	30 Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, fällig am 14.11.2024	30	–
660 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig am 01.12.2029	600	0,05	260 Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig am 01.08.2030	241	0,02
480 Diamondback Energy Inc, 4,400 %, fällig 24.03.2051	409	0,03	240 Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, fällig am 14.11.2034	228	0,02
450 DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	408	0,03	1.170 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	1.055	0,08
410 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	324	0,03	746 GE Capital International Funding Co. Unlimited Co., 4,418 %, fällig am 15.11.2035	706	0,06
230 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2026	190	0,02	230 General Dynamics Corp, 3,250 %, fällig 01.04.2025	227	0,02
40 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	31	–	90 General Dynamics Corp, 3,500 %, fällig 15.05.2025	90	0,01
170 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	101	0,01	40 General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2040	39	–
60 Dollar General Corp, 3,250 %, fällig 15.04.2023	60	0,01	290 General Dynamics Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2050	278	0,02
			124 General Electric Co, 6,750 %, fällig 15.03.2032	141	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinven- tarwert	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)						
USA — (Fortsetzung)						
240	General Motors Co, 5,400 %, fällig am 02.10.2023	243	80	Intel Corp., 3,700 %, fällig 29.07.2025	80	0,02
440	General Motors Co, 6,125 %, fällig am 01.10.2025	453	410	Intel Corp, 1,600 %, fällig 12.08.2028	356	0,03
50	General Motors Co, 6,600 %, fällig am 01.04.2036	51	130	Intel Corp, 3,734 %, fällig 08.12.2047	106	0,01
50	General Motors Co, 5,150 %, fällig am 01.04.2038	44	380	Intel Corp., 4,750 %, fällig 25.03.2050	363	0,03
230	General Motors Co, 6,250 %, fällig am 02.10.2043	222	200	Intel Corp, 3,050 %, fällig 12.08.2051	144	0,01
330	General Motors Co, 5,950 %, fällig am 01.10.2049	307	1.660	Intercontinental Exchange Inc, 4,600 %, fällig 15.03.2033	1.648	0,13
10	General Motors Financial Co Inc, 4,250 %, fällig am 15.05.2023	10	210	Intercontinental Exchange Inc, 4,950 %, fällig 15.06.2052	208	0,02
50	General Motors Financial Co. Inc., 4,350 %, fällig am 17.01.2027	48	1.940	International Business Machines Corp, 3,000 %, fällig am 15.05.2024	1.917	0,15
210	General Motors Financial Co. Inc., 3,100 %, fällig am 01.12.2032	170	930	Johnson & Johnson, 0,950 %, fällig am 01.09.2027	819	0,06
200	Gilead Sciences Inc, 3,500 %, fällig am 01.02.2025	197	1.040	Johnson & Johnson, 3,625 %, fällig am 03.03.2037	966	0,08
250	Gilead Sciences Inc, 4,750 %, fällig am 01.03.2046	240	1.420	JPMorgan Chase & Co, 1,514 %, fällig 01.06.2024 *	1.390	0,11
10	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,250 %, fällig am 01.06.2025	10	250	JPMorgan Chase & Co, 3,875 %, fällig 10.09.2024	249	0,02
80	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,375 %, fällig am 15.04.2026	79	1.400	JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, fällig 05.12.2024 *	1.394	0,11
3	Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, fortwährend *	2	1.160	JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, fällig 22.04.2026 *	1.085	0,09
440	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,200 %, fällig 23.02.2023	439	970	JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, fällig 01.10.2027	960	0,08
800	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,850 %, fällig 08.07.2024	797	1.000	JPMorgan Chase & Co, 3,509 %, fällig 23.01.2029 *	926	0,07
760	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01.04.2025	743	770	JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	739	0,06
720	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,210 %, fällig 21.10.2025	711	780	JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05.12.2029 *	752	0,06
1.970	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16.11.2026	1.894	640	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	542	0,04
270	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, fällig 15.03.2028 *	256	2.050	JPMorgan Chase & Co, 2,545 %, fällig 08.11.2032 *	1.687	0,13
4.750	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, fällig 23.04.2029 *	4.450	1.730	JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01.06.2045	1.661	0,13
2.650	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, fällig 01.05.2029 *	2.536	300	JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	217	0,02
3.730	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,650 %, fällig 21.10.2032 *	3.065	380	Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,500 %, fällig am 01.09.2023	378	0,03
670	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01.02.2041	752	110	Kinder Morgan Energy Partners LP, 4,250 %, fällig am 01.09.2024	110	0,01
160	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,210 %, fällig 22.04.2042 *	123	300	Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig am 01.06.2025	299	0,02
380	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,908 %, fällig 21.07.2042 *	277	520	Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig am 01.03.2028	509	0,04
560	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	534	270	Kinder Morgan Inc, 5,300 %, fällig am 01.12.2034	265	0,02
540	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig 21.10.2045	510	820	Kinder Morgan Inc, 5,550 %, fällig am 01.06.2045	799	0,06
580	GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 144A, 3,375 %, fällig am 24.03.2027	545	60	Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig am 01.03.2048	56	–
410	GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 144A, 3,375 %, fällig am 24.03.2029	373	30	KKR Group Finance Co II LLC, 144A, 5,500 %, fällig am 01.02.2043	30	–
620	GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 144A, 3,625 %, fällig am 24.03.2032	553	130	Kraft Heinz Foods Co, 3,000 %, fällig am 01.06.2026	123	0,01
100	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig am 15.12.2028	85	150	Kraft Heinz Foods Co, 4,250 %, fällig am 01.03.2031	143	0,01
11	Halliburton Co, 3,800 %, fällig 15.11.2025	11	20	Kraft Heinz Foods Co, 6,750 %, fällig am 15.03.2032	22	–
60	Halliburton Co, 4,850 %, fällig am 15.11.2035	57	80	Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig am 15.07.2035	78	0,01
320	Halliburton Co, 5,000 %, fällig am 15.11.2045	292	50	Kraft Heinz Foods Co, 6,875 %, fällig am 26.01.2039	55	–
50	Hanesbrands Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.05.2024	48	10	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 7,125 %, fällig am 08.01.2039	11	–
200	Hanesbrands Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15.05.2026	184	10	Kraft Heinz Foods Co, 4,625 %, fällig am 01.10.2039	9	–
70	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 20.01.2026	64	170	Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig am 06.04.2042	159	0,01
100	HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	101	520	Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, fällig am 15.07.2045	489	0,04
270	HCA Inc, 5,375 %, fällig am 01.02.2025	273	210	Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, fällig am 01.06.2046	179	0,01
10	HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.04.2025	10	370	Kraft Heinz Foods Co, 4,875 %, fällig am 01.10.2049	336	0,03
170	HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.06.2026	171	300	Kraft Heinz Foods Co, 5,500 %, fällig am 01.06.2050	299	0,02
30	HCA Inc, 5,375 %, fällig am 01.09.2026	30	770	L3Harris Technologies Inc, 4,854 %, fällig 27.04.2035	750	0,06
90	HCA Inc, 5,625 %, fällig am 01.09.2028	91	110	L3Harris Technologies Inc, 5,054 %, fällig 27.04.2045	107	0,01
660	HCA Inc, 5,875 %, fällig am 01.02.2029	674	2.770	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig am 08.08.2024	2.622	0,21
1.040	HCA Inc, 3,500 %, fällig am 01.09.2030	909	1.320	Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig am 25.06.2025	1.218	0,10
400	HCA Inc, 5,500 %, fällig 15.06.2047	370	160	Lehman Brothers Escrow, Serie DMTN, Nullkupon, fortwährend t=∞	–	–
180	Hershey Co/The, 0,900 %, fällig 01.06.2025	167	207	Lehman Escrow Receipt, Nullcoupon, fortwährend t=∞	1	–
500	Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375 %, fällig am 01.05.2025	497	79	Lehman Swap Receipt, Nullcoupon, fortwährend t=∞	–	–
200	Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,750 %, fällig am 01.05.2028	196	120	Lennar Corp, 4,500 %, fällig 30.04.2024	120	0,01
330	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.04.2027	316	50	Lennar Corp, 4,750 %, fällig 30.05.2025	50	–
380	Home Depot Inc/The, 2,500 %, fällig 15.04.2027	359	460	Lennar Corp, 4,750 %, fällig 29.11.2027	448	0,04
70	Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig am 06.12.2028	69	230	Lockheed Martin Corp, 3,550 %, fällig 15.01.2026	228	0,02
440	Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	397	40	Lockheed Martin Corp, 4,500 %, fällig 15.05.2036	40	–
490	Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	411	280	Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig 15.04.2030	276	0,02
90	Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 15.06.2047	79	300	Magallanes Inc, 144A, 3,755 %, fällig 15.03.2027	280	0,02
1.370	Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	1.094	370	Magallanes Inc, 144A, 4,054 %, fällig 15.03.2029	337	0,03
440	Honeywell International Inc, 1,350 %, fällig am 01.06.2025	413	2.180	Magallanes Inc, 144A, 4,279 %, fällig 15.03.2032	1.901	0,15
430	Humana Inc, 3,950 %, fällig 15.03.2027	419	130	Magallanes Inc, 144A, 5,050 %, fällig 15.03.2042	106	0,01
1.700	Humana Inc, 3,125 %, fällig 15.08.2029	1.553	1.580	Magallanes Inc, 144A, 5,141 %, fällig 15.03.2052	1.267	0,10
190	Humana Inc, 2,150 %, fällig 03.02.2032	154	540	Mars Inc, 144A, 3,200 %, fällig am 01.04.2030	503	0,04
70	Humana Inc, 4,625 %, fällig 01.12.2042	65	110	Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	100	0,01
20	Humana Inc, 4,800 %, fällig 15.03.2047	19	290	McDonald's Corp, 3,375 %, fällig 26.05.2025	285	0,02
50	ILFC E-Capital Trust II, 144A, 5,100 %, fällig am 21.12.2065 *	36	430	McDonald's Corp, 3,300 %, fällig 01.07.2025	423	0,03
			100	McDonald's Corp, 1,450 %, fällig 01.09.2025	93	0,01
			460	McDonald's Corp, 3,700 %, fällig am 30.01.2026	456	0,04
			510	McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.03.2027	502	0,04
			360	McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.07.2027	350	0,03
			260	McDonald's Corp, 3,800 %, fällig 01.04.2028	255	0,02
			130	McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	123	0,01
			80	McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	65	0,01
			720	McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	639	0,05
			60	MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	49	–

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — (Fortsetzung)					
750 Merck & Co Inc, 0,750 %, fällig am 24.02.2026	679	0,05	940 Pfizer Inc, 0,800 %, fällig 28.05.2025	871	0,07
450 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	373	0,03	620 Pfizer Inc, 2,625 %, fällig 01.04.2030	559	0,04
790 Merck & Co Inc, 2,750 %, fällig am 10.12.2051	573	0,05	580 Pfizer Inc, 1,700 %, fällig 28.05.2030	491	0,04
300 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	308	0,02	540 Philip Morris International Inc, 2,500 %, fällig am 02.11.2022	539	0,04
820 Microsoft Corp, 2,875 %, fällig 02.06.2024	812	0,06	360 Philip Morris International Inc, 1,125 %, fällig am 01.05.2023	354	0,03
200 Microsoft Corp, 2,700 %, fällig 02.12.2025	197	0,02	400 Philip Morris International Inc, 2,100 %, fällig am 01.05.2030	322	0,03
1.530 Microsoft Corp, 2,400 %, fällig 08.08.2026	1.461	0,12	160 Philip Morris International Inc, 4,500 %, fällig am 20.03.2042	132	0,01
1.400 Microsoft Corp, 3,300 %, fällig 02.06.2027	1.377	0,11	170 Pioneer Natural Resources Co, 1,125 %, fällig am 15.01.2026	152	0,01
10 Microsoft Corp, 3,450 %, fällig 08.08.2036	9	–	270 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, fällig am 15.08.2030	825	0,07
650 Microsoft Corp, 2,525 %, fällig 06.01.2050	474	0,04	250 PNC Bank NA, 3,875 %, fällig 10.04.2025	247	0,02
10 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	8	–	240 Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, fällig am 23.06.2025	220	0,02
43 Microsoft Corp, 2,675 %, fällig 06.01.2060	31	–	120 Procter & Gamble Co/The, 2,800 %, fällig 25.03.2027	116	0,01
207 Microsoft Corp, 3,041 %, fällig 17.03.2062	158	0,01	340 Procter & Gamble Co, 3,000 %, fällig 25.03.2030	321	0,03
730 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 20.06.2027	733	0,06	314 Range Resources Corp, 5,000 %, fällig am 15.03.2023	314	0,03
960 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig am 04.05.2025	899	0,07	200 Range Resources Corp, 4,875 %, fällig am 15.05.2025	194	0,02
1.770 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig am 28.04.2026 *	1.663	0,13	280 Raytheon Technologies Corp, 3,150 %, fällig 15.12.2024	273	0,02
1.360 Morgan Stanley, 3,772 %, fällig 24.01.2029 *	1.285	0,10	650 Raytheon Technologies Corp, 3,950 %, fällig 16.08.2025	650	0,05
50 Morgan Stanley, 4,431 %, fällig am 23.01.2030 *	49	–	630 Raytheon Technologies Corp, 4,125 %, fällig 16.11.2028	617	0,05
960 Morgan Stanley, 2,699 %, fällig am 22.01.2031 *	831	0,07	280 Raytheon Technologies Corp, 2,250 %, fällig 01.07.2030	240	0,02
2.090 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig am 01.04.2031 *	1.917	0,15	130 Raytheon Technologies Corp, 4,500 %, fällig 01.06.2042	123	0,01
460 Morgan Stanley, 2,511 %, fällig am 20.10.2032 *	377	0,03	370 Republic Services Inc, 2,500 %, fällig 15.08.2024	359	0,03
680 Morgan Stanley, 2,484 %, fällig am 16.09.2036 *	524	0,04	430 Salesforce Inc, 3,250 %, fällig 11.04.2023	429	0,03
380 MPLX LP, 4,875 %, fällig 01.12.2024	384	0,03	140 Salesforce Inc, 3,700 %, fällig 11.04.2028	139	0,01
230 MPLX LP, 4,000 %, fällig 15.03.2028	220	0,02	80 Santander Holdings USA Inc, 4,500 %, fällig 17.07.2025	80	0,01
1.750 MPLX LP, 4,800 %, fällig am 15.02.2029	1.711	0,14	322 Schlumberger Holdings Corp, 3,900 %, fällig am 17.05.2028	308	0,02
410 MPLX LP, 4,500 %, fällig am 15.04.2038	363	0,03	430 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig am 01.03.2032	498	0,04
20 MPLX LP, 5,200 %, fällig 01.03.2047	18	–	150 Southwestern Electric Power Co, 6,200 %, fällig am 15.03.2040	160	0,01
960 MPLX LP, 4,700 %, fällig am 15.04.2048	821	0,06	20 Southwestern Energy Co, 5,375 %, fällig am 01.02.2029	19	–
320 MPLX LP, 5,500 %, fällig am 15.02.2049	305	0,02	160 Southwestern Energy Co, 5,375 %, fällig 15.03.2030	150	0,01
140 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, fällig am 15.10.2027	126	0,01	250 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	223	0,02
80 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 4,625 %, fällig am 01.08.2029	68	0,01	552 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	561	0,04
570 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig am 15.03.2031	428	0,03	20 Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15.11.2028	21	–
160 Newell Brands Inc, 4,450 %, fällig am 01.04.2026	151	0,01	655 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	792	0,06
360 NIKE Inc, 2,400 %, fällig 27.03.2025	349	0,03	10 Sprint Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2023	10	–
580 NIKE Inc, 2,750 %, fällig 27.03.2027	555	0,04	220 Sprint Corp, 7,625 %, fällig 15.02.2025	230	0,02
290 NIKE Inc, 3,250 %, fällig 27.03.2040	246	0,02	30 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig am 31.12.2030	26	–
790 NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	659	0,05	760 Targa Resources Corp, 5,200 %, fällig 01.07.2027	759	0,06
640 Northrop Grumman Corp, 2,930 %, fällig 15.01.2025	624	0,05	240 Targa Resources Corp, 4,200 %, fällig 01.02.2033	216	0,02
1.140 Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig 15.01.2028	1.083	0,09	150 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,000 %, fällig am 15.01.2028	146	0,01
490 Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01.05.2050	516	0,04	290 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, fällig am 01.03.2030	284	0,02
320 NVIDIA Corp, 2,850 %, fällig 01.04.2030	289	0,02	490 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig am 01.02.2031	455	0,04
1.090 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	938	0,07	200 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig am 15.01.2032	175	0,01
1.980 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	1.643	0,13	640 Target Corp, 2,250 %, fällig am 15.04.2025	615	0,05
620 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	507	0,04	16 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig am 16.12.2039	19	–
30 Occidental Petroleum Corp, 6,950 %, fällig am 01.07.2024	31	–	300 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,900 %, fällig am 15.09.2044	291	0,02
130 Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, fällig am 15.03.2026	133	0,01	30 Tenet Healthcare Corp, 144A, 4,375 %, fällig 15.01.2030	26	–
410 Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, fällig am 15.04.2026	394	0,03	160 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig am 01.03.2030	138	0,01
610 Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, fällig am 15.08.2026	577	0,05	380 Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig am 04.05.2030	324	0,03
260 Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, fällig am 15.02.2027	240	0,02	980 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, due 22.08.2050 t=	731	0,06
600 Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig am 15.08.2029	553	0,04	182 Time Warner Cable LLC, 6,550 %, fällig am 01.05.2037	179	0,01
260 Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, fällig am 15.09.2031	300	0,02	420 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig am 01.07.2038	432	0,03
730 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig am 15.09.2036	781	0,06	560 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, fällig am 15.11.2040	503	0,04
200 Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, fällig am 15.03.2040	203	0,02	85 Time Warner Entertainment Co LP, 8,375 %, fällig am 15.07.2033	98	0,01
240 Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, fällig am 15.06.2045	213	0,02	50 TJX Group Inc/The, 2,250 %, fällig am 15.09.2026	47	–
520 Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig am 15.03.2046	573	0,05	2.640 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2025	2.579	0,20
100 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig am 15.04.2046	87	0,01	160 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.02.2026	147	0,01
520 Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, fällig am 15.02.2047	434	0,03	120 T-Mobile USA Inc, 3,750 %, fällig 15.04.2025	115	0,01
260 Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig am 15.03.2048	219	0,02	520 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	449	0,04
1.000 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig am 15.08.2049	858	0,07	370 T-Mobile USA Inc, 3,375 %, fällig 15.04.2029	334	0,03
1.160 Oracle Corp, 1,650 %, fällig 25/03/2026	1.047	0,08	2.850 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	2.636	0,21
90 Oracle Corp, 2,950 %, fällig 01.04.2030	77	0,01	450 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	375	0,03
1.690 Oracle Corp, 2,875 %, fällig 25/03/2031	1.403	0,11	380 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	322	0,03
300 Otis Worldwide Corp, 2,056 %, fällig 05.04.2025	283	0,02	270 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	239	0,02
310 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig am 01.08.2027	262	0,02	70 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.11.2031	56	–
390 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig am 01.02.2031	299	0,02	1.170 T-Mobile USA Inc, 2,700 %, fällig 15.03.2032	976	0,08
80 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig am 01.08.2040	56	–	220 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041	161	0,01
190 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig am 01.08.2050	126	0,01	10 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15.02.2051	7	–
90 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, fällig am 15.02.2028	84	0,01	150 Toll Brothers Finance Corp, 4,375 %, fällig am 15.04.2023	149	0,01
560 PayPal Holdings Inc, 1,650 %, fällig am 01.06.2025	527	0,04			
720 PepsiCo Inc, 0,750 %, fällig 01.05.2023	708	0,06			
80 PepsiCo Inc, 2,250 %, fällig 19.03.2025	77	0,01			
70 PepsiCo Inc, 2,625 %, fällig 19.03.2027	67	0,01			
580 PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig 01.05.2030	490	0,04			
220 PepsiCo Inc, 2,875 %, fällig 15.10.2049	172	0,01			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
Kenia — 0,12 % (28. Februar 2022: 0,12 %)					
2.270	Republic of Kenya Government International Bond, 144A, 6,300 %, fällig 23.01.2034	1.563	0,12		
Mexiko — 3,14 % (28. Februar 2022: 2,02 %)					
6.990	Mexican Bonos, Serie M 20, 10,000 %, fällig 05.12.2024	349	0,03		
131.480	Mexican Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig am 31.05.2029	6.357	0,50		
194.400	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 23.11.2034	8.710	0,69		
232.457	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	10.193	0,80		
256.970	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	11.491	0,91		
3.210	Mexico Government International Bond, 4,600 %, fällig am 10.02.2048	2.588	0,20		
190	Mexico Government International Bond, 5,750 %, fällig am 12.10.2110	163	0,01		
		39.851	3,14		
Nigeria — 0,02 % (28. Februar 2022: 0,02 %)					
300	Nigeria Government International Bond, 144A, 6,500 %, fällig 28.11.2027	231	0,02		
Panama — 0,10 % (28. Februar 2022: 0,10 %)					
670	Panama Government International Bond, 2,252 %, fällig am 29.09.2032	523	0,04		
950	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig am 01.04.2056	738	0,06		
		1.261	0,10		
Paraguay — 0,03 % (28. Februar 2022: 0,03 %)					
470	Paraguay Government International Bond, 144A, 3,849 %, fällig am 28.06.2033	405	0,03		
Peru — 0,10 % (28. Februar 2022: 0,19 %)					
730	Peruvian Government International Bond, 2,783 %, fällig am 23.01.2031	624	0,05		
580	Peruvian Government International Bond, 5,625 %, fällig am 18.11.2050	605	0,05		
		1.229	0,10		
Russland — 0,75 % (28. Februar 2022: 0,66 %)					
52.900	Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 25.01.2023 ty	278	0,02		
116.430	Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 16.08.2023 ty	612	0,05		
16.270	Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 16.09.2026 ty	85	0,01		
89.250	Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig 03.02.2027 ty	469	0,04		
203.271	Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 19.01.2028 ty	1.068	0,08		
689.514	Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 23.05.2029 ty	3.623	0,28		
232.730	Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig 10.04.2030 ty	1.223	0,10		
22.030	Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig 10.05.2034 ty	116	0,01		
382.680	Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 16.03.2039 ty	2.010	0,16		
		9.484	0,75		
Vereinigte Arabische Emirate — 0,10 % (28. Februar 2022: 0,30 %)					
1.270	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 2,500 %, fällig am 11.10.2022	1.270	0,10		
USA — 9,94 % (28. Februar 2022: 23,47 %)					
1.440	Federal National Mortgage Association, 6,625 %, fällig am 15.11.2030	1.763	0,14		
10.100	United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 31.08.2029	10.002	0,79		
4.770	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2041	3.657	0,29		
3.460	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.05.2041	2.823	0,22		
7.920	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 15.08.2041	5.887	0,46		
80	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.02.2042	66	0,01		
150	United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 15.05.2042	144	0,01		
5.130	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2048	4.701	0,37		
10.900	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	8.251	0,65		
33.380	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15.05.2050	20.657	1,63		
40.050	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig am 15.08.2050	25.630	2,02		
10.010	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig am 15.11.2050	6.854	0,54		
21.750	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	15.880	1,25		
7.250	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	5.971	0,47		
6.670	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	5.013	0,39		
11.729	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	8.545	0,67		
477	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	381	0,03		
		126.225	9,94		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 281.393\$)				204.478	16,10
Schuldscheindarlehen — 5,76 % (28. Februar 2022: 5,58 %)					
1.398	1011778 BC ULC, 4,122 %, fällig 14.11.2026 *	1.361	0,11		
560	Air Canada, 6,421 %, fällig am 27.07.2028 *	543	0,04		
1.200	Ali Group SRL, 4,436 %, fällig am 13.10.2028 *	1.170	0,09		
2.141	Allied Universal Holdco LLC, 6,122 %, fällig am 14.05.2028 *	2.049	0,16		
551	Alterra Mountain Co, 5,872 %, fällig am 30.07.2028 *	538	0,04		
196	American Axle & Manufacturing Inc, 5,040 %, fällig am 06.04.2024 *	193	0,02		
680	AmWINS Group, Inc., 4,622 %, fällig am 17.02.2028 *	665	0,05		
1.200	API Group Inc, 5,024 %, fällig am 01.10.2026 *	1.184	0,09		
410	Aramark Services Inc, 4,122 %, fällig am 11.03.2025 *	406	0,03		
1.635	Asplundh Tree Expert LLC, 4,122 %, fällig am 04.09.2027 *	1.615	0,13		
997	Asurion LLC, 5,622 %, fällig 18.12.2026 *	917	0,07		
1.083	Asurion LLC, 5,372 %, fällig 03.11.2024 *	1.045	0,08		
127	Asurion, LLC, 6,401 %, fällig 17.08.2028 *	119	0,01		
355	Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 4,618 %, fällig am 01.12.2027 *	349	0,03		
723	Berry Global Inc, 4,178 %, fällig am 01.07.2026 *	709	0,06		
358	Brookfield WEC Holdings Inc., 5,122 %, fällig 01.08.2025 *	351	0,03		
754	Brown Group Holding LLC, 4,872 %, fällig 07.06.2028 *	744	0,06		
501	Caesars Resort Collection LLC, 5,872 %, fällig am 19.06.2025 *	498	0,04		
1.484	Caesars Resort Collection LLC, 5,122 %, fällig am 22.12.2024 *	1.467	0,12		
157	Castlelake Aviation Ltd, 4,579 %, fällig 22.10.2026 *	154	0,01		
1.411	Change Healthcare Holdings LLC, 4,872 %, fällig 01.03.2024 *	1.405	0,11		
429	Charter Communications Operating LLC, 4,130 %, fällig am 01.02.2027 *	417	0,03		
2.075	Charter Communications Operating LLC, 4,130 %, fällig am 30.04.2025 *	2.054	0,16		
1.255	Citadel Securities, 4,941 %, fällig am 27.02.2028 *	1.232	0,10		
676	Clarios Global LP, 5,622 %, fällig am 30.04.2026 *	661	0,05		
98	CSC Holding LLC, 4,891 %, fällig am 15.04.2027 *	95	0,01		
257	CSC Holding LLC, 4,641 %, fällig am 15.01.2026 *	250	0,02		
1.870	DCert Buyer, Inc., 6,372 %, fällig am 16.10.2026 *	1.825	0,14		
1.323	Deerfield Dakota Holding LLC, 6,077 %, fällig 05.03.2027 *	1.292	0,10		
70	Delta 2 (Lux) Sarl, 4,872 %, fällig am 01.02.2024 *	70	0,01		
705	Edelman Financial Center LLC/The, 5,872 %, fällig am 05.04.2028 *	679	0,05		
315	Energizer Holdings, Inc., 4,625 %, fällig am 16.12.2027 *	310	0,03		
382	Eyecare Partners LLC, 6,000 %, fällig 20.02.2027 *	357	0,03		
134	FinCo I LLC, 4,872 %, fällig 27.06.2025 *	133	0,01		
234	First Eagle Holdings Inc, 4,750 %, fällig am 17.02.2027 *	225	0,02		
787	Focus Financial Partners LLC, 4,372 %, fällig am 03.07.2024 *	778	0,06		
884	Four Seasons Hotels Ltd, 4,372 %, fällig am 30.11.2023 *	882	0,07		
657	Froner US Inc, 4,622 %, fällig am 30.01.2027 *	635	0,05		
1.855	Gainwell Acquisition Corp, 6,250 %, fällig 01.10.2027 *	1.818	0,14		
350	Garda World Security Corp, 7,240 %, fällig am 30.10.2026 *	342	0,02		
2.117	Genesee & Wyoming Inc, 4,250 %, fällig am 30.12.2026 *	2.078	0,16		
105	GFL Environmental Inc., 5,806 %, fällig am 31.05.2025 *	104	0,01		
497	GoDaddy Operating Co, 4,122 %, fällig am 15.02.2024 *	494	0,04		
1.948	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 4,372 %, fällig am 15.11.2027 *	1.889	0,15		
347	GVC Holdings Gibraltar Ltd, 3,743 %, fällig am 16.03.2027 *	341	0,03		
1.111	Harbor Freight Tools USA Inc, 5,122 %, fällig am 19.10.2027 *	1.065	0,08		
1.435	Hilton Worldwide Finance LLC, 4,194 %, fällig am 21.06.2026 *	1.407	0,11		
955	ICON Luxembourg Sarl, 4,563 %, fällig 01.07.2028 *	942	0,07		
567	iHeartCommunications Inc, 5,372 %, fällig 01.05.2026 *	549	0,04		
990	II-VI Inc, 5,123 %, fällig 08.12.2028 *	971	0,08		
238	Indigo Merger Sub, Inc., 4,563 %, fällig am 01.07.2028 *	235	0,02		
1.346	Jane Street Group, LLC, 5,122 %, fällig 21.01.2027 *	1.322	0,10		
1.627	Level 3 Parent LLC, 4,122 %, fällig am 01.03.2027 *	1.558	0,12		
1.317	Mozart Borrower LP, 5,622 %, fällig 30.09.2028 *	1.260	0,10		
1.423	Nexstar Broadcasting Inc, 4,872 %, fällig am 19.09.2026 *	1.415	0,11		
324	PCI Gaming Authority, 4,872 %, fällig am 31.05.2026 *	317	0,03		
625	Phoenix Guarantor Inc, 5,622 %, fällig am 05.03.2026 *	607	0,05		
519	Phoenix Newco, Inc., 4,916 %, fällig am 11.08.2028 *	506	0,04		
2.600	Pilot Travel Centers, 4,427 %, fällig am 29.07.2028 *	2.556	0,20		
1.836	Prime Security Installations Ltd, 5,107 %, fällig am 23.09.2026 *	1.798	0,14		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
468 Project Sky Merger Sub, Inc., 6,122 %, fällig am 10.08.2028 *	449	0,04			
618 Quikrete Holdings, Inc., 5,372 %, fällig am 11.06.2028 *	600	0,05			
938 Rackspace Technology Global, Inc, 5,617 %, fällig am 09.02.2028 *	766	0,06			
1.598 RealPage Inc, 5,372 %, fällig 18.02.2028 *	1.541	0,12			
750 RegionalCare Hospital Partners Holding, 6,274 %, fällig 16.11.2025 *	728	0,06			
1.680 Reynolds Consumer Products LLC, 4,122 %, fällig am 04.02.2027 *	1.650	0,13			
1.420 Setanta Aircraft Leasing DAC, 4,250 %, fällig am 05.11.2028 *	1.398	0,11			
1.480 SkyMiles IP Ltd, 6,460 %, fällig 16.09.2027 *	1.503	0,12			
1.860 Sotera Health, 5,122 %, fällig am 13.12.2026 *	1.813	0,14			
1.382 Station Casinos LLC, 4,630 %, fällig am 08.02.2027 *	1.352	0,11			
868 Terrier Media Buyer, Inc., 5,872 %, fällig am 17.12.2026 *	844	0,07			
69 TransDigm Group Inc, 4,622 %, fällig am 09.12.2025 *	67	0,01			
50 Triton Water Holdings, Inc., 5,750 %, fällig 16.03.2028 *	47	–			
1.350 UFC Holdings Plc, 5,520 %, fällig 29.04.2026 *	1.316	0,10			
1.096 United Airlines Inc, 6,533 %, fällig am 14.04.2028 *	1.070	0,09			
824 Univision Communications Inc, 5,622 %, fällig 24.03.2026 *	807	0,06			
1.116 Versend Holding Corp., 6,372 %, fällig am 27.08.2025 *	1.111	0,09			
2.102 Virgin Media Bristol LLC, 4,891 %, fällig am 04.01.2028 *	2.061	0,16			
600 Zayo Group Holdings Ltd, 5,372 %, fällig am 09.03.2027 *	548	0,04			
590 Ziggo BV, 4,891 %, fällig 15.04.2028 *	571	0,04			
Summe Schuldverschreibungen (Kosten 74.949 USD)	73.193	5,76			
Organismen für gemeinsame Anlagen — 1,24 % (28. Februar 2022: 2,29 %)					
1.104 Franklin Templeton China Funds — Western Asset China Bond Fund — Klasse LM	15.794	1,24			
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 14.7325)	15.794	1,24			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.443.3565)					
	1.280.831	100,86			
Kontrakte (in Tsd.)					
	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert			
Gekaufte Optionen — 0,01 % (28. Februar 2022: 0,03 %)					
– U.S. 10 Year October 2022 Call 117,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	94	0,01			
– U.S. 5 Year October 2022 Call 111,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	59	–			
1.636 USD Put/CAD Call 1,2653, fällig 12.10.2022 — Citi	1	–			
1.636 USD Put/CAD Call 1,2670, fällig 12.10.2022 — Citi	1	–			
3.371 USD Put/CAD Call 1,2670, fällig 08.10.2022 — Morgan Stanley	2	–			
4.916 USD Put/CAD Call 1,2681, fällig 12.10.2022 — Citi	4	–			
4.932 USD Put/CAD Call 1,27, fällig 15.10.2022 — Goldman Sachs	5	–			
2.576 USD Put/JPY Call 131,39, fällig 07.10.2022 — Citi	5	–			
2.878 USD Put/JPY Call 131,50, fällig 07.10.2022 — Goldman Sachs	6	–			
8.706 USD Put/JPY Call 131,55, fällig 06.10.2022 — Goldman Sachs	16	–			
Gekaufte Optionen insgesamt (Kosten 5105)	193	0,01			
Credit Default Swaps — 0,07 % (28. Februar 2022: 0,33 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	868	0,07			
Index-Swaps — 1,88 % (28. Februar 2022: 0,37 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	23.967	1,88			
Inflationsswaps — 0,09 % (28. Februar 2022: 0,05 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.092	0,09			
Zinsswaps — 0,06 % (28. Februar 2022: 0,05 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	706	0,06			
Devisenterminkontrakte — 0,11 % (28. Februar 2022: 0,23 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.371	0,11			
Futures — (0,14 %) (28. Februar 2022: 0,40 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.840	0,14			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	1.310.868	103,22			
Geschriebene Optionen — (0,02 %) (28. Februar 2022: (0,10 %))					
– IMM Euro\$ December 2022 Call 96,50, fällig am 19.12.2022 — Morgan Stanley	(35)	–			
(1) IMM Euro\$ December 2022 Call 97,00, fällig am 19.12.2022 — Morgan Stanley	(61)	(0,01)			
– U.S. 10 Year October 2022 Call 122,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(11)	–			
– U.S. 10 Year October 2022 Put 115,50, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(46)	–			
– US 10 Year W2 September 2022 Put 116,00, fällig am 09.09.2022 — Morgan Stanley	(11)	–			
– U.S. 5 Year October 2022 Call 111,75, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(58)	(0,01)			
– US Long Bond W1 September 2022 Put 133,00, fällig am 02.09.2022 — Morgan Stanley	(3)	–			
(4.863) USD Put/GBP Call 1,2015, fällig 25.10.2022 — JP Morgan	(25)	–			
(4.647) USD Put/GBP Call 1,2056, fällig 28.10.2022 — Citi	(22)	–			
Summe geschriebene Optionen (Kosten 1.435 USD)	(272)	(0,02)			
Credit Default Swaps — 0,03 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(365)	(0,03)			
Index-Swaps — 0,08 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.049)	(0,08)			
Inflationsswaps — (0,08 %) (28. Februar 2022: (0,04 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(998)	(0,08)			
Zinsswaps — (0,44 %) (28. Februar 2022: (0,20 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(5.592)	(0,44)			
Devisenterminkontrakte — (0,17 %) (28. Februar 2022: (0,49 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(2.139)	(0,17)			
Futures — (0,82 %) (28. Februar 2022: (0,60 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(10.414)	(0,82)			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(20.829)	(1,64)			
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.290.039	101,58			
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten					
	(20.150)	(1,58)			
Gesamtvermögen	1.269.889\$	100,00			
–	Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.				
144A	Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 161.223.000\$ und machten 12,71 % des Nettovermögens aus.				
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.				
†	Nicht liquide.				
∞	Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach Ermessen des Bewertungsausschusses.				
±	Die Sicherheit ist zum 31. August 2022 (entweder Hauptsumme und/oder Zinsen) voreingestellt.				
±	Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.				
γ	Aufgrund der Ungewissheit der Zinszahlungen werden während und/oder nach dem zum 31. August 2022 endenden Geschäftsjahr keine Erträge aus dem Wertpapier mehr gezahlt.				
ABKÜRZUNGEN:					
Fortwährend	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.				
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.				
TBA	– Wird noch bekanntgegeben.				
IDR	– Indonesische Rupiah				
MXN	– Mexikanischer Peso				
RUB	– Russischer Rubel				

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	86,79
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	5,33
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,15
Finanzderivate	2,19
Sonstige Vermögenswerte	4,54
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit — Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.NA. HY, 5.000 % — Verkaufen	20.06.2027	29.101	\$ (365)
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1.000 % — Verkaufen	20.06.2027	260.228	868
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 4.882\$)				\$ 868
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -\$)				(365)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 4.882\$)				\$ 503

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Pay Floating USD 3M Libor, Receive Fixed 1,300 %	05.04.2024	15.890	\$ (659)
Morgan Stanley	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,820 %	06.04.2024	134.778	(3.947)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,350 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2028	7.200	706
Morgan Stanley	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,450 %	18.07.2029	142.060	(481)
Morgan Stanley	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,440 %	20.07.2029	147.960	(505)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 647\$)				\$ 706
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (2.957)\$)				(5.592)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (2.310)\$)				\$ (4.886)

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Pay Fixed 0,710 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.05.2027	60.282	\$ 6.289
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,130 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.08.2028	28.059	2.874
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,220 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.08.2028	20.467	1.997
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20.11.2026	22.420	873
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2047	15.537	3.507
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,630 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.05.2047	16.950	3.509
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,650 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.08.2047	834	170
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,729 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2047	17.531	3.318
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,733 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20.10.2031	13.940	575
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,000 %, Receive Floating USD SOFR Compound	18.03.2032	8.200	641
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,500 %, Receive Floating USD SOFR Compound	21.04.2052	5.300	214
Morgan Stanley	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 1,550 %	04.04.2027	15.927	(1.049)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 5.476\$)				\$ 23.967
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -\$)				(1.049)
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 5.476\$)				\$ 22.918

Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	USD — VPI Städtische Verbraucher	18.11.2023	19.740	\$ 686
Morgan Stanley	USD — VPI Städtische Verbraucher	20.10.2026	5.000	289
Morgan Stanley	USD — VPI Städtische Verbraucher	18.11.2026	19.740	(716)
Morgan Stanley	USD — SOFR Compound	15.02.2029	13.519	117
Morgan Stanley	USD — VPI Städtische Verbraucher	20.10.2031	5.000	(282)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 750\$)				\$ 1.092
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (551)\$)				(998)
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 199\$)				\$ 94

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
		Kauf	USD		Verkauf			
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	210	Verkauf	AUD	306	\$ 2
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	–	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	936	Verkauf	EUR	933	(3)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	17	Verkauf	USD	21	(1)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	34.691	Verkauf	USD	35.449	(550)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	12.178	Verkauf	USD	8.504	(169)
10.07.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.670	Verkauf	JPY	360.207	69
10.11.2022	Citi	Kauf	USD	756	Verkauf	JPY	101.891	20
10.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	863	Verkauf	JPY	116.449	23
10.11.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.448	Verkauf	CAD	1.848	41
10.12.2022	Citi	Kauf	USD	3.505	Verkauf	CAD	4.472	100
17.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.112	Verkauf	CAD	2.704	54
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	USD	3.000	Verkauf	EUR	2.959	16
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	NOK	66.018	Verkauf	EUR	6.379	217
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	JPY	2.167.758	Verkauf	USD	16.023	(356)
18.10.2022	Citi	Kauf	USD	15.970	Verkauf	CNH	107.051	462
18.10.2022	Citi	Kauf	CAD	67.341	Verkauf	USD	51.974	(716)
18.10.2022	Citi	Kauf	MXN	47.000	Verkauf	USD	2.244	67
18.10.2022	Citi	Kauf	IDR	40.407.938	Verkauf	USD	2.675	41
18.10.2022	Citi	Kauf	AUD	24.159	Verkauf	USD	16.551	(9)
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	GBP	6.744	Verkauf	USD	8.130	(288)
18.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD	7.254	Verkauf	CNH	48.587	216
18.10.2022	JP Morgan	Kauf	INR	156.175	Verkauf	USD	1.957	(1)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	MXN	30.377	Verkauf	USD	1.450	43
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	ZAR	29.450	Verkauf	USD	1.758	(46)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 3.409\$)								\$ 1.371
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (7.304)\$)								(2.139)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (3.895)\$)								\$ (768)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Juni 2023	Morgan Stanley	5	1.202 \$	\$ (5)
90 Day Euro\$ Dezember 2022	Morgan Stanley	1.103	264.541	(4.296)
90 Day Euro\$ Juni 2023	Morgan Stanley	309	74.087	(2.578)
90 Day Euro\$ September 2023	Morgan Stanley	73	17.534	(549)
Australia 10 Year Bond September 2022	Morgan Stanley	148	12.148	24
Euribor 3 Monate Dezember 2022	Morgan Stanley	270	66.586	(791)
Euro-FX Währung September 2022	Morgan Stanley	3	377	(27)
Euro-Bobl September 2022	Morgan Stanley	50	6.184	(111)
Euro-Bund September 2022	Morgan Stanley	(169)	(25.131)	1.529
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2022	Morgan Stanley	(25)	(4.135)	223
Euro-OAT September 2022	Morgan Stanley	91	12.622	(384)
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2022	Morgan Stanley	(8)	(8.611)	8
Long Gilt Dezember 2022	Morgan Stanley	60	7.523	(149)
Mexikanischer Peso Währung September 2022	Morgan Stanley	4	99	(1)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Morgan Stanley	410	47.931	(351)
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2022	Morgan Stanley	(94)	(11.767)	56
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2022	Morgan Stanley	29	6.041	(10)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Morgan Stanley	1.304	144.510	(716)
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2022	Morgan Stanley	628	85.310	(320)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2022	Morgan Stanley	326	48.737	(126)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 5.952\$)				\$ 1.840
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (8.964)\$)				(10.414)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (3.012)\$)				\$ (8.574)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 43,81 % (28. Februar 2022: 38,96 %)			Niederlande — 1,34 % (28. Februar 2022: 1,92 %)		
Australien — 0,67 % (28. Februar 2022: 0,67 %)			250 CTP NV, 0,625 %, fällig am 27.11.2023		
970			238	0,17	
			320 Enxsis Holding NV, 0,750 %, fällig am 02.07.2031	263	0,19
	940	0,67	940 Euronext NV, 1,000 %, fällig 18.04.2025	908	0,65
			300 ING Groep NV, 3,000 %, fällig am 11.04.2028 *	300	0,21
			40 Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030	36	0,02
			170 Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	134	0,10
				1.879	1,34
			Norwegen — 0,72 % (28. Februar 2022: 0,92 %)		
			1.030 DNB Bank ASA, 0,050 %, fällig 14.11.2023		
			1.009	0,72	
			Singapur — 0,25 % (28. Februar 2022: 0,33 %)		
			500 Temasek Financial I Ltd, 1,250 %, fällig am 20.11.2049		
			345	0,25	
			Südafrika — 0,21 % (28. Februar 2022: 0,21 %)		
			310 Anglo American Capital Plc, 1,625 %, fällig am 18.09.2025		
			299	0,21	
			Spanien — 1,28 % (28. Februar 2022: 0,50 %)		
			1.400 Banco Santander SA, 2,500 %, fällig 18.03.2025		
			1.371	0,98	
			440 Tendam Brands SAU, 5,517 %, fällig am 15.09.2024 *		
			422	0,30	
			1.793	1,28	
			Supranational — 3,08 % (28. Februar 2022: 2,89 %)		
			1.240 African Development Bank, 0,500 %, fällig 21.03.2029		
			1.109	0,79	
			3.480 European Stability Mechanism, Serie EUR, 0,750 %, fällig am 05.09.2028		
			3.212	2,29	
			4.321	3,08	
			Schweden — 0,79 % (28. Februar 2022: 0,62 %)		
			200 Skandinaviska Enskilda Banken AB, 6,875 %, fortwährend *		
			196	0,14	
			760 Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, fällig am 02.03.2028 *		
			755	0,54	
			160 Verisure Holding AB, 5,000 %, fällig 15.04.2025 *		
			159	0,11	
			1.110	0,79	
			Schweiz — 1,55 % (28. Februar 2022: 1,55 %)		
			920 Credit Suisse Group AG, 3,250 %, fällig am 02.04.2026 *		
			891	0,63	
			160 Holcim Finance Luxembourg SA, 3,000 %, fortwährend *		
			154	0,11	
			320 UBS AG/London, 0,500 %, fällig am 31.03.2031		
			255	0,18	
			330 UBS Group AG, 1,750 %, fällig 16.11.2022		
			331	0,24	
			550 UBS Group AG, 1,500 %, fällig 30.11.2024		
			543	0,39	
			2.174	1,55	
			Vereinigte Arabische Emirate — 0,22 % (28. Februar 2022: 0,46 %)		
			200 Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 2,625 %, fällig 31.03.2036		
			168	0,12	
			180 MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, fällig 10.03.2034		
			147	0,10	
			315	0,22	
			Vereinigtes Königreich — 5,36 % (28. Februar 2022: 5,32 %)		
			1.070 Annington Funding Plc, 1,650 %, fällig am 12.07.2024		
			1.044	0,75	
			100 Aviva Plc, 3,375 %, fällig 04.12.2045 *		
			98	0,07	
			1.050 Barclays Plc, 3,375 %, fällig 02.04.2025 *		
			1.052	0,75	
			1.260 HSBC Holdings Plc, 3,000 %, fällig 30.06.2025		
			1.261	0,90	
			1.110 Lloyds Banking Group Plc, 0,611 %, fällig 21.06.2024 *		
			1.120	0,80	
			1.190 NatWest Group Plc, 2,500 %, fällig 22.03.2023		
			1.198	0,85	
			140 Pinewood Finance Co Ltd, 3,250 %, fällig 30.09.2025		
			147	0,11	
			400 Rentokil Initial Plc, 0,950 %, fällig 22.11.2024		
			407	0,29	
			100 Segro Capital Sarl, 1,875 %, fällig am 23.03.2030		
			88	0,06	
			280 Standard Chartered Plc, 3,950 %, fällig am 11.01.2023		
			278	0,20	
			580 Standard Chartered Plc, 3,125 %, fällig 19.11.2024		
			577	0,41	
			140 Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250 %, fällig 15.05.2029		
			144	0,10	
			100 Wellcome Trust Ltd/The, 1,125 %, fällig am 21.01.2027		
			93	0,07	
			7.507	5,36	
			USA — 14,91 % (28. Februar 2022: 12,44 %)		
			50 3M Co, 3,700 %, fällig am 15.04.2050		
			40	0,03	
			430 AbbVie Inc, 1,250 %, fällig 01.06.2024		
			424	0,30	
			10 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig am 14.11.2048		
			10	0,01	
			420 Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig am 01.06.2028		
			351	0,25	
			40 Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057		
			37	0,03	
			30 American International Group Inc, 2,500 %, fällig 30.06.2025		
			28	0,02	
			30 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig am 15.01.2032		
			25	0,02	
			220 AT&T Inc, 3,550 %, fällig 17.12.2032		
			219	0,16	
			100 AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15.09.2053		
			73	0,05	
			40 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031		
			32	0,02	
			1.390 Bank of America Corp, 1,379 %, fällig 07.02.2025 *		
			1.367	0,98	
			250 Becton Dickinson und Co, 1,000 %, fällig am 15.12.2022		
			249	0,18	
			420 Berkshire Hathaway Inc, 1,125 %, fällig am 16.03.2027		
			390	0,28	
			290 Boeing Co/The, 5,150 %, fällig am 01.05.2030		
			284	0,20	
			410 Boeing Co/The, 5,805 %, fällig am 01.05.2050		
			392	0,28	
			60 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig am 06.04.2030		
			57	0,04	
			13 Bristol-Myers Squibb Co, 2,900 %, fällig 26.07.2024		
			13	0,01	
			70 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035		
			53	0,04	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% vom Nettoinven- tarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — (Fortsetzung)					
USD	70		USD	51	0,04
			USD	9	0,01
			USD	34	0,02
			USD	101	0,07
USD	200	0,11	USD	25	0,02
			USD	35	0,03
USD	180	0,10	USD	108	0,08
			USD	9	0,01
USD	20	0,01	USD	254	0,18
			USD	95	0,07
USD	100	0,06	USD	20	0,01
			USD	582	0,42
USD	180		USD	48	0,03
			USD	44	0,03
USD	30	0,02	USD	48	0,03
USD	50	0,03	USD	1.056	0,75
USD	120	0,08	USD	434	0,31
				20.886	14,91
1.440		1,01	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen		
USD	10	0,01	(Kosten 65.174€)		
USD	10	0,01		61.379	43,81
USD	50	0,03	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 53,22 % (28. Februar 2022: 58,64 %)		
USD	100	0,06	Belgien — 2,31 % (28. Februar 2022: 2,81 %)		
USD	80	0,05	2.720 Kingdom of Belgium Government Bond, Series 71,		
USD	290	0,17	3,750 %, fällig 22.06.2045		
USD	140	0,09	China — 0,36 % (28. Februar 2022: 0,81 %)		
USD	280	0,19	680 China Government International Bond,		
USD	90	0,06	1,000 %, fällig 12.11.2039		
USD	170	0,13	499		
USD	100	0,07	0,36		
USD	90	0,06	Frankreich — 11,80 % (28. Februar 2022: 12,75 %)		
USD	70	0,05	1.510 French Republic Government Bond OAT,		
430		0,21	1,000 %, fällig 25.05.2027		
USD	30	0,02	880 French Republic Government Bond OAT,		
USD	130	0,09	0,750 %, fällig 25.05.2028		
USD	60	0,04	6.260 French Republic Government Bond OAT,		
USD	180	0,10	0,000 %, fällig 25.11.2030		
USD	200	0,12	5.275 French Republic Government Bond OAT,		
USD	20	0,01	3,250 %, fällig 25.05.2045		
USD	350	0,22	880 French Republic Government Bond OAT, 144A,		
1.080		0,74	1,500 %, fällig 25.05.2050		
USD	10	0,01	590 French Republic Government Bond OAT,		
520		0,37	4,000 %, fällig 25.04.2060		
USD	540	0,38	1.600 UNEDIC ASSEO, 1,250 %, fällig am 25.05.2033		
USD	50	0,03	1.425		
1.320		0,86	16.532		
USD	260	0,16	Deutschland — 19,50 % (28. Februar 2022: 15,99 %)		
			3.620 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe,		
USD	80	0,05	0,000 %, fällig 15.08.2030		
USD	70	0,04	22.270 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe,		
USD	20	0,01	0,000 %, fällig 15.02.2031		
USD	210	0,12	19.781		
USD	20	0,01	4.230 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe,		
USD	580	0,41	1,700 %, fällig 15.08.2032		
1.370		0,96	4.295		
USD	60	0,04	27.318		
USD	110	0,06	Indonesien — 0,82 % (28. Februar 2022: 1,72 %)		
USD	170	0,10	350 Indonesia Government International Bond,		
USD	320	0,25	1,400 %, fällig 30.10.2031		
USD	600	0,41	280		
USD	20	0,01	USD 1.000 Indonesia Government International Bond,		
USD	730	0,51	4,200 %, fällig 15.10.2050		
USD	230	0,15	871		
USD	320	0,21	1.151		
USD	180	0,12	Italien — 5,56 % (28. Februar 2022: 8,01 %)		
USD	40	0,03	1.300 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 0,400 %,		
USD	90	0,05	fällig am 15.05.2030 ß		
USD	50	0,03	570 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,500 %, fällig 01.12.2032		
450		0,29	6.585 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A,		
700		0,39	3,250 %, fällig 01.09.2046		
USD	40	0,02	5.925		
USD	180	0,11	7.795		
USD	42	0,03	Mexiko — 1,91 % (28. Februar 2022: 1,59 %)		
USD	130	0,08	1.530 Mexico Government International Bond,		
USD	10	0,01	2,875 %, fällig 08.04.2039		
USD	40	0,03	USD 1.880 Mexico Government International Bond,		
450		0,29	4,600 %, fällig 23.01.2046		
700		0,39	1.525		
USD	40	0,02	2.677		
USD	180	0,11	Norwegen — 0,95 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
USD	42	0,03	6.340 Norway Government Bond, Serie 482, 144A, 1,375 %,		
USD	130	0,08	fällig am 19.08.2030		
USD	10	0,01	548		
USD	40	0,03	8.610 Norway Government Bond, Serie 484, 144A, 2,125 %,		
USD	130	0,08	fällig am 18.05.2032		
USD	10	0,01	776		
			1.324		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% vom Nettoinventarwert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) €	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
Polen — 1,21 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
PLN 11.670	Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	1,700	1,21		
Südafrika — 1,58 % (28. Februar 2022: 1,44 %)					
USD 2.500	Republic of South Africa Government International Bond, 4,300 %, fällig am 12.10.2028	2.213	1,58		
South Korea — 0,80 % (28. Februar 2022: 0,77 %)					
1.150	Export-Import Bank of Korea, 0,375 %, fällig am 26.03.2024	1.121	0,80		
Spanien — 6,06 % (28. Februar 2022: 7,08 %)					
1.600	Spain Government Bond, 144A, 1,300 %, fällig 31.10.2026	1.567	1,12		
1.800	Spain Government Bond, 144A, 1,400 %, fällig 30.04.2028	1.736	1,24		
1.330	Spain Government Bond, 144A, 2,900 %, fällig 31.10.2046	1.289	0,92		
4.200	Spain Government Bond, Serie 30Y, 144A, 2,700 %, fällig 31.10.2048	3.895	2,78		
		8.487	6,06		
Vereinigte Arabische Emirate — 0,35 % (28. Februar 2022: 0,47 %)					
USD 540	Abu Dhabi Government International Bond, 3,875 %, fällig 16.04.2050	489	0,35		
Vereinigtes Königreich — 0,01 % (28. Februar 2022: 0,01 %)					
GBP 10	United Kingdom Gilt, 2,500 %, fällig 22.07.2065	11	0,01		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 85.904 €)					
		74.552	53,22		
Organismen für gemeinsame Anlagen — 0,28 % (28. Februar 2022: 0,54 %)					
USD 394	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	392	0,28		
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 388 €)					
		392	0,28		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 151.466 €)					
		136.323	97,31		
Kontrakte (in Tsd.)					
Gekaufte Optionen — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
	– Euro Currency Future December 2022 Call 99,6250, fällig am 19.12.2022 — Bank of America Merrill Lynch	1	–		
Gekaufte Optionen insgesamt (Kosten 33 €)					
		1	–		
Devisenterminkontrakte — 0,05 % (28. Februar 2022: 0,04 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	76	0,05		
Futures — (0,44 %) (28. Februar 2022: 0,38 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	620	0,44		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
		137.020	97,80		
Geschriebene Optionen — (0,17 %) (28. Februar 2022: 0,00 %)					
	– Euro Currency Future December 2022 Put 99,00, fällig am 19.12.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(244)	(0,17)		
Summe verkaufte Optionen (Kosten (41) EUR)					
		(244)	(0,17)		
Inflationsswaps — (0,43 %) (28. Februar 2022: (0,24 %))					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(600)	(0,43)		
Zinsswaps — (0,76 %) (28. Februar 2022: (0,26 %))					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.061)	(0,76)		
Devisenterminkontrakte — (0,15 %) (28. Februar 2022: (0,38 %))					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(209)	(0,15)		
Futures — (0,67 %) (28. Februar 2022: (0,40 %))					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(946)	(0,67)		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
		(3.060)	(2,18)		
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
		133.960	95,62		
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen					
		6.125	4,38		
Gesamtnettovermögen					
		140.085€	100,00		
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, betreffen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A	Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 20.177.000€ und machten 14,42 % des Nettovermögens aus.				
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.				
β	Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.				
ABKÜRZUNGEN:					
Fortwährend	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.				
CPI	– Verbraucherpreisindex.				
GBP	– Britisches Pfund Sterling				
NOK	– Norwegische Krone				
PLN	– Polnischer Zloty				
USD	– US-Dollar				
Analyse des Gesamtvermögens					
% des Gesamtvermögens					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					
Organismen für gemeinsame Anlagen					
Finanzderivate					
Sonstige Vermögenswerte					
Gesamtvermögen					
100,00					

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating CAD 3M CDOR, Receive Fixed 1,483 %	27.10.2023	8.140	€ (197)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating EUR 6M Euribor Reuters, Receive Fixed -0,150 %	15.08.2026	7.280	(641)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating EUR 6M Euribor, Receive Fixed 1,500 %	16.04.2027	6.960	(223)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 72€)				€ –
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (385)€)				(1.061)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (313)€)				€ (1.061)

Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	USD — VPI Städtische Verbraucher	28.04.2026	3.060	€ (321)
Bank of America Merrill Lynch	GBP — RPI Alle Artikel NSA	15.10.2026	2.010	(279)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): €-)				€ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (358)€)				(600)
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (358)€)				€ (600)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
		Kauf	EUR		Verkauf	JPY			
16.11.2022	Citi	Kauf	EUR	51	Verkauf	JPY	6.900	€	2
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	GBP	430	Verkauf	EUR	508		(13)
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	EUR	80	Verkauf	GBP	68		2
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	EUR	3.020	Verkauf	USD	3.088		(36)
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	EUR	340	Verkauf	AUD	502		–
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	EUR	320	Verkauf	CAD	422		2
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	200	Verkauf	EUR	198		(1)
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	NOK	4.712	Verkauf	EUR	475		(5)
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	GBP	250	Verkauf	EUR	296		(8)
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	EUR	2.254	Verkauf	GBP	1.901		64
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	EUR	227	Verkauf	JPY	30.800		6
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	EUR	9.925	Verkauf	USD	10.144		(115)
16.11.2022	UBS	Kauf	EUR	2.485	Verkauf	USD	2.541		(31)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 59€)								€	76
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (569)€)									(209)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (510)€)								€	(133)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
90 Day Euro\$ Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	8	1.909 €	€	(53)
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	84	20.116		(549)
Australia 3 Year Bond September 2022	Bank of America Merrill Lynch	54	3.960		11
Canadian 5 Year Bond Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	9	769		(3)
Euro-Bobl September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(66)	(8.123)		205
Euro-BTP September 2022	Bank of America Merrill Lynch	8	956		(4)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(25)	(4.115)		345
ICE 3 Monate SONIA Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	77	21.430		(170)
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(8)	(8.568)		(68)
Long Gilt Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	45	5.615		(99)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(36)	(4.188)		36
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(20)	(2.492)		20
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(33)	(3.639)		3
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 567€)				€	620
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (590)€)					(946)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (23)€)				€	(326)

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 7,50 % (28. Februar 2022: 5,45 %)			Frankreich — 0,97 % (28. Februar 2022: 0,75 %)		
100 AGL CLO 6 Ltd, Serie 2020 6A, Klasse ER, 144A, 9,210 %, fällig am 20.07.2034 *	92	0,24	200 Banijay Entertainment SASU, 144A, 5,375 %, fällig am 01.03.2025	189	0,48
250 Apidos CLO XXXVI, Serie 2021 36A, Klasse D, 144A, 5,610 %, fällig am 20.07.2034 *	234	0,60	200 Banijay Entertainment SASU, 5,375 %, fällig am 01.03.2025	189	0,49
100 Ballyrock CLO 16 Ltd, Serie 2021 16A, Klasse D, 144A, 8,960 %, fällig am 20.07.2034 *	91	0,24		378	0,97
200 Ballyrock CLO 19 Ltd, Serie 2022 19A, Klasse D, 144A, 8,282 %, fällig am 20.04.2035 *	178	0,46	Hong Kong — 0,87 % (28. Februar 2022: 0,44 %)		
320 Canyon Capital CLO 2017-1 Ltd, Serie 2017 1A, Klasse DR, 144A, 5,512 %, fällig am 15.07.2030 *	306	0,79	200 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 06.06.2025	154	0,40
150 Canyon CLO 2021-3 Ltd, Serie 2021 3A, Klasse E, 144A, 8,712 %, fällig am 15.07.2034 *	132	0,34	250 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,250 %, fällig 26.04.2026	184	0,47
36 First Franklin Mortgage Loan Trust 2004-FFH1, Serie 2004 FFH1, Klasse M1, 3,119 %, fällig am 25.03.2034 *	35	0,09		338	0,87
100 Goldentree Loan Management US Clo 10 Ltd, Serie 2021 10A, Klasse E, 144A, 8,910 %, fällig am 20.07.2034 *	92	0,24	Indien — 0,49 % (28. Februar 2022: 0,40 %)		
100 Goldentree Loan Management US Clo 8 Ltd, Serie 2020 8A, Klasse FR, 144A, 10,760 %, fällig am 20.10.2034 *	82	0,21	210 CA Magnum Holdings, 144A, 5,375 %, fällig 31.10.2026	190	0,49
150 Golub Capital Partners CLO 37B Ltd, Serie 2018 37A, Klasse D, 144A, 6,010 %, fällig am 20.07.2030 *	145	0,37	Irland — 0,33 % (28. Februar 2022: 0,27 %)		
100 Golub Capital Partners CLO 53B Ltd, Serie 2021 53A, Klasse E, 144A, 9,410 %, fällig am 20.07.2034 *	93	0,24	150 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, fällig am 29.10.2028	128	0,33
100 JFIN CLO 2017 Ltd, Serie 2017 1A, Klasse D, 144A, 6,383 %, fällig am 24.04.2029 *	99	0,25	Israel — 1,31 % (28. Februar 2022: 1,40 %)		
100 Nassau 2021-I Ltd, Serie 2021 IA, Klasse D, 144A, 6,262 %, fällig am 26.08.2034 *	97	0,25	240 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig am 31.01.2025	238	0,61
34 New Century Home Equity Loan Trust 2003-6, Serie 2003 6, Klasse M1, 3,524 %, fällig am 25.01.2034 *	34	0,09	310 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig am 09.05.2027	272	0,70
250 Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Klasse ER, 144A, 10,082 %, fällig am 15.10.2034 *	239	0,62		510	1,31
57 Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Klasse 3A4, 5,860 %, fällig am 25.01.2037	56	0,14	Luxemburg — 0,40 % (28. Februar 2022: 0,36 %)		
100 Point Au Roche Park CLO Ltd, Serie 2021 1A, Klasse D, 144A, 5,510 %, fällig am 20.07.2034 *	93	0,24	200 ARD Finance SA, 6,500 %, fällig 30.06.2027	155	0,40
150 RR 18 Ltd, Serie 2021 18A, Klasse D, 144A, 8,762 %, fällig am 15.10.2034 *	133	0,34	Macau — 1,31 % (28. Februar 2022: 1,13 %)		
175 Southwick Park CLO LLC, Serie 2019 4A, Klasse ER, 144A, 8,960 %, fällig am 20.07.2032 *	162	0,42	250 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, fällig am 01.10.2024	200	0,51
250 Vibrant Clo VII Ltd, Serie 2017 7A, Klasse C, 144A, 6,310 %, fällig am 15.09.2030 *	232	0,60	400 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 15.01.2026	309	0,80
300 Vibrant CLO XI Ltd, Serie 2019 11A, Klasse CR, 144A, 6,210 %, fällig am 20.07.2032 *	284	0,73		509	1,31
Asset-Backed Securities insgesamt (Kosten 3.103 USD)	2.909	7,50	Polen — 0,47 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 1,45 % (28. Februar 2022: 1,14 %)			200 Canpack SA / Canpack US LLC, 144A, 3,125 %, fällig am 01.11.2025	180	0,47
64 Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Serie 2004 AR1, Klasse 6M2, 4,544 %, fällig am 25.02.2034 *	65	0,17	Schweiz — 0,96 % (28. Februar 2022: 0,78 %)		
260 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 DNA3, Klasse B1, 6,894 %, fällig am 25.03.2030 *	271	0,70	200 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, unbefristet *	177	0,46
30 Impac CMB Trust Series 2004-6, Serie 2004 6, Klasse 2A, 6,060 %, fällig am 25.10.2034	32	0,08	200 UBS Group AG, 144A, 7,000 %, unbefristet *	196	0,50
79 Lehman XS Trust Serie 2006-12N, Serie 2006 12N, Klasse A31A, 2,844 %, fällig am 25.08.2046 *	78	0,20		373	0,96
52 Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Serie 2003-A1, Serie 2003 A1, Klasse M, 6,649 %, fällig am 25.05.2033 *	32	0,09	Vereinigtes Königreich — 0,50 % (28. Februar 2022: 0,38 %)		
38 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Serie 2005 8XS, Klasse M1, 3,089 %, fällig am 25.04.2035 *	36	0,09	200 Neptune Energy Bondco Plc, 144A, 6,625 %, fällig am 15.05.2025	193	0,50
85 WalMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR15 Trust, Serie 2005 AR15, Klasse A1C4, 3,244 %, fällig am 25.11.2045 *	46	0,12	USA — 68,63 % (28. Februar 2022: 71,22 %)		
Summe Mortgage-Backed Securities (Anschaffungskosten 567 USD)	560	1,45	90 Academy Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2027	84	0,22
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 80,97 % (28. Februar 2022: 81,29 %)			167 Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2028	180	0,46
Bermudas — 1,04 % (28. Februar 2022: 0,81 %)			350 AdaptHealth LLC, 144A, 6,125 %, fällig am 01.08.2028	323	0,83
417 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig am 15.10.2025	401	1,04	245 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig am 01.03.2028	233	0,60
Brasilien — 0,05 % (28. Februar 2022: 0,04 %)			250 Akumin Inc, 144A, 7,000 %, fällig am 01.11.2025	213	0,55
20 Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig am 17.03.2024	20	0,05	180 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, fällig am 15.02.2028	91	0,24
Kanada — 1,59 % (28. Februar 2022: 1,71 %)			80 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 6,625 %, fällig am 15.07.2026	75	0,19
CAD 60 Doman Building Materials Group Ltd, 144A, 5,250 %, fällig am 15.05.2026	39	0,10	150 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig am 15.07.2026	141	0,36
60 Empire Communities Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.12.2025	52	0,13	200 Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/ Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig am 01.06.2028	168	0,43
200 Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, fällig am 01.04.2026	182	0,47	290 Alta Equipment Group Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 15.04.2026	252	0,65
240 MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2027	243	0,63	- Ambac Assurance Corp, 144A, 5,100 %, unbefristet	-	-
100 MEG Energy Corp, 7,125 %, fällig 01.02.2027	101	0,26	120 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 10,000 %, fällig am 15.06.2026	97	0,25
	617	1,59	160 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 15.02.2029	138	0,36
Cayman Islands — 1,01 % (28. Februar 2022: 0,64 %)			210 American Airlines Inc, 144A, 11,750 %, fällig 15.07.2025	232	0,60
301 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 15.09.2024	244	0,63	280 American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 20.04.2026	267	0,69
183 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 6,500 %, fällig am 15.09.2024	148	0,38	43 American Axle & Manufacturing Inc, 6,250 %, fällig am 15.03.2026	42	0,11
	392	1,01	250 American Axle & Manufacturing Inc, 6,500 %, fällig am 01.04.2027	234	0,60
Chile — 0,05 % (28. Februar 2022: 0,04 %)			116 American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig am 01.09.2026	131	0,34
20 Liberty Latin America Ltd, 2,000 %, fällig am 15.07.2024	18	0,05	110 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 5,375 %, fällig am 15.10.2023	109	0,28
			210 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig am 15.06.2027	206	0,53
			200 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 3,250 %, fällig am 01.09.2028	173	0,45
			200 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig am 15.08.2027	145	0,37
			50 Bank of America Corp, Serie FF, 5,875 %, unbefristet *	45	0,12
			180 Bath & Body Works Inc, 144A, 9,375 %, fällig am 01.07.2025	191	0,49
			200 Bath & Body Works Inc, 5,250 %, fällig am 01.02.2028	180	0,46
			160 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.02.2027	119	0,31
			140 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2027	102	0,26
			260 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029	99	0,25
			40 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,250 %, fällig 30.01.2030	15	0,04

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinven- tarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — (Fortsetzung)					
410 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2026	386	1,00	300 Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig am 01.05.2028	231	0,60
90 Blackstone Mortgage Trust Inc, 5,500 %, fällig am 15.03.2027	83	0,22	100 Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, fällig am 01.05.2029	67	0,17
150 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15.12.2025	150	0,39	100 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500 %, fällig am 01.05.2028	86	0,22
250 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2026	237	0,61	70 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 20.06.2027	70	0,18
120 Bread Financial Holdings Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.12.2024	107	0,28	110 Minerals Technologies Inc, 144A, 5,000 %, fällig am 01.07.2028	99	0,26
200 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig am 01.02.2026	181	0,47	200 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, fällig am 15.10.2027	180	0,46
450 Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,250 %, fällig am 01.07.2025	440	1,14	120 Nabors Industries Ltd, 144A, 7,250 %, fällig am 15.01.2026	109	0,28
270 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig 01.02.2026	278	0,72	50 NCL Corp Ltd, 3,625 %, fällig 15.12.2024	43	0,11
150 Carnival Corp, 144A, 9,875 %, fällig 01.08.2027	151	0,39	90 NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 15.12.2024	78	0,20
126 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig am 01.05.2026	125	0,32	50 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	41	0,10
140 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,125 %, fällig am 01.05.2027	133	0,34	300 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.02.2027	272	0,70
270 Cheniere Energy Partners LP, 4,000 %, fällig am 01.03.2031	237	0,61	170 NCL Corp Ltd, 144A, 7,750 %, fällig 15.02.2029	138	0,36
20 Chesapeake Energy Corp, 144A, 5,500 %, fällig am 01.02.2026	19	0,05	80 Netflix Inc, 4,375 %, fällig 15.11.2026	78	0,20
410 Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, fällig am 01.06.2026	398	1,03	160 NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC, 144A, 7,125 %, fällig am 01.04.2026	150	0,39
190 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, fällig am 15.03.2026	178	0,46	290 NMI Holdings Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2025	293	0,76
40 Citigroup Inc, Serie M, 6,300 %, unbefristet *	39	0,10	310 Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125 %, fällig am 01.03.2028	298	0,77
380 Coinbase Global Inc, 144A, 3,375 %, fällig am 01.10.2028	246	0,64	200 Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, fällig am 15.04.2026	192	0,50
170 Colgate Energy Partners III LLC, 144A, 7,750 %, fällig am 15.02.2026	170	0,44	300 Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, fällig am 15.08.2026	284	0,73
390 CommScope Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.03.2027	335	0,86	10 Pactiv LLC, 8,375 %, fällig 15.04.2027	9	0,02
290 Consensus Cloud Solutions Inc, 144A, 6,000 %, fällig am 15.10.2026	264	0,68	260 Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 01.04.2027	221	0,57
20 CoreCivic Inc, 4,625 %, fällig 01.05.2023	20	0,05	400 Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.08.2026	393	1,01
260 CoreCivic Inc, 8,250 %, fällig 15.04.2026	257	0,66	130 Photo Holdings Merger Sub Inc, 144A, 8,500 %, fällig am 01.10.2026	97	0,25
290 CSC Holdings LLC, 144A, 5,375 %, fällig 01.02.2028	264	0,68	210 PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig 01.10.2028	182	0,47
120 DCP Midstream Operating LP, 5,375 %, fällig am 15.07.2025	120	0,31	340 Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig am 15.04.2026	328	0,85
20 Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig am 28.10.2024	19	0,05	90 Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15.01.2029	95	0,24
40 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig am 01.05.2025	41	0,11	300 RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc, 144A, 9,750 %, fällig am 01.12.2026	286	0,74
250 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig am 15.01.2026	255	0,66	60 Resolute Forest Products Inc, 144A, 4,875 %, fällig am 01.03.2026	59	0,15
700 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	553	1,43	350 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, fällig am 15.10.2026	295	0,76
210 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2026	174	0,45	405 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 31.08.2026	324	0,84
160 Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig am 15.06.2025	158	0,41	120 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,625 %, fällig am 15.08.2027	118	0,30
180 DraftKings Holdings Inc, Nullkupon, fällig am 15.03.2028	123	0,32	100 Service Properties Trust, 4,650 %, fällig am 15.03.2024	93	0,24
60 Earthstone Energy Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig am 15.04.2027	59	0,15	260 Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 01.11.2026	244	0,63
40 Entegris Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2028	35	0,09	60 Sizzling Platter LLC / Sizzling Platter Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig am 28.11.2025	54	0,14
250 EQM Midstream Partners LP, 4,125 %, fällig am 01.12.2026	226	0,58	120 Spirit Airlines Inc, 1,000 %, fällig 15.05.2026	105	0,27
40 EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, fällig am 01.06.2027	40	0,10	268 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	273	0,70
190 EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, fällig am 01.07.2027	184	0,47	300 Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15.11.2028	317	0,82
10 EQM Midstream Partners LP, 5,500 %, fällig am 15.07.2028	9	0,02	40 Starwood Property Trust Inc, 144A, 5,500 %, fällig am 01.11.2023	40	0,10
250 Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, fällig am 15.11.2025	219	0,56	150 Starwood Property Trust Inc, 144A, 3,750 %, fällig am 31.12.2024	140	0,36
600 Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, fällig 10.08.2026	520	1,34	200 Starwood Property Trust Inc, 144A, 3,625 %, fällig am 15.07.2026	177	0,46
220 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig am 28.05.2027	207	0,53	280 StoneX Group Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.06.2025	286	0,74
330 Forestar Group Inc, 144A, 3,850 %, fällig 15.05.2026	281	0,73	300 Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP / Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp, 144A, 5,875 %, fällig am 15.05.2025	278	0,72
300 Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig am 15.02.2028	274	0,71	90 Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp, 144A, 5,250 %, fällig am 15.01.2029	81	0,21
190 Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000 %, fällig 01.11.2026	148	0,38	110 Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig am 15.10.2026	107	0,28
240 Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 5,625 %, fällig am 15.06.2024	230	0,59	270 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig am 01.09.2026	250	0,64
137 GEO Group Inc.The, 10,500 %, fällig 30.06.2028	131	0,34	410 Tenet Healthcare Corp, 144A, 4,625 %, fällig 15.06.2028	373	0,96
200 GEO Group Inc.The, 144A, 9,500 %, fällig 31.12.2028	181	0,47	130 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.04.2026	121	0,31
120 Granite US Holdings Corp, 144A, 11,000 %, fällig am 01.10.2027	117	0,30	160 TransDigm Inc, 5,500 %, fällig 15.11.2027	144	0,37
420 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 20.01.2026	384	0,99	200 Triton Water Holdings Inc, 144A, 6,250 %, fällig am 01.04.2029	164	0,42
370 HCA Inc, 5,625 %, fällig am 01.09.2028	372	0,96	32 United Airlines 2020-1 Klasse B Pass Through Trust, 4,875 %, fällig 15.01.2026	30	0,08
170 Holly Energy Partners LP / Holly Energy Finance Corp, 144A, 6,375 %, fällig am 15.04.2027	166	0,43	260 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	237	0,61
180 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,750 %, fällig am 15.01.2027	163	0,42	80 United Rentals North America Inc, 4,875 %, fällig am 15.01.2028	75	0,19
230 IIP Operating Partnership LP, 5,500 %, fällig am 25.05.2026	205	0,53	300 Urban One Inc, 144A, 7,375 %, fällig am 01.02.2028	270	0,70
170 Ladder Capital Finance Holdings LLLP - Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2027	149	0,38	370 US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig am 15.07.2027	178	0,46
320 LD Holdings Group LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.11.2025	184	0,48	340 Vericast Corp, 144A, 11,000 %, fällig 15.09.2026	341	0,88
160 LD Holdings Group LLC, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2028	85	0,22	180 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.11.2028	156	0,40
40 Legacy LifePoint Health LLC, 4,375 %, fällig am 15.02.2027	35	0,09	90 VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 3,750 %, fällig am 15.02.2027	82	0,21
250 Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144A, 5,000 %, fällig am 01.02.2026	229	0,59	220 Viking Cruises Ltd, 6,250 %, fällig 15.05.2025	197	0,51
43 Lehman Escrow Receipt, Nullkupon, fortwährend t=0	-	-	150 Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.05.2025	134	0,35
90 Match Group Holdings II LLC, 144A, 5,000 %, fällig am 15.12.2027	83	0,22			
280 MGM Resorts International, 5,500 %, fällig 15.04.2027	258	0,67			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit — Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Beazer Homes USA, Inc, 5,000 % — Kaufen	20.06.2027	120	\$ 9
Bank of America Merrill Lynch	KB Home, 5,000 % — Kaufen	20.06.2027	58	(2)
Bank of America Merrill Lynch	Macy's, Inc, 1,000 % — Kaufen	20.06.2027	120	19
Bank of America Merrill Lynch	Nova Chemicals Corp, 5,000 % — Kaufen	20.06.2027	37	–
Bank of America Merrill Lynch	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 % — Kaufen	20.06.2027	73	(3)
Bank of America Merrill Lynch	Xerox Holdings Corp, 1,000 % — Kaufen	20.06.2027	47	5
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				\$ 33
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				(5)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				\$ 28

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	AUD	–	\$ –
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	95	Verkauf	EUR	94	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.296	Verkauf	USD	3.369	(52)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	37	Verkauf	USD	26	(1)
16.11.2022	Citi	Kauf	USD	72	Verkauf	CAD	92	1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1\$)								\$ 1
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (29)\$)								(53)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (28)\$)								\$ (52)

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 0,86 % (28. Februar 2022: 0,80 %)			Deutschland — 2,33 % (28. Februar 2022: 1,60 %)		
590 Home Equity Asset Trust 2005-6, Serie 2005 6, Klasse M5, 3,389 %, fällig am 25.12.2035 *	550	0,22	EUR 3.000 Allianz SE, 3,200 %, fortwährend *	2.292	0,91
1.801 HSI Asset Securitization Corp Trust 2007-0PT1, Serie 2007 OPT1, Klasse 1A, 2,584 %, fällig am 25.12.2036 *	1.613	0,64	EUR 680 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, fällig 15.01.2027	562	0,22
Asset-Backed Securities insgesamt (Kosten 2.045 USD)			EUR 400 Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4,375 %, fällig 15.01.2028	364	0,14
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 2,07 % (28. Februar 2022: 3,08 %)			GBP 900 Deutsche Bank AG, 4,000 %, fällig 24.06.2026 *	984	0,39
580 BANK 2018-BNK15, Serie 2018 BN15, Klasse B, 4,812 %, fällig am 15.11.2061 *	552	0,22	EUR 800 Renk AG/Frankfurt am Main, 5,750 %, fällig am 15.07.2025	757	0,30
830 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Klasse 1B1, 5,994 %, fällig am 25.07.2030 *	844	0,33	EUR 558 TK Elevator Holdco GmbH, 6,625 %, fällig 15.07.2028	481	0,19
730 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Serie 2021 DNA3, Klasse B1, 144A, 5,683 %, fällig am 25.10.2033 *	678	0,27	EUR 540 TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig 15.05.2026	445	0,18
947 Hilton USA Trust 2016-HHV, Serie 2016 HHV, Klasse D, 144A, 4,333 %, fällig am 05.11.2038 *	856	0,34	Gibraltar — 0,26 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
5.300 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Serie 2018 PHMZ, Klasse M, 144A, 10,899 %, fällig am 15.06.2035 *†	1	–	EUR 750 888 Acquisitions Ltd, 7,558 %, fällig 15.07.2027	652	0,26
14 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12, Serie 2007 LD12, Klasse AJ, 6,723 %, fällig am 15.02.2051 *	12	0,01	Guatemala — 0,52 % (28. Februar 2022: 0,47 %)		
409 PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Serie 2021 1R, Klasse A, 144A, 5,344 %, fällig am 27.02.2024 *	400	0,16	1.400 Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, fällig am 27.04.2029 *	1.301	0,52
897 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-1, Serie 2017 1, Klasse M1, 144A, 4,000 %, fällig am 25.01.2056 *	888	0,35	Irland — 0,72 % (28. Februar 2022: 0,91 %)		
1.546 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR17 Trust, Serie 2005 AR17, Klasse A1C3, 3,404 %, fällig am 25.12.2045 *	990	0,39	440 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig am 30.01.2032	355	0,14
Summe Mortgage-Backed Securities (Anschaffungskosten 11.048 USD)			1.490 Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 15.02.2024	1.472	0,58
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 58,82 % (28. Februar 2022: 54,33 %)			Israel — 0,86 % (28. Februar 2022: 0,76 %)		
Argentinien — 0,48 % (28. Februar 2022: 0,38 %)			1.170 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig am 21.07.2023	1.124	0,44
1.320 Pampa Energia SA, 7,500 %, fällig 24.01.2027	1.209	0,48	1.250 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig am 01.10.2026	1.055	0,42
Australien — 0,31 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Italien — 0,96 % (28. Februar 2022: 0,66 %)		
828 Glencore Finance Canada Ltd, 6,000 %, fällig 15.11.2041	796	0,31	EUR 699 ASR Media and Sponsorship SpA, 5,125 %, fällig 01.08.2024	625	0,25
Belgien — 0,41 % (28. Februar 2022: 0,57 %)			EUR 620 Castor SpA, 6,000 %, fällig 15.02.2029	566	0,22
400 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, fällig am 01.02.2046	381	0,15	EUR 500 International Design Group SPA, 4,571 %, fällig 15.05.2026 *	463	0,18
200 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	182	0,07	EUR 610 Intesa Sanpaolo SpA, 6,375 %, unbefristet *	525	0,21
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439 %, fällig 06.10.2048	36	0,01	EUR 270 Marcolin SpA, 6,125 %, fällig 15.11.2026	247	0,10
240 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01.06.2050	218	0,09	Kasachstan — 0,93 % (28. Februar 2022 0,86 %)		
EUR 390 Ideal Standard International SA, 6,375 %, fällig am 30.07.2026	231	0,09	460 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig am 24.04.2030	431	0,17
			660 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, fällig 14.04.2033	521	0,21
			1.520 KazTransGas JSC, 4,375 %, fällig 26.09.2027	1.385	0,55
			Luxemburg — 0,41 % (28. Februar 2022: 0,42 %)		
			GBP 1.040 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig am 01.04.2028	1.027	0,41
			Macau — 0,16 % (28. Februar 2022: 0,15 %)		
			530 Sands China Ltd, 3,100 %, fällig am 03.08.2029	402	0,16
			Mexiko — 1,19 % (28. Februar 2022: 1,56 %)		
			1.360 BBVA Bancomer SA.Texas, 5,125 %, fällig 18.01.2033 *	1.215	0,48
			1.980 Orbia Advance Corp SAB de CV, 5,875 %, fällig 17.09.2044	1.795	0,71
			Marokko — 0,62 % (28. Februar 2022: 0,53 %)		
			1.600 OCP SA, 4,500 %, fällig 22.10.2025	1.569	0,62
			Niederlande — 2,48 % (28. Februar 2022: 1,51 %)		
			250 Cooperatieve Rabobank UA, 3,649 %, fällig am 06.04.2028 *	235	0,09
			EUR 800 Cooperatieve Rabobank UA, 3,250 %, unbefristet *	675	0,27
			EUR 200 Cooperatieve Rabobank UA, 4,875 %, unbefristet *	171	0,07
			GBP 1.100 ING Groep NV, 5,000 %, fällig am 30.08.2026 *	1.267	0,50
			EUR 380 Promontoria Holding 264 BV, 6,375 %, fällig am 01.03.2027	326	0,13
			1.510 Trivium Packaging Finance BV, 5,500 %, fällig am 15.08.2026	1.451	0,57
			EUR 1.020 United Group BV, 5,250 %, fällig 01.02.2030	805	0,32
			1.150 VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2032	947	0,38
			EUR 430 WP/AP Telecom Holdings IV BV, 3,750 %, fällig am 15.01.2029	369	0,15
			Peru — 1,82 % (28. Februar 2022: 1,74 %)		
			Niederlande — 2,48 % (28. Februar 2022: 1,51 %)		
			610 Petroleos del Peru SA, 5,625 %, fällig am 19.06.2047	422	0,17
			2.140 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	2.065	0,82
			2.170 Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, fällig am 30.04.2028	2.098	0,83
			Südafrika — 0,57 % (28. Februar 2022: 0,54 %)		
			Peru — 1,82 % (28. Februar 2022: 1,74 %)		
			200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 10.04.2027	196	0,08
			1.480 Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, fällig am 18.03.2031	1.246	0,49
			Südafrika — 0,57 % (28. Februar 2022: 0,54 %)		
			Summe Wertpapiere		
			Summe Wertpapiere		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
Spanien — 1,30 % (28. Februar 2022: 1,05 %)					
EUR	590	0,21	1.928	1.515	0,60
EUR	420	0,14	750	691	0,27
EUR	300	0,11	930	939	0,37
EUR	900	0,27	850	881	0,35
EUR	370	0,14	540	552	0,22
EUR	1.130	0,43	970	951	0,38
	3.286	1,30	640	612	0,24
Schweden — 0,53 % (28. Februar 2022: 0,36 %)					
EUR	680	0,20	624	633	0,25
EUR	1.080	0,20	246	253	0,10
	494	0,13	1.200	1.100	0,44
	330	0,13	420	381	0,15
	1.329	0,53	2.250	1.777	0,70
Schweiz — 1,71 % (28. Februar 2022: 1,62 %)					
	1.275	0,50	670	516	0,20
	446	0,18	830	817	0,32
	636	0,25	200	238	0,09
	1.968	0,78	940	972	0,39
	4.325	1,71	830	830	0,33
Vereinigte Arabische Emirate — 0,74 % (28. Februar 2022: 0,69 %)					
	1.861	0,74	860	792	0,31
Vereinigtes Königreich — 5,79 % (28. Februar 2022: 4,62 %)					
GBP	689	0,27	30	31	0,01
GBP	570	0,21	970	919	0,36
GBP	210	0,08	640	627	0,25
GBP	1.160	0,48	210	200	0,08
GBP	1.459	0,56	50	41	0,02
	1.398	0,07	780	852	0,34
	178	0,07	390	344	0,14
	1.470	0,56	1.515	1.229	0,49
EUR	110	0,04	1.670	1.505	0,60
EUR	1.600	0,61	1.156	1.094	0,43
GBP	1.275	0,46	50	48	0,02
	1.171	0,28	350	335	0,13
	692	0,28	390	394	0,16
	414	0,16	235	185	0,07
	1.119	0,44	590	628	0,25
	525	0,21	970	928	0,37
	1.156	0,46	30	22	0,01
EUR	300	0,10	710	537	0,21
GBP	360	0,14	1.800	1.772	0,70
GBP	680	0,26	47	47	0,02
GBP	1.000	0,40	550	627	0,25
	14.609	5,79	865	1.001	0,40
USA — 26,11 % (28. Februar 2022: 25,96 %)					
	770	0,31	135	157	0,06
	457	0,18	370	348	0,14
	747	0,30	440	383	0,15
	381	0,15	318	2	-
	1.193	0,47	660	668	0,26
	557	0,22	140	122	0,05
	698	0,28	290	238	0,09
	1.297	0,51	430	345	0,14
GBP	502	0,20	1.083	1.000	0,40
	1.305	0,52	200	177	0,07
	155	0,06	160	174	0,07
	211	0,08	340	327	0,13
	165	0,07	1.500	1.435	0,57
	596	0,24	580	626	0,25
	1.834	0,73	690	636	0,25
	613	0,24	490	366	0,14
	1.113	0,44	2.400	2.227	0,88
	326	0,13	205	237	0,09
	278	0,11	610	545	0,22
	299	0,12	700	712	0,28
	551	0,22	1.620	1.958	0,78
	334	0,13	980	959	0,38
			870	805	0,32
			630	554	0,22
			290	288	0,11
			500	433	0,17

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — (Fortsetzung)					
520	Verizon Communications Inc, 3,400 %, fällig am 22.03.2041	419	0,17		
150	Verizon Communications Inc, 3,550 %, fällig 22.03.2051	118	0,05		
420	Verizon Communications Inc, 3,700 %, fällig 22.03.2061	324	0,13		
460	Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.09.2027	372	0,15		
530	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig am 15.02.2029	434	0,17		
1.000	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	846	0,34		
510	Wells Fargo & Co, 3,473 %, fällig 26.04.2028 *	552	0,22		
560	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig am 04.04.2051 *	548	0,22		
880	Wells Fargo & Co, Serie U, 5,875 %, unbefristet *	878	0,35		
330	Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig am 01.06.2025	316	0,12		
680	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig am 15.08.2048	594	0,24		
900	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig am 01.02.2050	780	0,31		
452	Williams Cos Inc/The, Serie A, 7,500 %, fällig am 15.01.2031	513	0,20		
1.235	Williams Cos Inc/The, 5,750 %, fällig am 24.06.2044	1.249	0,49		
		65.863	26,11		
Sambia — 0,63 % (28. Februar 2022: 0,56 %)					
560	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2025	552	0,22		
1.090	First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 01.03.2026	1.048	0,41		
		1.600	0,63		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 169.011 USD)					
		148.393	58,82		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 20,52 % (28. Februar 2022: 21,55 %)					
Argentinien — 0,45 % (28. Februar 2022: 0,46 %)					
3.264	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 5,250 %, fällig am 01.09.2037	1.148	0,45		
Brasilien — 2,05 % (28. Februar 2022: 2,59 %)					
BRL 16.570	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, fällig am 01.01.2025	3.059	1,21		
BRL 11.694	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, fällig am 01.01.2027	2.107	0,84		
		5.166	2,05		
Kolumbien — 0,39 % (28. Februar 2022: 0,40 %)					
1.350	Colombia Government International Bond, 5,625 %, fällig am 26.02.2044	988	0,39		
Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) — 0,29 % (28. Februar 2022: 0,30 %)					
EUR 880	Ivory Coast Government International Bond, 5,250 %, fällig 22.03.2030	720	0,29		
Dominikanische Republik — 0,22 % (28. Februar 2022: 0,20 %)					
670	Dominican Republic International Bond, 144A, 4,875 %, fällig am 23.09.2032	543	0,22		
Ägypten — 0,74 % (28. Februar 2022: 0,74 %)					
1.360	Egypt Government International Bond, 3,875 %, fällig 16.02.2026	1.076	0,42		
EUR 1.180	Egypt Government International Bond, 6,375 %, fällig 11.04.2031	799	0,32		
		1.875	0,74		
Gabun — 0,46 % (28. Februar 2022: 0,47 %)					
1.550	Gabon Government International Bond, 144A, 7,000 %, fällig 24.11.2031	1.161	0,46		
Ghana — 0,15 % (28. Februar 2022: 0,23 %)					
1.000	Ghana Government International Bond, 7,625 %, fällig 16.05.2029	383	0,15		
Indonesien — 3,27 % (28. Februar 2022: 2,96 %)					
1.390	Indonesia Government International Bond, 5,250 %, fällig 17.01.2042	1.395	0,55		
IDR 45.226.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	3.081	1,22		
IDR 52.396.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR78, 8,250 %, fällig 15.05.2029	3.775	1,50		
		8.251	3,27		
Mexiko — 3,22 % (28. Februar 2022: 2,84 %)					
MXN 45.164	Mexican Bonos, Serie M 20, 7,500 %, fällig 03.06.2027	2.103	0,83		
MXN 137.587	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	6.033	2,39		
		8.136	3,22		
Nigeria — 0,13 % (28. Februar 2022: 0,14 %)					
520	Nigeria Government International Bond, 7,625 %, fällig 28.11.2047	322	0,13		
Panama — 0,21 % (28. Februar 2022: 0,22 %)					
680	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 01.04.2056	528	0,21		
Peru — 0,19 % (28. Februar 2022: 0,37 %)					
500	Peruvian Government International Bond, 2,392 %, fällig 23.01.2026	469	0,19		
Polen — 1,26 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
PLN 21.700	Republic of Poland Government Bond, Serie O432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	3.177	1,26		
Romania — 0,25 % (28. Februar 2022: 0,27 %)					
EUR 940	Romanian Government International Bond, 2,000 %, fällig 14.04.2033	625	0,25		
Russien — 1,53 % (28. Februar 2022: 1,14 %)					
RUB 288.495	Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 19.01.2028 ty	1.516	0,60		
RUB 118.210	Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 23.05.2029 ty	621	0,24		
RUB 329.535	Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig 10.05.2034 ty	1.731	0,69		
		3.868	1,53		
Südafrika — 1,68 % (28. Februar 2022: 1,67 %)					
ZAR 72.778	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	2.678	1,06		
2.180	Republic of South Africa Government International Bond, 5,750 %, fällig 30.09.2049	1.562	0,62		
		4.240	1,68		
USA — 4,03 % (28. Februar 2022: 3,45 %)					
770	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/02/2027	733	0,29		
30	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15/08/2030	25	0,01		
1.030	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/08/2031	877	0,35		
1.400	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/11/2031	1.199	0,48		
3.580	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2032	3.490	1,38		
120	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 15/08/2041	89	0,04		
140	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/11/2041	109	0,04		
1.650	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/05/2045 =	1.492	0,59		
15	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/11/2045	14	0,01		
500	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/08/2046 =	392	0,16		
360	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/02/2047	327	0,13		
120	United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 15/05/2048	113	0,04		
820	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/02/2049	763	0,30		
430	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2049	391	0,15		
40	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15/05/2050	25	0,01		
200	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/08/2050	128	0,05		
		10.167	4,03		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 72.872\$)					
		51.767	20,52		
Schuldscheindarlehen — 3,89 % (28. Februar 2022: 4,09 %)					
585	Alterra Mountain Co, 5,872 %, fällig am 30.07.2028 *	571	0,23		
958	API Group Inc, 5,024 %, fällig am 01.10.2026 *	946	0,38		
679	Asurion LLC, 5,372 %, fällig 03.11.2024 *	655	0,26		
827	Caesars Resort Collection LLC, 5,122 %, fällig am 22.12.2024 *	818	0,32		
811	Clarios Global LP, 5,622 %, fällig am 30.04.2026 *	793	0,31		
632	Focus Financial Partners LLC, 4,372 %, fällig am 03.07.2024 *	625	0,25		
463	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 4,372 %, fällig am 15.11.2027 *	449	0,18		
1.246	Hilton Worldwide Finance LLC, 4,194 %, fällig am 21.06.2026 *	1.222	0,48		
397	Level 3 Parent LLC, 4,122 %, fällig am 01.03.2027 *	380	0,15		
151	Nexstar Broadcasting Inc, 4,872 %, fällig am 19.09.2026 *	151	0,06		
590	Prime Security Installations Ltd, 5,107 %, fällig am 23.09.2026 *	578	0,23		
933	Sedgwick Claims Management Services Inc, 5,622 %, fällig am 31.12.2025 *	916	0,36		
600	Sotera Health, 5,122 %, fällig am 13.12.2026 *	585	0,23		
897	Terrier Media Buyer, Inc., 5,872 %, fällig am 17.12.2026 *	873	0,35		
252	UFC Holdings Plc, 5,520 %, fällig 29.04.2026 *	245	0,10		
		9.807	3,89		
Summe Schuldverschreibungen (Kosten 10.049 USD)					

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen — 4,15 % (28. Februar 2022: 9,56 %)		
EUR 57 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc — Western Asset European Loan — LM Class Euro Accumulating	5.875	2,33
35 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc — Western Asset India Bond Fund — LM Class US\$ Akkumulierend	4.602	1,82
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 10.246\$)	10.477	4,15
Stammaktien — 0,16 % (28. Februar 2022: 0,15 %)		
USA — 0,16 % (28. Februar 2022: 0,15 %)		
44 Berry Corp	401	0,16
Summe Stammaktien (Kosten 491 USD)	401	0,16
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Kosten 275.762 USD)		
	228.229	90,47
Devisenterminkontrakte — 0,71 % (28. Februar 2022: 1,52 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.803	0,71
Futures — (0,07 %) (28. Februar 2022: 0,03 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	170	0,07
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	230.202	95,11
Inflationsswaps — (0,13 %) (28. Februar 2022: (0,09 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(339)	(0,13)
Devisenterminkontrakte — (1,42 %) (28. Februar 2022: (0,75 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(3.582)	(1,42)
Futures — (0,62 %) (28. Februar 2022: (0,42 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.563)	(0,62)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	(5.484)	(2,17)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	224.718	89,08
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
	27.544	10,92
Gesamtnettovermögen	252.262\$	100,00

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 35.230.000\$ und machten 13,97 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.
- † Nicht liquide.
- ∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach Ermessen des Bewertungsausschusses.
- ≠ Die Wertpapiere (in ihrer Gesamtheit oder in Teilen) sind zum 31. August 2022 als Sicherheit für den Handel mit Derivaten verpfändet.
- γ Aufgrund der Ungewissheit der Zinszahlungen werden während und/oder nach dem zum 31. August 2022 endenden Geschäftsjahr keine Erträge aus dem Wertpapier mehr gezahlt.

ABKÜRZUNGEN:

- Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
- REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.
- BRL – Brasilianischer Real
- EUR – Euro
- GBP – Britisches Pfund Sterling
- IDR – Indonesische Rupiah
- MXN – Mexikanischer Peso
- PLN – Polnischer Zloty
- RUB – Russischer Rubel
- ZAR – Südafrikanischer Rand

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	80,50
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	3,80
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,06
Finanzderivate	0,76
Sonstige Vermögenswerte	10,88
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	USD — VPI Städtische Verbraucher	28.04.2026	3.220	\$ (339)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (263)\$)				(339)
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (263)\$)				\$ (339)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
09.08.2022	Citi	Kauf USD 5.141	Verkauf IDR 76.495.699	\$ (11)
09.08.2022	Citi	Kauf USD 5.109	Verkauf INR 402.166	53
09.08.2022	Citi	Kauf INR 108.790	Verkauf USD 1.388	(20)
09.08.2022	Citi	Kauf IDR 34.311.880	Verkauf USD 2.352	(41)
09.08.2022	Morgan Stanley	Kauf USD 2.399	Verkauf BRL 11.720	150
09.08.2022	Morgan Stanley	Kauf USD 3.453	Verkauf TWD 99.169	194
09.08.2022	Morgan Stanley	Kauf BRL 11.719	Verkauf USD 2.317	(69)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD 854	Verkauf AUD 1.237	8
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD 32	Verkauf CHF 31	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD 166	Verkauf EUR 166	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD 71	Verkauf EUR 69	2
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD 677	Verkauf GBP 564	21
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD 20	Verkauf PLN 91	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD –	Verkauf SGD –	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD 11	Verkauf SGD 14	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf ZAR 7.748	Verkauf USD 463	(13)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf AUD 121.814	Verkauf USD 85.066	(1.694)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf GBP 27.502	Verkauf USD 33.231	(1.272)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	109	Verkauf	USD	108	1	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CHF	2.968	Verkauf	USD	3.116	\$ (76)	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	12.998	Verkauf	USD	2.811	(52)	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	9.685	Verkauf	USD	9.898	(154)	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.336	Verkauf	USD	969	(13)	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	45	Verkauf	ZAR	745	1	
16.11.2022	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	6.634	Verkauf	SGD	9.120	104	
16.11.2022	BNP Paribas	Kauf	USD	664	Verkauf	GBP	547	28	
16.11.2022	BNP Paribas	Kauf	JPY	348.486	Verkauf	USD	2.604	(78)	
16.11.2022	Citi	Kauf	USD	329	Verkauf	AUD	470	7	
16.11.2022	Citi	Kauf	USD	8.591	Verkauf	GBP	7.092	341	
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	322	Verkauf	AUD	460	7	
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.879	Verkauf	GBP	2.377	114	
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	4.186	Verkauf	MXN	87.017	(69)	
16.11.2022	HSBC	Kauf	USD	28.362	Verkauf	EUR	27.641	437	
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	1.483	Verkauf	GBP	1.221	62	
16.11.2022	Morgan Stanley	Kauf	CAD	1.230	Verkauf	USD	956	(20)	
16.11.2022	UBS	Kauf	USD	6.309	Verkauf	GBP	5.246	206	
12.09.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	2.265	Verkauf	BRL	11.720	67	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 4.595\$)								\$	1.803
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (2.265)\$)									(3.582)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 2.330\$)								\$	(1.779)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
90 Day Euro\$ Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	133	31.898 \$	\$ (953)	
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	76	18.290	(587)	
Australia 3 Year Bond September 2022	Bank of America Merrill Lynch	149	10.981	35	
Euro-Bobl September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(5)	(619)	18	
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(165)	15	
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(39)	(4.559)	38	
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	12	2.500	(5)	
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(337)	(37.346)	33	
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(23)	(3.124)	31	
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	45	6.728	(18)	
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 104\$)				\$	170
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.281)\$)					(1.563)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.177)\$)				\$	(1.393)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 6,42 % (28. Februar 2022: 4,73 %)					
500	522	0,25	210	189	0,10
	522		600	517	0,27
310	286	0,15	260	236	0,12
			840	741	0,39
400	370	0,19	640	648	0,34
			340	300	0,16
400	390	0,21		3.369	1,77
300	274	0,15	Cayman Islands — 0,87 % (28. Februar 2022: 1,03 %)		
710	683	0,36	2.045	1.658	0,87
250	226	0,12	Chile — 0,04 % (28. Februar 2022: 0,03 %)		
910	810	0,43	80	71	0,04
440	406	0,21	Frankreich — 0,82 % (28. Februar 2022: 1,24 %)		
420	372	0,20	330	314	0,16
400	364	0,19	650	495	0,26
250	239	0,13	800	760	0,40
300	276	0,14		1.569	0,82
300	284	0,15	Hong Kong — 0,23 % (28. Februar 2022: 0,15 %)		
250	219	0,12	200	153	0,08
300	276	0,14	450	294	0,15
250	219	0,12		447	0,23
510	465	0,24	Indien — 0,26 % (28. Februar 2022: 0,29 %)		
250	230	0,12	540	489	0,26
300	275	0,15	Irland — 0,19 % (28. Februar 2022: 0,16 %)		
300	275	0,14	440	355	0,19
443	399	0,21	Israel — 0,83 % (28. Februar 2022: 0,96 %)		
500	439	0,23	20	18	0,01
280	248	0,13	1.780	1.559	0,82
500	483	0,25		1.577	0,83
250	222	0,12	Italien — 0,46 % (28. Februar 2022: 0,43 %)		
500	465	0,24	500	364	0,19
300	272	0,14	660	522	0,27
350	322	0,17		886	0,46
580	537	0,28	Luxemburg — 1,12 % (28. Februar 2022: 0,81 %)		
475	441	0,23	1.100	887	0,47
280	250	0,13	710	614	0,32
320	302	0,16	800	622	0,33
100	82	0,04		2.123	1,12
500	473	0,25	Macau — 1,18 % (28. Februar 2022: 0,97 %)		
370	355	0,19	200	173	0,09
	12.210	6,42	200	172	0,09
			450	330	0,17
			200	154	0,08
			1.560	1.094	0,58
			460	321	0,17
				2.244	1,18
			Niederlande — 0,19 % (28. Februar 2022: 0,16 %)		
			420	360	0,19
			Polen — 0,17 % (28. Februar 2022: 0,06 %)		
			390	317	0,17
			Schweiz — 1,48 % (28. Februar 2022: 0,77 %)		
			530	507	0,27
			720	729	0,38
			920	722	0,38
			200	165	0,09
			800	689	0,36
				2.812	1,48
			Vereinigtes Königreich — 1,20 % (28. Februar 2022: 1,44 %)		
			280	276	0,15
			800	630	0,33
			450	401	0,21
			470	402	0,21
			700	577	0,30
				2.286	1,20
Asset-Backed Securities insgesamt (Kosten 13.079 USD)					
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 82,82 % (28. Februar 2022: 86,26 %)					
Argentinien — 0,47 % (28. Februar 2022: 0,34 %)					
200	180	0,10			
818	708	0,37			
	888	0,47			
Bermudas — 0,60 % (28. Februar 2022: 0,31 %)					
1.181	1.137	0,60			
Kanada — 1,77 % (28. Februar 2022: 1,82 %)					
550	492	0,26			
280	246	0,13			

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinven- tarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — 69,91 % (28. Februar 2022: 74,05 %)					
580 Academy Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2027	542	0,29	1.140 Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2029	971	0,51
742 Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2028	799	0,42	380 Carrols Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029	286	0,15
440 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, fällig am 01.05.2028	370	0,19	680 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig am 01.02.2031	556	0,29
190 AdaptHealth LLC, 144A, 6,125 %, fällig am 01.08.2028	175	0,09	740 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	613	0,32
550 AdaptHealth LLC, 144A, 4,625 %, fällig am 01.08.2029	459	0,24	1.520 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig am 01.05.2032	1.235	0,65
360 AdaptHealth LLC, 144A, 5,125 %, fällig am 01.03.2030	308	0,16	200 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig am 01.06.2033	157	0,08
560 ADT Security Corp/The, 144A, 4,125 %, fällig am 01.08.2029	482	0,25	370 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig am 15.01.2034	282	0,15
307 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig am 01.03.2028	292	0,15	690 Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig am 15.06.2029	662	0,35
480 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, fällig am 15.06.2030	476	0,25	520 Cheniere Energy Partners LP, 4,000 %, fällig am 01.03.2031	456	0,24
850 Akumin Inc, 144A, 7,000 %, fällig am 01.11.2025	723	0,38	100 Chesapeake Energy Corp, 144A, 5,500 %, fällig am 01.02.2026	97	0,05
1.830 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, fällig am 15.02.2028	927	0,49	1.200 Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, fällig am 01.06.2026	1.166	0,61
300 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig am 15.07.2026	281	0,15	770 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2029	482	0,25
500 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig am 01.06.2029	372	0,20	1.000 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, fällig am 01.04.2030	621	0,33
850 Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/ Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig am 01.06.2028	713	0,38	490 Clarivate Science Holdings Corp, 144A, 4,875 %, fällig am 01.07.2029	406	0,21
570 Alta Equipment Group Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 15.04.2026	495	0,26	510 Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 01.06.2029	411	0,22
590 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 10,000 %, fällig am 15.06.2026	475	0,25	600 CNX Midstream Partners LP, 144A, 4,750 %, fällig am 15.04.2030	507	0,27
810 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 15.02.2029	698	0,37	480 Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, fällig am 01.10.2031	293	0,15
170 American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 20.04.2026	162	0,09	1.030 Colgate Energy Partners III LLC, 144A, 5,875 %, fällig am 01.07.2029	956	0,50
1.280 American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 20.04.2029	1.157	0,61	1.500 CommScope Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.03.2027	1.288	0,68
410 American Axle & Manufacturing Inc, 6,500 %, fällig am 01.04.2027	384	0,20	790 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 01.09.2029	674	0,35
1.260 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig am 01.10.2029	1.063	0,56	580 Compass Group Diversified Holdings LLC, 144A, 5,250 %, fällig am 15.04.2029	494	0,26
445 American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig am 01.09.2026	503	0,26	630 Comstock Resources Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.01.2030	577	0,30
86 Anagram International Inc / Anagram Holdings LLC, 144A, 10,000 %, fällig am 15.08.2026	85	0,04	110 CoreCivic Inc, 4,625 %, fällig 01.05.2023	109	0,06
410 Antero Resources Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01.03.2030	386	0,20	1.320 CoreCivic Inc, 8,250 %, fällig 15.04.2026	1.307	0,69
390 Apache Corp, 7,750 %, fällig am 15.12.2029	415	0,22	460 Covanta Holding Corp, 144A, 4,875 %, fällig am 01.12.2029	389	0,20
750 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 15.06.2029	609	0,32	310 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	286	0,15
250 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig am 15.06.2027	245	0,13	320 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2030	248	0,13
870 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, fällig am 01.09.2029	706	0,37	450 CSC Funding LLC, 144A, 4,125 %, fällig am 01.12.2030	365	0,19
800 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig am 15.08.2027	580	0,31	300 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	241	0,13
310 Bath & Body Works Inc, 144A, 9,375 %, fällig am 01.07.2025	328	0,17	430 CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.11.2031	307	0,16
250 Bath & Body Works Inc, 7,500 %, fällig am 15.06.2029	241	0,13	250 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig am 03.11.2036	252	0,13
900 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig am 01.10.2030	819	0,43	600 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, fällig am 15.09.2037	638	0,34
480 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.02.2027	356	0,19	250 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig am 15.01.2026	255	0,13
1.020 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029	387	0,20	400 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig am 20.10.2028	382	0,20
400 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,250 %, fällig 30.01.2030	149	0,08	1.390 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig am 15.08.2027	1.274	0,67
860 Bed Bath & Beyond Inc, 5,165 %, fällig am 01.08.2044	178	0,09	2.220 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	1.753	0,92
1.300 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2026	1.223	0,64	1.350 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	1.039	0,55
430 Blackstone Mortgage Trust Inc, 5,500 %, fällig am 15.03.2027	398	0,21	1.920 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	1.141	0,60
300 Blue Racer Midstream LLC . Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15.12.2025	299	0,16	300 DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	217	0,11
1.020 Blue Racer Midstream LLC . Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2026	967	0,51	430 Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig am 15.06.2025	423	0,22
810 Boyne USA Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.05.2029	722	0,38	630 Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, fällig am 15.02.2028	466	0,25
640 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig am 01.02.2026	581	0,31	290 Diversified Healthcare Trust, 4,375 %, fällig am 01.03.2031	199	0,11
200 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,250 %, fällig am 15.04.2028	178	0,09	510 Dornoch Debt Merger Sub Inc, 144A, 6,625 %, fällig am 15.10.2029	398	0,21
1.120 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2030	990	0,52	880 DraftKings Holdings Inc, Nullkupon, fällig am 15.03.2028	599	0,32
410 Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,250 %, fällig am 01.07.2025	401	0,21	330 Earthstone Energy Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig am 15.04.2027	322	0,17
320 Caesars Entertainment Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.10.2029	258	0,14	230 Edgewell Personal Care Co, 144A, 4,125 %, fällig am 01.04.2029	198	0,10
520 Cano Health LLC, 144A, 6,250 %, fällig 01.10.2028	468	0,25	550 Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig 15.07.2029	466	0,25
700 Carnival Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.03.2027	545	0,29	80 Endeavour Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig am 30.01.2028	79	0,04
570 Carnival Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01.05.2029	433	0,23	180 Energy Transfer LP, Serie H, 6,500 %, fortwährend *	167	0,09
570 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig 01.06.2030	522	0,27	210 EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000 %, fällig am 01.07.2025	203	0,11
830 Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.10.2029	648	0,34	200 EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, fällig am 01.07.2027	193	0,10
			730 EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, fällig am 01.06.2030	726	0,38
			170 EQM Midstream Partners LP, 144A, 4,750 %, fällig am 15.01.2031	147	0,08
			1.570 EQM Midstream Partners LP, 6,500 %, fällig am 15.07.2048	1.334	0,70
			770 Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 15.01.2029	672	0,35
			340 Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc, 144A, 6,750 %, fällig am 15.01.2030	278	0,15
			510 FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 09.01.2028	442	0,23
			590 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 01.01.2030	529	0,28

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Kreditausfallversicherungen

Gegenpartei	Referenzeinheit — Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Beazer Homes USA, Inc, 5,000 % — Kaufen	20.06.2027	580	\$ 44
Goldman Sachs	Ford Motor Co, 5,000 % — Verkaufen	20.12.2026	900	65
Goldman Sachs	KB Home, 5,000 % — Kaufen	20.06.2027	812	(24)
Goldman Sachs	Macy's, Inc, 1,000 % — Kaufen	20.06.2027	580	91
Goldman Sachs	Nova Chemicals Corp, 5,000 % — Kaufen	20.06.2027	429	(4)
Goldman Sachs	Occidental Petroleum Corporation, 1,000 % — Verkaufen	20.06.2026	920	(1)
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 % — Kaufen	20.06.2027	580	(26)
Goldman Sachs	Xerox Holdings Corp, 1,000 % — Kaufen	20.06.2027	231	24
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 112\$)				\$ 224
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (19)\$)				(55)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 93\$)				\$ 169

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	55	Verkauf	EUR	55	\$ —
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	GBP	—	—
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	9	Verkauf	SGD	14	—
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	38	Verkauf	USD	47	(2)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.811	Verkauf	USD	1.850	\$ (29)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	546	Verkauf	USD	396	(5)
18.10.2022	Citi	Kauf	USD	6	Verkauf	CAD	8	—
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): —\$)								—
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (41)\$)								(36)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (41)\$)								\$ (36)

Aufstellung der Terminkontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Goldman Sachs	76	8.422 \$
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 47\$)			\$ —
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (72)\$)			(45)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (25)\$)			(45)

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 70,78 % (28. Februar 2022: 62,78 %)			Indonesien — 4,28 % (28. Februar 2022: 4,29 %)		
Brasilien — 3,82 % (28. Februar 2022: 4,17 %)			200 Freeport Indonesia PT, 4,763 %, fällig 14.04.2027		
300 B3 SA — Brasil Bolsa Balcao, 4,125 %, fällig am 20.09.2031	254	0,56	400 Hutama Karya Persero PT, 3,750 %, fällig am 11.05.2030	377	0,83
200 Braskem Netherlands Finance BV, 4,500 %, fällig 10.01.2028	186	0,41	460 Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, 6,530 %, fällig am 15.11.2028	480	1,06
200 Itau Unibanco Holding SA, Cayman Island, 6,125 %, fortwährend *	184	0,41	460 Minejesa Capital BV, 5,625 %, fällig 10.08.2037	378	0,84
360 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig am 05.06.2115	314	0,69	200 Pertamina Persero PT, 2,300 %, fällig 09.02.2031	167	0,37
200 Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, fällig am 15.01.2032	159	0,35	460 Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4,000 %, fällig 30.06.2050	339	0,75
460 Ultrapar International SA, 5,250 %, fällig am 06.10.2026	456	1,01		1.936	4,28
200 Vale Overseas Ltd, 3,750 %, fällig 08.07.2030	174	0,39			
	1.727	3,82			
Chile — 5,21 % (28. Februar 2022: 3,70 %)			Irland — 0,36 % (28. Februar 2022: 0,46 %)		
200 Antofagasta Plc, 5,625 %, fällig 13.05.2032	198	0,44	200 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig am 30.01.2032	161	0,36
580 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig am 27.04.2026	510	1,13			
200 Banco del Estado de Chile, 2,704 %, fällig am 09.01.2025	191	0,42	Israel — 2,31 % (28. Februar 2022: 2,70 %)		
200 Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA, 3,693 %, fällig am 13.09.2061	135	0,30	460 Bank Leumi Le-Israel BM, 144A, 3,275 %, fällig am 29.01.2031 *	410	0,91
200 Empresa Nacional del Petroleo, 3,750 %, fällig 05.08.2026	186	0,41	200 Israel Electric Corp Ltd, 144A, 3,750 %, fällig 22.02.2032	186	0,41
200 Engie Energia Chile SA, 3,400 %, fällig 28.01.2030	164	0,36	460 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,000 %, fällig 15.04.2024	447	0,99
165 GNL Quintero SA, 4,634 %, fällig 31.07.2029	161	0,36		1.043	2,31
200 Inversiones CMPC SA, 3,000 %, fällig 06.04.2031	167	0,37	Kasachstan — 1,79 % (28. Februar 2022 2,37 %)		
200 Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 3,500 %, fällig 10.09.2051	150	0,33	200 KazMunayGas National Co JSC, 6,375 %, fällig 24.10.2048	389	0,86
200 Transelec SA, 3,875 %, fällig 12.01.2029	185	0,41	460 KazTransGas JSC, 4,375 %, fällig 26.09.2027	419	0,93
460 VTR Comunicaciones SpA, 5,125 %, fällig 15.01.2028	309	0,68		808	1,79
	2.356	5,21			
China — 4,78 % (28. Februar 2022: 4,05 %)			Kuwait — 2,25 % (28. Februar 2022: 2,66 %)		
200 CCBL Cayman 1 Corp Ltd, 1,990 %, fällig 21.07.2025	187	0,41	460 MEGlobal Canada ULC, 5,875 %, fällig am 18.05.2030	483	1,07
200 CDBL Funding 1, 4,250 %, fällig 02.12.2024	198	0,44	200 NBK SPC Ltd, 1,625 %, fällig 15.09.2027 *	179	0,40
200 CDBL Funding 2, 2,000 %, fällig 04.03.2026	184	0,41	400 NBK Tier 1 Ltd, 3,625 %, unbefristet *	354	0,78
200 China SCE Group Holdings Ltd, 7,375 %, fällig 09.04.2024	62	0,14		1.016	2,25
200 Chinalco Capital Holdings Ltd, 2,125 %, fällig 03.06.2026	185	0,41	Macau — 0,34 % (28. Februar 2022: 0,41 %)		
200 CMB International Leasing Management Ltd, 2,750 %, fällig am 12.08.2030	165	0,36	200 Sands China Ltd, 3,100 %, fällig am 03.08.2029	152	0,34
200 Coastal Emerald Ltd, 4,300 %, fortwährend *	192	0,43	Malaysia — 1,54 % (28. Februar 2022: 0,90 %)		
460 Huarong Finance 2019 Co Ltd, 2,125 %, fällig 30.09.2023	429	0,95	200 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig am 19.08.2050	146	0,32
200 ICBCL Finance Co Ltd, 1,750 %, fällig 02.08.2026	182	0,40	200 Gohl Capital Ltd, 4,250 %, fällig 24.01.2027	181	0,40
200 Pingan Real Estate Capital Ltd, 3,450 %, fällig am 29.07.2026	165	0,37	200 Misc Capital Two Labuan Ltd, 3,625 %, fällig am 06.04.2025	195	0,43
200 Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig am 13.07.2031	149	0,33	200 Petronas Capital Ltd, 2,480 %, fällig 28.01.2032	175	0,39
200 Shimao Group Holdings Ltd, 3,975 %, fällig 16.09.2023 *	29	0,06		697	1,54
200 Times China Holdings Ltd, 6,750 %, fällig 08.07.2025	32	0,07	Mexiko — 5,32 % (28. Februar 2022: 4,24 %)		
	2.159	4,78	200 Alpek SAB de CV, 3,250 %, fällig 25.02.2031	170	0,38
Kolumbien — 3,55 % (28. Februar 2022: 4,30 %)			200 America Movil SAB de CV, 3,625 %, fällig 22.04.2029	189	0,42
500 Banco Bilbao Vizcaya Argentina Colombia SA, 4,875 %, fällig am 21.04.2025	484	1,07	200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 7,625 %, unbefristet *	188	0,42
200 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig am 28.05.2045	138	0,31	200 Banco Nacional de Comercio Exterior SNC/Kaimaninseln, 4,375 %, fällig am 14.10.2025	197	0,44
414 Millicom International Cellular SA, 6,250 %, fällig 25.03.2029	393	0,87	200 Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand, 5,375 %, fällig am 17.04.2025	201	0,44
460 Oleoducto Central SA, 4,000 %, fällig 14.07.2027	400	0,88	200 BBVA Bancomer SA.Texas, 5,125 %, fällig 18.01.2033 *	179	0,39
200 Transportadora de Gas Internacional SA ESP, 5,550 %, fällig 01.11.2028	192	0,42	200 Cemex SAB de CV, 3,875 %, fällig 11.07.2031	169	0,37
	1.607	3,55	200 Comision Federal de Electricidad, 3,348 %, fällig 09.02.2031	159	0,35
Costa Rica — 0,43 % (28. Februar 2022: 0,49 %)			460 Fresnillo Plc, 4,250 %, fällig 02.10.2050	356	0,79
200 Instituto Costarricense de Electricidad, 6,750 %, fällig am 07.10.2031	195	0,43	460 Orbia Advance Corp SAB de CV, 5,875 %, fällig 17.09.2044	417	0,92
Dominikanische Republik — 0,37 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			200 Petroleos Mexicanos, 4,500 %, fällig 23.01.2026	179	0,40
200 Empresa Generadora de Electricidad Haina SA, 144A, 5,625 %, fällig am 08.11.2028	168	0,37		2.404	5,32
Guatemala — 0,41 % (28. Februar 2022: 0,49 %)			Marokko — 0,98 % (28. Februar 2022: 1,15 %)		
200 Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 5,250 %, fällig 27.04.2029	186	0,41	260 OCP SA, 4,500 %, fällig 22.10.2025	255	0,56
Hong Kong — 2,73 % (28. Februar 2022: 3,04 %)			260 OCP SA, 5,125 %, fällig 23.06.2051	188	0,42
460 AIA Group Ltd, 3,200 %, fällig 16.09.2040	366	0,81		443	0,98
200 Elect Global Investments Ltd, 4,850 %, unbefristet	165	0,36	Nigeria — 0,38 % (28. Februar 2022: 0,48 %)		
200 Inventive Global Investments Ltd, 1,650 %, fällig am 03.09.2025	184	0,41	200 IHS Holding Ltd, 5,625 %, fällig 29.11.2026	173	0,38
260 Melco Resorts Finance Ltd, 5,375 %, fällig 04.12.2029	170	0,37	Oman — 0,99 % (28. Februar 2022: 1,12 %)		
460 Panther Ventures Ltd, 3,500 %, unbefristet	351	0,78	460 OmGrid Funding Ltd, 5,196 %, fällig 16.05.2027	447	0,99
	1.236	2,73	Panama — 2,42 % (28. Februar 2022: 2,69 %)		
Indien — 2,66 % (28. Februar 2022: 1,63 %)			460 Banco General SA, 5,250 %, fortwährend *	414	0,92
200 ICICI Bank Ltd/Dubai, 4,000 %, fällig 18.03.2026	195	0,43	200 Banco Nacional de Panama, 2,500 %, fällig am 11.08.2030	162	0,36
200 Indian Railway Finance Corp Ltd, 3,835 %, fällig am 13.12.2027	190	0,42	200 Empresa de Transmision Electrica SA, 5,125 %, fällig am 02.05.2049	165	0,36
200 NTPC Ltd, 4,500 %, fällig 19.03.2028	195	0,43	460 ENA Master Trust, 4,000 %, fällig am 19.05.2048	352	0,78
460 REC Ltd, 2,250 %, fällig 01.09.2026	410	0,91		1.093	2,42
250 Reliance Industries Ltd, 2,875 %, fällig 12.01.2032	212	0,47	Peru — 3,30 % (28. Februar 2022: 1,50 %)		
	1.202	2,66	200 Banco de Credito del Peru SA, 2,700 %, fällig am 11.01.2025	190	0,42
			200 Consorcio Transmataro SA, 4,700 %, fällig 16.04.2034	187	0,41
			200 Kallpa Generacion SA, 4,125 %, fällig 16.08.2027	186	0,41
			200 Petroleos del Peru SA, 5,625 %, fällig am 19.06.2047	138	0,31
			200 Southern Copper Corp, 3,875 %, fällig 23.04.2025	196	0,43
			200 Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, fällig am 30.04.2028	194	0,43
			460 Volcan Cia Minera SAA, 4,375 %, fällig 11.02.2026	401	0,89
				1.492	3,30

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert				
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)			Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 18,65 % (28. Februar 2022: 18,03 %)						
Katar — 2,08 % (28. Februar 2022: 0,47 %)			Angola — 0,38 % (28. Februar 2022: 0,00 %)						
200	CBQ Finance Ltd, 2,000 %, fällig 15.09.2025	187	0,41	200	Angolan Government International Bond, 8,250 %, fällig 09.05.2028	174	0,38		
200	Ooredoo International Finance Ltd, 2,625 %, fällig 08.04.2031	180	0,40	400	Bahamas Government International Bond, 5,750 %, fällig 16.01.2024	334	0,74		
200	Qatar Energy, 3,125 %, fällig 12.07.2041	163	0,36	Bahrain — 1,01 % (28. Februar 2022: 1,15 %)					
200	QNB Finance Ltd, 1,375 %, fällig 26.01.2026	182	0,41	460	Bahrain Government International Bond, 6,750 %, fällig 20.09.2029	455	1,01		
217	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3, 5,838 %, fällig am 30.09.2027	226	0,50	Brasilien — 0,39 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
		938	2,08	200	Brazilian Government International Bond, 3,875 %, fällig 12.06.2030	175	0,39		
Singapur — 5,22 % (28. Februar 2022: 4,52 %)			Chile — 0,36 % (28. Februar 2022: 0,00 %)						
200	BOC Aviation Ltd, 2,625 %, fällig 17.01.2025	191	0,42	200	Chile Government International Bond, 2,550 %, fällig 27.07.2033	161	0,36		
250	BOC Aviation Ltd, 3,250 %, fällig 29.04.2025	242	0,54	Costa Rica — 0,33 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
460	DBS Group Holdings Ltd, 3,300 %, unbefristet *	439	0,97	200	Costa Rica Government International Bond, 5,625 %, fällig 30.04.2043	151	0,33		
460	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, fällig am 19.06.2024	459	1,02	Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) — 0,91 % (28. Februar 2022: 1,14 %)					
200	Singapore Airlines Ltd, 3,000 %, fällig 20.07.2026	192	0,42	458	Ivory Coast Government International Bond, 5,750 %, fällig 31.12.2032	412	0,91		
200	SingTel Group Treasury Pte Ltd, 3,250 %, fällig am 30.06.2025	195	0,43	Dominikanische Republik — 0,54 % (28. Februar 2022: 1,03 %)					
200	ST Engineering RHQ Ltd, 1,500 %, fällig 29.04.2025	187	0,41	300	Dominican Republic International Bond, 144A, 4,875 %, fällig 23.09.2032	243	0,54		
460	United Overseas Bank Ltd, 3,750 %, fällig am 15.04.2029 *	454	1,01	Ecuador — 0,24 % (28. Februar 2022: 0,48 %)					
		2.359	5,22	280	Ecuador Government International Bond, 2,500 %, fällig 31.07.2035	108	0,24		
Südafrika — 2,14 % (28. Februar 2022: 2,50 %)			Ägypten — 0,76 % (28. Februar 2022: 1,43 %)						
460	Eskom Holdings SOC Ltd, 6,350 %, fällig am 10.08.2028	436	0,97	EGP	3.980	Egypt Government Bond, Serie 2YR, 14,138 %, fällig 20.10.2022	206	0,46	
570	Sasol Financing USA LLC, 4,375 %, fällig 18.09.2026	531	1,17	200	Egypt Government International Bond, 7,300 %, fällig 30.09.2033	137	0,30		
		967	2,14			343	0,76		
Südkorea — 2,78 % (28. Februar 2022: 1,89 %)			Ghana — 0,32 % (28. Februar 2022: 0,48 %)						
200	Hana Bank, 1,250 %, fällig 16.12.2026	177	0,39	200	Ghana Government International Bond, 10,750 %, fällig 14.10.2030	145	0,32		
200	Hyundai Assan Otomotiv Sanayi ve Ticaret AS, 1,625 %, fällig am 12.07.2026	175	0,39	Guatemala — 0,35 % (28. Februar 2022: 0,45 %)					
200	Hyundai Capital Services Inc, 2,500 %, fällig 24.01.2027	182	0,40	200	Guatemala Government Bond, 4,650 %, fällig 07.10.2041	159	0,35		
200	Kia Corp, 2,750 %, fällig 14.02.2027	184	0,41	Hong Kong — 0,36 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
200	Kookmin Bank, 2,375 %, fällig 15.02.2027	185	0,41	200	Airport Authority, 1,625 %, fällig am 04.02.2031	163	0,36		
200	NH Investment & Securities Co Ltd, 1,875 %, fällig 07.10.2026	178	0,39	Indien — 0,42 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
200	Shinhan Financial Group Co Ltd, 2,875 %, unbefristet *	178	0,39	200	Export-Import Bank of India, 3,375 %, fällig am 05.08.2026	191	0,42		
		1.259	2,78	Indonesien — 0,80 % (28. Februar 2022: 0,51 %)					
Supranational — 4,98 % (28. Februar 2022: 2,92 %)			Jamaika — 1,11 % (28. Februar 2022: 1,24 %)						
200	African Export-Import Bank/The, 3,994 %, fällig am 21.09.2029	176	0,39	460	Jamaica Government International Bond, 6,750 %, fällig 28.04.2028	500	1,11		
INR	22.000	Asian Development Bank, 5,900 %, fällig 20.12.2022	276	0,61	Jordanien — 0,83 % (28. Februar 2022: 0,46 %)				
CNY	2.000	Asian Development Bank, 2,715 %, fällig 16.01.2023	290	0,64	200	Jordan Government International Bond, 7,750 %, fällig 15.01.2028	199	0,44	
ZAR	3.550	Asian Development Bank, 4,500 %, fällig 07.12.2023	201	0,44	200	Jordan Government International Bond, 5,850 %, fällig 07.07.2030	176	0,39	
IDR	741.300	European Bank for Reconstruction & Development, 6,450 %, fällig 13.12.2022	50	0,11			375	0,83	
IDR	5.820.000	Inter-American Development Bank, 7,875 %, fällig 14.03.2023	397	0,88	Kenia — 0,61 % (28. Februar 2022: 0,82 %)				
INR	17.600	International Finance Corp, 5,850 %, fällig 25.11.2022	221	0,49	400	Republic of Kenya Government International Bond, 6,300 %, fällig 23.01.2034	276	0,61	
BRL	2.300	International Finance Corp, 8,250 %, fällig 30.01.2023	434	0,96	Mexiko — 0,75 % (28. Februar 2022: 0,45 %)				
UYU	9.000	International Finance Corp, 6,280 %, fällig 27.05.2024	206	0,46	MXN	3.920	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	172	0,38
		2.251	4,98	200	Mexico Government International Bond, 2,659 %, fällig 24.05.2031	166	0,37		
Taiwan — 0,82 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Jamaika — 1,11 % (28. Februar 2022: 1,24 %)						
200	Foxconn Far East Ltd, 3,000 %, fällig am 23.09.2026	188	0,42			338	0,75		
200	TSMC Arizona Corp, 1,750 %, fällig 25.10.2026	182	0,40	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 35,929\$)					
		370	0,82			31.996	70,78		
Thailand — 0,37 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			USA — 0,49 % (28. Februar 2022: 1,22 %)						
200	GC Treasury Center Co Ltd, 2,980 %, fällig 18.03.2031	167	0,37	10	Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	9	0,02		
Vereinigte Arabische Emirate — 1,68 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			USA — 0,49 % (28. Februar 2022: 1,22 %)						
200	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC, 3,650 %, fällig am 02.11.2029	198	0,44	30	New York Life Insurance Co, 3,750 %, fällig am 15.05.2050	25	0,05		
200	Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 144A, 4,375 %, fällig am 23.04.2025	203	0,45	200	Sagcor Financial Co Ltd, 5,300 %, fällig 13.05.2028	189	0,42		
200	DP World Ltd/United Arab Emirates, 4,700 %, fällig 30.09.2049	173	0,38			223	0,49		
200	MDGH GMTN RSC Ltd, 2,875 %, fällig 21.05.2030	187	0,41						
		761	1,68						

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
Marokko — 0,29 % (28. Februar 2022: 0,89 %)					
200	Morocco Government International Bond, 4,000 %, fällig 15.12.2050	131	0,29		
Nigeria — 0,78 % (28. Februar 2022: 1,07 %)					
460	Nigeria Government International Bond, 6,500 %, fällig 28.11.2027	354	0,78		
Oman — 1,02 % (28. Februar 2022: 1,13 %)					
460	Oman Government International Bond, 4,125 %, fällig am 17.01.2023	460	1,02		
Panama — 0,34 % (28. Februar 2022: 0,47 %)					
200	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig 01.04.2056	155	0,34		
Paraguay — 0,35 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
200	Paraguay Government International Bond, 2,739 %, fällig 29.01.2033	159	0,35		
Peru — 0,46 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
150	Fondo MIVIVIENDA SA, 4,625 %, fällig am 12.04.2027	145	0,32		
100	Peruvian Government International Bond, 2,780 %, fällig 01.12.2060	63	0,14		
		208	0,46		
Republik Ruanda — 0,41 % (28. Februar 2022: 0,55 %)					
240	Rwanda International Government Bond, 5,500 %, fällig 09.08.2031	185	0,41		
Senegal — 0,31 % (28. Februar 2022: 0,41 %)					
200	Senegal Government International Bond, 6,750 %, fällig 13.03.2048	141	0,31		
Südafrika — 0,32 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
200	Republic of South Africa Government International Bond, 5,375 %, fällig 24.07.2044	144	0,32		
Südkorea — 1,27 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
200	Korea Gas Corp, 3,875 %, fällig 13.07.2027	197	0,44		
200	Korea South-East Power Co Ltd, 1,000 %, fällig am 03.02.2026	181	0,40		
200	Korea Water Resources Corp, 3,500 %, fällig 27.04.2025	196	0,43		
		574	1,27		
Vereinigte Arabische Emirate — 0,65 % (28. Februar 2022: 0,92 %)					
460	Finance Department Government of Sharjah, 4,000 %, fällig am 28.07.2050	294	0,65		
Uruguay — 0,45 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
200	Uruguay Government International Bond, 4,975 %, fällig 20.04.2055	202	0,45		
Usbekistan — 0,34 % (28. Februar 2022: 0,41 %)					
200	Republic of Uzbekistan International Bond, 3,900 %, fällig 19.10.2031	154	0,34		
Vietnam — 0,45 % (28. Februar 2022: 0,51 %)					
200	Vietnam Government International Bond, 144A, 4,800 %, fällig 19.11.2024	202	0,45		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 9.872\$)					
		8.430	18,65		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 45.801\$)					
		40.426	89,43		
Devisenterminkontrakte — 0,05 % (28. Februar 2022: 0,37 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				21	0,05
Futures — (0,09 %) (28. Februar 2022: 0,00 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				39	0,09
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
				40.486	89,57
Devisenterminkontrakte — (0,14 %) (28. Februar 2022: (0,42 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				(62)	(0,14)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
				(62)	(0,14)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
				40.424	89,43
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen					
				4.781	10,57
Gesamnettovermögen					
				45.205\$	100,00
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.561.000\$ und machten 3,46 % des Nettovermögens aus.					
* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.					
e Die Sicherheit ist zum 31. August 2022 (entweder Hauptsumme und/oder Zinsen) voreingestellt.					
ABKÜRZUNGEN:					
Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.					
BRL – Brasilianischer Real					
CNY – Chinesischer Renminbi					
EGP – Ägyptisches Pfund					
IDR – Indonesische Rupiah					
INR – Indische Rupie					
MXN – Mexikanischer Peso					
UYU – Uruguayscher Peso					
ZAR – Südafrikanischer Rand					
Analyse des Gesamtvermögens					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					87,55
Finanzderivate					0,13
Sonstige Vermögenswerte					12,32
Gesamtvermögen					100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 2	Verkauf	EUR 2	\$ –
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 15	Verkauf	EUR 15	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD 12	Verkauf	USD 9	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 83	Verkauf	USD 100	(3)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 1.484	Verkauf	USD 1.517	(24)
15.09.2022	JP Morgan	Kauf	USD 301	Verkauf	CNH 2.022	8
14.10.2022	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD 226	Verkauf	ZAR 3.791	6
14.10.2022	Citi	Kauf	USD 231	Verkauf	BRL 1.280	(12)
14.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD 652	Verkauf	IDR 9.844.894	(10)
14.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD 519	Verkauf	INR 41.435	–
14.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD 219	Verkauf	MXN 4.597	(7)
14.10.2022	JP Morgan	Kauf	SGD 550	Verkauf	USD 391	2
18.10.2022	Citi	Kauf	USD 362	Verkauf	IDR 5.466.400	(6)
18.10.2022	Citi	Kauf	IDR 5.466.400	Verkauf	USD 363	5
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 155\$)					\$ 21	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (174))\$					(62)	
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (19))\$					\$ (41)	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Goldman Sachs	(53)	(6,196) USD	\$ 39
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -\$)				\$ 39
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (89))\$				-
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (89))\$				\$ 39

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 0,36 % (28. Februar 2022: 0,30 %)			Mexiko — 2,84 % (28. Februar 2022: 2,81 %)		
250 Magnetite XII Ltd, Serie 2015 12A, Klasse ER, 144A, 8,192 %, fällig 15.10.2031 *	225	0,36	200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625 %, unbefristet *	188	0,30
Asset-Backed Securities insgesamt (Kosten 247 USD)	225	0,36	360 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 6,625 %, unbefristet *	307	0,49
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 79,01 % (28. Februar 2022: 66,19 %)			Niederlande — 1,29 % (28. Februar 2022: 1,16 %)		
Argentinien — 0,45 % (28. Februar 2022: 1,32 %)			EUR 200 United Group BV, 5,250 %, fällig 01.02.2030		
310 Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750 %, fällig am 02.05.2025	279	0,45	780 VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2032	642	1,04
Belgien — 0,10 % (28. Februar 2022: 0,25 %)			800		
EUR 105 Ideal Standard International SA, 6,375 %, fällig am 30.07.2026	62	0,10	Peru — 0,97 % (28. Februar 2022: 0,88 %)		
Brazilien — 2,01 % (28. Februar 2022: 4,15 %)			750 Petroleos del Peru SA, 144A, 4,750 %, fällig 19.06.2032		
450 B3 SA — Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig am 20.09.2031	381	0,61	Polen — 0,39 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
1.100 MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	866	1,40	300 Canpack SA / Canpack US LLC, 144A, 3,875 %, fällig am 08.12.2033 *		
1.247			243		
Kanada — 1,10 % (28. Februar 2022: 0,91 %)			Südafrika — 0,38 % (28. Februar 2022: 0,56 %)		
340 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2029	293	0,47	280 Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, fällig am 18.03.2031		
440 AT5 Automation Tooling Systems Inc, 144A, 4,125 %, fällig am 15.12.2028	387	0,63	Schweden — 0,22 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
680			EUR 300 Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,624 %, unbefristet *		
Cayman Islands — 1,18 % (28. Februar 2022: 1,04 %)			137		
899 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 15.09.2024	729	1,18	Schweiz — 2,40 % (28. Februar 2022: 0,37 %)		
China — 0,16 % (28. Februar 2022: 0,45 %)			250 Credit Suisse Group AG, 144A, 6,537 %, fällig am 08.12.2033 *		
400 China Aoyuan Group Ltd, 0,000 %, fällig 23.01.2023 te	27	0,04	280 Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, unbefristet *		
400 China Aoyuan Group Ltd, 6,350 %, fällig am 08.02.2024 e	28	0,05	300 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, unbefristet *		
600 Yuzhou-Gruppe, 0,000 %, fällig am 25.10.2023 e	45	0,07	850 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, unbefristet *		
100			1.489		
Kolumbien — 0,33 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Türkei — 1,07 % (28. Februar 2022: 0,86 %)		
250 Millicom International Cellular SA, 4,500 %, fällig 27.04.2031	205	0,33	300 TC Ziraat Bankasi AS, 144A, 5,125 %, fällig 29.09.2023		
Frankreich — 1,11 % (28. Februar 2022: 0,97 %)			410 Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 6,875 %, fällig am 28.02.2025		
720 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, fällig am 15.10.2029	569	0,92	662		
EUR 120 Burger King France SAS, 5,017 %, fällig 01.11.2026 *	116	0,19	Vereinigtes Königreich — 6,59 % (28. Februar 2022: 5,63 %)		
685			GBP 220 Bellis Acquisition Co Plc, 4,500 %, fällig am 16.02.2026		
Deutschland — 1,19 % (28. Februar 2022: 1,46 %)			EUR 110 INEOS Quattro Finance 1 Plc, 144A, 3,750 %, fällig 15.07.2026		
EUR 650 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, fällig 15.01.2027	537	0,87	95		
EUR 240 TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig 15.05.2026	198	0,32	EUR 310 INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750 %, fällig 15.07.2026		
735			GBP 250 Marks & Spencer Plc, 3,750 %, fällig 19.05.2026		
Gibraltar — 0,31 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			GBP 510 Marston's Issuer Plc, Serie B1, 4,219 %, fällig am 16.07.2035 *		
EUR 220 888 Acquisitions Ltd, 7,558 %, fällig 15.07.2027	191	0,31	468		
Guatemala — 0,73 % (28. Februar 2022: 0,48 %)			EUR 1.488		
490 Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, fällig am 27.04.2029 *	455	0,73	EUR 100 Victoria Plc, 3,625 %, fällig 24.08.2026		
Hong Kong — 0,48 % (28. Februar 2022: 0,28 %)			400 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029		
260 Melco Resorts Finance Ltd, 5,375 %, fällig 04.12.2029	170	0,27	356		
200 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig am 12.04.2029	130	0,21	560 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.07.2031		
300			462		
Israel — 3,85 % (28. Februar 2022: 3,16 %)			GBP 240 Wheel Bidco Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 15.07.2026		
2.560 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	2.161	3,48	GBP 180 Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, fällig 15.07.2026		
260 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig 09.05.2027	228	0,37	4.085		
2.389			USA — 42,38 % (28. Februar 2022: 34,87 %)		
Italien — 1,54 % (28. Februar 2022: 0,24 %)			200 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, fällig am 01.05.2028		
920 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01.06.2032 *	670	1,08	320 Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/ Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig am 01.06.2028		
70 Telecom Italia Capital SA, 7,200 %, fällig am 18.07.2036	60	0,10	150 American Airlines Group Inc, 144A, 3,750 %, fällig 01.03.2025		
230 Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303 %, fällig 30.05.2024	222	0,36	110 American Airlines Inc/AA Advantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 20.04.2026		
952			330 American Airlines Inc/AA Advantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029		
Luxemburg — 3,20 % (28. Februar 2022: 1,90 %)			250 American Axle & Manufacturing Inc, 6,500 %, fällig am 01.04.2027		
200 Altice Financing SA, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2028	162	0,26	660 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig am 01.10.2029		
500 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	403	0,65	280 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig am 15.06.2027		
200 Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2027	173	0,28	400 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig am 15.08.2027		
720 Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, fällig 15.02.2028	490	0,79	390 Ball Corp, 2,875 %, fällig 15.08.2030		
390 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	303	0,49	240 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031		
GBP 220 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig am 01.04.2028	217	0,35	150 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.02.2027		
260 FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 15.08.2026	238	0,38	340 Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig am 01.07.2030		
1.986			330 BWX Technologies Inc, 144A, 4,125 %, fällig 30.06.2028		
Macau — 2,74 % (28. Februar 2022: 2,44 %)			350 Carnival Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.03.2027		
480 MGM China Holdings Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2027	376	0,61	640 Carnival Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01.05.2029		
610 Sands China Ltd, 3,750 %, fällig am 08.08.2031	447	0,72	280 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig 01.06.2030		
400 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01.10.2027	288	0,46	500 Carnival Plc, 1,000 %, fällig 28.10.2029		
840 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig am 15.12.2029	586	0,95	820 Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2029		
1.697			320 Carrols Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029		
Mexiko — 2,84 % (28. Februar 2022: 2,81 %)			2.010 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032		
200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625 %, unbefristet *	188	0,30	1.634		
360 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 6,625 %, unbefristet *	307	0,49	350 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034		
440 BBVA Bancomer SA.Texas, 144A, 5,125 %, fällig 18.01.2033 *	393	0,63	267		
660 Petroleos Mexicanos, 6,625 %, fällig 15.06.2035	474	0,77	150 Charles Schwab Corp/The, Serie H, 4,000 %, fortwährend *		
600 Petroleos Mexicanos, 6,625 %, fällig 15.06.2038	400	0,65	240 Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, fällig am 01.10.2031		
1.762			147		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — (Fortsetzung)					
540	CoreCivic Inc, 8,250 %, fällig 15.04.2026	535	0,86		
210	CoreCivic Inc, 4,750 %, fällig 15.10.2027	177	0,29		
290	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	267	0,43		
630	CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2030	489	0,79		
440	CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.11.2031	314	0,51		
370	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig am 15.08.2027	339	0,55		
230	DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig am 15.11.2024	208	0,34		
270	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	213	0,34		
260	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	200	0,32		
280	DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	166	0,27		
300	DISH Network Corp, 2,375 %, fällig 15.03.2024	272	0,44		
890	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	643	1,04		
100	Diversified Healthcare Trust, 4,375 %, fällig am 01.03.2031	69	0,11		
80	Energy Transfer LP Serie B, 6,625 %, fortwährend *	65	0,10		
650	Energy Transfer LP Serie F, 6,750 %, fortwährend*	592	0,95		
480	Energy Transfer LP Serie G, 7,125 %, fortwährend*	438	0,71		
90	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, fällig am 01.07.2027	87	0,14		
120	EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, fällig am 01.06.2030	119	0,19		
1.780	Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	1.393	2,25		
1.100	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig am 16.02.2028	922	1,49		
830	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig am 15.12.2028	702	1,13		
810	JB Poindexter & Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.04.2026	786	1,27		
150	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig am 08.08.2024	142	0,23		
1.000	Las Vegas Sands Corp, 3,900 %, fällig am 08.08.2029	852	1,37		
550	Level 3 Financing Inc, 144A, 3,625 %, fällig 15.01.2029	442	0,71		
740	Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, fällig am 01.10.2031	580	0,94		
110	Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, fällig am 01.05.2029	73	0,12		
465	NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 15.12.2024	404	0,65		
410	NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	332	0,54		
120	NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.02.2027	109	0,18		
780	NCL Finance Ltd, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2028	607	0,98		
380	Occidental Petroleum Corp, 6,125 %, fällig 01.01.2031	395	0,64		
340	Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, fällig am 15.02.2028	246	0,40		
340	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 01.07.2026	262	0,42		
290	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 31.08.2026	232	0,37		
770	Service Properties Trust, 5,500 %, fällig am 15.12.2027	667	1,08		
200	Service Properties Trust, 4,950 %, fällig 01.10.2029	151	0,24		
390	Sirius XM Radio Inc, 144A, 4,125 %, fällig am 01.07.2030	331	0,53		
320	Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	286	0,46		
500	Spirit Airlines Inc, 1,000 %, fällig 15.05.2026	439	0,71		
360	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	366	0,59		
520	StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029	453	0,73		
150	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 5,875 %, fällig 01.03.2027	147	0,24		
320	Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig am 01.09.2026	296	0,48		
190	Tenet Healthcare Corp, 144A, 6,250 %, fällig 01.02.2027	183	0,30		
1.020	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	896	1,45		
120	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 15.02.2029	98	0,16		
530	VWV International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2029	332	0,53		
		26.269	42,38		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 59.1965)			48.974	79,01	
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 15,13 % (28. Februar 2022: 14,64 %)					
Angola — 0,79 % (28. Februar 2022: 0,31 %)					
250	Angolan Government International Bond, 144A, 8,250 %, fällig 09.05.2028	218	0,35		
330	Angolan Government International Bond, 144A, 8,750 %, fällig 14.04.2032	271	0,44		
		489	0,79		
Argentinien — 1,78 % (28. Februar 2022: 1,65 %)					
161	Argentine Republic Government International Bond, 1,000 %, fällig am 09.07.2029	38	0,06		
467	Argentine Republic Government International Bond, 0,500 %, fällig am 09.07.2030	112	0,18		
1.614	Argentine Republic Government International Bond, 1,500 %, fällig 09.07.2035	365	0,59		
1.051	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 5,250 %, fällig 01.09.2037	369	0,60		
340	Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, fällig 01.06.2027	218	0,35		
		1.102	1,78		
Bahamas — 0,27 % (28. Februar 2022: 0,23 %)					
200	Bahamas Government International Bond, 144A, 5,750 %, fällig 16.01.2024	167	0,27		
Bahrain — 0,38 % (28. Februar 2022: 0,32 %)					
310	Bahrain Government International Bond, 144A, 6,000 %, fällig 19.09.2044	234	0,38		
Costa Rica — 0,30 % (28. Februar 2022: 0,24 %)					
200	Costa Rica Government International Bond, 6,125 %, fällig 19.02.2031	188	0,30		
Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) — 0,56 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
410	Ivory Coast Government International Bond, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2033	348	0,56		
Dominikanische Republik — 1,18 % (28. Februar 2022: 0,73 %)					
250	Dominican Republic International Bond, 144A, 5,500 %, fällig 22.02.2029	229	0,37		
380	Dominican Republic International Bond, 144A, 4,500 %, fällig 30.01.2030	320	0,52		
210	Dominican Republic International Bond, 144A, 6,000 %, fällig 22.02.2033	184	0,29		
		733	1,18		
Ecuador — 0,71 % (28. Februar 2022: 0,48 %)					
660	Ecuador Government International Bond, 144A, Nullkupon, fällig am 31.07.2030	226	0,37		
550	Ecuador Government International Bond, 144A, 2,500 %, fällig 31.07.2035	213	0,34		
		439	0,71		
Ägypten — 0,83 % (28. Februar 2022: 0,71 %)					
300	Egypt Government International Bond, 6,588 %, fällig 21.02.2028	238	0,38		
350	Egypt Government International Bond, 144A, 7,600 %, fällig 01.03.2029	277	0,45		
		515	0,83		
Ghana — 0,54 % (28. Februar 2022: 0,60 %)					
360	Ghana Government International Bond, 144A, 10,750 %, fällig 14.10.2030	261	0,42		
200	Ghana Government International Bond, 144A, 8,125 %, fällig 26.03.2032	77	0,12		
		338	0,54		
Jordanien — 0,71 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
440	Jordan Government International Bond, 144A, 7,750 %, fällig 15.01.2028	437	0,71		
Kenia — 0,25 % (28. Februar 2022: 0,23 %)					
200	Republic of Kenya Government International Bond, 144A, 7,250 %, fällig 28.02.2028	155	0,25		
Mexiko — 1,11 % (28. Februar 2022: 1,92 %)					
MXN	10.720 Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 23.11.2034	480	0,78		
MXN	4.680 Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	205	0,33		
		685	1,11		
Nigeria — 0,35 % (28. Februar 2022: 0,34 %)					
300	Nigeria Government International Bond, 144A, 7,875 %, fällig 16.02.2032	217	0,35		
Paraguay — 0,44 % (28. Februar 2022: 0,69 %)					
340	Paraguay Government International Bond, 144A, 2,739 %, fällig 29.01.2033	270	0,44		
Russia — 1,11 % (28. Februar 2022: 0,77 %)					
RUB	69.969 Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 19.01.2028 ty	368	0,59		
RUB	61.500 Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 23.05.2029 ty	323	0,52		
		691	1,11		
Senegal — 0,26 % (28. Februar 2022: 0,24 %)					
230	Senegal Government International Bond, 144A, 6,750 %, fällig 13.03.2048	162	0,26		
Südafrika — 0,29 % (28. Februar 2022: 0,26 %)					
250	Republic of South Africa Government International Bond, 5,650 %, fällig 27.09.2047	180	0,29		
Türkei — 1,29 % (28. Februar 2022: 1,70 %)					
960	Turkey Government International Bond, 4,250 %, fällig 14.04.2026	800	1,29		
Ukraine — 0,16 % (28. Februar 2022: 0,19 %)					
450	Ukraine Government International Bond, 144A, 7,750 %, fällig 01.09.2028	96	0,16		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)		
USA — 1,82 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
400 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.08.2023	397	0,64
500 United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 29.02.2024	486	0,78
250 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.06.2025	246	0,40
	1.129	1,82
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 13.122\$)	9.375	15,13
Schuldscheindarlehen — 0,76 % (28. Februar 2022: 3,22 %)		
492 DIRECTV Financing LLC, 7,372 %, fällig 22.07.2027 *	472	0,76
Summe Schuldverschreibungen (Kosten 493 USD)	472	0,76
Organismen für gemeinsame Anlagen — 1,06 % (28. Februar 2022: 7,76 %)		
EUR 6 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc — Western Asset European Loan — LM Klasse Euro Accumulating	656	1,06
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 713\$)	656	1,06
Warrant — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
USA — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
4 EG Acquisition Corp	1	–
Optionsschein insgesamt (Kosten 4 USD)	1	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 73.775\$)	59.703	96,32
Devisenterminkontrakte — 0,21 % (28. Februar 2022: 0,24 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	133	0,21
Futures — (0,68 %) (28. Februar 2022: 0,06 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	419	0,68
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	60.255	97,21
Devisenterminkontrakte — (0,57 %) (28. Februar 2022: (0,17 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(356)	(0,57)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(356)	(0,57)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	59.899	96,64
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	2.088	3,36
Gesamtnettovermögen	61.987\$	100,00

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 32.140.000\$ und machten 51,86 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.
- † Nicht liquide.
- γ Aufgrund der Ungewissheit der Zinszahlungen werden während und/oder nach dem zum 31. August 2022 endenden Geschäftsjahr keine Erträge aus dem Wertpapier mehr gezahlt.
- ε Die Sicherheit ist zum 31. August 2022 (entweder Hauptsumme und/oder Zinsen) voreingestellt.

ABKÜRZUNGEN:

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

	% des Gesamtvormögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,14
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	0,74
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,03
Finanzderivate	0,87
Sonstige Vermögenswerte	5,22
Gesamtvormögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 409 Verkauf	AUD 592 \$ 5
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 39 Verkauf	EUR 38 –
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 18 Verkauf	EUR 18 –
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 160 Verkauf	GBP 135 2
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 36 Verkauf	SGD 50 –
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 22 Verkauf	SGD 31 –
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD 9.186 Verkauf	USD 6.416 129)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD 2.726 Verkauf	USD 1.978 (28)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 3.223 Verkauf	USD 3.894 149)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 1.764 Verkauf	USD 1.803 (29)
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	EUR 2.054 Verkauf	USD 2.083 (11)
18.10.2022	Citi	Kauf	USD 203 Verkauf	EUR 200 1
18.10.2022	Citi	Kauf	EUR 289 Verkauf	USD 296 (4)
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD 3.525 Verkauf	GBP 2.924 125
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	EUR 403 Verkauf	USD 413 (6)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 193\$)				\$ 133
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (139))\$				(356)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 54\$)				\$ (223)

Aufstellung der Terminkontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-FX Währung September 2022	UBS (47)	(5,908) USD	\$ 419
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 51\$)			\$ 419
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -\$)			–
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 51\$)			\$ 419

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 95,24 % (28. Februar 2022: 91,86 %)			Vereinigtes Königreich — 4,07 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Australien — 0,59 % (28. Februar 2022: 0,59 %)			GBP 440 United Kingdom Gilt, 0,250 %, fällig 31.07.2031 409 4,07		
AUD 60	Australia Government Bond, Serie 30CI, 2,500 %, fällig 20.09.2030 β	59 0,59	United States — 44,41 % (28. Februar 2022: 52,14 %)		
Kanada — 0,47 % (28. Februar 2022: 0,62 %)			480 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15.04.2023 β 589 5,86		
CAD 10	Canadian Government Real Return Bond, Serie CPI, 4,000 %, fällig am 01.12.2031 β	16 0,16	460 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15.07.2025 β 567 5,65		
CAD 30	Canadian Government Real Return Bond, Serie CPI, 1,500 %, fällig am 01.12.2044 β	31 0,31	890 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15.01.2027 β 1.073 10,70		
		47 0,47	230 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500 %, fällig 15.01.2028 β 272 2,71		
Frankreich — 12,52 % (28. Februar 2022: 9,24 %)			190 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 3,875 %, fällig 15.04.2029 β 410 4,08		
EUR 760	French Republic Government Bond OAT, Serie OATe, 0,250 %, fällig 25.07.2024 β	969 9,65	840 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15.01.2030 β 924 9,21		
EUR 200	French Republic Government Bond OAT, Serie OATe, 1,850 %, fällig 25.07.2027 β	288 2,87	110 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375 %, fällig 15.02.2044 β 145 1,45		
		1.257 12,52	490 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31/07/2027 477 4,75		
Deutschland — 5,63 % (28. Februar 2022: 6,79 %)			4.457 44,41		
EUR 260	Deutsche Bundesrepublik Inflationsgebundene Anleihe, Serie I/L, 0,100 %, fällig am 15.04.2023 β	327 3,26	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 10.128\$) 9.558 95,24		
EUR 180	Deutsche Bundesrepublik Inflationsgebundene Anleihe, Serie I/L, 0,500 %, fällig am 15.04.2030 β	238 2,37	Organismen für gemeinsame Anlagen — 1,83 % (28. Februar 2022: 5,06 %)		
		565 5,63	184 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend) 184 1,83		
Indonesien — 0,87 % (28. Februar 2022: 1,32 %)			Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 184\$) 184 1,83		
IDR 1.168.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR79, 8,375 %, fällig 15.04.2039	87 0,87	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 10.312\$) 9.742 97,07		
Italien — 7,93 % (28. Februar 2022: 6,24 %)			Kontrakte (in Tsd.)		
EUR 180	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 2,600 %, fällig 15.09.2023 β	258 2,57	Gekaufte Optionen — 0,03 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
EUR 370	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 3,100 %, fällig 15.09.2026 β	517 5,15	EUR – Euro Currency Future Dezember 2022 – –		
EUR 20	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 0,400 %, fällig 15.05.2030 β	21 0,21	Call 99.6250, fällig am 19.12.2022 – Citi – –		
		796 7,93	210 USD Call/GBP Put 1,12, fällig 20.12.2022 – JP Morgan 3 0,03		
Japan — 11,45 % (28. Februar 2022: 8,51 %)			Gekaufte Optionen insgesamt (Kosten 4\$) 3 0,03		
JPY 47.800	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 21, 0,100 %, fällig am 10.03.2026 β	374 3,72	Devisenterminkontrakte — 1,09 % (28. Februar 2022: 0,59 %)		
JPY 63.000	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 22, 0,100 %, fällig am 10.03.2027 β	501 5,00	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 109 1,09		
JPY 34.900	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 23, 0,100 %, fällig am 10.03.2028 β	274 2,73	Futures — (0,20 %) (28. Februar 2022: 0,53 %)		
		1.149 11,45	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 21 0,20		
Mexiko — 1,62 % (28. Februar 2022: 2,64 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 9.875 98,39		
MXN 430	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	19 0,19	Kontrakte (in Tsd.)		
MXN 3.202	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	143 1,43	Geschriebene Optionen — (0,13 %) (28. Februar 2022: 0,00 %)		
		162 1,62	EUR – Euro Currency Future Dezember 2022 – (13) (0,13)		
Neuseeland — 0,31 % (28. Februar 2022: 0,30 %)			Put 99.00, fällig am 19.12.2022 – Citi (13) (0,13)		
NZD 40	New Zealand Government Inflation Linked Bond, Serie 0930, 3,000 %, fällig am 20.09.2030 β	31 0,31	Summe geschriebene Optionen (Kosten 2 USD) (13) (0,13)		
Norwegen — 0,45 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Inflationsswaps — (0,40 %) (28. Februar 2022: (0,24 %))		
NOK 210	Norway Government Bond, Serie 482, 144A, 1,375 %, fällig 19.08.2030	18 0,19	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (40) (0,40)		
NOK 290	Norway Government Bond, Serie 484, 144A, 2,125 %, fällig 18.05.2032	27 0,26	Zinsswaps — (0,62 %) (28. Februar 2022: (0,24 %))		
		45 0,45	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (62) (0,62)		
Polen — 1,30 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Devisenterminkontrakte — (0,04 %) (28. Februar 2022: (0,50 %))		
PLN 890	Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	130 1,30	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (4) (0,04)		
Romania — 0,34 % (28. Februar 2022: 0,44 %)			Futures — (0,45 %) (28. Februar 2022: (0,40 %))		
EUR 40	Romanian Government International Bond, 2,000 %, fällig 14.04.2033	26 0,26	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (46) (0,45)		
EUR 10	Romanian Government International Bond, 3,750 %, fällig 07.02.2034	8 0,08	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten (165) (1,64)		
		34 0,34	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 9.710 96,75		
Südafrika — 1,30 % (28. Februar 2022: 1,37 %)			Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen 326 3,25		
ZAR 3.550	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	131 1,30	Gesamtvermögen 10.036\$ 100,00		
Spanien — 1,98 % (28. Februar 2022: 1,25 %)			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, betreffen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %		
EUR 170	Spain Government Inflation Linked Bond, 144A, 0,700 %, fällig 30.11.2033 β	199 1,98	144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.040.000\$ und machten 10,36 % des Nettovermögens aus.		
			β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihenzins entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.		

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

ABKÜRZUNGEN:

CPI	– Verbraucherpreisindex.
AUD	– Australischer Dollar
CAD	– Kanadischer Dollar
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
IDR	– Indonesische Rupiah
JPY	– Japanischer Yen
MXN	– Mexikanischer Peso
NOK	– Norwegische Krone
NZD	– Neuseeländischer Dollar
PLN	– Polnischer Zloty
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Analise des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,95
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,79
Finanzderivate	1,29
Sonstige Vermögenswerte	3,97
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	Pay Floating CAD 3M CDOR, Receive Fixed 1,483 %	27.10.2023	910	\$ (22)
Citi	Pay Floating EUR 6M Euribor Reuters, Receive Fixed -0,150 %	15.08.2026	450	(40)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 26\$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (144))\$				(62)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (118))\$				\$ (62)

Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	USD — VPI Städtische Verbraucher	28.04.2026	210	\$ (22)
Citi	GBP — RPI Alle Artikel NSA	15.10.2026	130	(18)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (142))\$				(40)
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (142))\$				\$ (40)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
18.10.2022	Citi	Kauf USD 250	Verkauf EUR 248	\$ –
16.11.2022	BNP Paribas	Kauf EUR 10	Verkauf USD 10	–
16.11.2022	Citi	Kauf USD 320	Verkauf JPY 42.879	9
16.11.2022	Citi	Kauf PLN 27	Verkauf USD 6	–
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf USD 32	Verkauf NZD 51	1
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf GBP 50	Verkauf USD 59	(1)
16.11.2022	JP Morgan	Kauf USD 99	Verkauf AUD 141	2
16.11.2022	JP Morgan	Kauf USD 206	Verkauf CNH 1.400	4
16.11.2022	JP Morgan	Kauf USD 2.871	Verkauf EUR 2.797	46
16.11.2022	JP Morgan	Kauf USD 7	Verkauf EUR 7	–
16.11.2022	JP Morgan	Kauf USD 617	Verkauf GBP 513	20
16.11.2022	JP Morgan	Kauf USD 166	Verkauf JPY 22.081	5
16.11.2022	JP Morgan	Kauf USD 53	Verkauf NOK 517	1
16.11.2022	JP Morgan	Kauf MXN 820	Verkauf USD 39	1
16.11.2022	JP Morgan	Kauf GBP 81	Verkauf USD 95	(2)
16.11.2022	JP Morgan	Kauf EUR 5	Verkauf USD 5	–
16.11.2022	JP Morgan	Kauf CAD 49	Verkauf USD 38	(1)
16.11.2022	JP Morgan	Kauf AUD 41	Verkauf USD 29	–
16.11.2022	JP Morgan	Kauf CZK 270	Verkauf USD 11	–
16.11.2022	Morgan Stanley	Kauf USD 102	Verkauf CAD 130	3
16.11.2022	Morgan Stanley	Kauf USD 588	Verkauf JPY 78.670	17
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 353\$)				\$ 109
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (298))\$				(4)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 55\$)				\$ 105

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Citi	8	1.925 \$	\$ (6)
Australia 3 Year Bond September 2022	Citi	6	442	2
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2022	Citi	(1)	(165)	15
Euro-OAT September 2022	Citi	2	277 \$	4

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Termingeschäftskontrakte — (Fortsetzung)

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
ICE 3 Monate SONIA Dezember 2022	Citi	5	1.398	(11)
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2022	Citi	(1)	(1.076)	(17)
Long Gilt Dezember 2022	Citi	5	627	(11)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Citi	2	234	–
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Citi	3	332	(1)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2022	Citi	1	150	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 315\$)				\$ 21
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (236))\$				(46)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 79\$)				\$ (25)

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 15,36 % (28. Februar 2022: 14,64 %)			Indonesien — 8,80 % (28. Februar 2022: 8,21 %)		
Australien — 0,98 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			IDR 51.000.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR77, 8,125 %, fällig 15.05.2024	3.572	0,81
SGD 6.000 Macquarie Group Ltd, 4,500 %, fällig 18.08.2026 *	4.335	0,98	IDR 96.000.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR56, 8,375 %, fällig 15.09.2026	6.892	1,56
China — 2,60 % (28. Februar 2022: 2,45 %)			IDR 108.875.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	7.418	1,67
1.150 China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd, 3,080 %, unbefristet *	1.099	0,25	IDR 20.000.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR47, 10,000 %, fällig 15.02.2028	1.544	0,35
2.650 China Minmetals Corp, 3,750 %, unbefristet *	2.650	0,60	IDR 27.500.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR64, 6,125 %, fällig 15.05.2028	1.799	0,41
CNY 30.000 CNI Capital Ltd, 3,970 %, fällig 01.11.2022	4.332	0,98	IDR 114.000.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR54, 9,500 %, fällig 15.07.2031	8.872	2,00
2.500 Coastal Emerald Ltd, 4,300 %, fortwährend *	2.406	0,54	IDR 25.000.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR58, 8,250 %, fällig 15.06.2032	1.828	0,41
2.100 Country Garden Holdings Co Ltd, 3,125 %, fällig 22.10.2025	1.018	0,23	IDR 100.000.000 Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Serie OB, 8,250 %, fällig am 15.08.2024	7.033	1,59
	11.505	2,60		38.958	8,80
Frankreich — 2,10 % (28. Februar 2022: 1,49 %)			Malaysia — 11,26 % (28. Februar 2022: 10,60 %)		
SGD 5.000 BNP Paribas SA, 5,250 %, fällig 12.07.2032 *	3.703	0,83	MYR 20.490 Malaysia Government Bond, Serie 0118, 3,882 %, fällig 14.03.2025	4.638	1,05
SGD 8.000 Credit Agricole SA, 3,800 %, fällig 30.04.2031 *	5.610	1,27	MYR 52.380 Malaysia Government Bond, Serie 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	11.889	2,69
	9.313	2,10	MYR 1.200 Malaysia Government Bond, Serie 0308, 5,248 %, fällig 15.09.2028	288	0,06
Hong Kong — 1,04 % (28. Februar 2022: 1,02 %)			MYR 26.850 Malaysia Government Bond, Serie 0219, 3,885 %, fällig 15.08.2029	5.976	1,35
6.000 Panther Ventures Ltd, 3,500 %, unbefristet	4.584	1,04	MYR 78.000 Malaysia Government Bond, Serie 0411, 4,232 %, fällig 30.06.2031	17.734	4,01
Indien — 0,81 % (28. Februar 2022: 1,92 %)			MYR 22.510 Malaysia Government Bond, Serie 0413, 3,844 %, fällig 15.04.2033	4.914	1,11
4.000 REC Ltd, 2,250 %, fällig 01.09.2026	3.569	0,81	MYR 20.360 Malaysia Government Bond, Serie 0419, 3,828 %, fällig 05.07.2034	4.394	0,99
Indonesien — 2,34 % (28. Februar 2022: 2,25 %)				49.833	11,26
800 Freeport Indonesia PT, 4,763 %, fällig 14.04.2027	781	0,18	Philippinen — 8,92 % (28. Februar 2022: 9,17 %)		
3.000 Minejasa Capital BV, 5,625 %, fällig 10.08.2037	2.468	0,56	PHP 1.016.000 Philippine Government International Bond, 3,900 %, fällig 26.11.2022	17.916	4,05
3.350 Pelabuhan Indonesia Persero PT, 5,375 %, fällig 05.05.2045	3.239	0,73	PHP 1.256.000 Philippine Government International Bond, 6,250 %, fällig 14.01.2036	21.541	4,87
4.000 Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4,125 %, fällig 15.05.2027	3.877	0,87		39.457	8,92
	10.365	2,34	Singapur — 2,49 % (28. Februar 2022: 1,14 %)		
Katar — 2,09 % (28. Februar 2022: 1,94 %)			SGD 8.750 Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, Nullkupon, fällig 18.11.2022	6.224	1,41
IDR 140.000.000 QNB Finance Ltd, 6,900 %, fällig 23.01.2025	9.268	2,09	SGD 8.250 National Environment Agency, 2,500 %, fällig am 15.09.2051	4.806	1,08
Singapur — 1,46 % (28. Februar 2022: 1,72 %)				11.030	2,49
SGD 11.500 Temasek Financial I Ltd, 2,800 %, fällig 17.08.2071	6.444	1,46	Südkorea — 12,49 % (28. Februar 2022: 13,87 %)		
Supranational — 1,50 % (28. Februar 2022: 1,38 %)			IDR 50.000.000 Export-Import Bank of Korea, 144A, 6,700 %, fällig 02.12.2024	3.396	0,77
IDR 20.000.000 International Bank for Reconstruction & Development, 4,300 %, fällig 13.09.2023	1.330	0,30	KRW 25.000.000 Korea Treasury Bond, Serie 2912, 1,375 %, fällig am 12.10.2029	15.949	3,61
IDR 77.000.000 International Finance Corp, 8,000 %, fällig 09.10.2023	5.332	1,20	KRW 46.300.000 Korea Treasury Bond, Serie 3006, 1,375 %, fällig am 10.06.2030	29.210	6,60
	6.662	1,50	KRW 13.000.000 Korea Treasury Bond, Serie 3909, 1,125 %, fällig am 10.09.2039	6.695	1,51
Thailand — 0,44 % (28. Februar 2022: 0,47 %)				55.250	12,49
3.000 Thaioil Treasury Centre Co Ltd, 3,500 %, fällig am 17.10.2049	1.935	0,44	Thailand — 4,99 % (28. Februar 2022: 5,13 %)		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 75.632\$)			THB 801.030 Thailand Government Bond, 3,300 %, fällig 17.06.2038	22.085	4,99
	67.980	15,36	USA — 3,29 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 82,79 % (28. Februar 2022: 79,61 %)			15.000 United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 29/02/2024	14.572	3,29
Australien — 2,15 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 419.608\$)		
AUD 15.300 Australia Government Bond, Serie 161, 0,250 %, fällig 21.11.2025	9.509	2,15		366.381	82,79
China — 20,81 % (28. Februar 2022: 23,15 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen — 0,16 % (28. Februar 2022: 2,41 %)		
CNY 110.000 Agricultural Development Bank of China, Serie 1806, 4,650 %, fällig am 11.05.2028	17.544	3,96	721 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	721	0,16
HKD 7.500 China Development Bank/Hongkong, 2,568 %, fällig am 24.01.2024 *	956	0,22	Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 721\$)		
CNY 33.000 China Government Bond, 3,380 %, fällig 21.11.2024	4.893	1,10		721	0,16
CNY 50.000 China Government Bond, Serie INBK, 2,680 %, fällig 21.05.2030	7.258	1,64	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 495.961\$)		
CNY 96.500 China Government Bond, 3,600 %, fällig 21.05.2030	14.830	3,35		435.082	98,31
CNY 130.000 China Government Bond, Serie INBK, 3,390 %, fällig 16.03.2050	19.592	4,43	Devisenterminkontrakte — 0,12 % (28. Februar 2022: 0,08 %)		
CNY 60.000 Egypt Government Bond, Serie INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050	9.740	2,20	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
CNY 5.000 Export-Import Bank of China/The, 4,400 %, fällig 14.05.2024	746	0,17		509	0,12
CNY 40.000 Export-Import Bank of China/The, Serie 2007, 3,260 %, fällig am 24.02.2027	5.961	1,35	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
CNY 30.000 Export-Import Bank of China/The, Serie 1910, 3,860 %, fällig am 20.05.2029	4.630	1,05		435.591	98,43
CNY 40.000 Export-Import Bank of China/The, Serie 2010, 3,230 %, fällig am 23.03.2030	5.944	1,34	Devisenterminkontrakte — (0,21 %) (28. Februar 2022: (0,12 %))		
	92.094	20,81	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
Indien — 7,59 % (28. Februar 2022: 8,34 %)				(923)	(0,21)
INR 280.000 India Government Bond, 8,150 %, fällig 24.11.2026	3.669	0,83			
INR 980.000 India Government Bond, Serie SPB, 8,240 %, fällig 15.02.2027	12.902	2,92			
INR 450.000 India Government Bond, 7,170 %, fällig 08.01.2028	5.705	1,29			
INR 700.000 India Government Bond, 7,610 %, fällig 09.05.2030	9.047	2,04			
INR 190.000 India Government Bond, 6,570 %, fällig 05.12.2033	2.270	0,51			
	33.593	7,59			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Futures — (0,06 %) (28. Februar 2022: (0,22 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(273)	(0,06)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(1.196)	(0,27)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	434.395	98,16
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	8.161	1,84
Gesamtvermögen	442.556\$	100,00

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 3.396.000\$ und machten 0,77 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.

ABKÜRZUNGEN:

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

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,66
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,16
Finanzderivate	0,11
Sonstige Vermögenswerte	2,07
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf USD 14	Verkauf AUD 20	\$ –
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf AUD 31	Verkauf USD 22	–
09.12.2022	BNY Mellon	Kauf USD 9.146	Verkauf JPY 1.250.000	139
09.12.2022	State Street Bank & Trust Co	Kauf JPY 1.250.000	Verkauf USD 9.024	(17)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD 403	Verkauf AUD 580	6
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD 4	Verkauf CHF 4	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD 56	Verkauf CNH 387	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD 60	Verkauf CNH 402	2
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD 133	Verkauf EUR 133	(1)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD –	Verkauf SGD –	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf USD 47	Verkauf SGD 66	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf SGD –	Verkauf USD –	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf AUD 23.021	Verkauf USD 16.077	(321)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf CHF 277	Verkauf USD 291	(7)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf CNH 27.132	Verkauf USD 4.016	(87)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf CNH 97	Verkauf USD 14	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf EUR 9.045	Verkauf USD 9.242	(143)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf SGD 4.504	Verkauf USD 3.267	(45)
18.10.2022	BNY Mellon	Kauf SGD 25.300	Verkauf USD 18.380	(271)
25.11.2022	Citi	Kauf USD 7.963	Verkauf PHP 430.000	362
25.11.2022	JP Morgan	Kauf PHP 430.000	Verkauf USD 7.632	(31)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 378\$)				\$ 509
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (594))\$				(923)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (216))\$				\$ (414)

Aufstellung der Terminkontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Korea 10 Year Bond September 2022	UBS	124	10.242 \$
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)			
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.113))\$			
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.113))\$			

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 84,77 % (28. Februar 2022: 86,23 %)					
Australien — 0,96 % (28. Februar 2022: 1,67 %)					
EUR	720	0,17	EUR	1.300	0,29
EUR	3.000	0,79	EUR	1.780	0,48
			EUR	1.700	0,41
	3.531	0,96	EUR	1.910	0,50
			EUR	220	0,06
			EUR	1.500	0,32
				17.725	4,82
Kanada — 2,08 % (28. Februar 2022: 2,64 %)					
EUR	2.200	0,58	Norwegen — 1,27 % (28. Februar 2022: 0,80 %)		
GBP	1.230	0,36	EUR	940	0,22
EUR	2.110	0,56	GBP	2.150	0,65
GBP	1.980	0,58	EUR	1.000	0,26
	7.658	2,08	EUR	540	0,14
				4.662	1,27
Dänemark — 1,99 % (28. Februar 2022: 1,91 %)					
EUR	550	0,15	Singapur — 0,22 % (28. Februar 2022: 0,19 %)		
EUR	1.580	0,43	EUR	810	0,22
EUR	5.700	1,41	Spanien — 0,81 % (28. Februar 2022: 1,27 %)		
	7.315	1,99	GBP	500	0,15
			EUR	1.000	0,27
			EUR	1.700	0,39
				2.980	0,81
Frankreich — 8,95 % (28. Februar 2022: 9,16 %)					
EUR	300	0,08	Supranational — 2,87 % (28. Februar 2022: 2,73 %)		
EUR	2.300	0,53	GBP	1.440	0,45
EUR	800	0,20	GBP	6.300	1,78
GBP	2.600	0,73	GBP	2.090	0,64
EUR	230	0,06		10.545	2,87
EUR	2.700	0,65	Schweden — 2,29 % (28. Februar 2022: 2,26 %)		
EUR	1.100	0,26	EUR	2.190	0,48
EUR	1.000	0,25	EUR	1.240	0,33
GBP	2.600	0,72	EUR	3.050	0,79
EUR	300	0,08	EUR	2.250	0,55
EUR	6.350	1,59	EUR	550	0,14
EUR	300	0,07		8.425	2,29
EUR	1.000	0,27	Schweiz — 5,86 % (28. Februar 2022: 4,87 %)		
EUR	400	0,10	EUR	800	0,20
EUR	400	0,11	GBP	3.530	0,97
EUR	1.100	0,24	GBP	500	0,13
EUR	2.200	0,60	GBP	1.050	0,30
EUR	2.400	0,62	EUR	180	0,05
EUR	600	0,15	EUR	3.000	0,77
EUR	400	0,11	EUR	7.000	1,61
EUR	1.040	0,27	EUR	2.400	0,65
EUR	1.900	0,48	EUR	4.430	1,18
EUR	1.100	0,28		21.566	5,86
GBP	1.700	0,50	Vereinigtes Königreich — 8,25 % (28. Februar 2022: 7,81 %)		
	32.935	8,95	GBP	1.700	0,46
			EUR	400	0,10
			GBP	1.440	0,41
			EUR	270	0,07
			EUR	550	0,14
			EUR	520	0,14
			EUR	1.660	0,40
			EUR	390	0,10
			EUR	1.220	0,31
			EUR	1.630	0,41
			GBP	300	0,08
			EUR	2.100	0,54
			EUR	1.000	0,26
			EUR	890	0,24
			EUR	3.000	0,78
			EUR	200	0,05
			EUR	690	0,18
			GBP	1.250	0,33
			EUR	1.560	0,36
			EUR	4.750	1,20
			EUR	1.340	0,34
			EUR	2.200	0,46
			EUR	580	0,15
			EUR	850	0,23
			EUR	480	0,13
			EUR	550	0,14
			EUR	810	0,21
				30.327	8,25
			USA — 35,87 % (28. Februar 2022: 36,47 %)		
			EUR	2.100	0,49
			EUR	1.240	0,32
			EUR	1.700	0,43
			EUR	4.500	1,07
				1.809	0,49
				1.189	0,32
				1.595	0,43
				3.934	1,07

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinven- tarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — (Fortsetzung)					
	1.980	0,54	540	528	0,14
	2.200	0,53	4.000	3.691	1,00
	340	0,09	251	226	0,06
EUR	1.520	0,39	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen		
GBP	1.500	0,46	(Kosten 369.924\$)		
EUR	800	0,22	311.779		
EUR	500	0,13	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 5,68 % (28. Februar 2022: 12,53 %)		
EUR	530	0,14	Kanada — 0,36 % (28. Februar 2022: 0,36 %)		
EUR	550	0,14	GBP 1.200 CPPIB Capital Inc, 0,875 %, fällig 17.12.2024		
	1.276	0,34	Südkorea — 0,17 % (28. Februar 2022: 0,16 %)		
	588	0,15	EUR 660 Korea Development Bank/The, 0,000 %, fällig am 10.07.2024		
	1.700	0,42	USA — 5,15 % (28. Februar 2022: 11,76 %)		
	7.500	0,48	5.470 United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 15/02/2030		
	2.400	0,62	16.030 United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15/05/2030		
EUR	1.300	0,32	980 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2032		
EUR	800	0,20	876		
GBP	230	0,07	18.948		
	6.440	0,71	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 24.567\$)		
EUR	1.300	0,33	20.897		
	390	0,10	Organismen für gemeinsame Anlagen — 7,26 % (28. Februar 2022: 1,49 %)		
	1.800	0,44	26.694 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		
	1.600	0,41	26.694		
	7.000	1,61	Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 26.694\$)		
	2.000	0,48	26.694		
EUR	5.860	1,55	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 421.185\$)		
EUR	2.200	0,59	359.370		
	780	0,21	Devisenterminkontrakte — 1,29 % (28. Februar 2022: 0,94 %)		
	1.830	0,49	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
EUR	1.750	0,46	4.743		
	4.500	1,05	Futures — (0,77 %) (28. Februar 2022: 0,49 %)		
	2.800	0,72	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
EUR	180	0,04	2.831		
	1.020	0,27	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
EUR	110	0,03	366.944		
	3.090	0,84	Devisenterminkontrakte — (2,63 %) (28. Februar 2022: (1,05 %))		
EUR	320	0,08	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	4.400	1,06	(9.675)		
	240	0,06	Futures — (0,10 %) (28. Februar 2022: (0,04 %))		
	910	0,25	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	1.700	0,45	(380)		
	1.150	0,30	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
EUR	280	0,08	(10.055)		
EUR	2.000	0,49	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
EUR	2.550	0,65	356.889		
	7.140	1,71	Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
	570	0,15	10.922		
	2.400	0,62	Gesamtvermögen		
EUR	330	0,08	367.811\$		
EUR	2.790	0,64	100,00		
GBP	320	0,10	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %		
EUR	680	0,17	144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 9.923.000\$ und machten 2,70 % des Nettovermögens aus.		
	5.410	1,42	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.		
	1.600	0,39			
GBP	300	0,10			
EUR	1.510	0,40			
EUR	310	0,08			
GBP	1.260	0,38			
EUR	1.250	0,33			
EUR	350	0,09			
	2.120	0,53			
EUR	2.600	0,57			
	570	0,16			
	430	0,12			
EUR	1.000	0,27			
	560	0,14			
	1.150	0,30			
	1.630	0,36			
GBP	1.340	0,37			
EUR	2.000	0,54			
	4.043	1,09			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung)/ Kontrakten (in Tsd.)	
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	250	Verkauf	GBP	213	\$	3
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	41	Verkauf	USD	48		(1)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	109	Verkauf	AUD	157		1
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	23	Verkauf	EUR	23		1
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.259	Verkauf	EUR	1.257		(4)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	4.045	Verkauf	GBP	3.406		87
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf	SEK	54		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	128	Verkauf	SEK	1.353		1
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	14.677	Verkauf	USD	10.250		(204)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	182.850	Verkauf	USD	220.919		(8.443)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	39.119	Verkauf	USD	39.974		(622)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	94	Verkauf	USD	94		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	72.165	Verkauf	USD	7.117		(342)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	1.216	Verkauf	USD	114		–
16.11.2022	BNP Paribas	Kauf	USD	138	Verkauf	EUR	134		2
16.11.2022	BNP Paribas	Kauf	USD	1.642	Verkauf	GBP	1.352		68
16.11.2022	Citi	Kauf	USD	29.748	Verkauf	EUR	28.977		474
16.11.2022	Citi	Kauf	USD	12.406	Verkauf	GBP	10.240		492
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	14.857	Verkauf	EUR	14.452		258
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	472	Verkauf	GBP	390		19
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	784	Verkauf	JPY	104.254		29
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	EUR	600	Verkauf	USD	614		(8)
16.11.2022	HSBC	Kauf	USD	24.235	Verkauf	EUR	23.619		374
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	41.161	Verkauf	EUR	40.090		661
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	2.995	Verkauf	EUR	3.000		(36)
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	2.112	Verkauf	GBP	1.740		88
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	EUR	814	Verkauf	USD	824		(1)
16.11.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.303	Verkauf	EUR	1.268		22
16.11.2022	Royal Bank of Canada	Kauf	USD	1.462	Verkauf	GBP	1.206		58
16.11.2022	UBS	Kauf	USD	36.718	Verkauf	EUR	35.781		570
16.11.2022	UBS	Kauf	USD	38.832	Verkauf	GBP	32.058		1.535
16.11.2022	UBS	Kauf	EUR	900	Verkauf	USD	924		(14)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 4.176\$)								\$	4.743
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (4.645))\$									(9.675)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (469))\$								\$	(4.932)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(240)	(29.685)\$	\$ 835
Euro-Bund September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(223)	(33.161)	1.593
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(12)	(12.916)	(115)
Long Gilt Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(198)	(24.826)	403
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	164	19.173	(142)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	206	22.829	(123)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 2.194\$)				\$ 2.831
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (181))\$				(380)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 2.013\$)				\$ 2.451

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 8,50 % (28. Februar 2022: 6,46 %)					
100 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 % ±	98	0,06	28 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, fällig 15.11.2042	26	0,02
100 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 % ±	99	0,06	21 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, fällig 20.10.2049	20	0,01
300 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 % ±	258	0,16	83 Ginnie Mae II Pool '785218', 2,000 %, fällig 20.12.2050	73	0,05
2.300 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 % ±	2.055	1,29	163 Ginnie Mae II Pool '785219', 2,000 %, fällig 20.12.2050	143	0,09
1.500 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ±	1.389	0,87	86 Ginnie Mae II Pool '785220', 2,000 %, fällig 20.12.2050	76	0,05
100 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 % ±	95	0,06	169 Ginnie Mae II Pool '785221', 2,000 %, fällig 20.12.2050	148	0,09
5 Fannie Mae Pool '255984', 4,500 %, fällig 01.11.2025	5	–	80 Ginnie Mae II Pool '858546', 2,500 %, fällig am 20.12.2050	71	0,05
10 Fannie Mae Pool '975097', 5,000 %, fällig 01.06.2038	11	0,01	86 Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500 %, fällig am 20.12.2050	78	0,05
59 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, fällig 01.01.2043	58	0,04	97 Ginnie Mae II Pool 'BZ4350', 2,500 %, fällig 20.03.2051	88	0,06
10 Fannie Mae Pool 'AL3572', 5,000 %, fällig 07.01.2041	11	0,01	84 Ginnie Mae II Pool 'CD8312', 2,500 %, fällig 20.05.2051	76	0,05
80 Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000 %, fällig 05.01.2045	80	0,05	64 Ginnie Mae II Pool 'CG3836', 3,000 %, fällig am 20.09.2047	60	0,04
19 Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930 %, fällig am 01.06.2030	18	0,01	146 Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, fällig am 20.06.2044	143	0,09
24 Fannie Mae Pool 'AS4271', 4,500 %, fällig 01.01.2045	25	0,02	16 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, fällig am 20.04.2046	15	0,01
54 Fannie Mae Pool 'AS8951', 3,500 %, fällig 03.01.2047	52	0,03	16 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, fällig am 20.06.2046	16	0,01
18 Fannie Mae Pool 'AS9760', 4,500 %, fällig 06.01.2047	19	0,01	21 Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000 %, fällig am 20.11.2046	20	0,01
315 Fannie Mae Pool 'AX0756', 3,500 %, fällig 07.01.2044	308	0,19	15 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, fällig am 20.06.2047	15	0,01
35 Fannie Mae Pool 'BC9077', 3,500 %, fällig 12.01.2046	34	0,02	4 Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000 %, fällig am 20.11.2047	4	–
106 Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, fällig 12.01.2037	102	0,06	16 Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, fällig am 20.11.2047	16	0,01
112 Fannie Mae Pool 'BK7700', 4,500 %, fällig 10.01.2048	114	0,07	57 Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500 %, fällig am 20.02.2048	55	0,04
40 Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, fällig 12.01.2046	39	0,02	12 Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000 %, fällig am 20.04.2048	12	0,01
20 Fannie Mae Pool 'BM6898', 2,149 %, fällig 01.02.2032 *	17	0,01	66 Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, fällig am 20.05.2048	67	0,04
30 Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500 %, fällig 11.01.2048	31	0,02	23 Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, fällig am 20.06.2048	24	0,02
37 Fannie Mae Pool 'BP1585', 3,500 %, fällig 01.01.2050	35	0,02	33 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, fällig am 20.07.2048	33	0,02
56 Fannie Mae Pool 'BP7009', 3,000 %, fällig 08.01.2050	52	0,03	11 Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500 %, fällig 20.09.2048	11	0,01
80 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, fällig 02.01.2051	70	0,04	46 Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, fällig am 20.10.2048	46	0,03
82 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, fällig 02.01.2051	71	0,05	28 Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, fällig am 20.01.2049	29	0,02
89 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, fällig 03.01.2051	77	0,05	262 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, fällig am 20.09.2051	248	0,16
280 Fannie Mae Pool 'BU1030', 2,000 %, fällig 11.01.2051	243	0,15	100 Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 % ±	91	0,06
53 Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500 %, fällig 07.01.2048	53	0,03	400 Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ±	376	0,24
101 Fannie Mae Pool 'CA2199', 4,500 %, fällig 08.01.2048	102	0,06	300 Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,000 % ±	296	0,19
50 Fannie Mae Pool 'CA2482', 4,500 %, fällig 10.01.2048	51	0,03	99 Government National Mortgage Association, Serie 2022 3, Klasse IO, 0,640 %, fällig am 16.02.2061 *	6	–
314 Fannie Mae Pool 'CA6672', 2,000 %, fällig 07.01.2050	273	0,17	Gesamt Mortgage-Backed Securities (Kosten 14.458 USD)	13.520	8,50
26 Fannie Mae Pool 'FM1193', 3,500 %, fällig 06.01.2049	25	0,02	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 28,38 % (28. Februar 2022: 25,27 %)		
146 Fannie Mae Pool 'FM1578', 3,500 %, fällig 09.01.2034	144	0,09	Australien — 0,67 % (28. Februar 2022: 0,59 %)		
92 Fannie Mae Pool 'FM1579', 3,500 %, fällig 10.01.2034	90	0,06	EUR		
167 Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, fällig 09.01.2049	172	0,11	871 Glencore Finance Europe Ltd, 1,875 %, fällig 13.09.2023	873	0,55
78 Fannie Mae Pool 'FM3215', 3,500 %, fällig 01.01.2049	75	0,05	200 Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, fällig am 27.03.2027	193	0,12
334 Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500 %, fällig 05.01.2047	324	0,20		1.066	0,67
73 Fannie Mae Pool 'FM3978', 4,000 %, fällig 07.01.2050	72	0,05	Belgien — 0,28 % (28. Februar 2022: 0,32 %)		
49 Fannie Mae Pool 'FM4737', 3,500 %, fällig 09.01.2050	47	0,03	260 Anheuser-Busch Cos LLC - Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, fällig 01.02.2046		
297 Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000 %, fällig 01.01.2049	294	0,19	110 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	100	0,06
88 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, fällig 07.01.2051	80	0,05	20 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048	18	0,01
91 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, fällig 07.01.2051	82	0,05	90 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01.06.2050	82	0,05
92 Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, fällig 10.01.2051	83	0,05		448	0,28
652 Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, fällig 07.01.2051	565	0,36	Brasilien — 0,15 % (28. Februar 2022: 0,12 %)		
190 Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000 %, fällig 01.01.2052	177	0,11	230 Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01.02.2029		
97 Fannie Mae Pool 'FS0352', 2,000 %, fällig 01.01.2052	84	0,05	Kanada — 0,98 % (28. Februar 2022: 0,12 %)		
96 Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, fällig 01.01.2052	87	0,05	130 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.01.2028		
98 Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000 %, fällig 02.01.2052	91	0,06	130 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2029	116	0,07
96 Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500 %, fällig 02.01.2052	87	0,05	EUR 750 Bank of Montreal, 2,750 %, fällig am 15.06.2027	733	0,46
97 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 02.01.2052	84	0,05	GBP 540 Royal Bank of Canada, 3,625 %, fällig am 14.06.2027	598	0,38
100 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, fällig 06.01.2049	97	0,06		1.559	0,98
78 Fannie Mae Pool 'MAA158', 2,000 %, fällig 10.01.2050	67	0,04	China — 0,01 % (28. Februar 2022: 0,01 %)		
68 Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, fällig am 04.01.2038	65	0,04	20 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, fällig am 01.05.2025		
23 Freddie Mac Gold Pool 'G67721', 4,500 %, fällig am 04.01.2049	24	0,02	Frankreich — 0,84 % (28. Februar 2022: 0,53 %)		
20 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,098 %, fällig am 01.03.2047 *	19	0,01	330 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, fällig am 15.10.2029		
45 Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500 %, fällig am 01.02.2050	44	0,03	200 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *	261	0,16
79 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig am 01.02.2051	68	0,04	300 BNP Paribas SA, 1,875 %, fällig 14.12.2027	185	0,12
185 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, fällig am 08.01.2051	167	0,11	500 BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig am 30.05.2028 *	297	0,19
88 Freddie Mac Pool 'QC6768', 3,000 %, fällig am 09.01.2051	82	0,05	200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, fällig 17.09.2044	431	0,27
96 Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, fällig am 02.01.2052	87	0,05		1.328	0,84
29 Freddie Mac Pool 'RA2358', 4,000 %, fällig am 03.01.2050	29	0,02	Deutschland — 1,36 % (28. Februar 2022: 1,27 %)		
37 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig am 10.01.2041	32	0,02	GBP 250 E.ON International Finance BV, 5,625 %, fällig 06.12.2023		
79 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig am 01.04.2051	68	0,04	EUR 500 Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München, 3,250 %, fällig 26.05.2049 *	294	0,19
90 Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500 %, fällig am 07.01.2051	81	0,05	EUR 1.420 Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, fällig 01.10.2024	468	0,29
191 Freddie Mac Pool 'SD0809', 3,000 %, fällig am 01.01.2052	177	0,11		1.394	0,88
387 Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, fällig am 07.01.2049	383	0,24		2.156	1,36
189 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig am 11.01.2051	170	0,11			
79 Freddie Mac Pool 'ZA6680', 4,000 %, fällig am 04.01.2049	78	0,05			
68 Freddie Mac Pool 'ZS3204', 5,000 %, fällig am 06.01.2041	71	0,04			
140 Freddie Mac Pool 'ZS3940', 4,500 %, fällig am 06.01.2038	142	0,09			
38 Freddie Mac Pool 'ZS4720', 4,500 %, fällig am 05.01.2047	39	0,02			
56 Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000 %, fällig 15.09.2042	53	0,03			
385 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15.06.2048	381	0,24			
20 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15.09.2042	19	0,01			
11 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15.09.2042	11	0,01			
48 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15.10.2042	46	0,03			
32 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, fällig 15.10.2042	30	0,02			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — (Fortsetzung)					
90	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig am 15.12.2028	76	0,05		
340	HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	342	0,21		
380	HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.06.2026	382	0,24		
200	HCA Inc, 4,500 %, fällig 15.02.2027	195	0,12		
130	Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	109	0,07		
70	Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	56	0,03		
20	Humana Inc, 2,150 %, fällig 03.02.2032	16	0,01		
70	JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, fällig 15.12.2026	69	0,04		
520	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	440	0,28		
440	JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, fällig 13.05.2031 *	378	0,24		
177	Lehman Escrow Receipt, Nullcoupon, fortwährend [†]	1	–		
180	Magallanes Inc, 144A, 5,141 %, fällig 15.03.2052	144	0,09		
220	Magallanes Inc, 144A, 5,391 %, fällig 15.03.2062	177	0,11		
30	McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	24	0,01		
110	McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	98	0,06		
29	Medtronic Inc, 4,625 %, fällig 15.03.2045	29	0,02		
40	MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	41	0,03		
10	Morgan Stanley, 4,431 %, fällig am 23.01.2030 *	10	0,01		
260	Morgan Stanley, 3,622 %, fällig am 01.04.2031 *	238	0,15		
EUR	850 Netflix Inc, 3,625 %, fällig am 15.06.2030	775	0,49		
170	NGPL PipeCo LLC, 144A, 4,875 %, fällig 15.08.2027	165	0,10		
70	NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	58	0,04		
70	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig am 15.08.2029	64	0,04		
80	Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig am 15.03.2046	88	0,06		
320	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig am 15.04.2046	278	0,17		
600	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig am 15.08.2049	515	0,32		
EUR	380 Prologis Euro Finance LLC, 0,500 %, fällig 16.02.2032	285	0,18		
EUR	271 Prologis Euro Finance LLC, 1,500 %, fällig 08.02.2034	214	0,13		
180	Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	161	0,10		
384	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	390	0,25		
10	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	12	0,01		
4	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig am 16.12.2039	5	–		
90	Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig am 04.05.2030	77	0,05		
100	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig am 01.07.2038	103	0,06		
40	Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig 15.06.2039	39	0,02		
30	T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.02.2026	28	0,02		
90	T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	78	0,05		
240	T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	222	0,14		
60	T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	51	0,03		
100	T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	89	0,06		
150	T-Mobile USA Inc, 2,700 %, fällig 15.03.2032	125	0,08		
140	T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041	103	0,06		
640	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	562	0,35		
50	United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig am 15.01.2030	47	0,03		
80	United Rentals North America Inc, 4,000 %, fällig 15.07.2030	70	0,04		
330	United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig am 15.02.2031	286	0,18		
70	United Rentals North America Inc, 3,750 %, fällig am 15.01.2032	58	0,04		
190	Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig am 10.08.2033	183	0,11		
50	Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig am 16.03.2027	51	0,03		
10	Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig am 21.08.2046	10	0,01		
10	Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig 16.03.2047	10	0,01		
90	Visa Inc, 2,700 %, fällig 15.04.2040	72	0,04		
340	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	288	0,18		
810	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig am 04.04.2051 *	793	0,50		
790	Western Midstream Operating LP, 4,300 %, fällig 01.02.2030	714	0,45		
550	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig am 01.02.2050	477	0,30		
		25.071	15,76		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 52.591\$)		45.152	28,38		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 56,04 % (28. Februar 2022: 56,78 %)					
Australien — 2,54 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
AUD	2.800 Australia Government Bond, Serie 139, 3,250 %, fällig 21.04.2025	1.918	1,21		
AUD	3.670 Australia Government Bond, Serie 157, 1,500 %, fällig 21.06.2031	2.121	1,33		
		4.039	2,54		
Belgien — 0,57 % (28. Februar 2022: 0,81 %)					
EUR	760 Kingdom of Belgium Government Bond, Serie 71, 3,750 %, fällig 22.06.2045	908	0,57		
Kanada — 1,58 % (28. Februar 2022: 1,44 %)					
CAD	1.640 Canadian Government Bond, 2,250 %, fällig 01.06.2025	1.208	0,76		
CAD	1.030 Provinz Ontario Canada, 3,450 %, fällig am 02.06.2045	710	0,44		
CAD	860 Provinz Quebec Canada, 3,500 %, fällig am 01.12.2045	599	0,38		
		2.517	1,58		
Frankreich — 1,62 % (28. Februar 2022: 0,87 %)					
EUR	1.670 French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032	1.376	0,87		
EUR	870 French Republic Government Bond OAT, 144A, 1,500 %, fällig 25.05.2050	700	0,44		
EUR	370 French Republic Government Bond OAT, 4,000 %, fällig 25.04.2060	500	0,31		
		2.576	1,62		
Deutschland — 0,38 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
EUR	670 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	598	0,38		
Indonesien — 1,83 % (28. Februar 2022: 2,60 %)					
	1.320 Indonesia Government International Bond, 4,200 %, fällig 15.10.2050	1.155	0,73		
IDR	23.602.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR79, 8,375 %, fällig 15.04.2039	1.756	1,10		
		2.911	1,83		
Italien — 1,20 % (28. Februar 2022: 1,48 %)					
EUR	2.120 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,250 %, fällig am 01/09/2046	1.917	1,20		
Japan — 6,37 % (28. Februar 2022: 6,43 %)					
JPY	29.700 Japan Government Thirty Year Bond, Serie 59, 0,700 %, fällig 20.06.2048	195	0,12		
JPY	479.200 Japan Government Thirty Year Bond, Serie 66, 0,400 %, fällig 20.03.2050	2.855	1,80		
JPY	635.800 Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 21, 0,100 %, fällig am 10.03.2026 β	4.970	3,12		
JPY	269.400 Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 23, 0,100 %, fällig 10.03.2028 β	2.112	1,33		
		10.132	6,37		
Mexiko — 3,79 % (28. Februar 2022: 3,78 %)					
MXN	83.640 Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	3.667	2,31		
EUR	820 Mexico Government International Bond, 2,875 %, fällig 08.04.2039	621	0,39		
	830 Mexico Government International Bond, 5,550 %, fällig 21.01.2045	779	0,49		
	1.180 Mexico Government International Bond, 4,600 %, fällig 23.01.2046	962	0,60		
		6.029	3,79		
Norwegen — 1,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
NOK	7.740 Norway Government Bond, Serie 482, 144A, 1,375 %, fällig 19.08.2030	672	0,42		
NOK	10.130 Norway Government Bond, Serie 484, 144A, 2,125 %, fällig 18.05.2032	918	0,58		
		1.590	1,00		
Polen — 1,17 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
PLN	12.700 Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	1.860	1,17		
Südafrika — 1,54 % (28. Februar 2022: 1,61 %)					
ZAR	66.492 Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	2.447	1,54		
Südkorea — 1,12 % (28. Februar 2022: 1,01 %)					
KRW	2.533.840 Korea Treasury Bond, Serie 2606, 1,875 %, fällig am 06.10.2026	1.784	1,12		
Spanien — 1,50 % (28. Februar 2022: 2,07 %)					
EUR	500 Spain Government Bond, 144A, 5,150 %, fällig 31.10.2044	671	0,42		
EUR	1.850 Spain Government Bond, Serie 30Y, 144A, 2,700 %, fällig 31.10.2048	1.724	1,08		
		2.395	1,50		
Vereinigte Arabische Emirate — 0,63 % (28. Februar 2022: 0,71 %)					
	1.110 Abu Dhabi Government International Bond, 3,875 %, fällig 16.04.2050	1.009	0,63		
Vereinigtes Königreich — 6,49 % (28. Februar 2022: 2,24 %)					
GBP	6.180 United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07.06.2032	8.059	5,07		
GBP	1.140 United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07.12.2040	1.518	0,95		
GBP	710 United Kingdom Gilt, 2,500 %, fällig 22.07.2065	754	0,47		
		10.331	6,49		
USA — 22,71 % (28. Februar 2022: 29,33 %)					
	5.370 United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30/04/2025	4.948	3,11		
	4.450 United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 30/06/2025	4.067	2,56		
	20.880 United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31/08/2025	18.962	11,92		
	2.130 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15/11/2047	1.855	1,17		
	2.300 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2049	2.093	1,31		
	3.440 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2052	3.171	1,99		
	1.090 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/08/2052	1.034	0,65		
		36.130	22,71		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 104.676\$)				89.173	56,04

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen — 6,81 % (28. Februar 2022: 10,08 %)		
758 Franklin Templeton China Funds — Western Asset China Bond Fund — Klasse LM	10.841	6,81
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 10.363\$)	10.841	6,81
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 182.088\$)	158.686	99,73
Kontrakte		
(in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Gekaufte Optionen — 0,03 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
EUR — Euro Currency Future December 2022 Call 99,6250, fällig am 19.12.2022 — Bank of America Merrill Lynch	1	–
3.280 USD Call/GBP Put 1,12, fällig 20.12.2022 — JP Morgan	42	0,03
Gekaufte Optionen insgesamt (Kosten 63\$)	43	0,03
Devisenterminkontrakte — 1,27 % (28. Februar 2022: 0,89 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	2.019	1,27
Futures — (0,27 %) (28. Februar 2022: 0,41 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	429	0,27
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	161.177	101,30
Kontrakte		
(in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Geschriebene Optionen — (0,13 %) (28. Februar 2022: 0,00 %)		
EUR — Euro Currency Future December 2022 Put 99,00, fällig 19.12.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(206)	(0,13)
Summe geschriebene Optionen (Kosten 36 USD)	(206)	(0,13)
Inflationsswaps — (0,52 %) (28. Februar 2022: (0,39 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(826)	(0,52)
Zinsswaps — (1,02 %) (28. Februar 2022: (0,35 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.626)	(1,02)
Devisenterminkontrakte — (1,57 %) (28. Februar 2022: (0,94 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(2.494)	(1,57)
Futures — (1,03 %) (28. Februar 2022: (0,57 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.637)	(1,03)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(6.789)	(4,27)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	154.388	97,03
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	4.723	2,97
Gesamtvermögen	159.111\$	100,00

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 12.192.000\$ und machten 7,65 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.
- † Nicht liquide.
- ∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach Ermessen des Bewertungsausschusses.
- ± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.
- β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI) Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihenzins entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.

ABKÜRZUNGEN:

- CPI – Verbraucherpreisindex.
- Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
- TBA – Wird noch bekanntgegeben.
- AUD – Australischer Dollar
- CAD – Kanadischer Dollar
- EUR – Euro
- GBP – Britisches Pfund Sterling
- IDR – Indonesische Rupiah
- JPY – Japanischer Yen
- KRW – Südkoreanischer Won
- MXN – Mexikanischer Peso
- NOK – Norwegische Krone
- PLN – Polnischer Zloty
- ZAR – Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	86,41
Organismen für gemeinsame Anlagen	6,34
Finanzderivate	1,46
Sonstige Vermögenswerte	5,79
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitsstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating CAD 3M CDOR, Receive Fixed 1,483 %	27.10.2023	21.130	\$ (512)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating EUR 6M Euribor Reuters, Receive Fixed -0,150 %	15.08.2026	10.590	(937)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating EUR 6M Euribor, Receive Fixed 1,500 %	16.04.2027	5.490	(177)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 142\$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (703))\$				(1.626)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (561))\$				\$ (1.626)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CAD — Bankers' Acceptance CDOR	25.10.2024	1.000	\$ (40)
Bank of America Merrill Lynch	USD — VPI Städtische Verbraucher	28.04.2026	4.400	(463)
Bank of America Merrill Lynch	GBP — RPI Alle Artikel NSA	15.10.2026	2.310	(323)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (805))\$				(826)
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (805))\$				\$ (826)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
09.08.2022	Citi	Kauf	USD	11.060	Verkauf	CNH	73.790	\$ 377
09.08.2022	JP Morgan	Kauf	USD	2.062	Verkauf	KRW	2.554.455	154
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2.566	Verkauf	CAD	3.338	25
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	675	Verkauf	EUR	664	8
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	252	Verkauf	EUR	254	(3)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	141	Verkauf	NZD	228	1
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	8.578	Verkauf	USD	5.381	(132)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	2	Verkauf	USD	2	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	21.726	Verkauf	USD	22.200	(344)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	126.780	Verkauf	USD	98.518	(1.999)
16.11.2022	Citi	Kauf	USD	53	Verkauf	AUD	75	1
16.11.2022	Citi	Kauf	USD	991	Verkauf	EUR	966	16
16.11.2022	Citi	Kauf	USD	4.340	Verkauf	GBP	3.583	172
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.141	Verkauf	CAD	1.468	24
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	426	Verkauf	EUR	414	7
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	121	Verkauf	GBP	100	5
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.212	Verkauf	JPY	296.158	65
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	241	Verkauf	MXN	5.006	(4)
16.11.2022	HSBC	Kauf	USD	12.561	Verkauf	EUR	12.242	194
16.11.2022	HSBC	Kauf	EUR	570	Verkauf	USD	584	(8)
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	4.442	Verkauf	AUD	6.408	52
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	3.285	Verkauf	CNH	22.250	59
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	6.039	Verkauf	EUR	5.881	98
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	240	Verkauf	EUR	240	(3)
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	11.455	Verkauf	GBP	9.528	369
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	1.322	Verkauf	JPY	176.853	40
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	AUD	140	Verkauf	USD	97	(1)
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	150	Verkauf	ZAR	2.520	4
16.11.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.754	Verkauf	CAD	2.240	49
16.11.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	206	Verkauf	GBP	170	8
16.11.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	4.603	Verkauf	JPY	616.200	137
16.11.2022	UBS	Kauf	USD	9.150	Verkauf	EUR	8.917	142
16.11.2022	UBS	Kauf	USD	404	Verkauf	JPY	54.000	12
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1.797\$)								\$ 2.019
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.907))\$								(2.494)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (110))\$								\$ (475)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro\$ Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	60	14.390 \$	(427)
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	130	31.286	(922)
90 Day Euro\$ September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(52)	(12.561)	4
Australia 3 Year Bond September 2022	Bank of America Merrill Lynch	67	4.938	16
Canadian 10 Year Bond Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	2	190	(1)
Euro-Bobl September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(54)	(6.679)	175
Euro-BTP September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(5)	(601)	32
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(7)	(1.158)	102
Euro-OAT September 2022	Bank of America Merrill Lynch	2	277	(10)
ICE 3 Monate SONIA Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	85	23.774	(187)
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(7)	(7.534)	(88)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Termingeschäftskontrakte — (Fortsetzung)

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(12)	(1,403) USD	\$ 13
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(80)	(10,015)	81
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	4	443	(2)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(9)	(1,345)	6
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 837\$)				\$ 429
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.170))\$				(1.637)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (333))\$				\$ (1.208)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 85,63 % (28. Februar 2022: 90,58 %)					
Australien — 1,31 % (28. Februar 2022: 0,95 %)					
EUR	240	0,28	200	196	0,29
AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1,625 %, fällig am 11.03.2081 *					
EUR	280	0,40	150	121	0,18
Glencore Finance Canada Ltd, 6,000 %, fällig 15.11.2041					
EUR	370	0,56	240	177	0,27
Glencore Finance Europe Ltd, 1,875 %, fällig 13.09.2023					
EUR	60	0,07	3850	298	0,45
Westpac Banking Corp, 2,668 %, fällig 15.11.2035 *					
	876	1,31			
Austria — 0,25 % (28. Februar 2022: 0,27 %)					
EUR	200	0,25	240	222	0,33
CA Immobilien Anlagen AG, 0,875 %, fällig am 05.02.2027					
Belgien — 0,38 % (28. Februar 2022: 1,28 %)					
EUR	10	0,01	270	263	0,39
Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048					
EUR	300	0,37	290	279	0,42
UCB SA, 1,000 %, fällig 30.03.2028					
	253	0,38	200	146	0,22
Brasilien — 0,72 % (28. Februar 2022: 0,69 %)					
EUR	300	0,45	200	172	0,26
Suzano Austria GmbH, 7,000 %, fällig 16.03.2047					
EUR	160	0,27	250	207	0,31
Vale Canada Ltd, 7,200 %, fällig am 15.09.2032					
	479	0,72	200	159	0,24
China — 0,08 % (28. Februar 2022: 0,08 %)					
EUR	60	0,08	250	232	0,35
NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 3,400 %, fällig 01.05.2030					
	53	0,08	340	311	0,46
Kolumbien — 0,18 % (28. Februar 2022: 0,19 %)					
EUR	170	0,18	200	193	0,29
Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig am 28.05.2045					
Dänemark — 1,78 % (28. Februar 2022: 1,34 %)					
EUR	140	0,21	270	263	0,39
Coloplast Finance BV, 2,250 %, fällig 19.05.2027					
EUR	150	0,22	290	279	0,42
Coloplast Finance BV, 2,750 %, fällig 19.05.2030					
EUR	270	0,41	200	172	0,26
Danske Bank A/S, 5,375 %, fällig 12.01.2024					
EUR	200	0,29	250	207	0,31
Danske Bank A/S, 2,500 %, fällig 21.06.2029 *					
EUR	470	0,65	200	159	0,24
Danske Bank A/S, 1,375 %, fällig 12.02.2030 *					
	1.184	1,78	250	232	0,35
Finnland — 0,78 % (28. Februar 2022: 0,56 %)					
EUR	400	0,53	240	222	0,33
Neste Oyj, 0,750 %, fällig am 25.03.2028					
EUR	170	0,25	200	193	0,29
Nokia Oyj, 3,125 %, fällig 15.05.2028					
	517	0,78	260	233	0,35
Frankreich — 6,88 % (28. Februar 2022: 6,45 %)					
EUR	200	0,25	260	233	0,35
Accor SA, 2,375 %, fällig 29.11.2028					
EUR	450	0,68	240	222	0,33
AXA SA, 3,250 %, fällig 28.05.2049 *					
EUR	400	0,60	200	193	0,29
BNP Paribas SA, 4,705 %, fällig 10.01.2025 *					
GBP	400	0,60	200	193	0,29
BNP Paribas SA, 1,875 %, fällig 14.12.2027					
GBP	410	0,52	200	193	0,29
BNP Paribas SA, 144A, 3,052 %, fällig 13.01.2031 *					
GBP	200	0,30	200	193	0,29
BNP Paribas SA, 2,000 %, fällig 24.05.2031 *					
EUR	200	0,30	200	193	0,29
BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, unbefristet *					
EUR	500	0,67	200	193	0,29
Eiffage SA, 1,625 %, fällig 14.01.2027					
EUR	200	0,23	200	193	0,29
Electricite de France SA, 1,000 %, fällig 29.11.2033					
EUR	200	0,28	200	193	0,29
Engie SA, 0,500 %, fällig 24.10.2030					
EUR	310	0,34	200	193	0,29
GELF Bond Issuer I SA, 1,125 %, fällig am 18.07.2029					
EUR	300	0,37	200	193	0,29
JCDecaux SA, 1,625 %, fällig 07.02.2030					
EUR	300	0,47	200	193	0,29
Orange SA, 5,000 %, fortwährend *					
EUR	400	0,57	200	193	0,29
Suez SACA, 1,875 %, fällig 24.05.2027					
EUR	200	0,23	200	193	0,29
Terega SA, 0,875 %, fällig 17.09.2030					
EUR	200	0,24	200	193	0,29
Terega SASU, 0,625 %, fällig 27.02.2028					
EUR	200	0,23	200	193	0,29
WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 4,750 %, fällig 17.09.2044					
	154	0,23	110	100	0,15
	4.582	6,88		1.703	2,56
Deutschland — 7,54 % (28. Februar 2022: 8,02 %)					
EUR	400	0,61	200	193	0,29
Allianz SE, 4,750 %, fortwährend *					
EUR	200	0,23	300	258	0,39
Allianz SE, 2,625 %, fortwährend *					
EUR	600	0,69	200	193	0,29
Allianz SE, 3,200 %, fortwährend *					
EUR	300	0,38	200	193	0,29
alstria office REIT-AG, 1,500 %, fällig am 23.06.2026					
EUR	200	0,25	200	193	0,29
Aroundtown SA, 0,375 %, fällig 15.04.2027					
EUR	360	0,66	200	193	0,29
Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, fällig 15.06.2030					
EUR	200	0,24	200	193	0,29
Evonik Industries AG, 1,375 %, fällig 02.09.2081 *					
EUR	200	0,23	200	193	0,29
Grand City Properties SA, 1,500 %, unbefristet *					
EUR	400	0,48	200	193	0,29
Hannover Rück SE, 1,125 %, fällig 09.10.2039 *					
EUR	200	0,27	200	193	0,29
Merck KGaA, 2,875 %, fällig 25.06.2079 *					
EUR	400	0,56	200	193	0,29
Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München, 3,250 %, fällig 26.05.2049 *					
EUR	100	0,13	200	193	0,29
Sirius Real Estate Ltd, 1,125 %, fällig 22.06.2026					
EUR	200	0,23	200	193	0,29
Sirius Real Estate Ltd, 1,750 %, fällig 24.11.2028					
EUR	200	0,24	200	193	0,29
Vantage Towers AG, 0,750 %, fällig 31.03.2030					
EUR	380	0,56	200	193	0,29
Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, fällig 01.10.2024					
GBP	400	0,68	200	193	0,29
Volkswagen Financial Services NV, 4,250 %, fällig 09.10.2025					
EUR	200	0,27	200	193	0,29
Vonovia Finance BV, 2,250 %, fällig 07.04.2030					
EUR	200	0,26	200	193	0,29
Vonovia SE, 0,375 %, fällig 16.06.2027					
EUR	200	0,22	200	193	0,29
Vonovia SE, 0,750 %, fällig 01.09.2032					
EUR	100	0,08	200	193	0,29
Vonovia SE, 1,625 %, fällig 01.09.2051					
EUR	200	0,27	200	198	0,30
ZF Finance GmbH, 3,000 %, fällig 21.09.2025					
	5.022	7,54		1.982	2,94
Hong Kong — 0,29 % (28. Februar 2022: 0,27 %)					
EUR	200	0,29	200	196	0,29
AIA Group Ltd, 144A, 3,200 %, fällig 11.03.2025					
Irland — 0,45 % (28. Februar 2022: 0,47 %)					
EUR	150	0,18	240	177	0,27
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig am 30.01.2032					
EUR	240	0,27	3850	298	0,45
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,850 %, fällig 29.10.2041					
	298	0,45			
Israel — 0,33 % (28. Februar 2022: 0,33 %)					
EUR	240	0,33	240	222	0,33
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,125 %, fällig 15.10.2024					
Italien — 2,94 % (28. Februar 2022: 3,43 %)					
EUR	270	0,39	290	279	0,42
Enel Finance International NV, 6,000 %, fällig 07.10.2039					
EUR	290	0,42	200	146	0,22
FCA Bank SpA/Ireland, 0,500 %, fällig 13.09.2024					
EUR	200	0,26	200	172	0,26
Intesa Sanpaolo SpA, 6,375 %, unbefristet *					
EUR	250	0,31	200	159	0,24
Intesa Sanpaolo SpA, 5,500 %, unbefristet *					
EUR	200	0,24	250	232	0,35
Terna — Rete Elettrica Nazionale, 2,375 %, fortwährend *					
EUR	250	0,35	340	311	0,46
UniCredit SpA, 1,200 %, fällig 20.01.2026 *					
EUR	340	0,46	200	193	0,29
UniCredit SpA, 2,000 %, fällig 23.09.2029 *					
EUR	200	0,29	200	193	0,29
UniCredit SpA, 7,500 %, unbefristet *					
	1.962	2,94			
Luxemburg — 2,54 % (28. Februar 2022: 2,79 %)					
GBP	100	0,15	200	193	0,29
ArcelorMittal SA, 6,750 %, fällig 01.03.2041					
EUR	200	0,28	270	263	0,39
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,625 %, fällig 20.10.2028					
EUR	270	0,32	200	172	0,26
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,625 %, fällig 20.04.2030					
EUR	340	0,45	200	172	0,26
Logicor Financing Sarl, 1,625 %, fällig 15.07.2027					
EUR	350	0,49	200	172	0,26
Logicor Financing Sarl, 3,250 %, fällig 13.11.2028					
EUR	125	0,17	240	222	0,33
Prologis International Funding II SA, 1,750 %, fällig 15.03.2028					
EUR	240	0,33	260	233	0,35
SELP Finance Sarl, 1,500 %, fällig 20.11.2025					
EUR	260	0,35			
	1.696	2,54			
Macau — 0,48 % (28. Februar 2022: 0,47 %)					
EUR	200	0,26	200	193	0,29
Sands China Ltd, 5,900 %, fällig am 08.08.2028					
EUR	200	0,22	200	193	0,29
Sands China Ltd, 3,100 %, fällig am 03.08.2029					
	323	0,48			
Mexiko — 0,66 % (28. Februar 2022: 0,61 %)					
EUR	240	0,36	200	193	0,29
BBVA Bancomer SA/Texas, 6,750 %, fällig 30.09.2022					
EUR	200	0,30	200	193	0,29
Orbia Advance Corp SAB de CV, 144A, 6,750 %, fällig 19.09.2042					
	203	0,30			
	443	0,66			
Niederlande — 2,56 % (28. Februar 2022: 3,03 %)					
EUR	300	0,38	200	193	0,29
ABN AMRO Bank NV, 4,750 %, unbefristet *					
EUR	270	0,37	200	193	0,29
CTP NV, 2,125 %, fällig 01.10.2025					
EUR	260	0,29	200	193	0,29
CTP NV, 1,250 %, fällig 21.06.2029					
EUR	100	0,13	200	193	0,29
Enxsis Holding NV, 0,750 %, fällig am 02.07.2031					
EUR	140	0,21	200	193	0,29
Euronext NV, 1,000 %, fällig 18.04.2025					
EUR	200	0,30	200	193	0,29
ING Groep NV, 3,000 %, fällig am 11.04.2028 *					
EUR	300	0,44	200	193	0,29
ING Groep NV, 2,500 %, fällig 15.02.2029 *					
EUR	200	0,29	200	193	0,29
Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1,750 %, fällig am 02.04.2027					
EUR	110	0,15	200	193	0,29
Koninklijke Philips NV, 2,000 %, fällig 30.03.2030					
	1.703	2,56			
Peru — 0,21 % (28. Februar 2022: 0,23 %)					
EUR	200	0,21	200	193	0,29
Petroleos del Peru SA, 5,625 %, fällig am 19.06.2047					
Portugal — 0,39 % (28. Februar 2022: 0,40 %)					
EUR	300	0,39	200	193	0,29
EDV — Energias de Portugal SA, 1,875 %, fällig am 02.08.2081 *					
Singapur — 0,27 % (28. Februar 2022: 0,29 %)					
EUR	200	0,27	200	193	0,29
Cromwell Ereit Lux Finco Sarl, 2,125 %, fällig am 19.11.2025					
Südafrika — 0,41 % (28. Februar 2022: 0,47 %)					
GBP	270	0,41	200	193	0,29
Anglo American Capital Plc, 3,375 %, fällig 11.03.2029					
Spanien — 2,37 % (28. Februar 2022: 2,27 %)					
EUR	100	0,12	200	193	0,29
Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 1,375 %, fällig am 26.01.2032					
GBP	500	0,74	200	193	0,29
Banco Santander SA, 1,750 %, fällig 17.02.2027					
EUR	200	0,30	200	193	0,29
Banco Santander SA, 5,294 %, fällig 18.08.2027					
EUR	200	0,29	200	193	0,29
Banco Santander SA, 5,250 %, fortwährend *					
EUR	100	0,11	200	193	0,29
Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, fällig 15.02.2033					
EUR	200	0,24	200	193	0,29
Cellnex Telecom SA,					

Legg Mason Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit — Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX,NA,IG, 1,000 % — Buy	20.06.2027	4.200	\$ (14)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 % — Buy	20.06.2027	3.440	31
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -\$)				\$ 31
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (283))\$				(14)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (283))\$				\$ 17

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating EUR 6M Euribor Reuters, Receive Fixed -0,150 %	15.08.2026	3.840	\$ (340)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -\$)				\$ -
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (110))\$				(340)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (110))\$				\$ (340)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	110	Verkauf	EUR	110	\$ -
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	1	-
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	23	Verkauf	USD	23	-
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	44	Verkauf	USD	53	(2)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	4.297	Verkauf	USD	4.391	(68)
16.11.2022	BNP Paribas	Kauf	USD	259	Verkauf	EUR	252	5
16.11.2022	Citi	Kauf	USD	10	Verkauf	EUR	10	-
16.11.2022	Citi	Kauf	USD	4.732	Verkauf	EUR	4.609	75
16.11.2022	Citi	Kauf	USD	95	Verkauf	GBP	79	4
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	11.277	Verkauf	EUR	10.969	196
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.956	Verkauf	GBP	1.614	77
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	JPY	78.866	Verkauf	USD	589	(18)
16.11.2022	HSBC	Kauf	USD	62	Verkauf	EUR	60	1
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	6.965	Verkauf	EUR	6.784	112
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	20	Verkauf	EUR	20	-
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	4.114	Verkauf	GBP	3.389	172
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	AUD	66	Verkauf	USD	46	(1)
16.11.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.624	Verkauf	EUR	1.581	27
16.11.2022	Royal Bank of Canada	Kauf	USD	758	Verkauf	EUR	738	12
16.11.2022	UBS	Kauf	USD	3.494	Verkauf	EUR	3.405	53
16.11.2022	UBS	Kauf	USD	1.687	Verkauf	GBP	1.393	67
16.11.2022	UBS	Kauf	EUR	390	Verkauf	USD	400	(7)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 827\$)								\$ 801
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (116))\$								(96)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 711\$)								\$ 705

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(47)	(5.814)\$	\$ 168
Euro-Bund September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(13)	(1.933)	90
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(2)	(2.153)	(19)
Long Gilt Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(14)	(1.755)	29
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	34	3.975	(30)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	32	3.546	(19)
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(11)	(1.494)	15
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	22	3.289	(5)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 437\$)				\$ 302
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (44))\$				(73)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 393\$)				\$ 229

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 4,73 % (28. Februar 2022: 4,54 %)			Irland — 0,01 % (28. Februar 2022: 0,10 %)		
16.250 Apidos CLO XXXVI, Serie 2021 36A, Klasse D, 144A, 5,610 %, fällig am 20.07.2034 *	15.182	0,58	490 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig am 30.01.2032	396	0,01
10.960 Apidos CLO XXXVIII, Serie 2021 38A, Klasse D, 144A, 5,682 %, fällig 21.01.2034 *	9.841	0,37	Israel — 3,83 % (28. Februar 2022: 2,75 %)		
15.430 Bain Capital Credit CLO 2021-4 Ltd, Serie 2021 4A, Klasse D, 144A, 5,810 %, fällig 20.10.2034 *	14.589	0,56	9.512 Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, fällig am 18.12.2022	9.458	0,36
7.790 Bavarian Sky UK 5 Plc, Serie 2014 1A, Klasse CR2, 144A, 6,340 %, fällig 20.10.2034 *	7.059	0,27	8.027 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig 01.02.2036	7.235	0,28
7.974 Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Serie 2016 1A, Klasse AA, 144A, 2,487 %, fällig 16.12.2041	7.454	0,28	5.853 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig am 21.07.2023	5.621	0,21
8.270 Canyon Capital CLO 2017-1 Ltd, Serie 2017 1A, Klasse DR, 144A, 5,512 %, fällig 15.07.2030 *	7.922	0,30	22.213 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig am 31.01.2025	22.021	0,84
3.375 CWHQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2006-I, Serie 2006 I, Klasse 2A, 2,531 %, fällig 15.01.2037 *	3.116	0,12	10.425 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	8.801	0,34
7.225 DB Master Finance LLC, Serie 2021 1A, Klasse A23, 144A, 2,791 %, fällig 20.11.2051	5.883	0,22	2.390 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,750 %, fällig 01.03.2028	2.288	0,09
8.000 Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Serie 2018 4, Klasse A, 4,060 %, fällig 15.11.2030	7.907	0,30	2.810 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09.05.2029	2.461	0,09
2.314 Loanpal Solar Loan Ltd, Serie 2020 3GS, Klasse B, 144A, 3,450 %, fällig am 20.12.2047	1.966	0,08	64.981 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, fällig 01.10.2046	42.630	1,62
8.025 Nassau 2021-I Ltd, Serie 2021 1A, Klasse D, 144A, 6,262 %, fällig 26.08.2034 *	7.755	0,30	100.515	3,83	
7.000 Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Klasse DR, 144A, 6,232 %, fällig 15.10.2034 *	6.384	0,24	Italien — 0,11 % (28. Februar 2022: 0,09 %)		
8.206 Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Klasse A, 144A, 2,675 %, fällig am 28.02.2033	7.549	0,29	2.950 Enel Finance International NV, 144 A, 6,000 %, fällig 07.10.2039	2.869	0,11
7.200 Venture XXVI CLO Ltd, Serie 2017 26A, Klasse D, 144A, 6,960 %, fällig 20.01.2029 *	6.920	0,26	Luxemburg — 0,06 % (28. Februar 2022: 0,05 %)		
9.550 Vibrant Clo VII Ltd, Serie 2017 7A, Klasse C, 144A, 6,310 %, fällig 15.09.2030 *	8.862	0,34	1.550 ArcelorMittal SA, 7,000 %, fällig 15.10.2039	1.566	0,06
6.100 Vibrant CLO XI Ltd, Serie 2019 11A, Klasse CR, 144A, 6,210 %, fällig am 20.07.2032 *	5.773	0,22	Macau — 0,35 % (28. Februar 2022: 0,31 %)		
Asset-Backed Securities insgesamt (Kosten 133.401 USD)	124.162	4,73	7.500 Sands China Ltd, 5,625 %, fällig am 08.08.2025	6.853	0,26
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 0,77 % (28. Februar 2022: 2,26 %)			1.450 Sands China Ltd, 2,550 %, fällig am 03.08.2027	1.165	0,04
10.400 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Serie 2021 R03, Klasse 1M2, 144A, 3,833 %, fällig 25.12.2041 *	9.790	0,37	1.540 Sands China Ltd, 3,100 %, fällig am 03.08.2029	1.167	0,05
1.127 CSMC Serie 2015-12R, Serie 2015 12R, Klasse 2A1, 144A, 2,759 %, fällig 30.11.2037 *	1.125	0,04	9.185	0,35	
37 Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500 %, fällig 01.12.2047	36	–	Malaysia — 0,34 % (28. Februar 2022: 0,39 %)		
40 Flagstar Mortgage Trust 2018-2, Serie 2018 2, Klasse A4, 144A, 3,500 %, fällig am 25.04.2048 *	40	–	12.270 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig am 19.08.2050	8.992	0,34
7.870 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Klasse M2, 144A, 3,683 %, fällig am 25.10.2033 *	7.448	0,28	Mexiko — 0,35 % (28. Februar 2022: 0,57 %)		
1.464 MortgageIT Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse A1, 3,044 %, fällig 25.08.2035 *	1.407	0,06	6.910 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625 %, unbefristet *	6.511	0,25
523 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQ2R, Klasse A3, 144A, 1,353 %, fällig am 25.10.2058 *	496	0,02	4.350 Petroleos Mexicanos, 6,375 %, fällig 23.01.2045	2.729	0,10
Summe Mortgage-Backed Securities (Anschaffungskosten 21.346 USD)	20.342	0,77	9.240	0,35	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 39,35 % (28. Februar 2022: 43,01 %)			Supranational — 0,31 % (28. Februar 2022: 0,21 %)		
Belgien — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,11 %)			IDR 127.100.000 European Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, fällig 06.10.2026	8.106	0,31
120 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, fällig 23.01.2049	125	–	Schweden — 0,30 % (28. Februar 2022: 0,32 %)		
Bermudas — 0,52 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			9.600 Svenska Handelsbanken AB, 4,750 %, unbefristet *	7.918	0,30
14.150 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig am 15.10.2025	13.627	0,52	Schweiz — 1,54 % (28. Februar 2022: 1,62 %)		
Brasilien — 0,37 % (28. Februar 2022: 1,26 %)			10.250 Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, unbefristet *	10.378	0,39
3.010 Petrobras Global Finance BV, 7,375 %, fällig am 17.01.2027	3.194	0,12	1.350 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, unbefristet *	1.193	0,05
3.220 Petrobras Global Finance BV, 5,999 %, fällig am 27.01.2028	3.243	0,12	13.220 Credit Suisse Group AG, 144A, 5,250 %, unbefristet *	9.971	0,38
3.720 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig am 05.06.2115	3.246	0,13	200 Credit Suisse Group AG, 144A, 6,375 %, unbefristet *	157	0,01
9.683	0,37		770 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, unbefristet *	635	0,02
Kanada — 0,16 % (28. Februar 2022: 0,13 %)			7.050 UBS Group AG, 7,000 %, unbefristet *	7.110	0,27
4.430 Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig 15.12.2027	4.189	0,16	11.160 UBS Group AG, 6,875 %, unbefristet *	11.094	0,42
China — 0,46 % (28. Februar 2022: 0,90 %)			40.538	1,54	
11.210 Alibaba Group Holding Ltd, 4,200 %, fällig 06.12.2047	8.996	0,34	Vereinigte Arabische Emirate — 0,34 % (28. Februar 2022: 0,57 %)		
4.660 Alibaba Group Holding Ltd, 3,150 %, fällig 09.02.2051	3.091	0,12	9.560 MDGH GMTN RSC Ltd, 3,950 %, fällig 21.05.2030	8.885	0,34
12.087	0,46		Vereinigtes Königreich — 0,62 % (28. Februar 2022: 0,91 %)		
Kolumbien — 0,24 % (28. Februar 2022: 0,43 %)			588 Barclays Bank Plc, 7,625 %, fällig 21.11.2022	591	0,02
6.630 Ecopetrol SA, 5,375 %, fällig 26.06.2026	6.234	0,24	9.260 Barclays Plc, 7,750 %, unbefristet *	9.073	0,35
Frankreich — 0,83 % (28. Februar 2022: 1,52 %)			2.290 BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig 15.08.2047	1.674	0,07
4.590 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, fällig am 15.01.2028	3.811	0,15	3.280 Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, unbefristet *	3.248	0,12
200 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, fällig am 15.10.2029	158	0,01	900 Reynolds American Inc, 6,150 %, fällig 15.09.2043	833	0,03
400 BNP Paribas SA, 144A, 7,000 %, unbefristet *	380	0,01	700 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	624	0,02
11.610 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, fortwährend *	11.922	0,45	210 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.07.2031	173	0,01
4.830 Credit Agricole SA, 7,500 %, fortwährend *	5.538	0,21	16.216	0,62	
21.809	0,83		USA — 27,73 % (28. Februar 2022: 28,67 %)		
Indien — 0,87 % (28. Februar 2022: 0,60 %)			2.780 Altria Group Inc, 2,450 %, fällig am 04.02.2032	2.103	0,08
500.000 NTPC Ltd, Serie 53, 9,170 %, fällig am 22.09.2024	6.559	0,25	3.270 Altria Group Inc, 5,950 %, fällig am 14.02.2049	2.941	0,11
500.000 Power Finance Corp Ltd, Serie 130C, 8,390 %, fällig am 19.04.2025	6.489	0,25	3.265 Altria Group Inc, 6,200 %, fällig am 14.02.2059	3.126	0,12
250.000 Power Grid Corp of India Ltd, Serie C, 8,200 %, fällig am 23.01.2025	3.227	0,12	557 Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057	524	0,02
500.000 REC Ltd, Serie 133, 8,300 %, fällig am 10.04.2025	6.477	0,25	3.740 Amazon.com Inc, 2,700 %, fällig 03.06.2060	2.513	0,10
22.752	0,87		26.430 Amazon.com Inc, 4,100 %, fällig 13.04.2062	23.852	0,91
			510 Apache Corp, 7,750 %, fällig am 15.12.2029	543	0,02
			560 Apache Corp, 6,000 %, fällig am 15.01.2037	525	0,02
			28.226 Apache Corp, 5,100 %, fällig 01.09.2040	24.024	0,91
			4.550 Apache Corp, 5,250 %, fällig 01.02.2042	3.819	0,15
			140 Apache Corp, 7,375 %, fällig am 15.08.2047	147	0,01
			1.970 Apache Corp, 5,350 %, fällig 01.07.2049	1.619	0,06
			1.933 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig am 15.08.2027	1.401	0,05
			4.500 BAC Capital Trust XIV, Serie G, 4,000 %, unbefristet *	3.417	0,13
			27.730 Bank of America Corp, Serie FF, 5,875 %, unbefristet *	25.165	0,96
			10.595 Bank of America Corp, Serie AA, 6,100 %, unbefristet *	10.503	0,40
			15.210 Bank of America Corp, Serie X, 6,250 %, unbefristet *	15.070	0,57
			1.300 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.11.2025	1.074	0,04

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — (Fortsetzung)					
2.978 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2026	2.803	0,11	1.566 Enterprise Products Operating LLC, 5,950 %, fällig am 01.02.2041	1.636	0,06
2.510 Blue Racer Midstream LLC . Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15.12.2025	2.502	0,10	2.330 Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, fällig 15.02.2045	2.228	0,09
4.450 Boeing Co/The, 3,250 %, fällig am 01.02.2035	3.428	0,13	2.995 Enterprise Products Operating LLC, 4,250 %, fällig 15.02.2048	2.560	0,10
780 Boeing Co/The, 3,550 %, fällig am 01.03.2038	588	0,02	200 EQT Corp, 6,125 %, fällig 01.02.2025	206	0,01
3.870 Boeing Co/The, 5,805 %, fällig am 01.05.2050	3.719	0,14	2.610 EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15.05.2026	2.459	0,09
3.000 Boeing Co/The, 3,950 %, fällig 01.08.2059	2.088	0,08	700 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2029	685	0,03
1.952 Boeing Co/The, 5,930 %, fällig am 01.05.2060	1.868	0,07	730 EQT Corp, 7,000 %, fällig 01.02.2030	782	0,03
128 Broadcom Inc, 144A, 3,187 %, fällig 15.11.2036	95	–	2.120 EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.05.2031	1.875	0,07
130 Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, fällig am 01.02.2032	104	–	90 FirstEnergy Corp, Serie C, 5,350 %, fällig am 15.07.2047	83	–
4.540 California Institute of Technology, 3,650 %, fällig am 01.09.2119	3.285	0,13	360 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	282	0,01
430 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig am 15.01.2035	365	0,01	5.500 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig am 19.08.2032	5.363	0,20
8.200 Carnival Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.03.2027	6.387	0,24	200 Ford Motor Credit Co LLC, 3,375 %, fällig am 13.11.2025	183	0,01
7.320 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig 01.06.2030	6.707	0,26	840 Ford Motor Credit Co LLC, 4,389 %, fällig 08.01.2026	792	0,03
320 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	265	0,01	200 Ford Motor Credit Co LLC, 4,542 %, fällig 01.08.2026	187	0,01
1.320 Centene Corp, 4,250 %, fällig am 15.12.2027	1.255	0,05	200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, fällig 10.08.2026	173	0,01
480 Centene Corp, 4,625 %, fällig am 15.12.2029	453	0,02	4.120 Ford Motor Credit Co LLC, 4,271 %, fällig 09.01.2027	3.770	0,14
2.210 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	2.086	0,08	4.670 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig am 28.05.2027	4.391	0,17
4.830 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	4.242	0,16	200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig am 10.02.2029	162	0,01
910 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.03.2042	630	0,02	760 Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, fällig am 03.05.2029	703	0,03
1.540 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	1.211	0,05	1.120 Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig am 01.08.2030	1.038	0,04
1.780 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 5,125 %, fällig am 30.06.2027	1.779	0,07	2.901 GE Capital International Funding Co Unlimited Co, 4,418 %, fällig am 15.11.2035	2.746	0,10
700 Cheniere Energy Inc, 4,625 %, fällig 15.10.2028	675	0,03	675 Goldman Sachs Capital II, 4,000 %, fortwährend *	532	0,02
1.300 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig am 31.01.2032	1.042	0,04	7.570 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, fällig 01.10.2037	8.404	0,32
6.095 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig am 15.07.2039	7.973	0,30	2.560 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,210 %, fällig 22.04.2042 *	1.965	0,07
34.015 Citigroup Inc, Serie P, 5,950 %, fortwährend *	32.638	1,24	7.180 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	6.850	0,26
4.999 CommonSpirit Health, 4,350 %, fällig am 01.11.2042	4.465	0,17	300 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig am 15.12.2028	254	0,01
1.960 CommonSpirit Health, 3,817 %, fällig am 01.11.2042	1.604	0,06	5.990 Hackensack Meridian Health Inc, 4,211 %, fällig am 01.07.2048	5.587	0,21
330 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 01.09.2029	281	0,01	150 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 20.01.2026	137	0,01
4.300 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig am 15.01.2031	4.121	0,16	610 HCA Inc, 5,375 %, fällig am 01.02.2025	617	0,02
5.810 Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, fällig 01.06.2044	4.567	0,17	2.370 HCA Inc, 7,690 %, fällig 15.05.2025	2.520	0,10
5.110 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	4.708	0,18	380 HCA Inc, 5,625 %, fällig am 01.09.2028	382	0,01
6.150 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2030	4.773	0,18	1.610 HCA Inc, 3,500 %, fällig am 01.09.2030	1.406	0,05
3.390 CSC Funding LLC, 144A, 4,125 %, fällig am 01.12.2030	2.752	0,10	4.401 HCA Inc, 7,500 %, fällig 15.11.2095	4.907	0,19
3.640 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	2.927	0,11	6.290 ILCF E-Capital Trust I, 144A, 4,850 %, fällig am 21.12.2065 *	4.482	0,17
690 CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 144A, 3,875 %, fällig am 30.06.2028	585	0,02	40 JPMorgan Chase & Co, 3,964 %, fällig 15.11.2048 *	34	–
4.342 DCP Midstream LP, Serie A, 7,375 %, fortwährend *	4.331	0,17	70 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, fällig 23.01.2049 *	58	–
2.405 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig am 03.11.2036	2.428	0,09	1.265 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,950 %, fällig 15.01.2038	1.372	0,05
5.990 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, fällig am 15.09.2037	6.366	0,24	1.089 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,500 %, fällig am 01.09.2039	1.126	0,04
2.940 Delta Air Lines Inc, 3,800 %, fällig am 19.04.2023	2.916	0,11	400 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,550 %, fällig am 15.09.2040	416	0,02
3.916 Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig am 28.10.2024	3.677	0,14	210 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,375 %, fällig am 01.03.2041	213	0,01
7.440 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig am 01.05.2025	7.708	0,29	170 Kraft Heinz Foods Co, 6,750 %, fällig am 15.03.2032	189	0,01
4.020 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig am 15.01.2026	4.106	0,16	480 Kraft Heinz Foods Co, 6,875 %, fällig am 26.01.2039	527	0,02
354 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,500 %, fällig am 20.10.2025	347	0,01	120 Kraft Heinz Foods Co, 144A, 7,125 %, fällig am 08.01.2039	134	0,01
6.030 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig am 20.10.2025	5.910	0,23	120 Kraft Heinz Foods Co, 4,625 %, fällig am 10.01.2039	107	–
354 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,750 %, fällig am 20.10.2028	338	0,01	60 Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig am 06.04.2042	56	–
4.920 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig am 20.10.2028	4.703	0,18	1.750 Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, fällig am 06.01.2046	1.489	0,06
5.940 Devon Energy Corp, 8,250 %, fällig 01.08.2023	6.104	0,23	1.930 Kraft Heinz Foods Co, 4,875 %, fällig am 10.01.2049	1.755	0,07
1.986 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	2.052	0,08	6.840 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig am 08.08.2024	6.476	0,25
1.736 Devon Energy Corp, 5,250 %, fällig 15.10.2027	1.762	0,07	610 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig am 25.06.2025	563	0,02
1.670 Devon Energy Corp, 5,875 %, fällig 15.06.2028	1.721	0,07	7.290 Magallanes Inc, 144A, 5,141 %, fällig 15.03.2052	5.847	0,22
1.436 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	1.364	0,05	9.110 Magallanes Inc, 144A, 5,391 %, fällig 15.03.2062	7.330	0,28
1.690 Devon Energy Corp, 7,875 %, fällig 30.09.2031	1.954	0,07	3.140 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 20.06.2027	3.152	0,12
1.440 Devon Energy Corp, 7,950 %, fällig 15.04.2032	1.669	0,06	2.350 MPLX LP, 5,200 %, fällig 01.03.2047	2.146	0,08
3.085 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	2.847	0,11	4.580 MPLX LP, 4,700 %, fällig am 15.04.2048	3.915	0,15
3.720 Dignity Health, 5,267 %, fällig 01.11.2064	3.516	0,13	4.690 MPLX LP, 5,500 %, fällig am 15.02.2049	4.475	0,17
170 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2026	141	0,01	630 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, fällig am 15.10.2027	566	0,02
90 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	69	–	1.710 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig am 15.03.2031	1.285	0,05
1.220 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	725	0,03	2.490 Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125 %, fällig am 01.03.2028	2.395	0,09
1.530 Energy Transfer LP, 6,850 %, fällig 15.02.2040	1.510	0,06	4.040 Occidental Petroleum Corp, 6,950 %, fällig 07.01.2024	4.222	0,16
2.520 Energy Transfer LP, 6,500 %, fällig am 02.01.2042	2.550	0,10	1.940 Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, fällig am 15.03.2026	1.989	0,08
2.135 Energy Transfer LP, 6,100 %, fällig 15.02.2042	2.055	0,08	6.760 Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, fällig 01.09.2030	7.231	0,28
2.922 Energy Transfer LP, 5,400 %, fällig am 10.01.2047	2.609	0,10	20.070 Occidental Petroleum Corp, 6,125 %, fällig 01.01.2031	20.887	0,80
410 Energy Transfer LP, 6,000 %, fällig am 15.06.2048	390	0,02	33.383 Occidental Petroleum Corp, zero coupon, fällig 10.10.2036	17.413	0,66
730 Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig am 15.04.2049	717	0,03	5.320 Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, fällig am 15.03.2040	5.408	0,21
13.680 Energy Transfer LP, Serie H, 6,500 %, fortwährend *	12.664	0,48	11.725 Occidental Petroleum Corp, 4,500 %, fällig 15.07.2044	10.164	0,39
12.990 Energy Transfer LP, Serie B, 6,625 %, fortwährend *	10.534	0,40	17.150 Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, fällig am 15.06.2045	15.204	0,58
12.260 Energy Transfer LP, Serie F, 6,750 %, fortwährend *	11.159	0,43	3.360 Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig am 15.03.2046	3.704	0,14
15.650 Energy Transfer LP, Serie G, 7,125 %, fortwährend *	14.280	0,54	3.000 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig am 15.04.2046	2.607	0,10
2.568 Enterprise Products Operating LLC, 6,125 %, fällig 15.10.2039	2.732	0,10	2.360 Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, fällig am 15.02.2047	1.969	0,08
1 Enterprise Products Operating LLC, 6,450 %, fällig am 01.09.2040	1	–	14.270 Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig am 15.03.2048	12.015	0,46
			890 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig am 01.08.2040	626	0,02
			2.280 Plains All American Pipeline LP, Serie B, 6,125 %, unbesfristet *	1.943	0,07
			2.180 Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700 %, fällig am 15.05.2036	2.192	0,08
			2.325 PulteGroup Inc, 6,375 %, fällig 15.05.2033	2.368	0,09
			1.809 Range Resources Corp, 5,000 %, fällig am 15.03.2023	1.809	0,07
			4.800 Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15.01.2029	5.045	0,19
			6.910 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2040	5.767	0,22

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — (Fortsetzung)					
1.820 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 31.08.2026	1.457	0,06	China — 1,32 % (28. Februar 2022: 3,48 %)		
5.650 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,375 %, fällig am 15.07.2027	4.382	0,17	CNY 54.500 China Government Bond, 3,380 %, fällig 21.11.2024	8.081	0,31
670 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	598	0,02	CNY 121.000 China Government Bond, 3,480 %, fällig 29.06.2027	18.210	0,69
2.262 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	2.300	0,09	CNY 11.000 China Government Bond, 3,600 %, fällig 27.06.2028	1.676	0,07
2.890 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	3.493	0,13	CNY 43.610 China Government Bond, Serie INBK, 3,390 %, fällig 16.03.2050	6.573	0,25
210 Sprint Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2023	217	0,01		34.540	1,32
3.810 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, fällig am 01.03.2030	3.727	0,14	Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) — 0,80 % (28. Februar 2022: 0,59 %)		
1.970 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig am 01.02.2031	1.829	0,07	EUR 4.020 Ivory Coast Government International Bond, 144A, 4,875 %, fällig 30.01.2032	3.070	0,12
280 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig am 15.01.2032	246	0,01	EUR 4.010 Ivory Coast Government International Bond, 4,875 %, fällig 30.01.2032	3.063	0,12
11.910 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, due 22.08.2050 t ^{oo}	8.884	0,34	928 Ivory Coast Government International Bond, 5,750 %, fällig 31.12.2032	836	0,03
1.300 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig am 01.07.2038	1.338	0,05	4.164 Ivory Coast Government International Bond, 6,125 %, fällig 15.06.2033	3.532	0,13
120 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.02.2026	110	–	12.540 Ivory Coast Government International Bond, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2033	10.637	0,40
2.100 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	1.814	0,07		21.138	0,80
90 T-Mobile USA Inc, 3,375 %, fällig 15.04.2029	81	–	Dominikanische Republik — 0,27 % (28. Februar 2022: 0,20 %)		
1.550 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	1.312	0,05	9.920 Dominican Republic International Bond, 144A, 5,875 %, fällig 30.01.2060	7.060	0,27
200 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	177	0,01	Ägypten — 0,21 % (28. Februar 2022: 0,34 %)		
5.160 Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, Nullkupon, fällig am 15.02.2024	4.728	0,18	EGP 22.000 Egypt Government Bond, Serie 7YR, 18,400 %, fällig 30.05.2024	1.156	0,05
2.100 Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, Nullkupon, fällig am 15.02.2038	660	0,03	5.020 Egypt Government International Bond, 5,250 %, fällig 06.10.2025	4.296	0,16
9.590 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	8.757	0,33		5.452	0,21
3.730 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	3.278	0,12	Ghana — 0,16 % (28. Februar 2022: 0,16 %)		
340 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig am 15.02.2031	294	0,01	2.180 Ghana Government International Bond, 144A, 7,875 %, fällig 26.03.2027	974	0,04
980 Wells Fargo & Co, 4,650 %, fällig am 04.11.2044	885	0,03	2.170 Ghana Government International Bond, 144A, 10,750 %, fällig 14.10.2030	1.574	0,06
3.926 Wells Fargo & Co, Serie U, 5,875 %, unbefristet *	3.916	0,15	4.700 Ghana Government International Bond, 144A, 8,950 %, fällig 26.03.2051	1.683	0,06
3.490 Wesleyan University, 4,781 %, fällig am 01.07.2116	3.105	0,12		4.231	0,16
1.460 Western Midstream Operating LP, 3,350 %, fällig am 01.02.2025	1.380	0,05	Indien — 5,10 % (28. Februar 2022: 3,57 %)		
4.630 Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig am 01.06.2025	4.430	0,17	INR 1.580.000 India Government Bond, Serie SPB, 8,130 %, fällig 21.09.2022	19.908	0,76
765 Western Midstream Operating LP, 4,650 %, fällig 01.07.2026	729	0,03	INR 500.000 India Government Bond, 7,160 %, fällig 20.05.2023	6.332	0,24
5.100 Western Midstream Operating LP, 4,500 %, fällig am 01.03.2028	4.742	0,18	INR 1.200.000 India Government Bond, 8,830 %, fällig 25.11.2023	15.521	0,59
5.274 Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig 01.04.2044	4.627	0,18	INR 900.000 India Government Bond, 6,180 %, fällig 04.11.2024	11.239	0,43
3.370 Western Midstream Operating LP, 5,300 %, fällig am 01.03.2048	2.969	0,11	INR 1.000.000 India Government Bond, 5,630 %, fällig 12.04.2026	12.119	0,46
7.200 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig am 15.08.2048	6.288	0,24	INR 1.480.000 India Government Bond, 8,150 %, fällig 24.11.2026	19.395	0,74
1.330 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig am 01.02.2050	1.153	0,04	INR 300.000 India Government Bond, 7,170 %, fällig 08.01.2028	3.803	0,14
130 Williams Cos Inc/The, 3,750 %, fällig 15.06.2027	126	–	INR 1.300.000 India Government Bond, 7,590 %, fällig 20.03.2029	16.757	0,64
7.350 Williams Cos Inc/The, Serie A, 7,500 %, fällig am 15.01.2031	8.342	0,32	INR 1.500.000 India Government Bond, 5,790 %, fällig 11.05.2030	17.389	0,66
7.030 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15.03.2032	8.698	0,33	INR 1.000.000 India Government Bond, 6,190 %, fällig 16.09.2034	11.479	0,44
3.600 Williams Cos Inc/The, 6,300 %, fällig 15.04.2040	3.844	0,15		133.942	5,10
4.780 Williams Cos Inc/The, 5,750 %, fällig am 24.06.2044	4.835	0,18	Indonesien — 6,03 % (28. Februar 2022: 8,89 %)		
665 Williams Cos Inc/The, 5,100 %, fällig 15.09.2045	620	0,02	IDR 18.941.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR56, 8,375 %, fällig 15.09.2026	1.360	0,05
3.070 Willis-Knighton Medical Center, Serie 2018, 4,813 %, fällig am 01.09.2048	2.988	0,11	IDR 594.673.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR78, 8,250 %, fällig 15.05.2029	42.840	1,63
7.313 XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig 01.05.2034	7.074	0,27	IDR 500.248.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR87, 6,500 %, fällig 15.02.2031	32.591	1,24
98 XPO Logistics Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.05.2025	99	–	IDR 473.554.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR68, 8,375 %, fällig 15.03.2034	34.777	1,32
	728.360	27,73	IDR 276.928.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR72, 8,250 %, fällig 15.05.2036	20.160	0,77
Sambia — 0,01 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			IDR 39.561.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR79, 8,375 %, fällig 15.04.2039	2.944	0,11
220 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 15.10.2027	210	0,01	IDR 75.986.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR92, 7,125 %, fällig 15.06.2042	5.142	0,20
			IDR 274.060.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR76, 7,375 %, fällig 15.05.2048	18.629	0,71
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 1.136.630\$)	1.033.502	39,35		158.443	6,03
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 34,71 % (28. Februar 2022: 35,29 %)					
Angola — 0,12 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
2.400 Angolan Government International Bond, 8,250 %, fällig 09.05.2028	2.092	0,08	Kenia — 0,16 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
1.450 Angolan Government International Bond, 144A, 8,750 %, fällig 14.04.2032	1.192	0,04	5.370 Republic of Kenya Government International Bond, 7,250 %, fällig 28.02.2028	4.169	0,16
	3.284	0,12	Mexiko — 4,16 % (28. Februar 2022: 9,05 %)		
Australien — 0,48 % (28. Februar 2022: 1,75 %)			MXN 1.684.964 Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	73.880	2,81
AUD 11.710 Australia Government Bond, Serie 150, 3,000 %, fällig 21.03.2047	6.919	0,27	MXN 792.330 Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	35.429	1,35
AUD 12.750 Australia Government Bond, Serie 162, 1,750 %, fällig 21.06.2051	5.592	0,21		109.309	4,16
	12.511	0,48	Nigeria — 0,10 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Brasilien — 2,32 % (28. Februar 2022: 2,74 %)			3.640 Nigeria Government International Bond, 6,125 %, fällig 28.09.2028	2.645	0,10
BRL 41.530 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, fällig am 01.01.2027	7.483	0,29	Polen — 2,47 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
BRL 96.647 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, fällig am 01.01.2031	16.625	0,63	PLN 442.750 Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	64.830	2,47
4.630 Brazilian Government International Bond, 4,250 %, fällig 07.01.2025	4.592	0,17	Russien — 7,19 % (28. Februar 2022: 4,39 %)		
41.800 Brazilian Government International Bond, 5,000 %, fällig 27.01.2045	32.311	1,23	RUB 1.043.860 Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 16.09.2026 t _y	5.485	0,21
	61.011	2,32	RUB 1.043.840 Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig 07.10.2026 t _y	5.484	0,21
			RUB 4.555.801 Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig 03.02.2027 t _y	23.937	0,91
			RUB 443.320 Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig 06.10.2027 t _y	2.329	0,09
			RUB 11.647.347 Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 19.01.2028 t _y	61.196	2,33
			RUB 8.416.700 Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 23.05.2029 t _y	44.222	1,68
			RUB 287.190 Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig 10.04.2030 t _y	1.509	0,06

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
Russia — (Fortsetzung)					
RUB 5.294.380 Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig 10.05.2034 tr	27.817	1,06			
RUB 3.194.750 Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 16.03.2039 tr	16.786	0,64			
	188.765	7,19			
USA — 3,82 % (28. Februar 2022: 0,08 %)					
1.820 Morongo Band of Mission Indians/The, 144A, 7.000 %, fällig am 01.10.2039	2.042	0,08			
13.870 United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, fällig 31/07/2029	13.299	0,51			
42.090 United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 31/08/2029	41.682	1,59			
500 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig am 15.08.2049	401	0,01			
2.570 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/11/2051	1.872	0,07			
18.446 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/02/2052	14.740	0,56			
27.720 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/08/2052	26.286	1,00			
	100.322	3,82			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 1.345.1065)	911.652	34,71			
Schuldscheindarlehen — 2,45 % (28. Februar 2022: 1,85 %)					
5.401 1011778 BC ULC, 4,122 %, fällig 14.11.2026 *	5.258	0,20			
1.435 Alterra Mountain Co, 5,872 %, fällig am 30.07.2028 *	1.401	0,05			
234 Aramark Services Inc, 4,122 %, fällig am 11.03.2025 *	232	0,01			
2.766 Asurion LLC, 5,372 %, fällig 03.11.2024 *	2.669	0,10			
748 Berry Global Inc, 4,178 %, fällig am 01.07.2026 *	733	0,03			
6.231 Caesars Resort Collection LLC, 5,122 %, fällig am 22.12.2024 *	6.164	0,24			
4.585 Change Healthcare Holdings LLC, 4,872 %, fällig 01.03.2024 *	4.565	0,17			
6.097 Charter Communications Operating LLC, 4,130 %, fällig am 30.04.2025 *	6.036	0,23			
1.433 Edelman Financial Center LLC/The, 5,872 %, fällig am 05.04.2028 *	1.378	0,05			
2.163 Hilton Worldwide Finance LLC, 4,194 %, fällig am 21.06.2026 *	2.120	0,08			
5.650 Hunter Douglas Inc, 6,340 %, fällig am 02.09.2029 *	4.962	0,19			
1.616 Jane Street Group, LLC, 5,122 %, fällig 21.01.2027 *	1.587	0,06			
3.260 Level 3 Parent LLC, 4,122 %, fällig am 01.03.2027 *	3.121	0,12			
1.329 Phoenix Guarantor Inc, 5,622 %, fällig am 05.03.2026 *	1.289	0,05			
5.743 Prime Security Installations Ltd, 5,107 %, fällig am 23.09.2026 *	5.625	0,22			
2.514 RegionalCare Hospital Partners Holding, 6,274 %, fällig 16.11.2025 *	2.442	0,09			
1.357 Reynolds Consumer Products LLC, 4,122 %, fällig am 04.02.2027 *	1.333	0,05			
4.287 SFR Group SA, 6,199 %, fällig 06.01.2026 *	4.163	0,16			
7.790 Univision Communications Inc, 5,622 %, fällig 24.03.2026 *	7.628	0,29			
1.550 Virgin Media Bristol LLC, 4,891 %, fällig am 04.01.2028 *	1.519	0,06			
Summe Schuldverschreibungen (Kosten 66.254 USD)	64.225	2,45			
Kommunale Anleihen — 0,51 % (28. Februar 2022: 0,55 %)					
4.240 Stadt Detroit MI, 4,000 %, fällig am 01.04.2044	3.367	0,13			
950 Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 3,706 %, fällig am 15.05.2120	665	0,02			
9.530 State of Illinois, 5,100 %, fällig am 01.06.2033	9.495	0,36			
Kommunale Anleihen insgesamt (Kosten 13.895 USD)	13.527	0,51			
Organismen für gemeinsame Anlagen — 3,50 % (28. Februar 2022: 3,96 %)					
5.690 Franklin Templeton China Funds — Western Asset China Bond Fund — Klasse LM	81.373	3,10			
EUR 101 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc — Western Asset European Loan — LM Klasse Euro Accumulating	10.430	0,40			
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 92.6205)	91.803	3,50			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 2.809.2525)					
	2.259.213	86,02			
Kontrakte (in Tsd.)					
	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert			
Gekaufte Optionen — 0,83 % (28. Februar 2022: 0,67 %)					
EUR — Euro-Bund October 2022 Call 146,00, fällig 23.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	336	0,01			
EUR — Euro-Bund October 2022 Call 147,00, fällig 23.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	491	0,02			
12 IMM Euro\$ December 2023 Call 97,1250, fällig 18.12.2023 — Bank of America Merrill Lynch	9.474	0,36			
— Japanese Yen Currency Future September 2022 Call 75,00, fällig 09.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	3	—			
— Japanese Yen Currency Future September 2022 Call 75,50, fällig 09.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	1	—			
1 U.S. 10 Year October 2022 Call 117,00, fällig 23.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	902	0,03			
1 U.S. 10 Year October 2022 Call 118,00, fällig 23.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	507	0,02			
— U.S. 10 Year October 2022 Put 117,00, fällig 23.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	406	0,02			
— U.S. 10 Year October 2022 Put 117,50, fällig 23.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	514	0,02			
— U.S. 10 Year October 2022 Put 118,00, fällig 23.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	647	0,03			
1 U.S. 10 Year October 2022 Put 120,50, fällig 23.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	2.214	0,08			
1 US 10 Year W1 September 2022 Call 117,00, fällig am 02.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	238	0,01			
Gekaufte Optionen insgesamt (Kosten 34.5795)					
	21.873	0,83			
Credit Default Swaps — 0,14 % (28. Februar 2022: 0,27 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	3.664	0,14			
Index-Swaps — 5,82 % (28. Februar 2022: 1,41 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	152.881	5,82			
Inflationsswaps — 0,21 % (28. Februar 2022: 0,12 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	5.383	0,21			
Zinsswaps — 5,26 % (28. Februar 2022: 3,64 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	138.103	5,26			
Swaptions — 0,01 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	399	0,01			
Devisenterminkontrakte — 1,12 % (28. Februar 2022: 2,68 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	29.492	1,12			
Futures — (0,73 %) (28. Februar 2022: 5,11 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	19.036	0,73			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
	2.630.044	100,14			
Geschriebene Optionen — (1,90 %) (28. Februar 2022: (3,05 %))					
(1) Australian Dollar Currency Future October 2022 Call 70,00, fällig 07.10.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(306)	(0,01)			
— Australian Dollar Currency Future October 2022 Call 71,00, fällig 07.10.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(53)	—			
— Australian Dollar Currency Future September 2022 Call 69,50, fällig 09.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(39)	—			
— Australian Dollar Currency Future September 2022 Call 70,00, fällig 09.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(21)	—			
— Australian Dollar Currency Future September 2022 Call 70,50, fällig 09.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(10)	—			
(1) Australian Dollar Currency Future September 2022 Call 71,00, fällig 09.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(16)	—			
— British Pound Currency Future September 2022 Call 119,00, fällig 09.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(13)	—			
— Canadian Dollar Currency Future September 2022 Call 78,00, fällig 09.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(1)	—			
— Canadian Dollar Currency Future September 2022 Put 78,00, fällig 09.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(375)	(0,01)			
(1) Euro Currency Future December 2022 Put 98,50, fällig 19.12.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(1.181)	(0,05)			
— Euro Currency Future September 2022 Call 1,0250, fällig 09.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(15)	—			
— Euro Currency Future September 2022 Put 1,02, fällig 09.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(841)	(0,03)			
(4) Euro-Bobl December 2022 Call 96,50, fällig 16.12.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(2.358)	(0,09)			
(4) Euro-Bobl December 2022 Call 96,75, fällig 16.12.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(1.521)	(0,06)			
(1) Euro-Bobl December 2022 Call 97,1250, fällig 16.12.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(268)	(0,01)			
EUR (1) Euro-Bund October 2022 Call 147,50, fällig 23.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(1.249)	(0,05)			
EUR (1) Euro-Bund October 2022 Call 148,00, fällig 23.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(526)	(0,02)			
EUR (2) Euro-Bund October 2022 Call 149,00, fällig 23.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(1.105)	(0,04)			
EUR (2) Euro-Bund October 2022 Call 150,00, fällig 23.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(796)	(0,03)			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit — Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA. HY, 5,000 % — Buy	20.06.2027	37.943	\$ 476
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % — Verkaufen	20.06.2027	955.930	3.188
Bank of America Merrill Lynch	Teva Pharmaceutical Industries Ltd, 1,000 % — Sell	20.06.2026	12.479	(1.135)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 11.462\$)				\$ 3.664
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (16.749))\$				(1.135)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (5.287))\$				\$ 2.529

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,820 %	06.04.2024	877.586	\$ (25.702)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 1,410 %	03.01.2025	2.786.615	(51.358)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 1,515 %	21.06.2025	932.347	(14.945)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 11,993 %	01.04.2027	586.759	987
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIE Banxico, Receive Fixed 8,930 %	21.04.2027	2.000.748	266
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,350 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2028	153.005	14.999
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,689 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	24.06.2030	11.636	2.041
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,680 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	07.08.2030	678.310	119.810
JP Morgan	Pay Floating RUB 3M MosPrime Reuters, Receive Fixed 8,985 %	27.10.2024	4.000.000	(1.467)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 152.352\$)				\$ 138.103
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (204.363))\$				(93.472)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (52.011))\$				\$ 44.631

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,560 %, Receive Floating USD Sofr Compound	20.07.2045	21.760	\$ 8.287
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 0,710 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15.05.2027	490.643	51.189
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,130 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15.08.2028	363.289	37.216
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,220 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15.08.2028	213.642	20.845
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD Sofr Compound	20.11.2026	142.530	5.547
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15.02.2047	26.146	5.901
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,650 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15.08.2047	32.688	6.666
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,733 %, Receive Floating USD Sofr Compound	20.10.2031	93.640	3.866
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,000 %, Receive Floating USD Sofr Compound	18.03.2032	35.169	2.749
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,500 %, Receive Floating USD Sofr Compound	21.04.2052	111.770	4.519
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,510 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15.02.2048	53.054	2.663
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,600 %, Receive Floating USD SOFR OIS Compound	15.02.2048	73.959	2.390
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,620 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15.02.2048	34.210	1.043
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 1,396 %	13.10.2025	582.851	(7.998)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 1,550 %	03.04.2027	80.406	(5.296)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR OIS Compound, Receive Fixed 3,500 %	30.09.2024	322.878	(480)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 58.980\$)				\$ 152.881
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.721))\$				(13.774)
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 57.259\$)				\$ 139.107

Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	USD — VPI Städtische Verbraucher	18.11.2023	96.120	\$ 3.343
Bank of America Merrill Lynch	USD — VPI Städtische Verbraucher	05.12.2026	85.490	(7.701)
Bank of America Merrill Lynch	GBP — RPI Alle Artikel NSA	15.10.2026	51.400	(7.182)
Bank of America Merrill Lynch	USD — VPI Städtische Verbraucher	20.10.2026	26.050	1.508
Bank of America Merrill Lynch	USD — VPI Städtische Verbraucher	18.11.2026	96.120	(3.488)
Bank of America Merrill Lynch	USD — SOFR Compound	15.02.2029	61.775	532
Bank of America Merrill Lynch	USD — VPI Städtische Verbraucher	20.10.2031	26.050	(1.468)
Bank of America Merrill Lynch	USD — VPI Städtische Verbraucher	10.07.2051	13.940	(843)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 4.912\$)				\$ 5.383
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (16.551))\$				(20.682)
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (11.639))\$				\$ (15.299)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Wirksamkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Swaption Receiver Strike 1,01 %	22.09.2022	21.325	\$ 41
Goldman Sachs	Swaption Receiver Strike 1,01 %	17.11.2022	42.639	358
Nicht realisierte Wertminderung von Swaptions (28. Februar 2021 (in Tsd.): 7\$)				\$ 399
Nicht realisierte Wertsteigerung von Swaptions (28. Februar 2021 (in Tsd.): (528))\$				–
Nettowertsteigerung von Swaptions (28. Februar 2021 (in Tsd.): (521))\$				\$ 399

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	GBP	2	\$ –
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	4	Verkauf	USD	5	–
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	79.496	Verkauf	BRL	403.515	1.932
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–	–
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	385.684	Verkauf	USD	71.421	2.715
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	17.831	Verkauf	USD	3.465	(37)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	5.238	Verkauf	AUD	7.512	100
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2.661	Verkauf	CHF	2.563	33
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	45	Verkauf	CNH	310	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	15.655	Verkauf	EUR	15.718	(160)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	3.200	Verkauf	EUR	3.119	63
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	4.365	Verkauf	GBP	3.663	107
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.146	Verkauf	JPY	156.418	17
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	249	Verkauf	NOK	2.427	2
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	15	Verkauf	PLN	71	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	58	Verkauf	SEK	603	1
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	39	Verkauf	SEK	419	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	448	Verkauf	SGD	618	6
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	598	Verkauf	SGD	836	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CHF	36.118	Verkauf	USD	37.924	(929)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	15.741	Verkauf	USD	15.818	18
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	934.386	Verkauf	USD	955.019	(15.053)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	30.461	Verkauf	USD	4.508	(97)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	89.876	Verkauf	USD	108.610	(4.170)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	66	Verkauf	USD	5	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NOK	74.245	Verkauf	USD	7.634	(160)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	4.697	Verkauf	USD	1.016	(20)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	62.306	Verkauf	USD	45.204	(616)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	25.314	Verkauf	USD	2.498	(122)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	7.698.482	Verkauf	USD	57.292	(1.809)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	84.231	Verkauf	USD	58.830	(1.177)
26.09.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	7.502	Verkauf	JPY	899.343	1.015
10.04.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	371.027	Verkauf	USD	72.677	(1.970)
10.07.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	4.826	Verkauf	JPY	651.157	125
10.11.2022	Citi	Kauf	USD	1.368	Verkauf	JPY	184.444	36
10.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.563	Verkauf	JPY	210.798	41
10.11.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	5.206	Verkauf	CAD	6.645	148
10.12.2022	Citi	Kauf	USD	12.608	Verkauf	CAD	16.089	361
17.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	7.800	Verkauf	CAD	9.985	200
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	USD	13.136	Verkauf	EUR	12.918	111
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	USD	253.814	Verkauf	JPY	34.336.795	5.641
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	JPY	6.150.747	Verkauf	USD	45.746	(1.291)
18.10.2022	Citi	Kauf	USD	14.365	Verkauf	AUD	20.968	8
18.10.2022	Citi	Kauf	USD	277.519	Verkauf	CNH	1.865.233	7.327
18.10.2022	Citi	Kauf	USD	89.770	Verkauf	EUR	87.499	1.549
18.10.2022	Citi	Kauf	USD	16.382	Verkauf	EUR	16.250	(3)
18.10.2022	Citi	Kauf	USD	6.493	Verkauf	GBP	5.500	97
18.10.2022	Citi	Kauf	USD	147.989	Verkauf	IDR	2.233.657.422	(2.118)
18.10.2022	Citi	Kauf	USD	2.252	Verkauf	JPY	305.000	49
18.10.2022	Citi	Kauf	EUR	21.500	Verkauf	USD	22.315	(637)
18.10.2022	Citi	Kauf	CNH	26.521	Verkauf	USD	3.945	(103)
18.10.2022	Citi	Kauf	CAD	86.116	Verkauf	USD	66.626	(1.075)
18.10.2022	Citi	Kauf	AUD	8.805	Verkauf	USD	6.102	(73)
18.10.2022	Citi	Kauf	AUD	5.000	Verkauf	USD	3.362	62
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	4.204	Verkauf	BRL	23.326	(225)
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	25.413	Verkauf	COP	112.299.540	264
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	173	Verkauf	GBP	143	6
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	BRL	64.359	Verkauf	USD	12.537	(315)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	MXN	78.589	Verkauf	USD	3.722	143
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	GBP	1.351	Verkauf	USD	1.654	(83)
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	JPY	831.878	Verkauf	USD	6.105	(92)
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	BRL	304.003	Verkauf	USD	54.371	3.360
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	COP	1.591.481	Verkauf	USD	342	14
18.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD	83.085	Verkauf	CNH	556.498	2.471
18.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD	166.832	Verkauf	INR	13.313.200	118
18.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD	30.443	Verkauf	TWD	902.772	713
18.10.2022	JP Morgan	Kauf	CNH	252.656	Verkauf	USD	37.525	(926)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.134	Verkauf	CAD	1.475	11
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.072	Verkauf	CNH	7.244	22
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	572	Verkauf	IDR	8.649.630	(9)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	161.030	Verkauf	MXN	3.371.134	\$ (4.722)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	89	Verkauf	NOK	916	(3)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.580	Verkauf	PLN	7.727	(50)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	MXN	724.856	Verkauf	USD	35.111	529
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	CAD	7.816	Verkauf	USD	6.075	(126)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	COP	58.275.610	Verkauf	USD	13.167	(116)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	COP	6.978.500	Verkauf	USD	1.556	7
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	NOK	37.706	Verkauf	USD	3.740	58
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	PLN	1.229	Verkauf	USD	261	(1)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	ZAR	676.425	Verkauf	USD	40.997	(1.684)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	TWD	902.772	Verkauf	USD	30.329	(598)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	AUD	9.970	Verkauf	USD	6.938	(111)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	385	Verkauf	ZAR	6.446	10
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	307	Verkauf	MXN	6.237	2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 112.006\$)							\$	29.492
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (98.156)\$)								(40.681)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 13.850\$)							\$	(11.189)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	588	\$ 141.377	\$ (574)
90 Day Euro\$ Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	20.743	4.974.949	(21.231)
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	7.838	1.886.313	(29.345)
90 Day Euro\$ Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	1.594	382.181	(13.320)
90 Day Euro\$ September 2023	Bank of America Merrill Lynch	4.464	1.072.197	(33.306)
Australischer Dollar Währung September 2022	Bank of America Merrill Lynch	2.694	184.472	(3.888)
Britisches Pfund Währung September 2022	Bank of America Merrill Lynch	880	63.899	(3.384)
Kanadischer Dollar Währung September 2022	Bank of America Merrill Lynch	215	16.381	(255)
Euribor 3 Monate Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	1.016	250.561	(1.130)
Euro-FX Währung September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(1.220)	(153.354)	5.520
Euro-Bund Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(191)	(27.941)	89
Euro-Bund September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(22)	(3.271)	199
Fed Fund 30 Tage August 2022	Bank of America Merrill Lynch	(4.877)	(1.984.844)	(9)
ICE 3 Monate SONIA Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	26	7.272	(3)
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(389)	(418.695)	445
Japanische Yen-Währung September 2022	Bank of America Merrill Lynch	3.353	302.524	(12.240)
Long Gilt Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	965	120.994	(2.445)
Mexikanischer Peso Währung September 2022	Bank of America Merrill Lynch	5.347	132.231	1.330
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	18.172	2.124.420	(15.744)
U.S. 10 Year Note (CBT) September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(152)	(17.765)	19
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(10.540)	(1.319.476)	9.395
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(17.494)	(1.938.691)	2.039
U.S. 5 Year Note (CBT) September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(1.928)	(213.586)	(13)
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	5.955	808.950	(6.858)
U.S. Long Bond (CBT) September 2022	Bank of America Merrill Lynch	406	55.381	(74)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	5.153	770.373	(2.452)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 213.705\$)				\$ 19.036
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (237.864)\$)				(146.271)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (24.159)\$)				\$ (127.235)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinven- tarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 14,05 % (28. Februar 2022: 9,77 %)					
72 ABFC 2003-OPT1 Trust, Serie 2003 OPT1, Klasse A3, 3,124 %, fällig 25.04.2033 *	68	0,03	944 National Collegiate Student Loan Trust 2007-2, Serie 2007 2, Klasse A4, 2,734 %, fällig 25.01.2033 *	870	0,35
1.274 ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Serie 2005-HE3, Serie 2005 HE3, Klasse M4, 3,389 %, fällig 25.05.2035 *	1.225	0,49	1.302 National Collegiate V Commutation Trust, Serie 2007 33A6, Klasse 10, 1,44A, 0,000 %, fällig 25.03.2038 *	376	0,15
700 Aegis Asset Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Cfts Ser 2005-4, Serie 2005 4, Klasse M2, 3,149 %, fällig am 25.10.2035 *	673	0,27	2.295 National Collegiate VI 2007-4 Klasse A-3L Commutation Trust, Serie 2007 4VI, Klasse O, 1,44A, 3,294 %, fällig am 29.03.2038 **	484	0,19
950 AGL CLO 12 Ltd, Serie 2021 12A, Klasse D, 1,44A, 5,560 %, fällig 20.07.2034 *	885	0,36	1.000 Ocean Trails CLO V, Serie 2014 5A, Klasse DRR, 1,44A, 5,905 %, fällig am 13.10.2031 *	907	0,37
1.000 Allegro CLO XIII Ltd, Serie 2021 1A, KlasseE, 1,44A, 9,320 %, fällig 20.07.2034 *	915	0,37	650 OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, Serie 2018 1A, Klasse C, 1,44A, 5,310 %, fällig am 20.01.2031 *	588	0,24
400 Ammc Clo 20 Ltd, Serie 2017 20A, Klasse E, 1,44A, 8,550 %, fällig am 17.04.2029 *	370	0,15	940 Option One Mortgage Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse M4, 3,374 %, fällig 25.08.2035 *	818	0,33
450 Anchorage Capital CLO 3-R Ltd, Serie 2014 3RA, Klasse E, 1,44A, 8,293 %, fällig 28.01.2031 *	397	0,16	281 Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Klasse 1A1, 5,866 %, fällig am 25.01.2037	243	0,10
700 Apex Credit CLO 2019-II Ltd, Serie 2019 2A, Klasse D, 1,44A, 6,833 %, fällig am 25.10.2032 *	682	0,27	567 Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Klasse 2A1, 5,866 %, fällig am 25.01.2037	499	0,20
750 Apidos CLO XII, Serie 2013 12A, Klasse ER, 1,44A, 7,912 %, fällig 15.04.2031 *	650	0,26	761 RAMP Serie 2006-NC3 Trust, Serie 2006 NC3, Klasse M1, 2,954 %, fällig 25.03.2036 *	740	0,30
480 Bain Capital Credit CLO 2022-2 Ltd, Serie 2022 2A, Klasse D1, 1,44A, 4,984 %, fällig 22.04.2035 *	450	0,18	97 RBSSP Resecuritization Trust 2010-4, Serie 2010 4, Klasse 6A2, 1,44A, 5,825 %, fällig 26.02.2036	94	0,04
300 Ballyrock CLO 16 Ltd, Serie 2021 16A, Klasse D, 1,44A, 8,960 %, fällig am 20.07.2034 *	273	0,11	1.320 Saranac CLO III Ltd, Serie 2014 3A, Klasse DR, 1,44A, 5,373 %, fällig am 22.06.2030 *	1.223	0,49
1.380 Ballyrock CLO 19 Ltd, Serie 2022 19A, Klasse D, 1,44A, 8,282 %, fällig am 20.04.2035 *	1.229	0,49	320 SMB Private Education Loan Trust 2015-C, Serie 2015 C, Klasse C, 1,44A, 4,500 %, fällig 17.09.2046	303	0,12
1.225 Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Serie 2018 1A, Klasse C, 1,44A, 5,860 %, fällig am 20.04.2031 *	1.129	0,46	500 Venture XVII CLO Ltd, Serie 2014 17A, Klasse ERR, 1,44A, 8,252 %, fällig 15.04.2027 *	407	0,16
720 Barings CLO Ltd 2016-II, Serie 2016 2A, Klasse ER2, 1,44A, 9,210 %, fällig 20.01.2032 *	665	0,27	750 Voya CLO 2016-3 Ltd, Serie 2016 3A, Klasse A1R, 1,44A, 3,930 %, fällig am 18.10.2031 *	742	0,30
575 Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Serie 2016 1A, Klasse AA, 1,44A, 2,487 %, fällig 16.12.2041	537	0,22	1.000 Voya CLO 2017-1 Ltd, Serie 2017 1A, Klasse C, 1,44A, 6,070 %, fällig 17.04.2030 *	941	0,38
1.000 BlueMountain CLO XXII Ltd, Serie 2018 22A, Klasse A1, 1,44A, 3,592 %, fällig am 15.07.2031 *	983	0,40	200 VOYA CLO 2017-2, Serie 2017 2A, Klasse D, 1,44A, 8,532 %, fällig 07.06.2030 *	177	0,07
281 CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2004-B, Serie 2004 B, Klasse 2A, 2,611 %, fällig 15.02.2029 *	266	0,11	671 WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Serie 2007-HE4 Trust, Serie 2007 HE4, Klasse 1A, 2,614 %, fällig 25.07.2047 *	513	0,21
22 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2005-D, Serie 2005 D, Klasse 2A, 2,581 %, fällig 15.11.2035 *	21	0,01	600 Wellfleet CLO 2017-3 Ltd, Serie 2017 3A, Klasse C, 1,44A, 5,490 %, fällig 17.01.2031 *	544	0,22
716 Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Serie 2018 2, Klasse B, 1,44A, 4,250 %, fällig 20.12.2038	672	0,27	Gesamt Asset-Backed Securities (Kosten 36,962 USD)	34.846	14,05
570 Educational Funding Co LLC/The, Serie 2006 1A, Klasse A3, 1,44A, 3,133 %, fällig am 25.04.2033 *	426	0,17	Forderungsbesicherte Wertpapiere — 13,27 % (28. Februar 2022: 10,09 %)		
660 Encore Credit Receivables Trust 2005-2, Serie 2005 2, Klasse M4, 3,374 %, fällig am 25.11.2035 *	634	0,26	299 Alternative Loan Trust 2007-4CB, Serie 2007 4CB, Klasse 1A5, 5,750 %, fällig 25.04.2037	265	0,11
86 First Franklin Mortgage Loan Trust 2003-FF4, Serie 2003 FF4, Klasse M1, 4,173 %, fällig am 25.10.2033 *	82	0,03	217 BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Serie 2016 GG10, Klasse AJA, 1,44A, 6,035 %, fällig am 10.08.2045 *	65	0,03
1.000 Golub Capital Partners CLO 21M Ltd, Serie 2014 21A, Klasse CR, 1,44A, 5,233 %, fällig 25.01.2031 *	947	0,38	593 Banc of America Funding Corp, Serie 2015 R3, Klasse 1A2, 1,44A, 2,639 %, fällig 27.03.2036 *	527	0,21
1.000 Golub Capital Partners CLO 53B Ltd, Serie 2021 53A, Klasse E, 1,44A, 9,410 %, fällig am 20.07.2034 *	926	0,37	140 BBCCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Klasse D, 1,44A, 4,715 %, fällig 10.08.2033 *	131	0,05
147 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Serie 2021 4GS, Klasse A, 1,44A, 1,930 %, fällig am 20.07.2048	123	0,05	840 BBSG 2016-MRP Mortgage Trust, Serie 2016 MRP, Klasse A, 1,44A, 3,275 %, fällig 05.06.2036	764	0,31
250 Greenwood Park CLO Ltd, Serie 2018 1A, Klasse E, 1,44A, 7,462 %, fällig am 15.04.2031 *	219	0,09	510 BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Klasse C, 1,44A, 4,291 %, fällig 15.07.2035 *	489	0,20
1.000 Grippen Park CLO Ltd, Serie 2017 1A, Klasse D, 1,44A, 6,010 %, fällig 20.01.2030 *	972	0,39	520 BX Trust 2021-VIEW, Serie 2021 VIEW, Klasse C, 1,44A, 4,741 %, fällig 15.06.2036 *	500	0,20
1.400 Harriman Park CLO Ltd, Serie 2020 1A, Klasse ER, 1,44A, 9,110 %, fällig am 20.04.2034 *	1.290	0,52	1.020 BXMT 2020-FL2 Ltd, Serie 2020 FL2, Klasse A, 1,44A, 3,311 %, fällig am 15.02.2038 *	1.009	0,41
145 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Klasse C, 1,44A, 4,087 %, fällig am 16.06.2036 *	138	0,06	11.256 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Serie 2017 P8, Klasse XA, 1,020 %, fällig 15.09.2050 *	386	0,16
170 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Klasse D, 1,44A, 4,737 %, fällig am 16.06.2036 *	160	0,06	710 COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Serie 2015 DC1, Klasse C, 4,441 %, fällig am 10.02.2048 *	663	0,27
843 Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Serie INABS 2005-C, Serie 2005 C, Klasse M2, 3,194 %, fällig am 25.10.2035 *	824	0,33	730 Connecticut Avenue Securities Trust 2018-R07, Serie 2018 R07, Klasse 1B1, 1,44A, 6,794 %, fällig 25.04.2031 *	729	0,29
1.300 LCM XXII Ltd 22A, Klasse DR, 1,44A, 8,210 %, fällig am 20.10.2028 *	1.189	0,48	360 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Klasse 1B1, 1,44A, 5,844 %, fällig 25.10.2039 *	354	0,14
266 Long Beach Mortgage Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Klasse M4, 3,719 %, fällig am 25.02.2034 *	262	0,11	190 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Serie 2021 R03, Klasse 1B1, 1,44A, 4,933 %, fällig 25.12.2041 *	173	0,07
1.000 Magnetite XII Ltd, Serie 2015 12A, Klasse ER, 1,44A, 8,192 %, fällig 15.10.2031 *	902	0,36	330 CSAIL 2017-C8 Commercial Mortgage Trust, Serie 2017 C8, Klasse C, 4,438 %, fällig 15.06.2050 *	288	0,12
1.270 Marble Point CLO XIV Ltd, Serie 2018 2A, Klasse D, 1,44A, 6,240 %, fällig am 20.01.2032 *	1.116	0,45	1.480 CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse F, 1,44A, 4,373 %, fällig am 15.09.2037	1.074	0,43
566 Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE2, Serie 2007 HE2, Klasse A1, 3,594 %, fällig 25.08.2037 *	521	0,21	630 CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Klasse F, 1,44A, 6,741 %, fällig 15.07.2032 *	561	0,23
341 Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, Serie 2018 1A, Klasse CERT, 1,44A, 0,000 %, fällig 22.06.2043 ∞	199	0,08	440 CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Klasse H, 1,44A, 9,741 %, fällig 15.07.2032 *	377	0,15
710 National Collegiate II Commutation Trust, Serie 2005 AR15, Klasse AR15, 0,000 %, fällig am 01.06.2045	122	0,05	638 DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Klasse 1A1B, 2,506 %, fällig 19.04.2047 *	538	0,22
630 National Collegiate Student Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Klasse B, 2,824 %, fällig am 26.03.2035 *	560	0,23	700 Eagle RE 2020-1 Ltd, Serie 2020 1, Klasse M1C, 1,44A, 4,244 %, fällig 25.01.2030 *	677	0,27
89 National Collegiate Student Loan Trust 2006-1, Serie 2006 1, Klasse A5, 2,794 %, fällig 25.03.2033 *	82	0,03	790 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C05, Klasse 1B1, 6,044 %, fällig 25.01.2030 *	799	0,32
790 National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Serie 2006 3, Klasse B, 2,804 %, fällig am 26.01.2032 *	593	0,24	1.070 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C06, Klasse 1B1, 6,594 %, fällig 25.02.2030 *	1.104	0,44
			630 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C07, Klasse 1B1, 6,444 %, fällig 25.05.2030 *	644	0,26

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
950 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Klasse 1B1, 5,994 %, fällig 25.07.2030 *	966	0,39	354 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2006-AR13 Trust, Serie 2006 AR13, Klasse 2A, 2,359 %, fällig 25.10.2046 *	324	0,13
1.050 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C05, Klasse 1B1, 6,694 %, fällig 25.01.2031 *	1.097	0,44	141 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2006-AR3 Trust, Serie 2006 AR3, Klasse A1B, 1,859 %, fällig 25.02.2046 *	127	0,05
520 Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, Serie 2020 DNA1, Klasse B1, 144A, 4,744 %, fällig am 25.01.2050 *	495	0,20	Gesamt Mortgage-Backed Securities (Kosten 36.233 USD)	32.913	13,27
680 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, Serie 2020 DNA6, Klasse B1, 144A, 5,183 %, fällig am 25.12.2050 *	643	0,26	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 54,69 % (28. Februar 2022: 52,04 %)		
450 Freddie Mac STACR Trust 2018-DNA2, Serie 2018 DNA2, Klasse B1, 144A, 6,144 %, fällig 25.12.2030 *	448	0,18	Argentinien — 0,59 % (28. Februar 2022: 0,55 %)		
164 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 SP1, Klasse B, 144A, 4,109 %, fällig 25.09.2047 *	144	0,06	710 Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750 %, fällig am 02.05.2025	640	0,26
380 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2021 DNA2, Klasse M2, 144A, 4,483 %, fällig 25.08.2033 *	375	0,15	790 YPF SA, 144A, 8,500 %, fällig 28.07.2025	567	0,23
469 GS Mortgage Securities Corp II, Serie 2018 SRP5, Klasse C, 144A, 6,641 %, fällig 15.09.2031 *	184	0,07	420 YPF SA, 144A, 6,950 %, fällig 21.07.2027	258	0,10
64 GSMPs Mortgage Loan Trust 2006-RP1, Serie 2006 RP1, Klasse 1A2, 144A, 7,500 %, fällig 25.01.2036	59	0,02		1.465	0,59
330 Hilton USA Trust 2016-HHV, Serie 2016 HHV, Klasse D, 144A, 4,333 %, fällig am 05.11.2038 *	298	0,12	Belgien — 0,39 % (28. Februar 2022: 0,31 %)		
1.247 Impac Secured Assets Trust 2006-3, Serie 2006 3, Klasse A7, 2,984 %, fällig 25.11.2036 *	952	0,38	EUR 1.000 KBC Group NV, 4,750 %, Perpetual *	963	0,39
1.010 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Serie 2018 PHMZ, Klasse M, 144A, 10,899 %, fällig am 15.06.2035 *†	–	–	Bermudas — 0,44 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
2 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12, Serie 2007 LD12, Klasse AJ, 6,723 %, fällig am 15.02.2051 *	2	–	1.130 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig am 15.10.2025	1.088	0,44
1.300 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Serie 2018 WPT, Klasse FFL, 144A, 5,526 %, fällig 05.07.2033 *	1.252	0,50	Brasilien — 1,47 % (28. Februar 2022: 1,59 %)		
282 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-NNN MZ, Serie 2020 NNNZ, Klasse M, 144A, 8,542 %, fällig 16.01.2037	243	0,10	460 B3 SA — Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig am 20.09.2031	389	0,16
281 JP Morgan Resecuritization Trust Serie 2009-10, Serie 2009 10, Klasse 7A2, 144A, 6,054 %, fällig 26.02.2037 *	143	0,06	350 Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 4,500 %, fällig 10.01.2028	326	0,13
31 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Klasse AJ, 5,450 %, fällig am 12.08.2048 *	15	0,01	570 MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	449	0,18
31 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Klasse AJFL, 144A, 5,450 %, fällig 12.08.2048 *	15	0,01	890 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig am 05.06.2115	776	0,31
381 Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP, Serie 2018 MP, Klasse A, 144A, 4,419 %, fällig 11.07.2040 *	355	0,14	210 Suzano Austria GmbH, 5,750 %, fällig 14.07.2026	214	0,09
163 Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-2AR, Serie 2005 2AR, Klasse B1, 2,944 %, fällig am 25.04.2035 *	121	0,05	200 Suzano Austria GmbH, 6,000 %, fällig 15.01.2029	201	0,08
880 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse D, 144A, 4,544 %, fällig 15.08.2036 *	790	0,32	800 Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, fällig am 15.01.2032	635	0,26
361 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse E, 144A, 4,544 %, fällig 15.08.2036 *	307	0,12	270 Vale Overseas Ltd, 6,250 %, fällig 10.08.2026	284	0,11
288 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQ2R, Klasse A3, 144A, 1,353 %, fällig am 25.10.2058 *	273	0,11	350 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 10.11.2039	364	0,15
466 Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Serie 2015 4R, Klasse 2A2, 144A, 2,539 %, fällig 26.10.2036 *	410	0,17		3.638	1,47
287 PMT Credit Risk Transfer Trust 2019-3R, Serie 2019 3R, Klasse A, 144A, 5,193 %, fällig 27.10.2022 *	286	0,12	Kanada — 1,64 % (28. Februar 2022: 1,96 %)		
1.260 Radnor RE 2018-1 Ltd, Serie 2018 1, Klasse M2, 144A, 5,144 %, fällig 25.03.2028 *	1.264	0,51	310 Air Canada, 144A, 3,875 %, fällig am 15.08.2026	277	0,11
1.390 Radnor RE 2020-1 Ltd, Serie 2020 1, Klasse M1C, 144A, 4,194 %, fällig 25.01.2030 *	1.330	0,54	250 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, fällig am 15.01.2028	225	0,09
1.390 Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Serie 2017 4, Klasse M, 144A, 4,750 %, fällig 25.06.2057 *	1.348	0,54	CAD 420 Doman Building Materials Group Ltd, 144A, 5,250 %, fällig am 15.05.2026	277	0,11
822 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-1, Serie 2017 1, Klasse M1, 144A, 4,000 %, fällig 25.01.2056 *	813	0,33	565 GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2026	547	0,22
1.320 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-1, Serie 2018 1, Klasse M, 4,750 %, fällig 25.05.2057 *	1.248	0,50	280 Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, fällig am 01.04.2026	255	0,10
790 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-4, Serie 2018 4, Klasse M, 144A, 4,750 %, fällig 25.03.2058	720	0,29	330 Hudbay Minerals Inc, 144A, 6,125 %, fällig am 01.04.2029	291	0,12
531 Sequoia Mortgage Trust 2007-2, Serie 2007 2, Klasse 1A3, 3,008 %, fällig 20.06.2036 *	482	0,19	350 MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2027	354	0,14
250 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Klasse C, 144A, 5,142 %, fällig 15.11.2027 *	26	0,01	80 MEG Finance Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.02.2029	75	0,03
410 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Klasse D, 144A, 5,892 %, fällig 15.11.2027 *	16	0,01	140 Open Text Corp, 144A, 3,875 %, fällig 15.02.2028	120	0,05
370 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Klasse E, 144A, 6,792 %, fällig am 15.11.2027 *†	–	–	270 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, fällig am 15.02.2030	218	0,09
853 Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Serie 2018 THL, Klasse D, 144A, 4,673 %, fällig 11.11.2034 *	805	0,32	250 Superior Plus LP / Superior General Partner Inc, 144A, 4,500 %, fällig am 15.03.2029	221	0,09
834 Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Serie 2018 THL, Klasse E, 144A, 5,853 %, fällig 11.11.2034 *	772	0,31	130 Teck Resources Ltd, 6,000 %, fällig 15.08.2040	125	0,05
891 Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Serie 2018 THL, Klasse F, 144A, 6,625 %, fällig 11.11.2034 *	822	0,33	330 Teck Resources Ltd, 5,400 %, fällig 01.02.2043	293	0,12
63 Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Serie 2007-C33, Serie 2007 C33, Klasse AJ, 5,880 %, fällig 15.02.2051 *	49	0,02	790 TransAlta Corp, 6,500 %, fällig 15.03.2040	785	0,32
107 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR17 Trust, Serie 2005 AR17, Klasse A1C3, 3,404 %, fällig 25.12.2045 *	69	0,03		4.063	1,64
844 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR2 Trust, Serie 2005 AR2, Klasse B1, 3,239 %, fällig am 25.11.2045 *	708	0,29	Cayman Islands — 0,43 % (28. Februar 2022: 0,32 %)		
			1.306 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 15.09.2024	1.059	0,43
			Chile — 0,27 % (28. Februar 2022: 0,25 %)		
			150 Liberty Latin America Ltd, 2,000 %, fällig am 15.07.2024	133	0,05
			803 VTR Comunicaciones SpA, 144A, 5,125 %, fällig 15.01.2028	539	0,22
				672	0,27
			China — 0,35 % (28. Februar 2022: 0,32 %)		
			400 Country Garden Holdings Co Ltd, 8,000 %, fällig 27.01.2024	254	0,10
			200 Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, fällig 12.11.2023	202	0,08
			570 Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig am 13.07.2031	424	0,17
				880	0,35
			Kolumbien — 0,12 % (28. Februar 2022: 0,19 %)		
			363 Millicom International Cellular SA, 144A, 4,500 %, fällig 27.04.2031	298	0,12
			Frankreich — 0,27 % (28. Februar 2022: 0,38 %)		
			200 Altice France SA, France, 144A, 8,125 %, fällig 01.02.2027	190	0,08
			470 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, fortwährend *	483	0,19
				673	0,27
			Deutschland — 7,54 % (28. Februar 2022: 8,02 %)		
			320 Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2028	275	0,11
			120 Mercer International Inc, 5,125 %, fällig 01.02.2029	105	0,04
			100 Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, fällig 30.09.2025	88	0,04
			713 ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 29.04.2025	662	0,27
				1.130	0,46

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
Hong Kong — 0,25 % (28. Februar 2022: 0,17 %)					
200	153	0,06			
Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig am 06.06.2025					
730	477	0,19			
Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig am 12.04.2029					
	630	0,25			
Irland — 0,26 % (28. Februar 2022: 0,20 %)					
420	339	0,14			
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032					
320	295	0,12			
Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 15.04.2026					
	634	0,26			
Israel — 0,53 % (28. Februar 2022: 0,53 %)					
1.180	1.063	0,43			
Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig am 02.01.2036					
300	263	0,10			
Teva Pharmaceutical Finance Niederlande III BV, 4,750 %, fällig am 05.09.2027					
	1.326	0,53			
Italien — 0,36 % (28. Februar 2022: 0,30 %)					
230	216	0,09			
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig am 15.01.2026					
200	179	0,07			
UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, fällig 02.04.2034 *					
640	506	0,20			
UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, fällig 30.06.2035 *					
	901	0,36			
Kasachstan — 0,37 % (28. Februar 2022 0,52 %)					
580	537	0,21			
KazMunayGas National Co JSC, 144A, 4,750 %, fällig 19.04.2027					
430	392	0,16			
KazTransGas JSC, 144A, 4,375 %, fällig 26.09.2027					
	929	0,37			
Kuwait — 0,33 % (28. Februar 2022: 0,27 %)					
780	819	0,33			
MEGlobal Canada ULC, 144A, 5,875 %, fällig 18.05.2030					
Luxemburg — 0,99 % (28. Februar 2022: 0,61 %)					
1.450	1.253	0,51			
Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2027					
230	179	0,07			
ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027					
460	454	0,18			
Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig am 01.04.2028					
620	568	0,23			
FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 15.08.2026					
	2.454	0,99			
Macau — 0,69 % (28. Februar 2022: 0,44 %)					
270	247	0,10			
Sands China Ltd, 5,625 %, fällig am 08.08.2025					
200	172	0,07			
Sands China Ltd, 5,900 %, fällig am 08.08.2028					
200	152	0,06			
Sands China Ltd, 3,100 %, fällig am 03.08.2029					
200	146	0,06			
Sands China Ltd, 3,750 %, fällig am 08.08.2031					
200	160	0,07			
Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, fällig am 01.10.2024					
200	154	0,06			
Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 15.01.2026					
530	372	0,15			
Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig am 26.08.2028					
430	300	0,12			
Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig am 15.12.2029					
	1.703	0,69			
Malaysia — 0,15 % (28. Februar 2022: 0,19 %)					
490	359	0,15			
Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig am 19.08.2050					
Mexiko — 0,38 % (28. Februar 2022: 0,41 %)					
1.020	930	0,38			
Banco Mercantil del Norte SA Grand Cayman, 144A, 7,500 %, unbefristet *					
Niederlande — 0,50 % (28. Februar 2022: 0,42 %)					
1.000	938	0,38			
Coöperatieve Rabobank UA, 4,625 %, unbefristet *					
310	313	0,12			
Stichting AK Rabobank Certificaten, 6,500 %, fortwährend					
	1.251	0,50			
Russia — 0,19 % (28. Februar 2022: 0,13 %)					
770	481	0,19			
Lukoil International Finance BV, 144A, 4,750 %, fällig am 11.02.2026					
Singapur — 0,17 % (28. Februar 2022: 0,12 %)					
420	419	0,17			
Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, fällig 19.06.2024					
Südafrika — 0,17 % (28. Februar 2022: 0,25 %)					
510	429	0,17			
Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, fällig am 18.03.2031					
Spanien — 0,04 % (28. Februar 2022: 0,15 %)					
100	96	0,04			
Tendam Brands SAU, 5,517 %, fällig am 15.09.2024 *					
Schweiz — 0,91 % (28. Februar 2022: 0,27 %)					
450	430	0,17			
Credit Suisse Group AG, 144A, 6,537 %, fällig am 08.12.2033 *					
640	648	0,26			
Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, unbefristet *					
200	177	0,07			
Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, unbefristet *					
200	165	0,07			
Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, unbefristet *					
720	705	0,29			
UBS Group AG, 144A, 7,000 %, unbefristet *					
140	121	0,05			
Vistalet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc, 144A, 6,375 %, fällig am 01.02.2030					
	2.246	0,91			
Türkei — 0,17 % (28. Februar 2022: 0,20 %)					
460	413	0,17			
Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 6,875 %, fällig 28.02.2025					
Vereinigte Arabische Emirate — 0,22 % (28. Februar 2022: 0,26 %)					
560	554	0,22			
DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, fällig am 25.09.2048					
Vereinigtes Königreich — 1,83 % (28. Februar 2022: 2,09 %)					
550	546	0,22			
Barclays Plc, 2,000 %, fällig 07.02.2028 *					
320	307	0,12			
Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, unbefristet *					
842	715	0,29			
Mclaren Finance Plc, 144A, 7,500 %, fällig 01.08.2026					
970	883	0,36			
NatWest Group Plc, 4,500 %, fortwährend *					
690	667	0,27			
Neptune Energy Bondco Plc, 144A, 6,625 %, fällig am 15.05.2025					
640	623	0,25			
Saga Plc, 5,500 %, fällig 15.07.2026					
600	534	0,21			
Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029					
330	272	0,11			
Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.07.2031					
	4.547	1,83			
USA — 38,90 % (28. Februar 2022: 37,58 %)					
1.103	1.188	0,48			
Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2028					
330	278	0,11			
Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, fällig am 01.05.2028					
130	120	0,05			
AdaptHealth LLC, 144A, 6,125 %, fällig am 01.08.2028					
380	317	0,13			
AdaptHealth LLC, 144A, 4,625 %, fällig am 01.08.2029					
286	272	0,11			
Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig am 01.03.2028					
420	416	0,17			
Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, fällig am 15.06.2030					
320	264	0,11			
AES Corp.The, 2,450 %, fällig 15.01.2031					
490	389	0,16			
Akumim Escrow Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.08.2028					
240	234	0,09			
Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,125 %, fällig 15.05.2028					
1.150	582	0,23			
Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, fällig am 15.02.2028					
270	253	0,10			
Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig am 15.07.2026					
180	168	0,07			
Allison Transmission Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.10.2027					
70	56	0,02			
AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 10,000 %, fällig am 15.06.2026					
100	86	0,03			
AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 15.02.2029					
309	286	0,12			
American Airlines 2017-1 Klasse B Pass Through Trust, Serie B, 4,950 %, fällig 15.02.2025					
530	586	0,24			
American Airlines Inc, 144A, 11,750 %, fällig 15.07.2025					
650	588	0,24			
American Airlines Inc.AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029					
160	135	0,05			
American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig am 01.10.2029					
811	918	0,37			
American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig am 01.09.2026					
190	179	0,07			
Antero Resources Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01.03.2030					
350	348	0,14			
Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 5,375 %, fällig am 15.10.2023					
370	300	0,12			
Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 15.06.2029					
210	206	0,08			
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig am 15.06.2027					
480	390	0,16			
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, fällig am 01.09.2029					
360	353	0,14			
Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.12.2024					
350	284	0,11			
Ball Corp, 2,875 %, fällig 15.08.2030					
340	276	0,11			
Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031					
500	449	0,18			
Bath & Body Works Inc, 5,250 %, fällig am 01.02.2028					
260	237	0,10			
Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig am 01.10.2030					
170	102	0,04			
Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, fällig am 01.04.2026					
170	140	0,06			
Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.11.2025					
320	237	0,10			
Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.02.2027					
140	54	0,02			
Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.01.2028					
70	26	0,01			
Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,000 %, fällig 30.01.2028					
810	167	0,07			
Bed Bath & Beyond Inc, 5,165 %, fällig am 01.08.2044					
1.580	1.487	0,60			
Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2026					
320	281	0,11			
Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, fällig am 01.09.2028					
20	19	0,01			
Blackstone Mortgage Trust Inc, 5,500 %, fällig am 15.03.2027					
590	588	0,24			
Blue Racer Midstream LLC . Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15.12.2025					
530	485	0,20			
Boeing Co/The, 2,196 %, fällig am 04.02.2026					
160	158	0,06			
Boeing Co/The, 5,150 %, fällig am 01.05.2030					

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)							
USA — (Fortsetzung)							
420	Boeing Co/The, 3,250 %, fällig am 01.05.2035	324	0,13	170	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000 %, fällig am 01.07.2025	164	0,07
350	Boeing Co/The, 5,930 %, fällig am 01.05.2060	335	0,13	190	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, fällig am 01.07.2027	184	0,07
580	Boyer USA Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.05.2029	517	0,21	190	EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, fällig am 01.06.2030	189	0,08
280	Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, fällig am 01.02.2032	224	0,09	250	EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15.05.2026	236	0,09
230	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2030	203	0,08	380	EQT Corp, 7,000 %, fällig 01.02.2030	407	0,16
620	Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig 01.06.2030	568	0,23	250	Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 15.01.2029	218	0,09
1.964	Carnival Plc, 7,875 %, fällig 01.06.2027	1.995	0,80	720	FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 01.01.2030	645	0,26
160	Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.10.2029	125	0,05	230	FirstEnergy Corp, Serie B, 4,400 %, fällig am 15.07.2027	218	0,09
420	Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2029	358	0,14	750	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, fällig am 15.11.2025	656	0,26
290	Carrols Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029	218	0,09	860	Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	673	0,27
800	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,000 %, fällig 01.02.2028	732	0,29	220	Ford Motor Co, 6,100 %, fällig am 19.08.2032	215	0,09
90	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig am 15.08.2030	76	0,03	450	Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, fällig am 16.06.2025	440	0,18
500	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2032	414	0,17	440	Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig am 28.05.2027	414	0,17
870	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	707	0,28	350	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig am 13.11.2030	293	0,12
380	CDW LLC / CDW Finance Corp, 4,125 %, fällig 01.05.2025	374	0,15	200	Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, fällig am 17.06.2031	162	0,07
170	CDW LLC / CDW Finance Corp, 3,250 %, fällig am 15.02.2029	148	0,06	670	Freeport Minerals Corp, 7,125 %, fällig 01.11.2027	727	0,29
20	Centene Corp, 4,250 %, fällig am 15.12.2027	19	0,01	630	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	568	0,23
400	Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig am 15.06.2029	384	0,15	210	Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig am 15.02.2028	192	0,08
50	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.03.2042	35	0,01	380	Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000 %, fällig 01.11.2026	297	0,12
590	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	480	0,19	220	Gartner Inc, 144A, 3,625 %, fällig 15.06.2029	189	0,08
970	Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, fällig am 01.06.2026	942	0,38	1.069	GEO Group Inc.The, 10,500 %, fällig 30.06.2028	1.018	0,41
800	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2029	501	0,20	157	GEO Group Inc.The, 144A, 9,500 %, fällig 31.12.2028 ∞	142	0,06
970	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, fällig am 01.04.2030	603	0,24	820	GoTo Group Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.09.2027	604	0,24
570	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 144A, 8,500 %, fällig am 15.05.2027	561	0,23	720	Granite US Holdings Corp, 144A, 11,000 %, fällig am 01.10.2027	702	0,28
140	Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 01.06.2029	113	0,05	940	Guitar Center Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.01.2026	871	0,35
370	Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, fällig am 01.10.2031	226	0,09	460	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig am 15.12.2028	389	0,16
920	Colgate Energy Partners III LLC, 144A, 5,875 %, fällig am 01.07.2029	854	0,34	800	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 20.01.2026	731	0,29
140	CommScope Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.03.2027	120	0,05	370	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 6,250 %, fällig am 15.04.2032	332	0,13
490	CommScope Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 01.09.2029	418	0,17	540	Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,750 %, fällig am 15.01.2027	489	0,20
420	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig am 15.01.2031	403	0,16	590	iHeartCommunications Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.01.2028	507	0,20
850	CoreCivic Inc, 8,250 %, fällig 15.04.2026	841	0,34	1.120	iIP Operating Partnership LP, 5,500 %, fällig am 25.05.2026	998	0,40
100	Crowdstrike Holdings Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2029	89	0,04	450	Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 4,500 %, fällig am 15.11.2029	409	0,16
340	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	313	0,13	270	Jazz Securities DAC, 144A, 4,375 %, fällig am 15.01.2029	244	0,10
260	CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2030	202	0,08	250	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2027	219	0,09
240	CSC Funding LLC, 144A, 4,125 %, fällig am 01.12.2030	195	0,08	140	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.06.2029	119	0,05
530	CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	426	0,17	510	Las Vegas Sands Corp, 3,500 %, fällig 18.08.2026	458	0,18
530	Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2030	531	0,21	400	LD Holdings Group LLC, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2028	213	0,09
300	DCP Midstream LP, Serie A, 7,375 %, fortwährend *	299	0,12	300	Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 4,375 %, fällig am 15.02.2027	261	0,11
100	DCP Midstream Operating LP, 3,875 %, fällig 15.03.2023	100	0,04	710	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144A, 5,000 %, fällig am 01.02.2026	649	0,26
40	DCP Midstream Operating LP, 5,625 %, fällig 15.07.2027	41	0,02	620	Liberty Interactive LLC, 8,500 %, fällig 15.07.2029	474	0,19
190	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, fällig am 15.09.2037	202	0,08	80	Liberty TripAdvisor Holdings Inc, 144A, 0,500 %, fällig am 30.06.2051	59	0,02
520	Delta Air Lines Inc, 3,800 %, fällig am 19.04.2023	516	0,21	450	Magallanes Inc, 144A, 3,755 %, fällig 15.03.2027	421	0,17
900	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig am 01.05.2025	932	0,38	290	Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,625 %, fällig am 01.06.2028	259	0,10
240	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig am 20.10.2028	229	0,09	620	Medline Borrower LP, 144A, 3,875 %, fällig am 01.04.2029	526	0,21
440	Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	406	0,16	390	Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig am 01.05.2028	300	0,12
260	Diamondback Energy Inc, 4,400 %, fällig 24.03.2051	222	0,09	640	Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, fällig am 01.05.2029	427	0,17
1.050	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig am 15.08.2027	962	0,39	560	Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500 %, fällig am 01.05.2028	481	0,19
220	DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig am 15.11.2024	199	0,08	260	Minerals Technologies Inc, 144A, 5,000 %, fällig am 01.07.2028	235	0,09
180	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	142	0,06	700	Minerva Merger Sub Inc, 144A, 6,500 %, fällig am 15.02.2030	595	0,24
530	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	408	0,16	416	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692 %, fällig 05.06.2028	405	0,16
530	DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	315	0,13	670	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig 15.03.2031	503	0,20
840	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	607	0,24	90	MSCI Inc, 144A, 3,250 %, fällig 15.08.2033	72	0,03
166	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig am 15.06.2025	163	0,07	150	Navient Corp, 5,625 %, fällig 01.08.2033	112	0,05
210	Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, fällig am 15.02.2028	155	0,06	550	NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.02.2027	499	0,20
800	DraftKings Holdings Inc, Nullkupon, fällig am 15.03.2028	544	0,22	290	NCL Corp Ltd, 144A, 7,750 %, fällig 15.02.2029	236	0,10
373	Endeavour Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig am 30.01.2028	369	0,15	480	NCR Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.04.2029	449	0,18
540	Energy Transfer LP, 5,350 %, fällig 15.05.2045	477	0,19	220	NMI Holdings Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2025	223	0,09
250	Energy Transfer LP, Serie G, 7,125 %, fortwährend *	228	0,09	500	Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125 %, fällig am 01.03.2028	481	0,19
260	Entegris Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2028	230	0,09	2.790	Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.11.2022 †	-	-
240	Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, fällig am 31.01.2051	188	0,08	40	NRG Energy Inc, 144A, 3,625 %, fällig 15.02.2031	32	0,01
380	Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig am 31.01.2060	297	0,12	130	Occidental Petroleum Corp, 7,200 %, fällig 15.03.2029	140	0,06
				30	Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig am 15.09.2036	32	0,01
				180	Occidental Petroleum Corp, 4,500 %, fällig 15.07.2044	156	0,06

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
USA — (Fortsetzung)					
120	Olin Corp, 5,000 %, fällig 01.02.2030	109	0,04		
750	Option Care Health Inc, 144A, 4,375 %, fällig am 31.10.2029	661	0,27		
110	Pactiv LLC, 7,950 %, fällig 15.12.2025	103	0,04		
270	Pactiv LLC, 8,375 %, fällig 15.04.2027	252	0,10		
700	Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 01.04.2027	596	0,24		
912	Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, fällig am 15.04.2027	758	0,31		
350	Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000 %, fällig am 15.06.2029	262	0,11		
620	Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.08.2026	609	0,25		
250	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144A, 7,750 %, fällig am 15.02.2029	236	0,10		
320	Plains All American Pipeline LP, Serie B, 6,125 %, unbefristet *	273	0,11		
720	PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig 01.10.2028	625	0,25		
880	Prime Security Services Borrower LLC - Prime Finance Inc, 144A, 3,375 %, fällig 31.08.2027	758	0,31		
250	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 6,250 %, fällig am 15.01.2028	220	0,09		
260	QVC Inc, 5,450 %, fällig 15.08.2034	187	0,08		
420	Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, fällig am 15.02.2028	304	0,12		
490	Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, fällig am 01.02.2028	366	0,15		
444	Range Resources Corp, 5,000 %, fällig am 15.03.2023	444	0,18		
840	Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15.01.2029	883	0,36		
360	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	334	0,13		
310	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp, 144A, 5,750 %, fällig am 15.01.2029	243	0,10		
380	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc, 144A, 9,750 %, fällig am 01.12.2026	363	0,15		
720	Rent-A-Center Inc/TX, 144A, 6,375 %, fällig am 15.02.2029	609	0,25		
410	Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.07.2038	361	0,15		
300	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,625 %, fällig am 15.08.2027	294	0,12		
550	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 5,625 %, fällig am 01.12.2025	528	0,21		
610	Scientific Games International Inc, 144A, 8,625 %, fällig am 01.07.2025	629	0,25		
280	Service Properties Trust, 7,500 %, fällig 15.09.2025	269	0,11		
340	Service Properties Trust, 5,500 %, fällig am 15.12.2027	295	0,12		
530	Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 01.11.2026	497	0,20		
420	Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 144A, 4,625 %, fällig am 01.03.2029	372	0,15		
1.190	Southwestern Energy Co, 7,750 %, fällig 01.10.2027	1.235	0,50		
440	Southwestern Energy Co, 8,375 %, fällig 15.09.2028	464	0,19		
560	Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	500	0,20		
100	Spirit Airlines Inc, 1,000 %, fällig 15.05.2026	88	0,04		
508	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	517	0,21		
1.129	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	1.364	0,55		
520	SRM Escrow Issuer LLC, 144A, 6,000 %, fällig 01.11.2028	472	0,19		
750	StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029	654	0,26		
240	StoneX Group Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.06.2025	245	0,10		
320	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig am 15.10.2026	310	0,13		
330	Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig am 01.09.2026	305	0,12		
260	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig am 31.12.2030	228	0,09		
460	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig am 01.02.2031	427	0,17		
190	Tenet Healthcare Corp, 144A, 5,125 %, fällig 01.11.2027	176	0,07		
160	Terminix Co LLC/The, 7,450 %, fällig am 15.08.2027	186	0,07		
300	Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	285	0,12		
70	TKC Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.05.2028	59	0,02		
210	TKC Holdings Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2029	169	0,07		
1.110	T-Mobile USA Inc, 4,750 %, fällig 01.02.2028	1.087	0,44		
350	TopBuild Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.03.2029	295	0,12		
150	TransDigm Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.12.2025	154	0,06		
270	TransDigm Inc, 7,500 %, fällig 15.03.2027	264	0,11		
390	TransDigm Inc, 5,500 %, fällig 15.11.2027	351	0,14		
270	TransDigm Inc, 4,625 %, fällig 15.01.2029	229	0,09		
70	Triumph Group Inc, 144A, 8,875 %, fällig 01.06.2024	71	0,03		
1.000	Triumph Group Inc, 7,750 %, fällig 15.08.2025	844	0,34		
370	Tutor Perini Corp, 144A, 6,875 %, fällig 01.05.2025	303	0,12		
430	Twitter Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2027	401	0,16		
200	Uniquify Inc, Serie CLIP, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2024 +	199	0,08		
64	United Airlines 2020-1 Klasse B Pass Through Trust, 4,875 %, fällig 15.01.2026	61	0,02		
80	United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	73	0,03		
280	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	246	0,10		
190	United Rentals North America Inc, 5,500 %, fällig am 15.05.2027	188	0,08		
930	United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig am 15.01.2030	881	0,36		
330	United Rentals North America Inc, 4,000 %, fällig 15.07.2030	287	0,12		
440	US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig am 15.07.2027	211	0,09		
400	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2031	348	0,14		
260	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig am 01.11.2033	216	0,09		
150	Vericast Corp, 144A, 11,000 %, fällig 15.09.2026	150	0,06		
200	Vericast Corp/Harland Clarke/Checks in the Mail/Valassis Comm/Valassis Direct, 144A, 13,000 %, fällig am 15.10.2027	229	0,09		
100	Verizon Communications Inc, 3,400 %, fällig am 22.03.2041	81	0,03		
150	Verizon Communications Inc, 3,550 %, fällig 22.03.2051	118	0,05		
720	Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.11.2028	624	0,25		
160	Viavi Solutions Inc, 144A, 3,750 %, fällig am 01.10.2029	138	0,06		
459	VICI Properties LP - VICI Note Co Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2030	404	0,16		
110	Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2029	88	0,04		
600	Viper Energy Partners LP, 144A, 5,375 %, fällig 01.11.2028	575	0,23		
590	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	499	0,20		
540	Wendy's International LLC, 7,000 %, fällig am 15.12.2025	554	0,22		
230	Western Midstream Operating LP, 3,350 %, fällig am 01.02.2025	217	0,09		
490	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig 01.04.2044	430	0,17		
680	Western Midstream Operating LP, 5,300 %, fällig 01.03.2048	599	0,24		
550	Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15.03.2032	680	0,27		
400	WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2029	250	0,10		
690	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,750 %, fällig am 15.04.2025	689	0,28		
1.127	XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig 01.05.2034	1.090	0,44		
610	Ziff Davis Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.10.2030	521	0,21		
180	ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2030	150	0,06		
370	ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp, 144A, 3,875 %, fällig am 01.02.2029	321	0,13		
		96.506	38,90		
Sambia — 0,85 % (28. Februar 2022: 0,79 %)					
207	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2025	204	0,08		
610	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 01.03.2026	586	0,24		
1.390	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 15.10.2027	1.328	0,53		
		2.118	0,85		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 158.7475)				135.674	54,69
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 6,85 % (28. Februar 2022: 14,10 %)					
Angola — 0,07 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
210	Angola Government International Bond, 144A, 8,750 %, fällig 14.04.2032	173	0,07		
Argentinien — 0,67 % (28. Februar 2022: 0,67 %)					
8	Argentine Republic Government International Bond, 1,000 %, fällig am 09.07.2029	2	–		
47	Argentine Republic Government International Bond, 0,500 %, fällig am 09.07.2030	11	–		
90	Argentine Republic Government International Bond, 1,500 %, fällig 09.07.2035	20	0,01		
500	Ciudad Autonoma De Buenos Aires.Government Bonds, 7,500 %, fällig 01.06.2027	437	0,18		
2.198	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 5,250 %, fällig 01.09.2037	773	0,31		
665	Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, fällig 01.06.2027	426	0,17		
		1.669	0,67		
Bahamas — 0,19 % (28. Februar 2022: 0,14 %)					
550	Bahamas Government International Bond, 144A, 5,750 %, fällig 16.01.2024	459	0,19		
Brasilien — 0,30 % (28. Februar 2022: 0,75 %)					
970	Brazilian Government International Bond, 5,000 %, fällig 27.01.2045	750	0,30		
Cote d'Ivoire (Elfenbeinküste) — 0,28 % (28. Februar 2022: 0,30 %)					
EUR	180 Ivory Coast Government International Bond, 144A, 4,875 %, fällig 30.01.2032	137	0,05		
660	Ivory Coast Government International Bond, 6,125 %, fällig 15.06.2033	560	0,23		
		697	0,28		
Dominikanische Republik — 0,29 % (28. Februar 2022: 0,26 %)					
490	Dominican Republic International Bond, 144A, 5,500 %, fällig 22.02.2029	449	0,18		
300	Dominican Republic International Bond, 144A, 6,000 %, fällig 22.02.2033	262	0,11		
		711	0,29		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
Gabun — 0,08 % (28. Februar 2022: 0,11 %)					
250	Gabon Government International Bond, 144A, 7,000 %, fällig 24.11.2031	187	0,08		
Deutschland — 0,11 % (28. Februar 2022: 0,09 %)					
EUR 280	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2026	268	0,11		
Ghana — 0,18 % (28. Februar 2022: 0,20 %)					
200	Ghana Government International Bond, 8,125 %, fällig 18.01.2026	123	0,05		
200	Ghana Government International Bond, 144A, 7,625 %, fällig 16.05.2029	77	0,03		
670	Ghana Government International Bond, 144A, 8,125 %, fällig 26.03.2032	256	0,10		
		456	0,18		
Indonesien — 1,83 % (28. Februar 2022: 2,51 %)					
750	Indonesia Government International Bond, 3,500 %, fällig 11.01.2028	732	0,30		
IDR 48.151.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	3.280	1,32		
IDR 7.398.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR87, 6,500 %, fällig 15.02.2031	482	0,19		
IDR 721.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR68, 8,375 %, fällig 15.03.2034	53	0,02		
		4.547	1,83		
Japan — 0,09 % (28. Februar 2022: 0,07 %)					
JPY 29.100	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 21, 0,100 %, fällig am 10.03.2026 β	228	0,09		
Jordanien — 0,30 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
760	Jordanien Government International Bond, 144A, 7,750 %, fällig 15.01.2028	755	0,30		
Kasachstan — 0,19 % (28. Februar 2022: 0,24 %)					
440	Kasachstan Government International Bond, 5,125 %, fällig 21.07.2025	463	0,19		
Mexiko — 0,78 % (28. Februar 2022: 0,87 %)					
MXN 13.970	Mexican Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig am 31.05.2029	676	0,27		
1.480	Mexico Government International Bond, 4,750 %, fällig am 08.03.2044	1.260	0,51		
		1.936	0,78		
Panama — 0,20 % (28. Februar 2022: 0,29 %)					
630	Panama Government International Bond, 4,500 %, fällig am 01.04.2056	489	0,20		
Peru — 0,29 % (28. Februar 2022: 0,29 %)					
840	Peruvian Government International Bond, 2,783 %, fällig am 23.01.2031	718	0,29		
Katar — 0,16 % (28. Februar 2022: 0,38 %)					
380	Katar Government International Bond, 144A, 4,817 %, fällig 14.03.2049	393	0,16		
Russia — 0,84 % (28. Februar 2022: 0,53 %)					
RUB 397.822	Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig am 19.01.2028ty	2.090	0,84		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 24.1435)					
		16.989	6,85		
Schuldscheindarlehen — 7,69 % (28. Februar 2022: 6,54 %)					
430	8Th Avenue Food & Provisions Inc, 10,122 %, fällig am 01.10.2026 *	360	0,15		
64	Academy Ltd, 6,123 %, fällig am 06.11.2027 *	62	0,03		
547	Acrisure LLC, 6,622 %, fällig 15.02.2027 *	533	0,22		
265	Acrisure LLC, 5,872 %, fällig 15.02.2027 *	255	0,10		
114	Allen Media LLC, 7,704 %, fällig 10.02.2027 *	100	0,04		
3	Allied Universal Holdco LLC, 6,122 %, fällig am 14.05.2028 *	3	–		
400	AMC Entertainment Holdings Inc, 5,380 %, fällig 22.04.2026 *	346	0,14		
170	Amentum Government Services Holdings LLC, 11,000 %, fällig am 31.01.2028 *	162	0,07		
179	American Axle & Manufacturing Inc, 5,040 %, fällig 06.04.2024 *	177	0,07		
57	API Group Inc, 5,024 %, fällig am 01.10.2026 *	56	0,02		
68	Apollo Group CMR, 5,122 %, fällig 15.05.2026 *	66	0,03		
153	AppLovin Corporation, 5,500 %, fällig am 08.03.2025 *	151	0,06		
194	Asurion LLC, 5,622 %, fällig 18.12.2026 *	178	0,07		
574	Asurion LLC, 5,372 %, fällig 03.11.2024 *	554	0,22		
196	Asurion, LLC, 6,401 %, fällig 17.08.2028 *	183	0,07		
296	Caesars Resort Collection LLC, 5,122 %, fällig am 22.12.2024 *	292	0,12		
185	Caesars Resort Collection LLC, 5,872 %, fällig 19.06.2025 *	184	0,07		
407	City Brewing Co LLC, 5,873 %, fällig am 31.03.2028 *	356	0,14		
872	ClubCorp Holdings Inc, 5,000 %, fällig 18.09.2024 *	838	0,34		
191	Deerfield Dakota Holding LLC, 6,077 %, fällig 05.03.2027 *	186	0,08		
647	Equinox Holdings Inc, 11,250 %, fällig am 08.03.2024 *	576	0,23		
105	Eyecare Partners LLC, 6,000 %, fällig am 05.02.2027 *	98	0,04		
537	First Brands Group LLC, 8,368 %, fällig 24.03.2027 *	523	0,21		
4	Focus Financial Partners LLC, 4,372 %, fällig am 03.07.2024 *	4	–		
EUR 790	Froneri Lux FinCo SARL, 3,006 %, fällig 30.01.2027 *	745	0,30		
208	Garda World Security Corp, 7,240 %, fällig am 30.10.2026 *	203	0,08		
78	Global Medical Response, Inc, 6,623 %, fällig am 24.09.2025 *	71	0,03		
127	Global Tel'Link Corp, 7,056 %, fällig am 29.11.2025 *	118	0,05		
716	Grey Television Inc, 5,373 %, fällig am 27.10.2028 *	707	0,29		
204	Great Outdoors Group LLC, 6,122 %, fällig am 05.03.2028 *	198	0,08		
632	Greystone Select Financial, 7,738 %, fällig am 06.05.2028 *	606	0,24		
197	Hayward Industries Inc., 4,872 %, fällig 14.05.2028 *	191	0,08		
60	Hexion Inc, 7,413 %, fällig 02.03.2029 *	56	0,02		
286	Jazz Financing Lux Sarl, 5,872 %, fällig am 22.04.2028 *	281	0,11		
206	Leslie's Poolmart Inc, 4,872 %, fällig am 08.03.2028 *	203	0,08		
478	LRS Holdings LLC, 6,622 %, fällig 12.08.2028 *	462	0,19		
207	LTR Intermediate Holdings, Inc., 6,750 %, fällig 23.04.2028 *	191	0,08		
305	Madison IAQ LLC, 4,524 %, fällig 16.06.2028 *	295	0,12		
260	Mister Car Wash, 5,372 %, fällig 14.05.2026 *	255	0,10		
1.925	Monitronics International Inc., 10,306 %, fällig 29.03.2024 *	1.289	0,52		
478	One Call Corp, 8,313 %, fällig 07.04.2027 *	394	0,16		
801	PECF USS Intermediate Holding Corp, 6,622 %, fällig am 04.11.2028 *	748	0,30		
415	Peraton Corporation, 6,122 %, fällig am 22.02.2028 *	404	0,16		
740	Polyconcept North America Holdings Inc, 7,554 %, fällig am 12.05.2029 *	707	0,28		
420	Project Sky Merger Sub, Inc., 8,372 %, fällig 10.08.2029 *	386	0,16		
730	Radiology Partners Inc, 6,618 %, fällig am 09.07.2025 *	683	0,28		
318	Redstone Holdco 2 LP, 7,533 %, fällig am 27.04.2028 *	273	0,11		
29	Seattle SpinCo Inc, 5,122 %, fällig am 18.04.2024 *	28	0,01		
310	Sedgwick Claims Management Services Inc, 5,622 %, fällig 05.11.2025 *	304	0,12		
244	Sovos Brands, 5,872 %, fällig am 03.06.2028 *	237	0,10		
104	Surf Holdings LLC, 5,165 %, fällig 14.10.2026 *	102	0,04		
99	Triton Water Holdings, Inc., 5,750 %, fällig 16.03.2028 *	93	0,04		
698	Tutor Perini Corp, 7,127 %, fällig am 18.08.2027 *	655	0,26		
359	U.S. Renal Care Inc, 7,375 %, fällig 14.06.2026 *	276	0,11		
117	United Airlines Inc, 6,533 %, fällig am 14.04.2028 *	114	0,05		
507	UST Holdings Ltd, 6,194 %, fällig am 29.10.2028 *	500	0,20		
249	Vertex Aerospace LLC, 6,372 %, fällig am 27.10.2028 *	247	0,10		
260	Virgin Media Bristol LLC, 4,891 %, fällig am 04.01.2028 *	255	0,10		
288	Virgin Pulse Inc, 6,372 %, fällig am 30.03.2028 *	256	0,10		
320	Ziggo BV, 4,891 %, fällig 15.04.2028 *	310	0,12		
Summe Schuldverschreibungen (Kosten 20.674 USD)				19.086	7,69
Organismen für gemeinsame Anlagen — 0,99 % (28. Februar 2022: 1,55 %)					
EUR 24	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc — Western Asset European Loan — LM Klasse Euro Thesaurierend	2.446	0,99		
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 2.6625)				2.446	0,99
Vorzugsaktien — 1,21 % (28. Februar 2022: 2,23 %)					
USA — 1,21 % (28. Februar 2022: 2,23 %)					
	8 B. Riley Financial Inc	165	0,07		
	9 B. Riley Financial Inc	202	0,08		
	70 MPLX LP, Serie A ∞	2.638	1,06		
		3.005	1,21		
Summe Vorzugsaktien (Kosten 2.690 USD)				3.005	1,21
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 282.1115)				244.959	98,75
Kontrakte (in Tsd.)					
Gekaufte Optionen — 0,22 % (28. Februar 2022: 0,11 %)					
	– IMM Euro\$ December 2023 Call 99,00, fällig 18.12.2023 — Bank of America Merrill Lynch	1	–		
	– S&P 500 E-mini December 2022 Put 3,700,00, fällig 16.12.2022 — Bank of America Merrill Lynch	149	0,06		
	– S&P 500 E-mini September 2022 Put 3,400,00, fällig 16.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	2	–		
	– S&P 500 E-mini September 2022 Put 3,500,00, fällig 16.09.2022 — Bank of America Merrill Lynch	4	–		
	– S&P 500 E-mini W3 October 2022 Put 3,600,00, fällig 21.10.2022 — Bank of America Merrill Lynch	101	0,04		
	– S&P 500 E-mini W3 October 2022 Put 3,800,00, fällig 21.10.2022 — Bank of America Merrill Lynch	51	0,02		
	– S&P 500 E-mini W3 October 2022 Put 4,000,00, fällig 21.10.2022 — Bank of America Merrill Lynch	104	0,04		
2.600	USD Call/GBP Put 1,19, fällig 08.10.2022 — Morgan Stanley	74	0,03		
	286 USD Put/CAD Call 1,2653, fällig 12.10.2022 — Citi	–	–		
	286 USD Put/CAD Call 1,2670, fällig 12.10.2022 — Citi	–	–		
	590 USD Put/CAD Call 1,2670, fällig 08.10.2022 — Morgan Stanley	–	–		
	860 USD Put/CAD Call 1,2681, fällig 12.10.2022 — Citi	1	–		
	878 USD Put/CAD Call 1,27, fällig 15.10.2022 — Goldman Sachs	1	–		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinven- tarwert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinven- tarwert
Gekaufte Optionen — (Fortsetzung)					
2.340 USD Put/JPY Call 113,00, fällig 22.09.2022 — Morgan Stanley	–	–			
2.200 USD Put/MXN Call 20,6234, fällig 14.10.2022 — Citi	57	0,03			
Gekaufte Optionen insgesamt (Kosten 592\$)	545	0,22			
Credit Default Swaps — 0,01 % (28. Februar 2022: 0,03 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	23	0,01			
Index-Swaps — 0,14 % (28. Februar 2022: 0,01 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	346	0,14			
Inflationsswaps — 0,05 % (28. Februar 2022: 0,02 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	119	0,05			
Devisenterminkontrakte — 0,30 % (28. Februar 2022: 1,44 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	748	0,03			
Futures — (0,23 %) (28. Februar 2022: 0,21 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	576	0,23			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	247.316	99,70			
Kontrakte (in Tsd.)					
Geschriebene Optionen — (0,07 %) (28. Februar 2022: (0,05 %))					
– IMM Euro\$ December 2022 Call 96,50, fällig 19.12.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(6)	–			
– S&P 500 E-mini December 2022 Put 3,300.00, fällig 16.12.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(57)	(0,02)			
– S&P 500 E-mini W3 October 2022 Put 3,300.00, fällig 21.10.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(9)	–			
– S&P 500 E-mini W3 October 2022 Put 3,400.00, fällig 21.10.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(10)	(0,01)			
– S&P 500 E-mini W3 October 2022 Put 3,500.00, fällig 21.10.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(18)	(0,01)			
– S&P 500 E-mini W3 October 2022 Put 3,700.00, fällig 21.10.2022 — Bank of America Merrill Lynch	(11)	(0,01)			
(5.200) USD Call/GBP Put 1,15, fällig 08.10.2022 — Morgan Stanley	(57)	(0,02)			
Summe geschriebene Optionen (Kosten 175 USD)	(168)	(0,07)			
Inflationsswaps — (0,05 %) (28. Februar 2022: (0,01 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(124)	(0,05)			
Zinsswaps — (0,24 %) (28. Februar 2022: (0,15 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(579)	(0,24)			
Devisenterminkontrakte — (3,20 %) (28. Februar 2022: (1,95 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(7.945)	(3,20)			
Futures — (0,63 %) (28. Februar 2022: (0,60 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.564)	(0,63)			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(10.380)	(4,19)			
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	236.936	95,51			
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen					
				11.130	4,49
Gesamtnettvermögen					
				248.066\$	100,00
–	Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.				
144A	Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 135.556.000\$ und machten 54,62 % des Nettovermögens aus.				
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.				
†	Nicht liquide.				
∞	Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach Ermessen des Bewertungsausschusses.				
ε	Die Sicherheit ist zum 31. August 2022 (entweder Hauptsumme und/oder Zinsen) voreingestellt.				
β	Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Anleihenzins entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.				
γ	Aufgrund der Ungewissheit der Zinszahlungen werden während und/oder nach dem zum 31. August 2022 endenden Geschäftsjahr keine Erträge aus dem Wertpapier mehr gezahlt.				
ABKÜRZUNGEN:					
CPI	– Verbraucherpreisindex.				
Fortwährend	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.				
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.				
CAD	– Kanadischer Dollar				
EUR	– Euro				
GBP	– Britisches Pfund Sterling				
IDR	– Indonesische Rupiah				
JPY	– Japanischer Yen				
MXN	– Mexikanischer Peso				
RUB	– Russischer Rubel				
Analyse des Gesamtvermögens					
					% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					85,70
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden					7,32
Organismen für gemeinsame Anlagen					0,94
Finanzderivate					0,90
Sonstige Vermögenswerte					5,14
Gesamtvermögen					100,00

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit — Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % — Verkaufen	20.06.2027	6.907	\$ 23
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 107\$)				\$ 23
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 107\$)				\$ 23

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIE Banxico, Receive Fixed 7,450 %	18.07.2029	170.990	\$ (579)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (532)\$)				(579)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (532)\$)				\$ (579)

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20.11.2026	3.899	\$ 152
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,510 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2048	1.601	80
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,620 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.048	1.335	41
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,650 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.08.2047	2.726	73
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 30\$)				\$ 346
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				–
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 30\$)				\$ 346

Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	USD — VPI Städtische Verbraucher	18.11.2023	3.424	\$ 119
Bank of America Merrill Lynch	USD — VPI Städtische Verbraucher	18.11.2026	3.424	(124)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 70\$)				\$ 119
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (40)\$)				(124)
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 30\$)				\$ (5)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 9	Verkauf	GBP 8	\$ –
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 94	Verkauf	USD 112	(1)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 5.047	Verkauf	AUD 7.323	35
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 564	Verkauf	EUR 563	(2)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 351	Verkauf	GBP 296	6
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 23	Verkauf	USD 23	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 56.686	Verkauf	USD 57.922	(898)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CHF 2.078	Verkauf	USD 2.181	(53)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD 24.436	Verkauf	USD 18.989	(385)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD 7.323	Verkauf	USD 5.114	(102)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 131.138	Verkauf	USD 158.425	(6.038)
26.09.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD 271	Verkauf	JPY 32.543	37
10.11.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD 253	Verkauf	CAD 323	7
10.12.2022	Citi	Kauf	USD 613	Verkauf	CAD 782	17
17.10.2022	Citi	Kauf	USD 902	Verkauf	MXN 19.027	(34)
17.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD 376	Verkauf	CAD 481	10
18.10.2022	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD 31	Verkauf	EUR 30	–
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	USD 8.623	Verkauf	EUR 8.505	48
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	USD 391	Verkauf	JPY 50.980	23
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	USD 1.350	Verkauf	NOK 13.443	(4)
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	JPY 511.712	Verkauf	USD 3.782	(84)
18.10.2022	Citi	Kauf	USD 1.362	Verkauf	AUD 1.974	11
18.10.2022	Citi	Kauf	USD 2.621	Verkauf	CNH 17.660	62
18.10.2022	Citi	Kauf	USD 512	Verkauf	EUR 510	(2)
18.10.2022	Citi	Kauf	USD 3.547	Verkauf	IDR 53.594.130	(55)
18.10.2022	Citi	Kauf	USD –	Verkauf	NZD –	–
18.10.2022	Citi	Kauf	CAD 7.147	Verkauf	USD 5.513	(73)
18.10.2022	Citi	Kauf	AUD 5.555	Verkauf	USD 3.806	(2)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
18.10.2022	Citi	Kauf	IDR	5.033.440	Verkauf	USD	339	\$ –
18.10.2022	Citi	Kauf	IDR	39.526.760	Verkauf	USD	2.622	34
18.10.2022	Citi	Kauf	EUR	390	Verkauf	USD	389	5
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	188	Verkauf	BRL	1.053	(12)
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	5.430	Verkauf	GBP	4.505	192
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	MXN	54.030	Verkauf	USD	2.550	107
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	GBP	1.630	Verkauf	USD	1.922	(29)
18.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD	–	Verkauf	INR	2	–
18.10.2022	JP Morgan	Kauf	CNH	4.430	Verkauf	USD	640	2
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	446	Verkauf	GBP	380	4
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	2.858	Verkauf	IDR	42.927.894	(27)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	5.521	Verkauf	MXN	115.058	(135)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	774	Verkauf	MXN	15.650	5
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	CNH	3.910	Verkauf	USD	566	1
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	GBP	1.030	Verkauf	USD	1.207	(9)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	NOK	60.995	Verkauf	USD	6.049	93
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	MXN	33.250	Verkauf	USD	1.586	49
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 5.345\$)								\$ 748
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (7.240)\$)								(7.945)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.895)\$)								\$ (7.197)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	17	\$ 4.087	\$ (17)
90 Day Euro\$ Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	133	31.898	(544)
90 Day Euro\$ Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	342	82.307	(731)
Australia 10 Year Bond September 2022	Bank of America Merrill Lynch	20	1.642	4
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(166)	15
Long Gilt Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	34	4.263	(88)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(486)	(56.817)	493
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	40	5.008	(9)
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	253	52.707	(90)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(48)	(5.319)	4
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(44)	(5.977)	60
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	201	30.050	(85)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 774\$)				\$ 576
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (2.239)\$)				(1.564)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.465)\$)				\$ (988)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 13,29 % (28. Februar 2022: 19,51 %)					
1.190 Accredited Mortgage Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Klasse M5, 5,143 %, fällig 25.04.2035 *	1.194	0,18	2.587 Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-5, Serie 2005 5, Klasse MV2, 3,186 %, fällig 25.11.2035 *	2.331	0,35
25 AFC Trust Serie 2000-3, Serie 2000 3, Klasse 1A, 144A, 3,194 %, fällig 25.10.2030 *	23	–	120 SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F LLC, Serie 2017 F, Klasse R1, 144A, 0,000 %, fällig 25.01.2041	2.032	0,31
2.390 BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Serie 1996 1, Klasse B1, 7,875 %, fällig 10.10.2026	117	0,02	– Southern Pacific Secured Assets Corp, Serie 1998 1, Klasse A7, 6,510 %, fällig am 25.12.2027 *	–	–
760 Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Serie 2007 B, Klasse 1A2, 7,331 %, fällig am 28.08.2047	656	0,10	881 Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Klasse A, 144A, 2,675 %, fällig 28.02.2033	811	0,12
1.244 Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Serie 2007 B, Klasse 1A3, 7,719 %, fällig am 28.08.2047	339	0,05	4.426 Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Klasse B, 144A, 3,821 %, fällig 28.02.2033	4.072	0,62
100 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Serie 2005 CL1, Klasse A1, 1,817 %, fällig 25.09.2034 *	96	0,01	3.360 Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, Serie 2005 9XS, Klasse M2, 3,419 %, fällig 25.06.2035 *	3.303	0,50
3.751 Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Serie 2016 1A, Klasse B, 144A, 5,682 %, fällig 16.12.2041	3.038	0,46	1.609 Structured Asset Securities Corp Trust 2005-SC1, Serie 2005 SC1, Klasse 1A1, 144A, 2,714 %, fällig 25.05.2031 *	1.194	0,18
4.211 Citigroup Mortgage Loan Trust Inc, Serie 2006 WFH2, Klasse M3, 2,909 %, fällig 25.08.2036 *	3.761	0,57	4.814 Sunnova Sol Issuer LLC, Serie 2020 1A, Klasse B, 144A, 5,540 %, fällig am 01.02.2055	4.224	0,64
5.540 Conesco Finance Securitizations Corp, Serie 2000 3, Klasse A, 144A, 8,260 %, fällig am 01.12.2030 *	1.688	0,26	Asset-Backed Securities insgesamt (Kosten 104.496 USD)	87.947	13,29
867 Countrywide Asset-Backed Certificates, Serie 2007 SD1, Klasse A1, 144A, 3,344 %, fällig 25.03.2047 *	736	0,11	Forderungsbesicherte Wertpapiere — 79,51 % (28. Februar 2022: 73,99 %)		
1.263 Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC, Serie 2007 MX1, Klasse A4, 144A, 6,231 %, fällig am 25.12.2036	1.259	0,19	471 Alternative Loan Trust 2005-56, Serie 2005 56, Klasse 4A1, 3,064 %, fällig 25.11.2035 *	426	0,06
1.888 CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-9, Serie 2004 9, Klasse MF2, 5,572 %, fällig 25.11.2034 *	1.721	0,26	444 Alternative Loan Trust 2005-59, Serie 2005 59, Klasse 1A1, 3,028 %, fällig am 20.11.2035 *	401	0,06
889 CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2004-B, Serie 2004 B, Klasse 2A, 2,611 %, fällig 15.02.2029 *	842	0,13	1.240 Alternative Loan Trust 2005-80CB, Serie 2005 80CB, Klasse 2A1, 6,000 %, fällig 25.02.2036	1.193	0,18
1.694 Dividend Solar Loans 2018-1 LLC, Serie 2018 1, Klasse D, 144A, 6,390 %, fällig 20.07.2038	1.587	0,24	2.224 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A14, 6,000 %, fällig am 25.08.2036 *	1.482	0,22
3.406 Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Serie 2018 2, Klasse D, 144A, 5,910 %, fällig 20.12.2038	3.131	0,47	566 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A15, 6,000 %, fällig am 25.08.2036 *	377	0,06
4.869 Fieldstone Mortgage Investment Trust Serie 2005-2, Serie 2005 2, Klasse M3, 3,224 %, fällig 25.12.2035 *	4.468	0,67	579 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A16, 6,000 %, fällig am 25.08.2036 *	386	0,06
4 First Franklin Mortgage Loan Trust 2002-FF1, Serie 2002 FF1, Klasse 1A2, 3,498 %, fällig 25.04.2032 *	4	–	656 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A20, 22,538 %, fällig 25.08.2036 *	578	0,09
6.793 Fremont Home Loan Trust 2006-B, Serie 2006 B, Klasse 1A, 2,594 %, fällig 25.08.2036 *	2.950	0,45	634 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A24, 6,000 %, fällig am 25.08.2036 *	422	0,06
2.435 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Serie 2021 4GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.07.2048	1.993	0,30	807 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A3, 6,000 %, fällig 25.08.2036 *	537	0,08
2.967 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2022-1, Serie 2022 1GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.01.2049	2.520	0,38	86 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A7, 6,000 %, fällig am 25.08.2036 *	57	0,01
3.365 HERO Funding Trust 2016-1, Serie 2016 1A, Klasse R, 144A, 0,000 %, fällig 20.09.2041	491	0,07	384 Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A8, 6,000 %, fällig am 25.08.2036 *	256	0,04
500 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Klasse E, 144A, 5,337 %, fällig 16.06.2036 *	461	0,07	4.859 Alternative Loan Trust 2006-28CB, Serie 2006 28CB, Klasse A12, 3,456 %, fällig am 25.10.2036 **	828	0,13
2.650 Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Serie INABS 2005-B, Serie 2005 B, Klasse M6, 3,509 %, fällig 25.08.2035 *	2.490	0,38	973 Alternative Loan Trust 2007-23CB, Serie 2007 23CB, Klasse A8, 18,625 %, fällig 25.09.2037 *	1.006	0,15
2.392 Home Partners of America 2021-2 Trust, Serie 2021 2, Klasse F, 144A, 3,799 %, fällig am 17.12.2026	2.070	0,31	6.586 Alternative Loan Trust 2007-5CB, Serie 2007 5CB, Klasse 1A20, 3,016 %, fällig 25.04.2037	1.035	0,16
1.517 Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Serie 2021 1GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.01.2048	1.260	0,19	2.500 Ashford Hospitality Trust 2018-KEYS, Serie 2018 KEYS, Klasse C, 144A, 4,242 %, fällig 15.06.2035 *	2.423	0,37
2.502 Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Serie 2021 2GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.03.2048	1.963	0,30	3.215 BAML Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Serie 2016 GG10, Klasse AJA, 144A, 6,035 %, fällig am 10.08.2045 *	964	0,15
1.282 Loanpal Solar Loan Ltd, Serie 2020 3GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.12.2047	1.016	0,15	1.497 Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Serie 2015 R4, Klasse 4A2, 144A, 4,500 %, fällig 27.01.2030 *	1.493	0,23
33 Long Beach Mortgage Loan Trust 2002-2, Serie 2002 2, Klasse M2, 4,059 %, fällig 25.07.2032 *	32	–	3.846 Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Serie 2015 R4, Klasse 4A3, 144A, 7,800 %, fällig 27.01.2030 *	1.314	0,20
4.749 Magnolia Finance BV, 3,114 %, fällig 09.08.2024	4.643	0,70	6.000 BBCCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Klasse F, 144A, 4,715 %, fällig 10.08.2033 *	5.170	0,78
87 Mastr Specialized Loan Trust, Serie 2006 2, Klasse A, 144A, 2,964 %, fällig 25.02.2036 *	84	0,01	897 BCAP LLC 2011-RR2 Trust, Serie 2011 RR2, Klasse 1A4, 144A, 2,983 %, fällig 26.07.2036 *	463	0,07
4 Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust Serie 2003-SD1, Serie 2003 SD1, Klasse A1, 3,444 %, fällig 25.03.2033 *	4	–	6.123 BCAP LLC 2014-RR2, Serie 2014 RR2, Klasse 10A2, 144A, 2,679 %, fällig 26.07.2046 *	5.714	0,86
1.318 Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, Serie 2018 1A, Klasse CERT, 144A, 0,000 %, fällig 22.06.2043 ∞	769	0,12	962 BCAP LLC Trust 2007-AA3, Serie 2007 AA3, Klasse 1A2, 2,984 %, fällig 25.04.2037 *	1.193	0,18
3.000 National Collegiate II Commutation Trust, Serie 2005 AR15, Klasse AR15, 0,000 %, fällig am 01.06.2045	513	0,08	1.420 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-AC6, Serie 2004 AC6, Klasse A1, 5,750 %, fällig 25.11.2034	1.243	0,19
1.370 National Collegiate Student Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Klasse B, 2,824 %, fällig am 26.03.2035 *	1.218	0,18	1.053 Bellemeade Re 2017-1 Ltd, Serie 2017 1, Klasse M2, 144A, 5,794 %, fällig 25.10.2027 *	1.056	0,16
10.796 National Collegiate Student Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse B, 2,944 %, fällig 27.07.2037 *	8.032	1,21	2.442 Bellemeade Re 2018-1 Ltd, Serie 2018 1A, Klasse M2, 144A, 5,344 %, fällig 25.04.2028 *	2.451	0,37
5.987 National Collegiate V Commutation Trust, Serie 2007 33A5, Klasse 1O, 144A, 0,000 %, fällig 25.03.2038 *	1.804	0,27	6.676 Bellemeade Re 2018-3 Ltd, Serie 2018 3A, Klasse B1, 144A, 6,344 %, fällig 25.10.2028 *	6.507	0,99
6.140 National Collegiate V Commutation Trust, Serie 2007 33A6, Klasse 1O, 144A, 0,000 %, fällig 25.03.2038 *	1.775	0,27	5.810 Bellemeade Re 2018-3 Ltd, Serie 2018 3A, Klasse M2, 144A, 5,194 %, fällig 25.10.2028 *	5.712	0,86
4.734 NRZ Excess Spread-Collateralized Notes, Serie 2021 FHT1, Klasse A, 144A, 3,104 %, fällig am 25.07.2026	4.286	0,65	14.000 BHMS 2018-MZB, Serie 2018 MZB, Klasse MZB, 144A, 9,028 %, fällig 15.07.2025 *	13.559	2,05
1.256 Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Klasse 3A4, 5,860 %, fällig am 25.01.2037	1.226	0,19	3.500 BX Trust 2018-GW MZ, Serie 2018 GWMZ, Klasse MC, 144A, 7,879 %, fällig 15.05.2037 *	3.428	0,52
902 Ownit Mortgage Loan Trust Serie 2005-3, Serie 2005 3, Klasse M1, 3,119 %, fällig 25.06.2036 *	784	0,12	1.750 BX Trust 2018-GW, Serie 2018 GW, Klasse G, 144A, 5,311 %, fällig 15.05.2035 *	1.675	0,25
1.031 PFGA Home Equity Investment Trust, Serie 2003 IFC6, Klasse A, 144A, 4,767 %, fällig am 22.04.2035 *	1.044	0,16	2.250 BX Trust 2021-VIEW, Serie 2021 VIEW, Klasse D, 144A, 5,291 %, fällig 15.06.2036 *	2.152	0,33
2.549 Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-2, Serie 2005 2, Klasse M2, 6,217 %, fällig 25.04.2035	1.892	0,29	870 BX Trust 2021-VIEW, Serie 2021 VIEW, Klasse E, 144A, 5,991 %, fällig 15.06.2036 *	825	0,12
			1.027 Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Serie 2004-4, Serie 2004 4A, Klasse B1, 144A, 1,877 %, fällig am 25.10.2035 *	740	0,11

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
332 Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Serie 2005-1, Serie 2005 1A, Klasse A2, 144A, 2,644 %, fällig am 25.01.2036 *	301	0,05	3.663 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C02, Klasse 1B, 14,694 %, fällig 25.09.2028 *	4.131	0,62
517 Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Serie 2005-B, Serie 2005 BA, Klasse B1, 144A, 2,844 %, fällig am 25.06.2036 *	439	0,07	2.941 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C03, Klasse 1B, 14,194 %, fällig 25.10.2028 *	3.270	0,49
436 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2004-25, Serie 2004 25, Klasse 2A1, 3,124 %, fällig am 25.02.2035 *	381	0,06	4.877 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C04, Klasse 1B, 12,694 %, fällig 25.01.2029 *	5.262	0,79
420 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11, Serie 2005 11, Klasse 3A3, 2,655 %, fällig am 25.04.2035 *	321	0,05	7.169 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C06, Klasse 1B, 11,694 %, fällig 25.04.2029 *	7.517	1,14
549 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11, Serie 2005 11, Klasse 6A1, 3,044 %, fällig am 25.04.2035 *	402	0,06	2.550 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C05, Klasse 1B1, 6,044 %, fällig 25.01.2030 *	2.580	0,39
214 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-25, Serie 2005 25, Klasse A15, 16,910 %, fällig am 25.04.2035 *	159	0,02	4.000 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C06, Klasse 1B1, 6,594 %, fällig 25.02.2030 *	4.128	0,62
923 Citicorp Mortgage Securities Trust Serie 2007-3, Serie 2007 3, Klasse 1A4, 6,000 %, fällig 25.04.2037	865	0,13	3.210 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C07, Klasse 1B1, 6,444 %, fällig 25.05.2030 *	3.281	0,50
9.200 Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Serie 2006 AR6, Klasse 2A4, 2,884 %, fällig am 25.09.2036 *	3.157	0,48	2.060 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Klasse 1B1, 6,194 %, fällig 25.10.2030 *	2.075	0,31
773 Citigroup Mortgage Loan Trust 2008-3, Serie 2008 3, Klasse A3, 144A, 6,100 %, fällig 25.04.2037	360	0,05	1.088 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C05, Klasse 1B1, 6,694 %, fällig 25.01.2031 *	1.137	0,17
3.529 Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-J2, Serie 2014 J2, Klasse B5, 144A, 3,780 %, fällig 25.11.2044 *	2.779	0,42	7.750 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C06, Klasse 1B1, 6,194 %, fällig 25.03.2031 *	7.707	1,16
3.250 COLT 2021-RPL1 Trust, Serie 2021 RPL1, Klasse B1, 144A, 4,811 %, fällig am 25.09.2061 *	2.915	0,44	1.854 Fannie Mae REMICS, Serie 2017 85, Klasse SC, 3,756 %, fällig am 25.11.2047 *	206	0,03
1.908 Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, Serie 2014 UBS2, Klasse E, 144A, 5,146 %, fällig 10.03.2047 *	1.574	0,24	3.590 Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Serie 2021 MN2, Klasse M2, 144A, 5,533 %, fällig 25.07.2041 *	3.134	0,47
5.801 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Serie 2019 R05, Klasse 1B1, 144A, 6,544 %, fällig 25.10.2039 *	5.851	0,88	6.605 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K038, Klasse X3, 2,568 %, fällig 25.06.2042 *	245	0,04
8.330 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Klasse 1B1, 144A, 5,844 %, fällig 25.10.2039 *	8.180	1,24	19.370 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K052, Klasse X3, 1,670 %, fällig 25.01.2044 *	874	0,13
8.760 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Klasse 1B1, 144A, 5,283 %, fällig 25.12.2041 *	8.214	1,24	6.000 Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, Serie 2020 DNA1, Klasse B2, 144A, 7,694 %, fällig am 25.01.2050 *	5.316	0,80
105 Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Serie 2005 C2, Klasse AMFX, 4,877 %, fällig 15.04.2037	104	0,01	8.000 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Serie 2020 DNA2, Klasse B2, 144A, 7,244 %, fällig am 25.02.2050 *	7.126	1,08
335 CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Serie 2004-AR5, Serie 2004 AR5, Klasse CB2, 2,966 %, fällig 25.06.2034 *	259	0,04	5.530 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Serie 2021 DNA5, Klasse B2, 144A, 7,683 %, fällig 25.01.2034 *	4.773	0,72
12.200 CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse E, 144A, 4,373 %, fällig am 15.09.2037	9.652	1,46	7.520 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Klasse B2, 144A, 9,683 %, fällig 25.07.2049 *	7.160	1,08
9.200 CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse F, 144A, 4,373 %, fällig am 15.09.2037	6.679	1,01	4.620 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA1, Serie 2019 DNA1, Klasse B2, 144A, 13,194 %, fällig 25.01.2049 *	5.167	0,78
4.373 CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Klasse B1, 144A, 2,958 %, fällig 25.07.2057 *	3.617	0,55	2.250 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA2, Serie 2019 DNA2, Klasse B2, 144A, 12,944 %, fällig 25.03.2049 *	2.483	0,38
5.017 CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Klasse B2, 144A, 2,958 %, fällig 25.07.2057 *	3.788	0,57	4.600 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Serie 2019 DNA3, Klasse B1, 144A, 5,694 %, fällig 25.07.2049 *	4.514	0,68
4.266 CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Klasse B3, 144A, 2,958 %, fällig 25.07.2057 *	2.751	0,42	3.100 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Serie 2019 DNA3, Klasse B2, 144A, 10,594 %, fällig 25.07.2049 *	3.222	0,49
4.387 CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Klasse B4, 144A, 2,958 %, fällig 25.07.2057 *	881	0,13	5.550 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Serie 2019 DNA4, Klasse B2, 144A, 8,694 %, fällig 25.10.2049 *	5.424	0,82
2.301 CSMC 2017-RPL3 Trust, Serie 2017 RPL3, Klasse B3, 144A, 4,352 %, fällig 01.08.2057 *	2.244	0,34	4.000 Freddie Mac Stacr Trust 2019-FTR4, Serie 2019 FTR4, Klasse B2, 144A, 7,444 %, fällig 25.11.2047 *	3.488	0,53
6.207 CSMC 2017-RPL3 Trust, Serie 2017 RPL3, Klasse B4, 144A, 4,352 %, fällig 01.08.2057 *	5.890	0,89	4.932 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA1, Klasse B, 12,444 %, fällig 25.07.2028 *	5.190	0,78
7.859 CSMC Mortgage-Backed Trust 2006-7, Serie 2006 7, Klasse 11A2, 4,056 %, fällig 25.08.2036 **	1.668	0,25	2.510 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA2, Klasse B, 12,944 %, fällig 25.10.2028 *	2.675	0,40
104 CSMC Resecuritization Trust 2006-1R, Serie 2006 1R, Klasse 1A2, 144A, 12,668 %, fällig 27.07.2036 *	135	0,02	2.548 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA3, Klasse B, 13,694 %, fällig 25.12.2028 *	2.781	0,42
4.623 CSMC Serie 2015-2R, Serie 2015 2R, Klasse 7A2, 144A, 2,740 %, fällig 27.08.2036 *	3.657	0,55	5.494 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA4, Klasse B, 11,044 %, fällig 25.03.2029 *	5.514	0,83
4.282 CSMC Trust 2013-IVR5, Serie 2013 IVR5, Klasse B5, 144A, 3,629 %, fällig 25.10.2043 *	3.253	0,49	6.923 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 DNA2, Klasse B2, 13,694 %, fällig 25.10.2029 *	7.111	1,07
5.900 CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Klasse H, 144A, 9,741 %, fällig 15.07.2032 *	5.056	0,76	6.402 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 HRP1, Klasse B2D, 5,444 %, fällig 25.12.2042 *	4.226	0,64
343.916 CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse AX1, 144A, 0,086 %, fällig am 25.02.2048 *	815	0,12	5.499 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2018 SPI1, Klasse B, 144A, 3,763 %, fällig 25.02.2048 *	4.345	0,66
4.396 CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse B5, 144A, 3,586 %, fällig am 25.02.2048 *	3.168	0,48	5.880 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2018 SPI2, Klasse B, 144A, 3,841 %, fällig 25.05.2048 *	4.626	0,70
8.649 CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse B6, 144A, 3,586 %, fällig am 25.02.2048 *	5.774	0,87	6.864 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2018 SPI3, Klasse B, 144A, 4,158 %, fällig 25.08.2048 *	5.594	0,85
- CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse SA, 144A, 0,000 %, fällig 25.02.2048	-	-	28.533 FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Serie 2018 SB48, Klasse B, 144A, 3,812 %, fällig 25.02.2038 *	23.681	3,58
4.000 CSWF 2018-TOP, Serie 2018 TOP, Klasse H, 144A, 5,804 %, fällig 15.08.2035 *	3.813	0,58	726 Government National Mortgage Association, Serie 2010 102, Klasse IO, 0,010 %, fällig 16.06.2052 *	-	-
603 DSLA Mortgage Loan Trust 2004-AR4, Serie 2004 AR4, Klasse 2A2B, 3,206 %, fällig 19.01.2045 *	398	0,06	3.935 Government National Mortgage Association, Serie 2010 13, Klasse IO, 0,000 %, fällig 16.11.2051 *	-	-
1.550 DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR3, Serie 2005 AR3, Klasse 2A1B, 2,846 %, fällig 19.07.2045 *	1.483	0,22	3.904 Government National Mortgage Association, Serie 2011 127, Klasse IO, 0,068 %, fällig am 16.03.2047 *	6	-
2.434 DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR5, Serie 2005 AR5, Klasse 2A1B, 3,046 %, fällig 19.09.2045 *	2.028	0,31	14.055 Government National Mortgage Association, Serie 2011 95, Klasse IO, 0,000 %, fällig am 16.04.2051 *	1	-
487 DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Klasse 2A1B, 2,546 %, fällig 19.04.2047 *	546	0,08	9.401 Government National Mortgage Association, Serie 2012 114, Klasse IO, 0,618 %, fällig am 16.01.2053 *	156	0,02
5.331 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C01, Klasse 1B, 14,194 %, fällig 25.08.2028 *	5.921	0,89	3.563 Government National Mortgage Association, Serie 2013 163, Klasse IO, 1,019 %, fällig am 16.02.2046 *	66	0,01
			5.927 Government National Mortgage Association, Serie 2014 16, Klasse IO, 0,469 %, fällig am 16.06.2055 *	97	0,01
			7.577 Government National Mortgage Association, Serie 2014 171, Klasse IO, 0,445 %, fällig am 16.11.2055 *	92	0,01
			849 Government National Mortgage Association, Serie 2014 47, Klasse IA, 0,145 %, fällig am 16.02.2048 *	6	-

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
3.618	102	0,02	15 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-15, Serie 2004 15, Klasse 6A1, 2,774 %, fällig 25.12.2034 *	14	–
740	128	0,02	1.883 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-6, Serie 2004 6, Klasse B1, 3,216 %, fällig 25.07.2034 *	1.773	0,27
730	82	0,01	1.225 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-8, Serie 2004 8, Klasse B1, 3,510 %, fällig 25.09.2034 *	1.095	0,17
3.625	351	0,05	749 MASTR Reperforming Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Klasse 1A1, 144A, 6,000 %, fällig 25.08.2034	527	0,08
26.388	7.429	1,12	893 MASTR Reperforming Loan Trust 2005-2, Serie 2005 2, Klasse 1A1F, 144A, 2,794 %, fällig 25.05.2035 *	492	0,07
1.250	911	0,14	379 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Klasse AJ, 5,450 %, fällig am 12.08.2048 *	188	0,03
4.994	594	0,09	187 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Klasse AJFL, 144A, 5,450 %, fällig 12.08.2048 *	92	0,01
89	80	0,01	5.000 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32, Serie 2016 C32, Klasse D, 144A, 3,396 %, fällig 15.12.2049 *	3.817	0,58
50	49	0,01	1.796 Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-11AR, Serie 2004 11AR, Klasse 1B1, 3,044 %, fällig 25.01.2035 *	1.455	0,22
254	204	0,03	3.411 Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-8AR, Serie 2006 8AR, Klasse 1A3, 2,764 %, fällig 25.06.2036 *	846	0,13
432	397	0,06	559 Multifamily Trust 2016-1, Serie 2016 1, Klasse B, 144A, 11,197 %, fällig 25.04.2046 *	581	0,09
229	218	0,03	5.308 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse D, 144A, 4,544 %, fällig 15.08.2036 *	4.763	0,72
2.267	2.020	0,31	4.870 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse E, 144A, 4,544 %, fällig 15.08.2036 *	4.147	0,63
498	457	0,07	3.000 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2022-JERI, Serie 2022 JERI, Klasse G, 144A, 9,765 %, fällig 15.01.2039 *	2.885	0,44
952	897	0,14	3.830 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-4, Serie 2016 4A, Klasse B5, 144A, 4,773 %, fällig am 25.11.2056 *	3.575	0,54
1.756	1.594	0,24	3.000 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Serie 2021 NQM3, Klasse B2, 144A, 4,051 %, fällig 27.11.2056 *	2.331	0,35
745	703	0,11	3.914 Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Serie 2015 4R, Klasse 4A7, 144A, 3,359 %, fällig 26.03.2037 *	3.873	0,59
1.190	1.083	0,16	450 Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Serie 2006 1, Klasse M1, 2,999 %, fällig 25.04.2036 *	1.604	0,24
1.268	1.248	0,19	3.447 PMT Credit Risk Transfer Trust 2019-3R, Serie 2019 3R, Klasse A, 144A, 5,193 %, fällig 27.10.2022 *	3.440	0,52
375	370	0,06	3.757 PMT Credit Risk Transfer Trust 2020-1R, Serie 2020 1R, Klasse A, 144A, 4,843 %, fällig am 27.02.2023 *	3.717	0,56
640	340	0,05	3.902 PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Serie 2021 1R, Klasse A, 144A, 5,344 %, fällig am 27.02.2024 *	3.822	0,58
675	499	0,08	668 RALI Serie 2006-QA2 Trust, Serie 2006 QA2, Klasse 1A1, 2,509 %, fällig 25.02.2036 *	446	0,07
1.805	1.441	0,22	8.205 RBSCG Mortgage Loan Trust 2007-A, Serie 2007 A, Klasse 3A1, 2,794 %, fällig 25.01.2037 *	1.458	0,22
9.650	9.465	1,43	13.116 Redwood Funding Trust 2019-1, Serie 2019 1, Klasse PT, 144A, 4,468 %, fällig 27.09.2024	12.854	1,94
2.250	2.083	0,31	1.236 Reperforming Loan REMIC Trust 2006-R2, Serie 2006 R2, Klasse AF1, 144A, 2,864 %, fällig 25.07.2036 *	1.191	0,18
28.545	3	–	3.642 Residential Asset Securitization Trust 2006-A7CB, Serie 2006 A7CB, Klasse 1A3, 6,250 %, fällig 25.07.2036	3.066	0,46
4.022	3.719	0,56	13.041 Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Serie 2017 4, Klasse B, 144A, 0,000 %, fällig 25.06.2057 †	2.640	0,40
1.800	1.690	0,26	19.945 Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Serie 2017 4, Klasse BIO, 144A, 4,362 %, fällig 25.06.2057 †	3.289	0,50
6.574	5.089	0,77	4.411 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Klasse B, 144A, 0,000 %, fällig 25.09.2055 †	1.148	0,17
6.867	5.180	0,78	8.218 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Klasse BIO, 144A, 0,886 %, fällig 25.09.2055 †	942	0,14
1.075	927	0,14	3.782 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Klasse M2, 144A, 3,750 %, fällig 25.09.2055 *	3.480	0,53
4.000	3.939	0,60	53.484 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Klasse XSIO, 144A, 0,075 %, fällig 25.09.2055 †	148	0,02
3.850	1.439	0,22	12.989 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-2, Serie 2017 2, Klasse B, 144A, 0,000 %, fällig 25.08.2056 †	2.940	0,44
10.214	57	0,01	22.023 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-2, Serie 2017 2, Klasse BIO, 144A, 1,049 %, fällig 25.08.2056 †	2.351	0,36
11.385	59	0,01	431.823 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-2, Serie 2017 2, Klasse XSIO, 144A, 0,075 %, fällig 25.08.2056 †	1.496	0,23
1.952	1.604	0,24	3.250 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-3, Serie 2017 3, Klasse M2, 144A, 4,750 %, fällig 25.07.2056 *	3.058	0,46
2.728	2.013	0,30	2.937 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-1, Serie 2018 1, Klasse M, 4,750 %, fällig 25.05.2057 *	2.776	0,42
5.420	3.662	0,55	11.496 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-2, Serie 2018 2, Klasse BX, 2,708 %, fällig 25.11.2057 *	4.452	0,67
			16.188 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-3, Serie 2018 3, Klasse BX, 144A, 0,878 %, fällig 25.08.2057 *	6.255	0,94
			2.630 STACR Trust 2018-DNA3, Serie 2018 DNA3, Klasse B1, 144A, 6,344 %, fällig 25.09.2048 *	2.661	0,40
			3.000 STACR Trust 2018-DNA3, Serie 2018 DNA3, Klasse B2, 144A, 10,194 %, fällig 25.09.2048 *	3.092	0,47
			650 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Klasse D, 144A, 5,892 %, fällig 15.11.2027 *	26	–
			14.332 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Klasse E, 144A, 6,792 %, fällig am 15.11.2027 †	–	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekarisch gesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
342 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Serie 2004 2, Klasse 1A1, 3,330 %, fällig 25.03.2034 *	327	0,05	Futures — (0,08 %) (28. Februar 2022: 0,05 %)		
580 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Serie 2005 8XS, Klasse M1, 3,089 %, fällig am 25.04.2035 *	557	0,08	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
3.618 Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR5, Serie 2006 AR5, Klasse 4A1, 2,884 %, fällig 25.05.2046 *	1.141	0,17	507	0,08	
59 Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR6, Serie 2006 AR6, Klasse 1A1, 2,804 %, fällig 25.07.2046 *	50	0,01	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
3.900 Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Serie 2018 2, Klasse B2, 144A, 3,308 %, fällig 25.03.2058 *	3.381	0,51	662.537	100,10	
7.118 Towd Point Mortgage Trust 2018-4, Serie 2018 4, Klasse B2, 144A, 3,245 %, fällig 25.06.2058 *	5.342	0,81	Devisenterminkontrakte — (0,25 %) (28. Februar 2022: (0,33 %))		
4.000 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-NYCH, Serie 2018 NYCH, Klasse F, 144A, 6,212 %, fällig 15.02.2032 *	3.633	0,55	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
2.000 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-NYCH, Serie 2018 NYCH, Klasse G, 144A, 7,229 %, fällig 15.02.2032 *	1.792	0,27	(1.629)	(0,25)	
3.427 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR11 Trust, Serie 2005 AR11, Klasse B1, 3,359 %, fällig am 25.08.2045 *	2.893	0,44	Futures — (0,01 %) (28. Februar 2022: (0,20 %))		
654 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR15 Trust, Serie 2005 AR15, Klasse A1C4, 3,244 %, fällig am 25.11.2045 *	358	0,05	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
1.109 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR9 Trust, Serie 2005 AR9, Klasse B1, 3,389 %, fällig am 25.07.2045 *	867	0,13	(35)	(0,01)	
1.343 Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Serie 2015 SBC5, Klasse B, 144A, 8,103 %, fällig 14.09.2022 *	1.037	0,16	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
1.252 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22, Serie 2014 C22, Klasse D, 144A, 4,056 %, fällig 15.09.2057 *	1.074	0,16	(1.664)	(0,26)	
Summe Mortgage-Backed Securities (Anschaffungskosten 640.949 USD)	526.315	79,51	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
			660.873	99,84	
			Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
			1.053	0,16	
			Gesamtnettovermögen		
			661.926\$	100,00	
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 432.538.000\$ und machten 65,38 % des Nettovermögens aus.					
* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.					
† Nicht liquide.					
∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach Ermessen des Bewertungsausschusses.					
Schuldscheindarlehen — 4,30 % (28. Februar 2022: 2,76 %)					
30.000 American Dream, –, fällig am 29.06.2024 *†∞	8.976	1,36	ABKÜRZUNGEN:		
1.613 Freehand Hotel, 6,123 %, fällig am 17.12.2024 *†∞	1.605	0,24	REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.	
2.935 Freehand Hotel, 6,123 %, fällig am 17.12.2024 *†∞	2.919	0,44			
5.452 Freehand Hotel, 6,123 %, fällig am 17.12.2024 *†∞	5.424	0,82			
9.592 Sono Retail Loan, 5,638 %, fällig am 06.09.2022 *†∞	9.506	1,44			
Summe Schuldverschreibungen (Kosten 49.490 USD)	28.430	4,30	Analyse des Gesamtvermögens		
			% des Gesamtvermögens		
			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
			92,30		
			Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden		
			4,27		
			Organismen für gemeinsame Anlagen		
			2,91		
			Finanzderivate		
			0,08		
			Sonstige Vermögenswerte		
			0,44		
			Gesamtvermögen		
			100,00		
Organismen für gemeinsame Anlagen — 2,92 % (28. Februar 2022: 3,43 %)					
19.337 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	19.337	2,92			
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 19.337\$)	19.337	2,92			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 814.272\$)					
662.029 100,02					
Devisenterminkontrakte — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,02 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)					
1 –					

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	JPY 5.897.797 Verkauf	USD 43.886 \$ (1.381)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 568 Verkauf	USD 686 (26)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 13.543 Verkauf	USD 13.838 (214)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 98 Verkauf	USD 98 1
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CHF 294 Verkauf	USD 309 (8)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 203\$)				\$ 1
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (3.513))\$				(1.629)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (3.310))\$				\$ (1.628)

Aufstellung der Terminkontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch (221)	(25.837)\$	\$ 219
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch (284)	(35.553)	288
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch 20	2.717	(21)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch 34	5.083	(14)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 502\$)			
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (2.083))\$			
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.581))\$			
\$ 472			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 1,61 % (28. Februar 2022: 1,75 %)					
1.221 DB Master Finance LLC, Serie 2021 1A, Klasse A23, 144A, 2,791 %, fällig am 20.11.2051	994	0,09	507 Fannie Mae Pool '836398', 2,551 %, fällig 01.10.2035 *	528	0,05
2.709 Hardee's Funding LLC, Serie 2020 1A, Klasse A2, 144A, 3,981 %, fällig 20.12.2050	2.422	0,22	7 Fannie Mae Pool '836852', 2,480 %, fällig 01.10.2035 *	7	–
2.000 HGI CRE CLO 2021-FL2 Ltd, Serie 2021 FL2, Klasse A, 144A, 3,387 %, fällig 17.09.2036 *	1.930	0,17	8 Fannie Mae Pool '843823', 2,595 %, fällig am 01.11.2035 *	9	–
2.794 Home Partners of America 2021-3 Trust, Serie 2021 3, Klasse A, 144A, 2,200 %, fällig am 17.01.2041	2.484	0,22	93 Fannie Mae Pool '843997', 2,477 %, fällig am 01.11.2035 *	96	0,01
2.419 Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Serie 2021 2GS, Klasse B, 144A, 2,790 %, fällig 20.03.2048	1.977	0,18	23 Fannie Mae Pool '865915', 2,622 %, fällig am 01.03.2036 *	23	–
1.500 MF1 2021-FL6 Ltd, Serie 2021 FL6, Klasse A, 144A, 3,477 %, fällig 16.07.2036 *	1.451	0,13	146 Fannie Mae Pool '888218', 5,000 %, fällig 01.03.2037	152	0,01
2.570 MF1 2021-FL7 Ltd, Serie 2021 FL7, Klasse A, 144A, 3,457 %, fällig 16.10.2036 *	2.478	0,22	11 Fannie Mae Pool '889117', 5,000 %, fällig am 01.10.2035	12	–
791 Navient Student Loan Trust 2016-3, Serie 2016 3A, Klasse A3, 144A, 3,794 %, fällig 25.06.2065 *	788	0,07	241 Fannie Mae Pool '890345', 5,000 %, fällig 01.06.2041	252	0,02
849 SBA Small Business Investment Cos, Serie 2018 10B, Klasse 1, 3,548 %, fällig am 10.09.2028	827	0,07	602 Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, fällig am 01.10.2044	615	0,06
1.350 SMB Private Education Loan Trust 2015-C, Serie 2015 C, Klasse C, 144A, 4,500 %, fällig 17.09.2046	1.279	0,12	17 Fannie Mae Pool '902663', 6,000 %, fällig am 01.11.2036	18	–
1.491 Store Master Funding I-VII XIV XIX XX, Serie 2021 1A, Klasse A3, 144A, 2,860 %, fällig am 20.06.2051	1.299	0,12	3 Fannie Mae Pool '909856', 6,000 %, fällig 01.03.2037	3	–
Asset-Backed Securities insgesamt (Kosten 19.912 USD)	17.929	1,61	185 Fannie Mae Pool '934231', 5,000 %, fällig 01.01.2039	192	0,02
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 98,63 % (28. Februar 2022: 95,73 %)					
64.009 BANK 2017-BNK8, Serie 2017 BNK8, Klasse XA, 0,843 %, fällig 15.11.2050 *	1.908	0,17	77 Fannie Mae Pool '961907', 5,000 %, fällig 01.03.2038	81	0,01
2.400 BANK 2018-BNK10, Serie 2018 BN10, Klasse A5, 3,688 %, fällig 15.02.2061	2.314	0,21	547 Fannie Mae Pool '962687', 5,000 %, fällig 01.04.2038	571	0,05
2.210 Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Serie 2018 B1, Klasse A5, 3,666 %, fällig 15.01.2051 *	2.127	0,19	8 Fannie Mae Pool '973013', 4,500 %, fällig 01.03.2038	8	–
4.050 BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Klasse A, 144A, 3,641 %, fällig am 15.07.2035 *	3.935	0,35	1 Fannie Mae Pool '974763', 4,500 %, fällig 01.04.2038	1	–
3.870 BXMT 2020-FL2 Ltd, Serie 2020 FL2, Klasse A, 144A, 3,311 %, fällig am 15.02.2038 *	3.826	0,35	15 Fannie Mae Pool '981766', 4,500 %, fällig 01.04.2038	16	–
34.032 CD 2017-CD6 Mortgage Trust, Serie 2017 CD6, Klasse XA, 1,029 %, fällig 13.11.2050 *	1.035	0,09	4 Fannie Mae Pool '995072', 5,000 %, fällig am 01.08.2038	5	–
499 COLT 2021-RPL1 Trust, Serie 2021 RPL1, Klasse A1, 144A, 1,665 %, fällig am 25.09.2061 *	461	0,04	542 Fannie Mae Pool '995948', 5,000 %, fällig 01.03.2039	567	0,05
2.252 CSMC 2021-NQM8, Serie 2021 NQM8, Klasse A1, 144A, 1,841 %, fällig 25.10.2066 *	1.993	0,18	65 Fannie Mae Pool 'AA8438', 4,500 %, fällig 06.01.2039	67	0,01
1.311 Fannie Mae Interest Strip 406, Klasse 2, 4,000 %, fällig 25.02.2041	227	0,02	66 Fannie Mae Pool 'AB0129', 5,000 %, fällig 01.01.2035	69	0,01
310 Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 9, 5,000 %, fällig 25.02.2041 *	52	–	35 Fannie Mae Pool 'AB2725', 5,500 %, fällig 04.01.2041	37	–
700 Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse C10, 5,000 %, fällig 25.01.2038	122	0,01	1.021 Fannie Mae Pool 'AB3882', 4,500 %, fällig 11.01.2041	1.043	0,09
425 Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C13, 3,500 %, fällig am 25.11.2041	67	0,01	402 Fannie Mae Pool 'AB5692', 4,000 %, fällig am 01.06.2042	401	0,04
2.322 Fannie Mae Interest Strip 417, Klasse C5, 3,500 %, fällig 25.02.2043	360	0,03	59 Fannie Mae Pool 'AB7668', 3,000 %, fällig 01.01.2043	55	–
5.490 Fannie Mae Interest Strip 418, Klasse C15, 3,500 %, fällig 25.08.2043	955	0,09	149 Fannie Mae Pool 'AB8144', 5,000 %, fällig 04.01.2037	156	0,01
6.800 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 % ±	6.074	0,55	213 Fannie Mae Pool 'AB9107', 3,500 %, fällig 04.01.2033	211	0,02
5.400 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 % ±	5.146	0,46	33 Fannie Mae Pool 'AC2389', 5,000 %, fällig 02.01.2037	34	–
– Fannie Mae Pool '252875', 8,000 %, fällig 01.11.2029	–	–	11 Fannie Mae Pool 'AD3336', 5,500 %, fällig 04.01.2040	11	–
– Fannie Mae Pool '253184', 8,000 %, fällig 01.04.2030	–	–	13 Fannie Mae Pool 'AD3796', 5,000 %, fällig 04.01.2040	14	–
– Fannie Mae Pool '253399', 8,500 %, fällig 01.08.2030	–	–	3 Fannie Mae Pool 'AD4567', 5,500 %, fällig 04.01.2040	3	–
– Fannie Mae Pool '253438', 8,500 %, fällig 01.09.2030	–	–	5 Fannie Mae Pool 'AD4598', 5,500 %, fällig 05.01.2040	5	–
1 Fannie Mae Pool '253598', 8,500 %, fällig 01.12.2030	1	–	11 Fannie Mae Pool 'AD4614', 5,500 %, fällig 06.01.2040	11	–
90 Fannie Mae Pool '254793', 5,000 %, fällig am 01.07.2033	92	0,01	7 Fannie Mae Pool 'AD8281', 5,500 %, fällig 07.01.2040	7	–
5.310 Fannie Mae Pool '387771', 3,790 %, fällig 01.08.2028	5.282	0,47	46 Fannie Mae Pool 'AD8326', 5,500 %, fällig 07.01.2040	47	–
– Fannie Mae Pool '535270', 8,500 %, fällig 01.04.2030	–	–	77 Fannie Mae Pool 'AD8642', 5,500 %, fällig 08.01.2040	80	0,01
10 Fannie Mae Pool '535299', 7,500 %, fällig 01.05.2030	10	–	65 Fannie Mae Pool 'AD9893', 5,500 %, fällig 07.01.2040	68	0,01
1 Fannie Mae Pool '535332', 8,500 %, fällig 01.04.2030	1	–	12 Fannie Mae Pool 'AE0758', 7,000 %, fällig 02.01.2039	14	–
– Fannie Mae Pool '535351', 8,000 %, fällig 01.06.2030	–	–	33 Fannie Mae Pool 'AH5036', 5,500 %, fällig 02.01.2041	34	–
– Fannie Mae Pool '535435', 8,500 %, fällig 01.08.2030	–	–	15 Fannie Mae Pool 'AH9785', 5,500 %, fällig 04.01.2041	16	–
– Fannie Mae Pool '535608', 9,500 %, fällig 01.04.2030	–	–	26 Fannie Mae Pool 'AI9532', 5,500 %, fällig 09.01.2041	26	–
4 Fannie Mae Pool '535996', 7,500 %, fällig 01.06.2031	4	–	16 Fannie Mae Pool 'AJ2033', 5,500 %, fällig 10.01.2041	16	–
– Fannie Mae Pool '537715', 8,500 %, fällig 01.09.2030	–	–	28 Fannie Mae Pool 'AJ4713', 4,500 %, fällig 11.01.2041	28	–
22 Fannie Mae Pool '545189', 7,500 %, fällig 01.08.2031	23	–	47 Fannie Mae Pool 'AL0521', 5,000 %, fällig 06.01.2041	49	–
20 Fannie Mae Pool '545190', 7,500 %, fällig 01.08.2031	21	–	109 Fannie Mae Pool 'AL1051', 4,500 %, fällig 09.01.2041	111	0,01
1 Fannie Mae Pool '545612', 8,000 %, fällig 01.04.2032	2	–	585 Fannie Mae Pool 'AL1469', 7,000 %, fällig 02.01.2039	656	0,06
2 Fannie Mae Pool '545990', 7,500 %, fällig 01.04.2031	2	–	264 Fannie Mae Pool 'AL1470', 7,000 %, fällig 04.01.2037	291	0,03
– Fannie Mae Pool '546591', 8,500 %, fällig 01.06.2030	–	–	3.912 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, fällig 01.01.2043	3.823	0,34
2 Fannie Mae Pool '548965', 8,500 %, fällig 01.07.2030	2	–	34 Fannie Mae Pool 'AL3026', 3,500 %, fällig 12.01.2042	34	–
10 Fannie Mae Pool '555676', 7,500 %, fällig 01.12.2032	11	–	1.439 Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, fällig am 01.05.2040	1.570	0,14
110 Fannie Mae Pool '555743', 5,000 %, fällig am 01.09.2033	114	0,01	135 Fannie Mae Pool 'AL4741', 4,500 %, fällig 01.01.2044	137	0,01
22 Fannie Mae Pool '735578', 5,000 %, fällig 01.06.2035	23	–	5.360 Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000 %, fällig 05.01.2045	5.381	0,48
17 Fannie Mae Pool '745248', 7,500 %, fällig 01.08.2034	18	–	909 Fannie Mae Pool 'AL7877', 4,000 %, fällig 12.01.2045	905	0,08
495 Fannie Mae Pool '745580', 5,000 %, fällig 01.06.2036	517	0,05	982 Fannie Mae Pool 'AL8991', 3,000 %, fällig 08.01.2035	946	0,08
129 Fannie Mae Pool '745802', 6,000 %, fällig 01.07.2036	139	0,01	113 Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, fällig am 01.11.2046	111	0,01
11 Fannie Mae Pool '745959', 5,500 %, fällig am 01.11.2036	11	–	479 Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930 %, fällig am 01.06.2030	454	0,04
164 Fannie Mae Pool '836390', 5,000 %, fällig am 01.10.2035	171	0,02	181 Fannie Mae Pool 'AN4677', 3,200 %, fällig 02.01.2029	175	0,02
			289 Fannie Mae Pool 'AN4927', 3,450 %, fällig am 01.03.2029	284	0,03
			333 Fannie Mae Pool 'AN5386', 3,250 %, fällig am 01.05.2029	324	0,03
			4.610 Fannie Mae Pool 'AN8048', 3,080 %, fällig 01.01.2028	4.480	0,40
			116 Fannie Mae Pool 'AO4102', 4,000 %, fällig am 01.06.2042	116	0,01
			393 Fannie Mae Pool 'AP9766', 4,000 %, fällig 10.01.2042	391	0,04
			1.201 Fannie Mae Pool 'AQ6295', 3,500 %, fällig 12.01.2032	1.163	0,10
			70 Fannie Mae Pool 'AQ7130', 3,500 %, fällig 12.01.2032	68	0,01
			300 Fannie Mae Pool 'AQ7270', 3,500 %, fällig 12.01.2032	289	0,03
			306 Fannie Mae Pool 'AQ7306', 3,000 %, fällig 01.01.2043	288	0,03
			368 Fannie Mae Pool 'AQ7864', 3,500 %, fällig 12.01.2032	356	0,03
			120 Fannie Mae Pool 'AQ7869', 3,500 %, fällig 11.01.2032	115	0,01
			145 Fannie Mae Pool 'AQ7913', 3,500 %, fällig 12.01.2032	140	0,01
			236 Fannie Mae Pool 'AQ8677', 3,500 %, fällig 12.01.2032	228	0,02
			89 Fannie Mae Pool 'AR1198', 3,000 %, fällig 01.01.2043	83	0,01
			308 Fannie Mae Pool 'AR1202', 3,000 %, fällig 01.01.2043	290	0,03
			163 Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, fällig 06.01.2043	154	0,01
			371 Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, fällig am 01.07.2043	352	0,03
			591 Fannie Mae Pool 'AS0462', 3,500 %, fällig 09.01.2033	581	0,05
			213 Fannie Mae Pool 'AS0469', 4,000 %, fällig 09.01.2033	214	0,02
			128 Fannie Mae Pool 'AS1281', 3,500 %, fällig 12.01.2033	127	0,01
			3.669 Fannie Mae Pool 'AS4347', 4,000 %, fällig 01.01.2045	3.673	0,33
			1.685 Fannie Mae Pool 'AS4363', 4,500 %, fällig 02.01.2045	1.735	0,16
			457 Fannie Mae Pool 'AS6340', 3,500 %, fällig am 01.12.2045	443	0,04
			877 Fannie Mae Pool 'AS6396', 3,500 %, fällig am 01.12.2045	850	0,08
			323 Fannie Mae Pool 'AS6541', 3,500 %, fällig 01.01.2046	313	0,03
			246 Fannie Mae Pool 'AS6562', 3,500 %, fällig 01.01.2046	239	0,02

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Forderungenbesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
266 Fannie Mae Pool 'AS9453', 4,000 %, fällig 04.01.2047	264	0,02	174 Fannie Mae Pool 'BR5577', 2,000 %, fällig 03.01.2051	150	0,01
166 Fannie Mae Pool 'AS9760', 4,500 %, fällig 06.01.2047	167	0,01	596 Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000 %, fällig 03.01.2051	518	0,05
286 Fannie Mae Pool 'AT2486', 3,500 %, fällig 06.01.2033	281	0,03	83 Fannie Mae Pool 'BR5589', 2,000 %, fällig 03.01.2051	72	0,01
3.336 Fannie Mae Pool 'AT3070', 3,500 %, fällig 04.01.2043	3.248	0,29	967 Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000 %, fällig 03.01.2051	837	0,08
76 Fannie Mae Pool 'AU4395', 4,000 %, fällig 10.01.2033	77	0,01	698 Fannie Mae Pool 'BR5634', 2,000 %, fällig 03.01.2051	603	0,05
42 Fannie Mae Pool 'AU4397', 4,000 %, fällig 10.01.2033	42	-	903 Fannie Mae Pool 'BR5649', 2,000 %, fällig 03.01.2051	782	0,07
369 Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, fällig 01.10.2043	350	0,03	173 Fannie Mae Pool 'BR6462', 2,000 %, fällig 03.01.2051	150	0,01
78 Fannie Mae Pool 'AU7248', 4,000 %, fällig 10.01.2033	78	0,01	174 Fannie Mae Pool 'BR6515', 2,000 %, fällig 04.01.2051	151	0,01
88 Fannie Mae Pool 'AU9562', 4,000 %, fällig 10.01.2033	88	0,01	440 Fannie Mae Pool 'BR6768', 2,500 %, fällig 06.01.2051	396	0,04
137 Fannie Mae Pool 'AU9567', 4,000 %, fällig 10.01.2033	140	0,01	86 Fannie Mae Pool 'BR7744', 2,000 %, fällig 04.01.2051	74	0,01
97 Fannie Mae Pool 'AU9570', 4,000 %, fällig 10.01.2033	98	0,01	81 Fannie Mae Pool 'BR7745', 2,000 %, fällig 04.01.2051	70	0,01
15 Fannie Mae Pool 'AV6366', 4,500 %, fällig 01.01.2044	15	-	221 Fannie Mae Pool 'BR8276', 2,500 %, fällig 04.01.2051	199	0,02
24 Fannie Mae Pool 'AV7116', 4,500 %, fällig 03.01.2044	24	-	84 Fannie Mae Pool 'BR8478', 2,000 %, fällig 04.01.2051	73	0,01
81 Fannie Mae Pool 'AV7681', 3,500 %, fällig 01.01.2034	80	0,01	81 Fannie Mae Pool 'BR8518', 2,000 %, fällig 04.01.2051	71	0,01
203 Fannie Mae Pool 'AV7683', 3,500 %, fällig 01.01.2034	201	0,02	298 Fannie Mae Pool 'BR9104', 2,500 %, fällig 05.01.2051	270	0,02
243 Fannie Mae Pool 'AV7694', 3,500 %, fällig 01.01.2034	238	0,02	1.060 Fannie Mae Pool 'BT0122', 2,500 %, fällig 06.01.2051	949	0,09
313 Fannie Mae Pool 'AV7696', 3,500 %, fällig 01.01.2034	310	0,03	550 Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500 %, fällig 07.01.2051	494	0,04
3.558 Fannie Mae Pool 'AY1321', 3,500 %, fällig 03.01.2035	3.533	0,32	722 Fannie Mae Pool 'BT3244', 2,500 %, fällig 07.01.2051	649	0,06
2.552 Fannie Mae Pool 'AZ9645', 4,000 %, fällig 09.01.2035	2.578	0,23	641 Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500 %, fällig 08.01.2051	577	0,05
2.693 Fannie Mae Pool 'BF0144', 3,500 %, fällig 10.01.2056	2.611	0,23	372 Fannie Mae Pool 'BT3290', 2,500 %, fällig 08.01.2051	334	0,03
754 Fannie Mae Pool 'BF0145', 3,500 %, fällig 03.01.2057	729	0,07	277 Fannie Mae Pool 'BT3303', 2,500 %, fällig 08.01.2051	250	0,02
2.284 Fannie Mae Pool 'BF0161', 4,500 %, fällig 10.01.2046	2.375	0,21	3.246 Fannie Mae Pool 'BT9482', 2,500 %, fällig 12.01.2051	2.913	0,26
4.625 Fannie Mae Pool 'BF0162', 5,000 %, fällig 11.01.2045	4.808	0,43	17.842 Fannie Mae Pool 'BU0971', 2,000 %, fällig 11.01.2051	15.493	1,39
1.011 Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, fällig 06.01.2057	993	0,09	958 Fannie Mae Pool 'BU2599', 2,500 %, fällig 01.01.2052	863	0,08
1.884 Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500 %, fällig 09.01.2057	1.932	0,17	1.467 Fannie Mae Pool 'BU2630', 2,000 %, fällig 02.01.2052	1.265	0,11
1.260 Fannie Mae Pool 'BF0263', 3,500 %, fällig 05.01.2058	1.225	0,11	3.309 Fannie Mae Pool 'BU2838', 2,500 %, fällig 11.01.2051	2.976	0,27
2.334 Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, fällig 08.01.2058	2.393	0,21	88 Fannie Mae Pool 'BU3608', 3,000 %, fällig 11.01.2051	82	0,01
795 Fannie Mae Pool 'BF0338', 4,500 %, fällig 01.01.2059	816	0,07	94 Fannie Mae Pool 'BU5925', 3,000 %, fällig 12.01.2051	88	0,01
2.220 Fannie Mae Pool 'BF0531', 2,500 %, fällig 05.01.2055	1.998	0,18	386 Fannie Mae Pool 'BU9129', 2,000 %, fällig 02.01.2052	333	0,03
180 Fannie Mae Pool 'BH6684', 4,000 %, fällig 08.01.2047	179	0,02	694 Fannie Mae Pool 'BV3167', 3,500 %, fällig 05.01.2052	668	0,06
95 Fannie Mae Pool 'BJ0685', 4,000 %, fällig 04.01.2048	95	0,01	96 Fannie Mae Pool 'BV5073', 4,500 %, fällig 07.01.2052	96	0,01
1.222 Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, fällig 12.01.2037	1.171	0,11	489 Fannie Mae Pool 'BV5389', 3,000 %, fällig 04.01.2052	454	0,04
347 Fannie Mae Pool 'BJ2763', 4,500 %, fällig 05.01.2048	350	0,03	199 Fannie Mae Pool 'BV9499', 4,000 %, fällig 04.01.2052	195	0,02
29 Fannie Mae Pool 'BK0751', 3,500 %, fällig 03.01.2048	28	-	498 Fannie Mae Pool 'BW1954', 4,500 %, fällig 07.01.2052	498	0,04
475 Fannie Mae Pool 'BK4770', 4,500 %, fällig 08.01.2048	881	0,08	768 Fannie Mae Pool 'BW3446', 4,500 %, fällig 06.01.2052	765	0,07
830 Fannie Mae Pool 'BM1660', 4,000 %, fällig 08.01.2047	428	0,04	149 Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500 %, fällig 12.01.2047	144	0,01
1.540 Fannie Mae Pool 'BM3929', 3,500 %, fällig 07.01.2032	1.526	0,14	5.642 Fannie Mae Pool 'CA0917', 3,500 %, fällig 12.01.2047	5.455	0,49
1.133 Fannie Mae Pool 'BM4696', 3,000 %, fällig 03.01.2047	1.080	0,10	804 Fannie Mae Pool 'CA1218', 4,500 %, fällig 02.01.2048	805	0,07
200 Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, fällig 03.01.2043	195	0,02	1.390 Fannie Mae Pool 'CA1902', 4,500 %, fällig 06.01.2048	1.401	0,13
106 Fannie Mae Pool 'BM4781', 4,500 %, fällig 10.01.2048	107	0,01	606 Fannie Mae Pool 'CA5220', 3,000 %, fällig 02.01.2050	563	0,05
279 Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, fällig 12.01.2046	272	0,02	1.035 Fannie Mae Pool 'CA6000', 3,000 %, fällig 06.01.2050	964	0,09
2.188 Fannie Mae Pool 'BM4951', 4,500 %, fällig 09.01.2048	2.236	0,20	550 Fannie Mae Pool 'CA6053', 3,000 %, fällig 06.01.2050	512	0,05
859 Fannie Mae Pool 'BM5073', 3,000 %, fällig 04.01.2048	812	0,07	4.024 Fannie Mae Pool 'CA7257', 2,500 %, fällig 10.01.2050	3.639	0,33
137 Fannie Mae Pool 'BM5119', 4,500 %, fällig 12.01.2048	138	0,01	76 Fannie Mae Pool 'CA8955', 2,500 %, fällig 02.01.2051	68	0,01
1.396 Fannie Mae Pool 'BM6898', 2,149 %, fällig 01.02.2032 *	1.217	0,11	433 Fannie Mae Pool 'CA9358', 2,500 %, fällig 03.01.2041	397	0,04
695 Fannie Mae Pool 'BM6912', 2,500 %, fällig 01.01.2052	614	0,06	176 Fannie Mae Pool 'CB0100', 2,500 %, fällig 04.01.2041	161	0,01
107 Fannie Mae Pool 'BO2878', 3,000 %, fällig 11.01.2049	100	0,01	444 Fannie Mae Pool 'CB0101', 2,500 %, fällig 04.01.2041	407	0,04
164 Fannie Mae Pool 'BO8932', 3,000 %, fällig 01.01.2050	154	0,01	2.243 Fannie Mae Pool 'CB0102', 2,500 %, fällig 04.01.2041	2.047	0,18
3.331 Fannie Mae Pool 'BP0060', 3,000 %, fällig 01.01.2050	3.097	0,28	442 Fannie Mae Pool 'CB0114', 2,500 %, fällig 04.01.2041	404	0,04
849 Fannie Mae Pool 'BP2319', 3,000 %, fällig 02.01.2050	791	0,07	10.139 Fannie Mae Pool 'CB0414', 2,500 %, fällig 05.01.2051	9.076	0,82
694 Fannie Mae Pool 'BP3484', 2,500 %, fällig 06.01.2051	624	0,06	1.218 Fannie Mae Pool 'CB1666', 2,500 %, fällig 09.01.2051	1.095	0,10
1.094 Fannie Mae Pool 'BP6171', 3,500 %, fällig 04.01.2050	1.058	0,09	1.936 Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000 %, fällig 10.01.2051	1.797	0,16
733 Fannie Mae Pool 'BP8713', 3,000 %, fällig 08.01.2050	681	0,06	1.040 Fannie Mae Pool 'CB2113', 2,500 %, fällig 11.01.2041	949	0,09
65 Fannie Mae Pool 'BP9421', 3,000 %, fällig 07.01.2050	61	0,01	5.114 Fannie Mae Pool 'CB2164', 3,000 %, fällig 11.01.2051	4.779	0,43
696 Fannie Mae Pool 'BQ1150', 2,500 %, fällig 10.01.2050	627	0,06	3.194 Fannie Mae Pool 'CB2292', 3,000 %, fällig 11.01.2051	2.993	0,27
62 Fannie Mae Pool 'BQ1402', 3,000 %, fällig 08.01.2050	58	0,01	3.993 Fannie Mae Pool 'CB2869', 2,500 %, fällig 02.01.2052	3.570	0,32
1.267 Fannie Mae Pool 'BQ3719', 3,000 %, fällig 09.01.2050	1.179	0,11	754 Fannie Mae Pool 'CB2929', 3,000 %, fällig 02.01.2052	700	0,06
910 Fannie Mae Pool 'BQ5815', 2,500 %, fällig 11.01.2050	915	0,08	7.973 Fannie Mae Pool 'CB3031', 2,500 %, fällig 03.01.2052	7.129	0,64
338 Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500 %, fällig 11.01.2050	305	0,03	2.368 Fannie Mae Pool 'CB3044', 2,500 %, fällig 03.01.2052	2.130	0,19
279 Fannie Mae Pool 'BQ6652', 2,500 %, fällig 10.01.2051	251	0,02	398 Fannie Mae Pool 'CB3833', 3,000 %, fällig 06.01.2052	369	0,03
98 Fannie Mae Pool 'BQ7435', 2,500 %, fällig 09.01.2051	88	0,01	4.735 Fannie Mae Pool 'CB3918', 4,500 %, fällig 06.01.2052	4.728	0,42
1.375 Fannie Mae Pool 'BQ7453', 2,500 %, fällig 11.01.2051	1.230	0,11	993 Fannie Mae Pool 'CB4121', 4,000 %, fällig 07.01.2052	973	0,09
76 Fannie Mae Pool 'BQ9224', 2,000 %, fällig 01.01.2051	152	0,01	1.856 Fannie Mae Pool 'FM1002', 3,500 %, fällig 01.01.2048	1.794	0,16
169 Fannie Mae Pool 'BQ9226', 2,000 %, fällig 01.01.2051	146	0,01	81 Fannie Mae Pool 'FM1159', 4,500 %, fällig 02.01.2048	82	0,01
81 Fannie Mae Pool 'BR0001', 2,500 %, fällig 12.01.2050	72	0,01	962 Fannie Mae Pool 'FM1349', 3,500 %, fällig 03.01.2047	935	0,08
76 Fannie Mae Pool 'BR0757', 2,500 %, fällig 01.01.2051	68	0,01	72 Fannie Mae Pool 'FM1458', 4,500 %, fällig 04.01.2049	72	0,01
793 Fannie Mae Pool 'BR1001', 2,500 %, fällig 05.01.2051	716	0,06	6.756 Fannie Mae Pool 'FM1625', 4,000 %, fällig 09.01.2049	6.731	0,60
86 Fannie Mae Pool 'BR1823', 2,000 %, fällig 01.01.2051	75	0,01	1.198 Fannie Mae Pool 'FM1637', 4,500 %, fällig 05.01.2049	1.212	0,11
88 Fannie Mae Pool 'BR2303', 3,000 %, fällig 08.01.2051	82	0,01	217 Fannie Mae Pool 'FM2173', 4,000 %, fällig 09.01.2048	215	0,02
167 Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000 %, fällig 02.01.2051	145	0,01	2.168 Fannie Mae Pool 'FM2256', 4,500 %, fällig 10.01.2044	2.214	0,20
154 Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000 %, fällig 02.01.2051	134	0,01	481 Fannie Mae Pool 'FM2745', 4,500 %, fällig 03.01.2050	482	0,04
78 Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000 %, fällig 02.01.2051	68	0,01	1.760 Fannie Mae Pool 'FM2770', 3,500 %, fällig 04.01.2050	1.694	0,15
80 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, fällig 02.01.2051	70	0,01	80 Fannie Mae Pool 'FM3083', 4,500 %, fällig 10.01.2049	81	0,01
246 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, fällig 02.01.2051	214	0,02	227 Fannie Mae Pool 'FM3141', 3,500 %, fällig 11.01.2048	220	0,02
410 Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000 %, fällig 03.01.2051	357	0,03	291 Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000 %, fällig 11.01.2048	289	0,03
345 Fannie Mae Pool 'BR3290', 2,000 %, fällig 03.01.2051	298	0,03	1.818 Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500 %, fällig 05.01.2047	1.763	0,16
174 Fannie Mae Pool 'BR4035', 2,000 %, fällig 02.01.2051	150	0,01	2.158 Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000 %, fällig 09.01.2048	2.143	0,19
87 Fannie Mae Pool 'BR4080', 2,000 %, fällig 03.01.2051	75	0,01	83 Fannie Mae Pool 'FM3542', 4,000 %, fällig 05.01.2049	82	0,01
4.643 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, fällig 03.01.2051	4.014	0,36	1.208 Fannie Mae Pool 'FM3589', 4,500 %, fällig 02.01.2046	1.233	0,11
406 Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000 %, fällig 03.01.2051	351	0,03	209 Fannie Mae Pool 'FM3830', 3,000 %, fällig 04.01.2050	196	0,02
342 Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000 %, fällig 03.01.2051	297	0,03	5.120 Fannie Mae Pool 'FM4165', 3,000 %, fällig 09.01.2050	4.774	0,43
712 Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000 %, fällig 03.01.2051	616	0,06	108 Fannie Mae Pool 'FM4532', 3,000 %, fällig 09.01.2050	101	0,01
177 Fannie Mae Pool 'BR5458', 2,000 %, fällig 03.01.2051	153	0,01	722 Fannie Mae Pool 'FM4577', 2,500 %, fällig 10.01.2050	650	0,06
341 Fannie Mae Pool 'BR5487', 2,000 %, fällig 03.01.2051	295	0,03	397 Fannie Mae Pool 'FM5018', 2,500 %, fällig 12.01.2050	357	0,03
			2.157 Fannie Mae Pool 'FM5279', 3,500 %, fällig 11.01.2050	2.073	0,19
			5.270 Fannie Mae Pool 'FM5306', 2,000 %, fällig 12.01.2050	4.556	0,41

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Forderungenbesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
5.933 Fannie Mae Pool 'FM5307', 2,000 %, fällig 12.01.2050	5.126	0,46	986 Fannie Mae Pool 'FS2066', 4,000 %, fällig 06.01.2052	970	0,09
1.298 Fannie Mae Pool 'FM5423', 2,500 %, fällig 01.01.2051	1.168	0,10	1.351 Fannie Mae Pool 'FS2172', 4,500 %, fällig 06.01.2052	1.345	0,12
167 Fannie Mae Pool 'FM5434', 4,500 %, fällig 05.01.2046	170	0,02	7.600 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, fällig 06.01.2049	7.359	0,66
3.463 Fannie Mae Pool 'FM5592', 4,000 %, fällig 12.01.2050	3.410	0,31	10 Fannie Mae Pool 'MA0440', 5,500 %, fällig 05.01.2040	11	–
156 Fannie Mae Pool 'FM5713', 2,500 %, fällig 02.01.2051	140	0,01	27 Fannie Mae Pool 'MA0619', 5,500 %, fällig 11.01.2040	28	–
71 Fannie Mae Pool 'FM5743', 2,500 %, fällig 02.01.2051	64	0,01	5 Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, fällig 04.01.2031	6	–
133 Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, fällig 02.01.2051	120	0,01	13 Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, fällig 05.01.2031	13	–
313 Fannie Mae Pool 'FM5931', 2,500 %, fällig 02.01.2051	282	0,03	16 Fannie Mae Pool 'MA0766', 5,500 %, fällig 05.01.2041	17	–
300 Fannie Mae Pool 'FM6117', 3,000 %, fällig 11.01.2048	284	0,03	7 Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, fällig 06.01.2031	7	–
165 Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, fällig 03.01.2051	149	0,01	164 Fannie Mae Pool 'MA0823', 5,500 %, fällig 07.01.2041	172	0,02
268 Fannie Mae Pool 'FM6816', 2,500 %, fällig 04.01.2051	241	0,02	66 Fannie Mae Pool 'MA0867', 5,500 %, fällig 09.01.2041	69	0,01
7.691 Fannie Mae Pool 'FM7167', 4,500 %, fällig 08.01.2050	7.702	0,69	162 Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, fällig 11.01.2031	163	0,01
3.911 Fannie Mae Pool 'FM7210', 2,000 %, fällig 04.01.2051	3.374	0,30	178 Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, fällig 12.01.2031	179	0,02
16.563 Fannie Mae Pool 'FM7382', 3,000 %, fällig 05.01.2051	15.384	1,38	34 Fannie Mae Pool 'MA0968', 4,500 %, fällig 12.01.2031	35	–
2.586 Fannie Mae Pool 'FM7518', 2,500 %, fällig 06.01.2051	2.322	0,21	200 Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500 %, fällig 09.01.2042	195	0,02
261 Fannie Mae Pool 'FM7529', 3,000 %, fällig 05.01.2051	244	0,02	11 Fannie Mae Pool 'MA1221', 4,500 %, fällig 09.01.2042	11	–
2.208 Fannie Mae Pool 'FM7556', 3,500 %, fällig 05.01.2051	2.136	0,19	49 Fannie Mae Pool 'MA1363', 3,000 %, fällig 02.01.2043	46	–
319 Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, fällig 06.01.2051	287	0,03	1.537 Fannie Mae Pool 'MA1393', 4,000 %, fällig 03.01.2043	1.530	0,14
89 Fannie Mae Pool 'FM7676', 2,500 %, fällig 06.01.2051	80	0,01	333 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, fällig 09.01.2043	338	0,03
86 Fannie Mae Pool 'FM7694', 3,000 %, fällig 06.01.2051	80	0,01	256 Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500 %, fällig 10.01.2043	260	0,02
262 Fannie Mae Pool 'FM7727', 2,500 %, fällig 06.01.2051	237	0,02	166 Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500 %, fällig 11.01.2043	168	0,02
339 Fannie Mae Pool 'FM7741', 2,500 %, fällig 05.01.2051	304	0,03	224 Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500 %, fällig 12.01.2043	227	0,02
1.074 Fannie Mae Pool 'FM7750', 2,000 %, fällig 05.01.2051	929	0,08	466 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, fällig 03.01.2036	448	0,04
950 Fannie Mae Pool 'FM7869', 2,500 %, fällig 01.01.2051	857	0,08	449 Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, fällig 12.01.2036	432	0,04
1.150 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, fällig 07.01.2051	1.034	0,09	6.015 Fannie Mae Pool 'MA4031', 4,500 %, fällig 05.01.2050	6.023	0,54
910 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, fällig 07.01.2051	821	0,07	708 Fannie Mae Pool 'MA4204', 2,000 %, fällig 12.01.2040	629	0,06
810 Fannie Mae Pool 'FM8025', 2,500 %, fällig 07.01.2051	731	0,07	430 Fannie Mae Pool 'MA4387', 2,000 %, fällig 07.01.2041	380	0,03
337 Fannie Mae Pool 'FM8166', 3,000 %, fällig 06.01.2051	317	0,03	3.001 Fannie Mae Pool 'MA4570', 2,000 %, fällig 03.01.2042	2.645	0,24
253 Fannie Mae Pool 'FM8171', 3,000 %, fällig 06.01.2051	235	0,02	1.065 Fannie Mae REMICS, Serie 2010 2, Klasse AI, 5,500 %, fällig 25.02.2040	182	0,02
1.841 Fannie Mae Pool 'FM8188', 3,000 %, fällig 03.01.2040	1.768	0,16	1.013 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 124, Klasse SD, 3,706 %, fällig 25.11.2042 *	140	0,01
3.617 Fannie Mae Pool 'FM8189', 3,000 %, fällig 08.01.2038	3.483	0,31	1.471 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 22, Klasse SM, 4,056 %, fällig 25.03.2042 *	192	0,02
1.385 Fannie Mae Pool 'FM8210', 3,000 %, fällig 04.01.2050	1.296	0,12	685 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 9, Klasse PT, 11,428 %, fällig 25.07.2036 *	857	0,08
10.466 Fannie Mae Pool 'FM8415', 2,000 %, fällig 08.01.2051	9.029	0,81	850 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse BC, 6,500 %, fällig am 25.07.2042	932	0,08
1.628 Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000 %, fällig 02.01.2050	1.537	0,14	4.098 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse CB, 5,500 %, fällig am 25.04.2042	4.304	0,39
15.896 Fannie Mae Pool 'FM8685', 3,000 %, fällig 09.01.2051	14.754	1,33	6.781 Fannie Mae REMICS, Serie 2016 48, Klasse IA, 4,500 %, fällig 25.06.2038	1.010	0,09
3.058 Fannie Mae Pool 'FM8786', 2,500 %, fällig 10.01.2051	2.750	0,25	2.019 Fannie Mae REMICS, Serie 2017 74, Klasse PZ, 3,500 %, fällig 25.10.2047	1.849	0,17
461 Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, fällig 10.01.2051	415	0,04	3.998 Fannie Mae REMICS, Serie 2018 3, Klasse IO, 4,000 %, fällig 25.02.2048	761	0,07
91 Fannie Mae Pool 'FM8977', 2,500 %, fällig 09.01.2051	82	0,01	1.063 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 25, Klasse PI, 5,000 %, fällig 25.05.2048	211	0,02
524 Fannie Mae Pool 'FM9044', 3,000 %, fällig 10.01.2051	491	0,04	4.571 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 38, Klasse SH, 3,791 %, fällig 25.07.2049 *	548	0,05
94 Fannie Mae Pool 'FM9174', 2,000 %, fällig 10.01.2051	81	0,01	2.217 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 44, Klasse SM, 3,606 %, fällig 25.08.2049 *	355	0,03
7.375 Fannie Mae Pool 'FM9195', 2,500 %, fällig 10.01.2051	6.595	0,59	2.438 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 45, Klasse BS, 3,606 %, fällig 25.08.2049 *	305	0,03
2.834 Fannie Mae Pool 'FM9264', 2,000 %, fällig 10.01.2041	2.507	0,23	4.295 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 5, Klasse IO, 4,500 %, fällig 25.03.2049	841	0,08
1.947 Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000 %, fällig 11.01.2051	1.825	0,16	1.249 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 57, Klasse NS, 3,556 %, fällig 25.10.2049 *	164	0,01
185 Fannie Mae Pool 'FM9335', 2,500 %, fällig 10.01.2051	166	0,01	1.582 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 58, Klasse HS, 3,556 %, fällig 25.10.2049 *	189	0,02
3.089 Fannie Mae Pool 'FM9362', 3,000 %, fällig 06.01.2038	2.974	0,27	3.420 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 59, Klasse SH, 3,556 %, fällig 25.10.2049 *	432	0,04
17.391 Fannie Mae Pool 'FM9434', 2,000 %, fällig 11.01.2051	15.102	1,36	1.352 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 26, Klasse SA, 3,506 %, fällig 25.05.2050 *	167	0,01
2.765 Fannie Mae Pool 'FM9444', 2,500 %, fällig 10.01.2041	2.532	0,23	940 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 47, Klasse GZ, 2,000 %, fällig am 25.07.2050	645	0,06
5.890 Fannie Mae Pool 'FM9456', 3,500 %, fällig 11.01.2051	5.689	0,51	1.807 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 62, Klasse BI, 2,000 %, fällig 25.09.2050	235	0,02
7.147 Fannie Mae Pool 'FM9507', 3,000 %, fällig 03.01.2037	6.882	0,62	2.576 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 67, Klasse IH, 2,000 %, fällig 25.09.2050	335	0,03
16.399 Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, fällig 07.01.2051	14.195	1,28	162 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 74, Klasse EI, 2,500 %, fällig am 25.10.2050	26	–
1.108 Fannie Mae Pool 'FM9585', 2,500 %, fällig 11.01.2041	1.011	0,09	14.294 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 88, Klasse GI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	2.123	0,19
59 Fannie Mae Pool 'FM9673', 3,500 %, fällig 06.01.2049	57	0,01	1.120 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 89, Klasse DI, 2,500 %, fällig am 25.12.2050	167	0,01
8.516 Fannie Mae Pool 'FM9733', 2,500 %, fällig 10.01.2051	7.648	0,69	9.340 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 91, Klasse IO, 2,500 %, fällig 25.12.2050	1.421	0,13
52 Fannie Mae Pool 'FS0014', 3,500 %, fällig 01.01.2048	51	–	6.673 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 93, Klasse LI, 2,500 %, fällig am 25.01.2051	989	0,09
1.136 Fannie Mae Pool 'FS0028', 2,500 %, fällig 09.01.2051	1.022	0,09	26.760 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 42, Klasse NI, 2,500 %, fällig 25.11.2048	3.606	0,32
258 Fannie Mae Pool 'FS0041', 3,000 %, fällig 11.01.2050	242	0,02	8.215 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 46, Klasse BI, 2,500 %, fällig 25.12.2048	1.120	0,10
4.380 Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000 %, fällig 01.01.2052	4.069	0,37	5.717 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 49, Klasse GI, 2,500 %, fällig 25.10.2048	771	0,07
3.687 Fannie Mae Pool 'FS0352', 2,000 %, fällig 01.01.2052	3.180	0,29			
373 Fannie Mae Pool 'FS0408', 3,000 %, fällig 01.01.2052	350	0,03			
2.791 Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, fällig 01.01.2052	2.515	0,23			
268 Fannie Mae Pool 'FS0464', 2,000 %, fällig 01.01.2052	231	0,02			
750 Fannie Mae Pool 'FS0483', 3,500 %, fällig 01.01.2052	719	0,06			
2.439 Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000 %, fällig 02.01.2052	2.282	0,20			
2.888 Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500 %, fällig 02.01.2052	2.598	0,23			
477 Fannie Mae Pool 'FS0534', 2,500 %, fällig 07.01.2051	430	0,04			
2.501 Fannie Mae Pool 'FS0551', 2,500 %, fällig 02.01.2052	2.254	0,20			
1.757 Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, fällig 02.01.2052	1.583	0,14			
1.548 Fannie Mae Pool 'FS0583', 2,500 %, fällig 02.01.2052	1.392	0,12			
1.559 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 02.01.2052	1.347	0,12			
7.909 Fannie Mae Pool 'FS0605', 2,500 %, fällig 02.01.2052	7.097	0,64			
877 Fannie Mae Pool 'FS0612', 2,000 %, fällig 02.01.2052	760	0,07			
6.492 Fannie Mae Pool 'FS1107', 2,500 %, fällig 12.01.2051	5.842	0,52			
1.966 Fannie Mae Pool 'FS1186', 3,500 %, fällig 01.01.2050	1.891	0,17			
581 Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000 %, fällig 03.01.2052	551	0,05			
376 Fannie Mae Pool 'FS1403', 3,000 %, fällig 01.01.2045	357	0,03			
476 Fannie Mae Pool 'FS1539', 3,000 %, fällig 11.01.2048	451	0,04			
861 Fannie Mae Pool 'FS1553', 2,500 %, fällig 11.01.2050	775	0,07			
194 Fannie Mae Pool 'FS1624', 2,500 %, fällig 10.01.2051	174	0,02			
1.375 Fannie Mae Pool 'FS1628', 2,500 %, fällig 04.01.2052	1.240	0,11			
1.378 Fannie Mae Pool 'FS1877', 3,000 %, fällig 05.01.2052	1.278	0,11			
294 Fannie Mae Pool 'FS1924', 2,500 %, fällig 03.01.2051	264	0,02			
782 Fannie Mae Pool 'FS1938', 2,500 %, fällig 02.01.2052	702	0,06			
582 Fannie Mae Pool 'FS1950', 4,000 %, fällig 05.01.2052	570	0,05			
1.089 Fannie Mae Pool 'FS2061', 4,000 %, fällig 06.01.2052	1.073	0,10			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Forderungenbesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
1.290 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 54, Klasse KI, 2,500 %, fällig 25.05.2049	195	0,02	76.590 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K123, Klasse X1, 0,865 %, fällig 25.12.2030 *	3.821	0,34
9.892 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 59, Klasse TI, 2,500 %, fällig 25.09.2051	1.487	0,13	9.972 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K125, Klasse X1, 0,676 %, fällig 25.01.2031 *	385	0,03
1.592 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 61, Klasse KI, 2,500 %, fällig 25.04.2049	222	0,02	12.498 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K132, Klasse X1, 0,608 %, fällig 25.08.2031 *	458	0,04
6.053 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 85, Klasse IN, 2,500 %, fällig 25.02.2050	966	0,09	58.284 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K141, Klasse X1, 0,407 %, fällig 25.02.2032 *	1.468	0,13
14.038 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 91, Klasse IG, 2,500 %, fällig 25.01.2052	2.122	0,19	61.492 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K142, Klasse X1, 0,403 %, fällig 25.03.2032 *	1.498	0,13
11.342 Fannie Mae REMICS, Serie 2022 29, Klasse KZ, 1,500 %, fällig 25.06.2042	8.406	0,76	85.378 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K143, Klasse X1, 0,450 %, fällig 25.04.2055 *	2.414	0,22
461 Fannie Mae-Aces, Serie 2016 M11, Klasse AL, 2,944 %, fällig 25.07.2039	434	0,04	17.900 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K148, Klasse X1, 0,391 %, fällig 25.07.2032 *	418	0,04
15.822 Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M11, Klasse X1, 1,188 %, fällig 25.06.2029 *	857	0,08	28.488 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates KG06, Klasse X1, 0,626 %, fällig 25.10.2031 *	1.091	0,10
16.264 Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M13, Klasse X1, 0,964 %, fällig 25.06.2034 *	825	0,07	4.184 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Serie K 1515, Klasse X1, 1,637 %, fällig 25.02.2035 *	539	0,05
38.252 Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M14, Klasse X1, 0,700 %, fällig 25.06.2029 *	1.179	0,11	6.076 Freddie Mac Non Gold Pool '841075', 3,267 %, fällig 01.01.2049 *	5.917	0,53
5.460 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M11, Klasse IO, 1,872 %, fällig 25.01.2029 *	484	0,04	2.839 Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,008 %, fällig am 01.11.2048 *	2.757	0,25
34.115 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M16, Klasse X1, 0,540 %, fällig 25.04.2032 *	1.064	0,10	550 Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 2,874 %, fällig am 01.11.2047 *	538	0,05
5.606 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M24, Klasse X1, 1,823 %, fällig 25.01.2037 *	721	0,06	976 Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,084 %, fällig am 01.02.2050 *	956	0,09
16.606 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M31, Klasse X2, 1,373 %, fällig 25.12.2032 *	1.368	0,12	156 Freddie Mac Pool 'QA5768', 3,000 %, fällig am 01.01.2050	145	0,01
48 Freddie Mac Gold Pool 'A29586', 5,000 %, fällig am 01.01.2035	49	–	97 Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000 %, fällig am 01.01.2050	91	0,01
10 Freddie Mac Gold Pool 'A30703', 5,500 %, fällig am 12.01.2034	10	–	361 Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500 %, fällig am 01.02.2050	348	0,03
103 Freddie Mac Gold Pool 'A35950', 5,000 %, fällig am 07.01.2035	107	0,01	3.313 Freddie Mac Pool 'QA7256', 3,000 %, fällig am 02.01.2050	3.082	0,28
15 Freddie Mac Gold Pool 'A36526', 5,000 %, fällig am 08.01.2035	16	–	132 Freddie Mac Pool 'QA9685', 3,000 %, fällig am 05.01.2050	124	0,01
44 Freddie Mac Gold Pool 'A39036', 5,000 %, fällig am 05.01.2035	46	–	205 Freddie Mac Pool 'QA9686', 3,000 %, fällig am 05.01.2050	192	0,02
7 Freddie Mac Gold Pool 'A39302', 5,500 %, fällig am 11.01.2035	7	–	493 Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, fällig am 01.11.2050	446	0,04
– Freddie Mac Gold Pool 'A84166', 6,500 %, fällig am 01.01.2039	–	–	321 Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, fällig am 01.11.2050	289	0,03
1 Freddie Mac Gold Pool 'C00556', 8,000 %, fällig am 10.01.2027	1	–	80 Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000 %, fällig am 01.02.2051	69	0,01
– Freddie Mac Gold Pool 'C01025', 8,000 %, fällig am 07.01.2030	–	–	158 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig am 01.02.2051	137	0,01
– Freddie Mac Gold Pool 'C01051', 8,000 %, fällig am 09.01.2030	–	–	75 Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000 %, fällig am 01.02.2051	66	0,01
1 Freddie Mac Gold Pool 'C46047', 8,000 %, fällig am 12.01.2030	1	–	81 Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000 %, fällig am 01.03.2051	70	0,01
3 Freddie Mac Gold Pool 'C55319', 8,000 %, fällig am 08.01.2031	3	–	244 Freddie Mac Pool 'QB9484', 2,000 %, fällig am 01.03.2051	212	0,02
– Freddie Mac Gold Pool 'C57324', 8,000 %, fällig am 09.01.2031	–	–	171 Freddie Mac Pool 'QB9485', 2,000 %, fällig am 01.03.2051	149	0,01
3 Freddie Mac Gold Pool 'C91046', 6,500 %, fällig am 05.01.2027	3	–	91 Freddie Mac Pool 'QB9961', 2,000 %, fällig am 01.03.2051	78	0,01
1.148 Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000 %, fällig am 02.01.2038	1.101	0,10	77 Freddie Mac Pool 'QC0160', 2,000 %, fällig am 01.03.2051	67	0,01
1 Freddie Mac Gold Pool 'G00556', 8,000 %, fällig am 09.01.2026	1	–	85 Freddie Mac Pool 'QC0161', 2,000 %, fällig am 01.03.2051	73	0,01
1 Freddie Mac Gold Pool 'G00726', 8,000 %, fällig am 06.01.2027	1	–	189 Freddie Mac Pool 'QC0297', 2,000 %, fällig am 01.04.2051	163	0,01
– Freddie Mac Gold Pool 'G00931', 8,000 %, fällig am 11.01.2026	1	–	88 Freddie Mac Pool 'QC0885', 2,000 %, fällig am 01.04.2051	77	0,01
5 Freddie Mac Gold Pool 'G02427', 5,500 %, fällig am 12.01.2036	6	–	81 Freddie Mac Pool 'QC1164', 2,000 %, fällig am 01.04.2051	70	0,01
30 Freddie Mac Gold Pool 'G04581', 6,500 %, fällig am 08.01.2038	31	–	173 Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500 %, fällig am 05.01.2051	156	0,01
1 Freddie Mac Gold Pool 'G04947', 6,500 %, fällig am 04.01.2038	1	–	615 Freddie Mac Pool 'QC3242', 3,000 %, fällig am 06.01.2051	574	0,05
5 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, fällig am 09.01.2039	5	–	466 Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, fällig am 01.07.2051	420	0,04
112 Freddie Mac Gold Pool 'G07335', 7,000 %, fällig am 03.01.2039	123	0,01	894 Freddie Mac Pool 'QC4446', 2,500 %, fällig am 07.01.2051	803	0,07
253 Freddie Mac Gold Pool 'G07509', 6,500 %, fällig am 09.01.2039	276	0,02	458 Freddie Mac Pool 'QC4689', 2,500 %, fällig am 08.01.2051	413	0,04
988 Freddie Mac Gold Pool 'G08700', 4,500 %, fällig am 03.01.2046	1.002	0,09	463 Freddie Mac Pool 'QC4690', 2,500 %, fällig am 01.08.2051	417	0,04
193 Freddie Mac Gold Pool 'G16672', 3,000 %, fällig am 03.01.2033	187	0,02	365 Freddie Mac Pool 'QC4818', 2,500 %, fällig am 08.01.2051	328	0,03
1.423 Freddie Mac Gold Pool 'G60329', 5,500 %, fällig am 06.01.2040	1.511	0,14	557 Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, fällig am 08.01.2051	502	0,04
3.944 Freddie Mac Gold Pool 'G60344', 4,000 %, fällig am 12.01.2045	3.951	0,35	4.170 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, fällig am 08.01.2051	3.755	0,34
5.437 Freddie Mac Gold Pool 'G61814', 3,500 %, fällig am 09.01.2048	5.273	0,47	1.977 Freddie Mac Pool 'QC7411', 2,500 %, fällig am 09.01.2051	1.778	0,16
9.557 Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000 %, fällig am 10.01.2046	9.072	0,81	3.915 Freddie Mac Pool 'QC8573', 2,500 %, fällig am 10.01.2051	3.522	0,32
1 Freddie Mac Gold Pool 'H00790', 5,500 %, fällig am 05.01.2037	1	–	1.039 Freddie Mac Pool 'QD1347', 2,500 %, fällig am 11.01.2051	934	0,08
45 Freddie Mac Gold Pool 'H02425', 5,500 %, fällig am 02.01.2038	45	–	4.517 Freddie Mac Pool 'QD1596', 2,000 %, fällig am 12.01.2051	3.922	0,35
1 Freddie Mac Gold Pool 'H09170', 5,500 %, fällig am 01.01.2038	1	–	95 Freddie Mac Pool 'QD1954', 3,000 %, fällig am 11.01.2051	88	0,01
367 Freddie Mac Gold Pool 'J39722', 3,000 %, fällig am 10.01.2033	357	0,03	92 Freddie Mac Pool 'QD2260', 3,000 %, fällig am 12.01.2051	85	0,01
183 Freddie Mac Gold Pool 'J39962', 3,000 %, fällig am 12.01.2033	178	0,02	8.098 Freddie Mac Pool 'QD2419', 3,000 %, fällig am 12.01.2051	7.591	0,68
184 Freddie Mac Gold Pool 'Q26702', 4,000 %, fällig am 06.01.2044	184	0,02	281 Freddie Mac Pool 'QD4146', 2,500 %, fällig am 01.01.2052	253	0,02
1.580 Freddie Mac Gold Pool 'U69040', 4,000 %, fällig am 05.01.2045	1.575	0,14	579 Freddie Mac Pool 'QD5620', 2,000 %, fällig am 01.02.2052	500	0,04
67 Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, fällig am 10.01.2042	67	0,01	680 Freddie Mac Pool 'QD5628', 2,000 %, fällig am 01.02.2052	587	0,05
399 Freddie Mac Gold Pool 'U90378', 4,000 %, fällig am 11.01.2042	397	0,04	99 Freddie Mac Pool 'QD5827', 2,000 %, fällig am 01.02.2052	85	0,01
319 Freddie Mac Gold Pool 'U90436', 4,000 %, fällig am 11.01.2042	318	0,03	873 Freddie Mac Pool 'QD5960', 2,000 %, fällig am 01.02.2052	753	0,07
33 Freddie Mac Gold Pool 'U90598', 3,500 %, fällig am 12.01.2042	32	–	583 Freddie Mac Pool 'QD5961', 2,000 %, fällig am 01.02.2052	503	0,05
82 Freddie Mac Gold Pool 'U90608', 3,500 %, fällig am 12.01.2042	79	0,01	591 Freddie Mac Pool 'QD6009', 2,000 %, fällig am 01.01.2052	510	0,05
49 Freddie Mac Gold Pool 'U90768', 3,500 %, fällig am 01.01.2043	49	–	3.565 Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, fällig am 02.01.2052	3.213	0,29
65 Freddie Mac Gold Pool 'U90778', 3,500 %, fällig am 01.01.2043	64	0,01	2.624 Freddie Mac Pool 'QD6093', 2,000 %, fällig am 01.02.2052	2.263	0,20
98 Freddie Mac Gold Pool 'U90794', 3,500 %, fällig am 01.01.2043	95	0,01	296 Freddie Mac Pool 'QD6142', 2,500 %, fällig am 02.01.2052	266	0,02
148 Freddie Mac Gold Pool 'U90828', 3,500 %, fällig am 02.01.2043	143	0,01	198 Freddie Mac Pool 'QD6216', 3,000 %, fällig am 02.01.2052	184	0,02
164 Freddie Mac Gold Pool 'U90879', 3,500 %, fällig am 02.01.2043	160	0,01	291 Freddie Mac Pool 'QD7365', 2,000 %, fällig am 01.02.2052	252	0,02
114 Freddie Mac Gold Pool 'U90903', 3,500 %, fällig am 02.01.2043	117	0,01	496 Freddie Mac Pool 'QE1075', 3,000 %, fällig am 01.04.2052	460	0,04
131 Freddie Mac Gold Pool 'U91027', 3,500 %, fällig am 02.01.2043	127	0,01	681 Freddie Mac Pool 'QE1492', 3,500 %, fällig am 05.01.2052	654	0,06
4.171 Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500 %, fällig am 03.01.2045	4.054	0,36	396 Freddie Mac Pool 'QE4043', 3,000 %, fällig am 06.01.2052	367	0,03
2.225 Freddie Mac Gold Pool 'U99135', 4,000 %, fällig am 02.01.2044	2.218	0,20	200 Freddie Mac Pool 'QE5811', 4,000 %, fällig am 07.01.2052	196	0,02
58.185 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K065, Klasse X1, 0,810 %, fällig 25.04.2027 *	1.506	0,14	100 Freddie Mac Pool 'QE5825', 4,500 %, fällig am 07.01.2052	100	0,01
83.849 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K069, Klasse X1, 0,478 %, fällig 25.09.2027 *	1.321	0,12	300 Freddie Mac Pool 'QE6418', 4,000 %, fällig am 07.01.2052	293	0,03
54.532 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K079, Klasse XAM, 0,221 %, fällig 25.06.2028 *	365	0,03	83 Freddie Mac Pool 'QK0701', 2,500 %, fällig am 04.01.2041	76	0,01
57.720 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K081, Klasse XAM, 0,215 %, fällig 25.08.2028 *	346	0,03	1.305 Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000 %, fällig am 01.09.2049	1.232	0,11
3.289 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K120, Klasse X1, 1,133 %, fällig 25.10.2030 *	212	0,02	2.245 Freddie Mac Pool 'RA2114', 3,500 %, fällig am 01.02.2050	2.162	0,19
			7.544 Freddie Mac Pool 'RA2194', 3,000 %, fällig am 02.01.2050	7.059	0,63
			400 Freddie Mac Pool 'RA2729', 2,500 %, fällig am 06.01.2050	360	0,03
			1.523 Freddie Mac Pool 'RA3474', 3,000 %, fällig am 09.01.2050	1.417	0,13
			424 Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, fällig am 11.01.2050	367	0,03
			6.143 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, fällig am 11.01.2050	5.563	0,50
			19.794 Freddie Mac Pool 'RA4142', 2,500 %, fällig am 12.01.2050	17.901	1,61
			1.911 Freddie Mac Pool 'RA4175', 2,500 %, fällig am 01.12.2050	1.724	0,15
			72 Freddie Mac Pool 'RA4349', 2,500 %, fällig am 01.01.2051	65	0,01

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungenbesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
483 Freddie Mac Pool 'RA4414', 2,500 %, fällig am 01.01.2051	435	0,04	2.606 Freddie Mac REMICS 4921, Klasse SN, 3,606 %, fällig 25.10.2049 *	318	0,03
78 Freddie Mac Pool 'RA4532', 2,500 %, fällig am 02.01.2051	70	0,01	1.071 Freddie Mac REMICS 4936, Klasse YZ, 2,500 %, fällig 25.12.2049	923	0,08
599 Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, fällig am 01.02.2051	518	0,05	1.491 Freddie Mac REMICS 4962, Klasse SP, 3,606 %, fällig 25.03.2050 *	179	0,02
1.591 Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, fällig am 05.01.2051	1.378	0,12	4.699 Freddie Mac REMICS 4988, Klasse AZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	3.236	0,29
1.029 Freddie Mac Pool 'RA5155', 2,000 %, fällig am 05.01.2051	888	0,08	2.416 Freddie Mac REMICS 4995, Klasse IQ, 2,500 %, fällig 25.07.2050	347	0,03
182 Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000 %, fällig am 06.01.2051	157	0,01	10.470 Freddie Mac REMICS 4995, Klasse QI, 2,500 %, fällig 25.07.2050	1.617	0,15
1.634 Freddie Mac Pool 'RA5576', 2,500 %, fällig am 07.01.2051	1.468	0,13	5.290 Freddie Mac REMICS 5000, Klasse IB, 2,500 %, fällig 25.07.2050	680	0,06
6.694 Freddie Mac Pool 'RA5921', 2,500 %, fällig am 09.01.2051	5.994	0,54	4.164 Freddie Mac REMICS 5000, Klasse UI, 2,500 %, fällig 25.07.2050	689	0,06
1.567 Freddie Mac Pool 'RA7191', 3,500 %, fällig am 04.01.2052	1.496	0,13	1.767 Freddie Mac REMICS 5027, Klasse HI, 2,000 %, fällig 25.10.2050	249	0,02
8.980 Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, fällig am 09.01.2041	7.939	0,71	154 Freddie Mac REMICS 5040, Klasse IB, 2,500 %, fällig am 25.11.2050	23	–
2.378 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig am 10.01.2041	2.014	0,18	2.513 Freddie Mac REMICS 5058, Klasse IL, 2,500 %, fällig 25.01.2051	395	0,04
304 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, fällig am 11.01.2041	257	0,02	717 Freddie Mac REMICS 5059, Klasse IB, 2,500 %, fällig am 25.01.2051	118	0,01
4.530 Freddie Mac Pool 'SC0052', 3,000 %, fällig am 02.01.2040	4.295	0,39	5.298 Freddie Mac REMICS 5070, Klasse NI, 2,000 %, fällig 25.02.2051	737	0,07
13.674 Freddie Mac Pool 'SC0190', 2,500 %, fällig am 09.01.2041	12.498	1,12	9.321 Freddie Mac REMICS 5078, Klasse EI, 1,500 %, fällig 25.01.2051	968	0,09
169 Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000 %, fällig am 07.01.2047	168	0,02	22.000 Freddie Mac REMICS 5085, Klasse IK, 2,500 %, fällig 25.03.2051	3.549	0,32
260 Freddie Mac Pool 'SD0422', 4,500 %, fällig am 07.01.2045	259	0,02	12.084 Freddie Mac REMICS 5092, Klasse IU, 2,500 %, fällig 25.02.2051	1.533	0,14
157 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig am 01.04.2051	137	0,01	3.847 Freddie Mac REMICS 5113, Klasse NI, 2,500 %, fällig 25.06.2051	509	0,05
359 Freddie Mac Pool 'SD0618', 3,000 %, fällig am 02.01.2051	334	0,03	12.304 Freddie Mac REMICS 5134, Klasse KI, 2,500 %, fällig 25.07.2048	1.739	0,16
5.395 Freddie Mac Pool 'SD0630', 4,000 %, fällig am 02.01.2050	5.357	0,48	11.406 Freddie Mac REMICS 5135, Klasse DI, 2,500 %, fällig 25.05.2048	1.592	0,14
360 Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500 %, fällig am 07.01.2051	324	0,03	1.492 Freddie Mac REMICS 5149, Klasse NI, 2,500 %, fällig 25.01.2051	214	0,02
2.709 Freddie Mac Pool 'SD0731', 2,000 %, fällig am 05.01.2051	2.337	0,21	10.009 Freddie Mac REMICS 5160, Klasse IU, 2,500 %, fällig 25.11.2050	1.337	0,12
7.500 Freddie Mac Pool 'SD0777', 2,500 %, fällig am 11.01.2051	6.729	0,60	10.255 Freddie Mac REMICS 5162, Klasse DI, 2,500 %, fällig 25.11.2051	1.326	0,12
4.774 Freddie Mac Pool 'SD0809', 3,000 %, fällig am 01.01.2052	4.431	0,40	7.700 Freddie Mac REMICS 5169, Klasse PW, 2,000 %, fällig 25.09.2051	5.868	0,53
971 Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, fällig am 01.01.2052	875	0,08	7.200 Freddie Mac REMICS 5178, Klasse CY, 2,000 %, fällig 25.01.2042	5.352	0,48
393 Freddie Mac Pool 'SD0952', 3,000 %, fällig am 01.04.2052	368	0,03	4.900 Freddie Mac REMICS 5209, Klasse EQ, 3,000 %, fällig 25.04.2052	4.140	0,37
98 Freddie Mac Pool 'SD1035', 4,000 %, fällig am 05.01.2052	96	0,01	1.316 Freddie Mac Strips 312, Klasse S1, 3,559 %, fällig 15.09.2043 *	166	0,01
797 Freddie Mac Pool 'SD1132', 4,000 %, fällig am 01.06.2052	782	0,07	4.000 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2021 DNA2, Klasse M2, 144A, 4,483 %, fällig 25.08.2033 *	3.943	0,35
17.910 Freddie Mac Pool 'SD1143', 4,500 %, fällig am 09.01.2050	18.044	1,62	– Ginnie Mae I Pool '410304', 7,500 %, fällig 15.12.2025	–	–
15.365 Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, fällig am 07.01.2049	15.219	1,37	1 Ginnie Mae I Pool '417463', 7,000 %, fällig 15.09.2025	1	–
673 Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, fällig am 11.01.2049	630	0,06	– Ginnie Mae I Pool '430208', 7,000 %, fällig 15.09.2027	–	–
232 Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, fällig am 10.01.2050	210	0,02	– Ginnie Mae I Pool '462669', 7,000 %, fällig 15.04.2028	1	–
741 Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, fällig am 02.01.2051	672	0,06	– Ginnie Mae I Pool '486470', 6,500 %, fällig 15.08.2028	–	–
25.032 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig am 11.01.2051	22.555	2,03	– Ginnie Mae I Pool '486516', 6,500 %, fällig 15.09.2028	–	–
6.108 Freddie Mac Pool 'SD8135', 2,500 %, fällig am 03.01.2051	5.475	0,49	– Ginnie Mae I Pool '519569', 8,000 %, fällig 15.05.2030	–	–
1.307 Freddie Mac Pool 'ZA2343', 3,500 %, fällig am 05.01.2034	1.295	0,12	26 Ginnie Mae I Pool '646044', 6,500 %, fällig 15.10.2037	27	–
1.739 Freddie Mac Pool 'ZA2415', 3,000 %, fällig am 06.01.2036	1.669	0,15	1 Ginnie Mae I Pool '652203', 5,000 %, fällig 15.03.2036	1	–
283 Freddie Mac Pool 'ZA5297', 4,000 %, fällig am 03.01.2048	281	0,03	3 Ginnie Mae I Pool '658182', 6,000 %, fällig 15.11.2036	3	–
267 Freddie Mac Pool 'Z19993', 5,000 %, fällig am 05.01.2040	279	0,02	1 Ginnie Mae I Pool '675375', 5,000 %, fällig 15.05.2038	1	–
2.157 Freddie Mac Pool 'ZM1466', 3,500 %, fällig am 07.01.2046	2.093	0,19	1 Ginnie Mae I Pool '676940', 5,000 %, fällig 15.04.2038	1	–
411 Freddie Mac Pool 'ZNO480', 3,500 %, fällig am 10.01.2042	400	0,04	4 Ginnie Mae I Pool '683926', 5,000 %, fällig 15.02.2038	5	–
879 Freddie Mac Pool 'ZNO538', 3,500 %, fällig am 11.01.2042	854	0,08	6 Ginnie Mae I Pool '684334', 5,000 %, fällig 15.02.2038	6	–
2.393 Freddie Mac Pool 'ZNO608', 3,500 %, fällig am 02.01.2043	2.327	0,21	2 Ginnie Mae I Pool '684754', 5,000 %, fällig 15.04.2038	2	–
120 Freddie Mac Pool 'ZNO614', 3,500 %, fällig am 02.01.2043	117	0,01	2 Ginnie Mae I Pool '684848', 5,000 %, fällig 15.04.2038	2	–
109 Freddie Mac Pool 'ZNO628', 3,500 %, fällig am 02.01.2043	106	0,01	2 Ginnie Mae I Pool '686062', 5,000 %, fällig 15.05.2038	2	–
64 Freddie Mac Pool 'ZN2185', 4,500 %, fällig am 12.01.2048	64	0,01	53 Ginnie Mae I Pool '698086', 6,000 %, fällig 15.04.2039	56	–
11 Freddie Mac Pool 'ZS0823', 5,000 %, fällig am 12.01.2034	12	–	11 Ginnie Mae I Pool '701501', 5,000 %, fällig 15.12.2038	11	–
362 Freddie Mac Pool 'ZS1355', 6,000 %, fällig am 03.01.2037	387	0,03	301 Ginnie Mae I Pool '701947', 5,000 %, fällig 15.06.2039	316	0,03
7 Freddie Mac Pool 'ZS1530', 5,500 %, fällig am 07.01.2037	7	–	123 Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, fällig 15.04.2040	129	0,01
9 Freddie Mac Pool 'ZS1821', 5,500 %, fällig am 11.01.2037	10	–	285 Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, fällig 15.05.2040	299	0,03
146 Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, fällig am 12.01.2038	155	0,01	1 Ginnie Mae I Pool '780732', 7,000 %, fällig 15.03.2028	1	–
10.932 Freddie Mac Pool 'ZS4751', 3,500 %, fällig am 01.01.2048	10.584	0,95	1 Ginnie Mae I Pool '781001', 7,500 %, fällig 15.03.2029	1	–
171 Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000 %, fällig am 10.01.2032	167	0,01	53 Ginnie Mae I Pool '781590', 5,500 %, fällig 15.04.2033	57	0,01
245 Freddie Mac Pool 'ZS9826', 3,000 %, fällig am 10.01.2046	232	0,02	364 Ginnie Mae I Pool '781994', 5,500 %, fällig 15.11.2033	394	0,04
42 Freddie Mac Pool 'ZT0474', 4,500 %, fällig am 08.01.2048	43	–	2 Ginnie Mae I Pool '782198', 6,000 %, fällig 15.10.2037	2	–
2.401 Freddie Mac Pool 'ZT1101', 3,000 %, fällig am 01.01.2043	2.257	0,20	315 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15.06.2048	312	0,03
856 Freddie Mac Pool 'ZT1107', 3,500 %, fällig am 03.01.2043	836	0,08	143 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15.09.2042	136	0,01
149 Freddie Mac Pool 'ZT1159', 3,500 %, fällig am 02.01.2044	145	0,01	159 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15.09.2042	151	0,01
155 Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, fällig am 01.01.2046	148	0,01	48 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15.10.2042	46	–
40 Freddie Mac Pool 'ZT1854', 4,500 %, fällig am 03.01.2049	40	–	255 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, fällig 15.10.2042	243	0,02
170 Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500 %, fällig am 04.01.2033	168	0,01	221 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, fällig 15.11.2042	211	0,02
1.967 Freddie Mac Pool 'ZT2228', 3,500 %, fällig am 01.06.2049	1.894	0,17	2.165 Ginnie Mae I Pool 'BS8462', 3,500 %, fällig 15.06.2050	2.131	0,19
4.600 Freddie Mac REMICS 3810, Klasse WA, 5,495 %, fällig 15.06.2040 *	4.952	0,44	7 Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500 %, fällig am 20.10.2037	8	–
3.366 Freddie Mac REMICS 3998, Klasse DS, 4,109 %, fällig 15.02.2042 *	484	0,04	10 Ginnie Mae II Pool '4170', 6,000 %, fällig 20.06.2038	11	–
2.303 Freddie Mac REMICS 4134, Klasse IM, 3,500 %, fällig 15.11.2042	369	0,03	730 Ginnie Mae II Pool '4245', 6,000 %, fällig 20.09.2038	794	0,07
1.088 Freddie Mac REMICS 4280, Klasse AI, 3,000 %, fällig 15.02.2028	28	–	112 Ginnie Mae II Pool '4602', 6,000 %, fällig 20.12.2039	122	0,01
4.800 Freddie Mac REMICS 4377, Klasse UZ, 3,000 %, fällig 15.08.2044	4.136	0,37			
360 Freddie Mac REMICS 4403, Klasse IG, 3,500 %, fällig 15.07.2032	15	–			
1.329 Freddie Mac REMICS 4715, Klasse JS, 3,759 %, fällig 15.08.2047 *	191	0,02			
402 Freddie Mac REMICS 4759, Klasse MI, 4,000 %, fällig 15.09.2045	26	–			
1.419 Freddie Mac REMICS 4808, Klasse SB, 3,809 %, fällig 15.07.2048 *	211	0,02			
197 Freddie Mac REMICS 4813, Klasse CJ, 3,000 %, fällig am 15.08.2048	181	0,02			
1.757 Freddie Mac REMICS 4856, Klasse IO, 5,000 %, fällig 15.01.2049	326	0,03			
929 Freddie Mac REMICS 4870, Klasse ES, 3,609 %, fällig 15.04.2049 *	121	0,01			
1.872 Freddie Mac REMICS 4882, Klasse S, 3,659 %, fällig 15.05.2049 *	230	0,02			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
119			2.864		
61			9.481		
38			2.444		
43			5.499		
4			5.150		
89			4.261		
38			1.742		
14			15.136		
9			652		
482			4.099		
1.067			17.000		
793			500		
73			1.100		
2.208			2.000		
65			752		
550			1.335		
9.707			1.335		
2.305			1.635		
3.225			393		
296			882		
1.671			625		
1.383			436		
492			732		
2.712			967		
252			1.324		
960			967		
1.168			3.124		
1.376			10.494		
504			578		
564			916		
3.486			2.668		
258			8.508		
1.342			4.151		
36			26.856		
736			2.061		
1.094			4.208		
704			7.747		
151			1.924		
622			3.170		
559			727		
80			500		
516			14.627		
1.185			5.691		
2.656			1.982		
914			1.335		
1.051			1.335		
1.545			4.198		
99			514		
763			175		
767			5.665		
1.179			254		
790			784		
173			4.706		
96			4.227		
163					
98					
5.983					
837					
423					
2.398					
88					
127					
173					
211					
192					
60					
95					
195					
144					
20					
152					
2.042					
46					
71					
224					
147					
13					
137					
138					
4.537					
2.184					

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — (Fortsetzung)					
4.852			1.658		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 36, Klasse GS, 3,732 %, fällig 20.03.2050 *					
690		0,06		1.475	0,13
573			Summe Mortgage-Backed Securities (Anschaffungskosten 1.178.707 USD)		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Klasse MI, 3,500 %, fällig am 20.04.2050					
91		0,01	1.097.852		98,63
231			Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 1,24 % (28. Februar 2022: 12,73 %)		
36		–	USA — 1,24 % (28. Februar 2022: 12,73 %)		
1.087			6.820 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig am 28.10.2022		
166		0,01	6.792		0,61
919			3.000 United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 30/09/2022		
134		0,01	2.999		0,27
6.310			60 United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 28/02/2025		
240		0,02	57		0,01
1.384			4.320 United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30/04/2026		
1.394		0,13	3.919		0,35
157			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 14.162\$)		
155		0,01	13.767		1,24
1.148			Organismen für gemeinsame Anlagen — 3,01 % (28. Februar 2022: 1,63 %)		
1.125		0,10	33.546 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		
28.934			33.546		3,01
1.124			Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 33.546\$)		
907		0,08	33.546		3,01
6.776			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.246.327\$)		
1.001		0,09	1.163.094		104,49
14.798			Futures — (0,03 %) (28. Februar 2022: 0,14 %)		
2.053		0,18	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
3.682			335		0,03
2.965			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
2.417		0,22	1.163.429		104,52
7.920			Devisenterminkontrakte — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
50.553			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
3.105		0,28	(34)		–
22.315			Futures — (0,06 %) (28. Februar 2022: (0,06 %))		
1.795		0,16	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
29.578			(618)		(0,06)
5.463			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
997		0,09	(652)		(0,06)
5.400			Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
3.966		0,36	1.162.777		104,46
1.100			Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
1.087		0,10	(49.643)		(4,46)
9.200			Gesamtnettovermögen		
7.747		0,70	1.113.134\$		100,00
4.452			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
3.126			144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 39.849.000\$ und machten 3,58 % des Nettovermögens aus.		
39.723			* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.		
1.900			† Nicht liquide.		
1.300			∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach Ermessen des Bewertungsausschusses.		
9.500			± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.		
3.441			ABKÜRZUNGEN:		
3.570			REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.		
2.120			TBA – Wird noch bekanntgegeben.		
8.328			Analyse des Gesamtvermögens		
1.262			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem regulierten Markt gehandelt werden		
1.246			Organismen für gemeinsame Anlagen		
			Finanzderivate		
			Sonstige Vermögenswerte		
			Gesamtvermögen		
			%		
			Gesamtvermögens		
			92,76		
			2,75		
			0,03		
			4,46		
			100,00		

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 48	Verkauf EUR 48 \$ –
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 2.108	Verkauf USD 2.154 (34)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (14))\$				
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (14))\$				

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(417)	(48.750)\$	\$ 335
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	52	6.510	(12)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	106	11.747	(27)
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	567	77.023	(553)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	72	10.764	(26)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1.640\$)				\$ 335
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (666))\$				(618)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 974\$)				\$ (283)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) GBP	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) GBP	% vom Nettoinven- tarwert	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)						
Großbritannien — (Fortsetzung)						
100 Land Securities Capital Markets Plc, 2,625 %, fällig am 22.09.2037	82	0,13	USD	519 Citigroup Inc, 7,375 %, fällig 01.09.2039	679	1,04
790 Leeds Building Society, 1,375 %, fällig am 06.10.2027	675	1,04	190 Comcast Corp, 1,875 %, fällig 20.02.2036	143	0,22	
190 Leeds Building Society, 3,750 %, fällig am 25.04.2029 *	169	0,26	60 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	45	0,07	
240 Legal & General Group Plc, 3,750 %, fällig 26.11.2049 *	205	0,32	200 Digital Stout Holding LLC, 3,750 %, fällig 17.10.2030	179	0,28	
190 Legal & General Group Plc, 4,500 %, fällig 01.11.2050 *	168	0,26	330 GE Capital UK Funding Unlimited Co, 5,875 %, fällig 18.01.2033	348	0,53	
330 Liberty Living Finance Plc, 3,375 %, fällig am 28.11.2029	295	0,45	560 General Motors Financial Co Inc, 2,350 %, fällig 03.09.2025	513	0,79	
120 LiveWest Treasury Plc, 2,250 %, fällig 10.10.2043	85	0,13	309 Goldman Sachs Group Inc.The, 7,125 %, fällig 07.08.2025	327	0,50	
430 Lloyds Bank Plc, 5,125 %, fällig 07.03.2025	443	0,68	580 Goldman Sachs Group Inc.The, 3,125 %, fällig 25.07.2029	515	0,79	
510 Lloyds Bank Plc, 7,625 %, fällig 22.04.2025	540	0,83	110 Goldman Sachs Group Inc.The, 6,875 %, fällig 18.01.2038	122	0,19	
453 Lloyds Bank Plc, 6,500 %, fällig 17.09.2040	561	0,86	210 GSK Consumer Healthcare Capital UK Plc, 3,375 %, fällig 29.03.2038	176	0,27	
340 Lloyds Banking Group Plc, 5,125 %, unbefristet *	312	0,48	USD	310 JPMorgan Chase & Co, 4,912 %, fällig 25.07.2033 *	264	0,41
350 Logisor 2019-1 UK Plc, 1,875 %, fällig am 17.11.2026	316	0,49	191 Kraft Heinz Foods Co, 4,125 %, fällig am 07.01.2027	184	0,28	
280 London Stock Exchange Group Plc, 1,625 %, fällig am 06.04.2030	233	0,36	200 McDonald's Corp, 2,950 %, fällig 15.03.2034	173	0,27	
177 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,125 %, fällig am 02.04.2024	176	0,27	180 McDonald's Corp, Serie gmt, 3,750 %, fällig 31.05.2038	162	0,25	
340 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,750 %, fällig am 31.03.2034	331	0,51	92 MetLife Inc, 5,375 %, fällig 09.12.2024	94	0,14	
160 Manchester Airport Group Funding Plc, 2,875 %, fällig am 30.09.2044	111	0,17	220 Mondelez International Inc, 4,500 %, fällig 03.12.2035	214	0,33	
305 Marston's Issuer Plc, Serie A3, 5,177 %, fällig 15.07.2032 *	289	0,44	USD	520 Morgan Stanley, 4,210 %, fällig 20.04.2028 *	436	0,67
108 Marston's Issuer Plc, Serie B1, 4,219 %, fällig am 16.07.2035 *	85	0,13	380 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692 %, fällig 05.06.2028	318	0,49	
21 Mitchells & Butlers Finance Plc, Serie B1, 5,965 %, fällig 15.12.2023	21	0,03	EUR	390 Netflix Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2029	312	0,48
90 Mitchells & Butlers Finance Plc, Serie B2, 6,013 %, fällig 15.12.2028	89	0,14	400 Omnicom Capital Holdings Plc, 2,250 %, fällig 22.11.2033	313	0,48	
300 National Express Group Plc, 2,375 %, fällig 20.11.2028	257	0,39	210 PepsiCo Inc, 3,200 %, fällig 22.07.2029	200	0,31	
250 National Grid Electricity Transmission Plc, 2,000 %, fällig 17.04.2040	165	0,25	230 PepsiCo Inc, 3,550 %, fällig 22.07.2034	216	0,33	
310 National Grid Gas Plc, 1,375 %, fällig am 07.02.2031	239	0,37	210 Prologis LP, 2,250 %, fällig 30.06.2029	184	0,28	
100 Nationwide Building Society, 3,000 %, fällig 06.05.2026	95	0,15	290 Realty Income Corp, 1,875 %, fällig 14.01.2027	259	0,40	
206 Nationwide Building Society, 3,250 %, fällig am 20.01.2028	195	0,30	365 Time Warner Cable LLC, 5,750 %, fällig 02.06.2031	358	0,55	
230 NatWest Group Plc, 3,125 %, fällig 28.03.2027 *	213	0,33	300 Toyota Motor Credit Corp, 0,750 %, fällig 19.11.2026	260	0,40	
150 NatWest Group Plc, 3,619 %, fällig 29.03.2029 *	135	0,21	590 Verizon Communications Inc, 1,875 %, fällig 19.09.2030	488	0,75	
460 NatWest Group Plc, 2,105 %, fällig 28.11.2031 *	389	0,60	110 Verizon Communications Inc, 2,500 %, fällig 08.04.2031	94	0,14	
110 Northern Powergrid Northeast Plc, 3,250 %, fällig am 01.04.2052	87	0,13	320 Verizon Communications Inc, 1,875 %, fällig 03.11.2038	216	0,33	
120 Notting Hill Genesis, 2,875 %, fällig am 31.01.2029	111	0,17	26 Walmart Inc, 5,250 %, fällig 28.09.2035	29	0,04	
140 Onward Homes Ltd, 2,125 %, fällig 25.03.2053	88	0,13	410 Wells Fargo & Co, 3,473 %, fällig 26.04.2028 *	382	0,59	
390 Paragon Treasury Plc, 2,000 %, fällig 07.05.2036	292	0,45	850 Wells Fargo & Co, 4,875 %, fällig 29.11.2035	785	1,20	
170 Rentokil Initial Plc, 5,000 %, fällig am 27.06.2032	168	0,26	200 Wells Fargo Bank NA, 5,250 %, fällig 01.08.2023	201	0,31	
120 Sanctuary Capital Plc, 5,000 %, fällig 26.04.2047	128	0,20		11.859	18,19	
190 Sanctuary Capital Plc, 2,375 %, fällig 14.04.2050	125	0,19	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 69.347€)	60.508	92,80	
440 Santander UK Group Holdings Plc, 2,920 %, fällig am 08.05.2026 *	410	0,63	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 4,73 % (28. Februar 2022: 5,81 %)			
170 Santander UK Plc, 5,750 %, fällig 02.03.2026	182	0,28	Vereinigtes Königreich — 3,57 % (28. Februar 2022: 4,38 %)			
467 Santander UK Plc, 3,875 %, fällig 15.10.2029	453	0,69	1.070 United Kingdom Gilt, 2,750 %, fällig 07.09.2024	1.065	1,63	
120 Scotland Gas Networks Plc, Serie A3S, 4,875 %, fällig am 21.12.2034	119	0,18	200 United Kingdom Gilt, 1,500 %, fällig 22.07.2026	191	0,29	
198 Scottish Widows Ltd, 7,000 %, fällig 16.06.2043	210	0,32	180 United Kingdom Gilt, 4,750 %, fällig 07.12.2038	217	0,33	
350 Segro Plc, 2,875 %, fällig 11.10.2037	280	0,43	180 United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07.12.2040	206	0,32	
140 Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,625 %, fällig am 22.02.2033	119	0,18	140 United Kingdom Gilt, 3,250 %, fällig 22.01.2044	141	0,22	
180 Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,000 %, fällig am 02.06.2040	124	0,19	290 United Kingdom Gilt, 1,750 %, fällig 22.01.2049	219	0,34	
100 Severn Trent Utilities Finance Plc, 4,875 %, fällig am 24.01.2042	103	0,16	229 United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07.12.2055	288	0,44	
252 South Eastern Power Networks Plc, 5,500 %, fällig am 05.06.2026	263	0,40		2.327	3,57	
191 Southern Gas Networks Plc, 2,500 %, fällig am 03.02.2025	183	0,28	USA — 1,16 % (28. Februar 2022: 1,01 %)			
380 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500 %, fällig am 02.05.2025	354	0,54	USD	510 United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.10.2024	421	0,65
190 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,750 %, fällig am 27.04.2030	161	0,25	USD	30 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2041	20	0,03
389 Tesco Property Finance 3 Plc, 5,744 %, fällig 13.04.2040	387	0,59	USD	140 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	110	0,17
330 Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, fällig 13.07.2044	314	0,48	USD	230 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.08.2049	159	0,24
190 UNITE Group Plc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2028	172	0,26	USD	70 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	46	0,07
350 UNITE USAF II Plc, 3,921 %, fällig am 30.06.2025	347	0,53		756	1,16	
220 United Utilities Water Finance Plc, 1,875 %, fällig am 03.06.2042	146	0,22	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 3.536€)	3.083	4,73	
170 University of Oxford, 2,544 %, fällig am 08.12.2117	110	0,17	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 72.883€)	63.591	97,53	
260 Wellcome Trust Ltd.The, 2,517 %, fällig 07.02.2118	164	0,25	Devisenterminkontrakte — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,01 %)			
362 Western Power Distribution East Midlands Plc, 5,250 %, fällig am 17.01.2023	364	0,56	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	3	–	
275 Western Power Distribution East Midlands Plc, 6,250 %, fällig am 10.12.2040	313	0,48	Futures — 0,06 % (28. Februar 2022: 0,08 %)			
470 Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027	408	0,63	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	38	0,06	
100 Whitbread Group Plc, 3,000 %, fällig 31.05.2031	81	0,12	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	63.632	97,59	
180 Yorkshire Building Society, 3,500 %, fällig am 21.04.2026	174	0,27	Devisenterminkontrakte — (0,29 %) (28. Februar 2022: (0,05 %))			
140 Yorkshire Building Society, 3,511 %, fällig am 10.11.2030 *	124	0,19	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(192)	(0,29)	
	26.990	41,40	Futures — (0,15 %) (28. Februar 2022: (0,01 %))			
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(94)	(0,15)	
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(286)	(0,44)	
			Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	63.346	97,15	
			Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	1.852	2,85	
			Gesamtnettvermögen	65.198€	100,00	
USA — 18,19 % (28. Februar 2022: 16,06 %)						
USD	700 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig am 21.11.2029	551	0,84			
USD	100 Apache Corp, 4,750 %, fällig am 15.04.2043	68	0,10			
	420 AT&T Inc, Serie GBP, 2,900 %, fällig am 04.12.2026	393	0,60			
	383 AT&T Inc, 4,250 %, fällig 01.06.2043	333	0,51			
USD	640 Bank of America Corp, 4,948 %, fällig 22.07.2028 *	551	0,84			
	460 Bank of America Corp, 3,584 %, fällig 27.04.2031 *	423	0,65			
	180 Becton Dickinson and Co, 3,020 %, fällig 24.05.2025	172	0,26			
	260 Berkshire Hathaway Finance Corp, 2,625 %, fällig 19.06.2059	179	0,28			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

ABKÜRZUNGEN:

Fortwährend	–	Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
EUR	–	Euro
USD	–	US-Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,05
Finanzderivate	0,06
Sonstige Vermögenswerte	2,89
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
16.11.2022	Citi	Kauf	USD 236	Verkauf	GBP 200	£	3
16.11.2022	Citi	Kauf	GBP 151	Verkauf	JPY 24.414		(1)
16.11.2022	Citi	Kauf	GBP 1.653	Verkauf	USD 2.001		(67)
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	GBP 1.723	Verkauf	USD 2.085		(69)
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	GBP 214	Verkauf	USD 260		(9)
16.11.2022	UBS	Kauf	GBP 1.059	Verkauf	EUR 1.260		(35)
16.11.2022	UBS	Kauf	GBP 374	Verkauf	USD 448		(11)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 8£)						£	3
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): £(35))							(192)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): £(27))						£	(189)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bund September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(2)	£ (256)	£ 12
Japan 10 Year Bond (OSE) September 2022	Bank of America Merrill Lynch	(3)	(2.779)	(23)
Long Gilt Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	23	2.482	(44)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(26)	(2.617)	22
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	37	3.530	(18)
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	9	1.052	(9)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(772)	4
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 59£)				£ 38
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): £(10))				(94)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 49£)				£ (56)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 0,15 % (28. Februar 2022: 0,15 %)			Dänemark — 1,40 % (28. Februar 2022: 0,34 %)		
225 SMB Private Education Loan Trust 2020-A, Serie 2020 A, Klasse A2A, 144A, 2,230 %, fällig am 15.09.2037			200 Danske Bank A.S., 144A, 3,773 %, fällig 28.03.2025 *		
	213	0,15		195	0,14
Asset-Backed Securities insgesamt (Kosten 232 USD)			200 Danske Bank A/S, 144A, 3,244 %, fällig am 20.12.2025 *		
	213	0,15	200 Danske Bank A.S., 144A, 1,549 %, fällig 10.09.2027 *		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 90,53 % (28. Februar 2022: 81,87 %)			1.520 Danske Bank A.S., 144A, 4,298 %, fällig 01.04.2028 *		
Australien — 1,75 % (28. Februar 2022: 1,08 %)			1.978		
200 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 2,688 %, fällig 11.03.2031			1,40		
	161	0,11	Frankreich — 2,59 % (28. Februar 2022: 2,59 %)		
200 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 3,305 %, fällig 11.03.2041			360 BNP Paribas SA, 144A, 2,819 %, fällig 19.11.2025 *		
	149	0,10	280 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *		
70 CSL Finance Plc, 144A, 3,850 %, fällig 27.04.2027			320 BNP Paribas SA, 144A, 1,323 %, fällig 13.01.2027 *		
	69	0,05	770 BNP Paribas SA, 144A, 1,675 %, fällig 30.06.2027 *		
140 CSL Finance Plc, 144A, 4,050 %, fällig 27.04.2029			340 BNP Paribas SA, 144A, 2,159 %, fällig 15.09.2029 *		
	136	0,09	750 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, unbefristet *		
130 CSL Finance Plc, 144A, 4,250 %, fällig 27.04.2032			370 BPCE SA, 144A, 3,116 %, fällig 19.10.2032 *		
	126	0,09	400 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, fortwährend *		
660 Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 25.10.2022			230 WEA Finance LLC - Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 3,750 %, fällig 17.09.2024		
	661	0,47	200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, fällig 17.09.2044		
30 Glencore Funding LLC, 144A, 3,000 %, fällig 27.10.2022			3.664		
	30	0,02	2,59		
390 Glencore Funding LLC, 144A, 4,625 %, fällig 29.04.2024			Deutschland — 0,55 % (28. Februar 2022: 0,04 %)		
	391	0,28	50 Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, fällig 15.06.2030		
120 Glencore Funding LLC, 144A, 1,625 %, fällig 01.09.2025			770 ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 29.04.2025		
	109	0,08	61		
40 Glencore Funding LLC, 144A, 3,875 %, fällig am 27.10.2027			776		
	38	0,03	0,55		
100 Glencore Funding LLC, 144A, 2,625 %, fällig 23.09.2031			Indien — 0,35 % (28. Februar 2022: 0,31 %)		
	80	0,06	580 Reliance Industries Ltd, 144A, 2,875 %, fällig am 12.01.2032		
100 Westpac Banking Corp, 5,405 %, fällig 10.08.2033 *			492		
	96	0,07	Irland — 0,70 % (28. Februar 2022: 1,00 %)		
120 Westpac Banking Corp, 2,668 %, fällig 15.11.2035 *			270 AerCap Ireland Capital DAC - AerCap Global Aviation Trust, 4,500 %, fällig 15.09.2023		
	95	0,07	260 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,150 %, fällig am 15.02.2024		
130 Westpac Banking Corp, 3,020 %, fällig 18.11.2036 *			160 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig am 30.01.2032		
	103	0,07	150 AerCap Ireland Capital DAC - AerCap Global Aviation Trust, 3,400 %, fällig 29.10.2033		
320 Westpac Banking Corp, 3,133 %, fällig 18.11.2041			180 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,850 %, fällig 29.10.2041		
	231	0,16	90 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 01.10.2023		
	2.475	1,75	989		
Belgien — 0,30 % (28. Februar 2022: 0,36 %)			Israel — 0,19 % (28. Februar 2022: 0,01 %)		
470 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048			320 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026		
	427	0,30	270		
Bermudas — 0,34 % (28. Februar 2022: 0,15 %)			Italien — 0,94 % (28. Februar 2022: 0,94 %)		
500 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig am 15.10.2025			800 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,375 %, fällig am 12.01.2023		
	482	0,34	796		
Brasilien — 0,54 % (28. Februar 2022: 0,57 %)			200 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, fällig am 26.06.2024		
360 MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031			200 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01.06.2032 *		
	284	0,20	203		
170 Petrobras Global Finance BV, 6,900 %, fällig 19.03.2049			0,94		
	159	0,11	Japan — 1,82 % (28. Februar 2022: 1,19 %)		
130 Petrobras Global Finance BV, 5,500 %, fällig am 10.06.2051			200 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,837 %, fällig 17.04.2026 *		
	105	0,08	210 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 4,080 %, fällig 19.04.2028 *		
270 Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, fällig am 15.01.2032			200 Nippon Life Insurance Co, 144A, 3,400 %, fällig 23.01.2050 *		
	214	0,15	340 Nippon Life Insurance Co, 144A, 2,750 %, fällig 21.01.2051 *		
	762	0,54	810 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,043 %, fällig am 15.09.2023		
Kanada — 2,35 % (28. Februar 2022: 1,86 %)			200 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,522 %, fällig am 17.09.2025		
240 Bank of Nova Scotia/The, 3,450 %, fällig am 11.04.2025			180 NTT Finance Corp, 144A, 1,162 %, fällig 03.04.2026		
	235	0,17	380 NTT Finance Corp, 144A, 4,372 %, fällig 27.07.2027		
40 Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, fällig am 04.05.2037 *			200 NTT Finance Corp, 144A, 2,065 %, fällig 03.04.2031		
	36	0,03	168		
140 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig am 30.05.2041			2.576		
	144	0,10	1,82		
60 Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950 %, fällig am 15.10.2039			Kasachstan — 0,11 % (28. Februar 2022 0,10 %)		
	63	0,04	200 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, fällig 14.04.2033		
300 Canadian Pacific Railway Co, 2,450 %, fällig am 02.12.2031			158		
	257	0,18	0,11		
90 Canadian Pacific Railway Co, 3,000 %, fällig am 02.12.2041			Luxemburg — 0,03 % (28. Februar 2022: 0,03 %)		
	71	0,05	40 ArcelorMittal SA, 7,000 %, fällig 15.10.2039		
100 Canadian Pacific Railway Co, 3,100 %, fällig am 02.12.2051			40		
	74	0,05	0,03		
790 CI Financial Corp, 3,200 %, fällig 17.12.2030			Macau — 1,40 % (28. Februar 2022: 1,07 %)		
	602	0,43	580 Sands China Ltd, 5,625 %, fällig am 08.08.2025		
160 Element Fleet Management Corp, 144A, 1,600 %, fällig am 06.04.2024			200 Sands China Ltd, 4,300 %, fällig am 01.08.2026		
	152	0,11	200 Sands China Ltd, 5,900 %, fällig am 08.08.2028		
100 GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2026			270 Sands China Ltd, 3,100 %, fällig am 03.08.2029		
	97	0,07	200 Sands China Ltd, 4,875 %, fällig 18.06.2030		
150 MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2027			200 Sands China Ltd, 4,875 %, fällig 18.06.2030		
	152	0,11	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 15.01.2026		
250 Royal Bank of Canada, 3,375 %, fällig 14.04.2025			200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01.10.2027		
	245	0,17	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig am 26.08.2028		
480 Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig 14.07.2026			200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig am 15.12.2029		
	45	0,03	139		
50 Teck Resources Ltd, 3,900 %, fällig 15.07.2030			1,40		
	290	0,21	1,40		
290 Teck Resources Ltd, 6,250 %, fällig 15.07.2041			Luxemburg — 0,03 % (28. Februar 2022: 0,03 %)		
	9	0,01	40 ArcelorMittal SA, 7,000 %, fällig 15.10.2039		
10 Teck Resources Ltd, 5,400 %, fällig 01.02.2043			40		
	60	0,04	0,03		
60 TransAlta Corp, 6,500 %, fällig 15.03.2040			Macau — 1,40 % (28. Februar 2022: 1,07 %)		
	331	0,23	580 Sands China Ltd, 5,625 %, fällig am 08.08.2025		
350 Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig 15.12.2027			200 Sands China Ltd, 4,300 %, fällig am 01.08.2026		
	31	0,02	200 Sands China Ltd, 5,900 %, fällig am 08.08.2028		
40 Yamana Gold Inc, 2,630 %, fällig 15.08.2031			270 Sands China Ltd, 3,100 %, fällig am 03.08.2029		
	3.322	2,35	200 Sands China Ltd, 4,875 %, fällig 18.06.2030		
Cayman Islands — 0,08 % (28. Februar 2022: 0,08 %)			200 Sands China Ltd, 4,875 %, fällig 18.06.2030		
144 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 15.09.2024			200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 15.01.2026		
	117	0,08	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01.10.2027		
Chile — 0,18 % (28. Februar 2022: 0,26 %)			200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig am 26.08.2028		
330 Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 144A, 3,500 %, fällig 10.09.2051			200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig am 15.12.2029		
	248	0,18	139		
China — 0,37 % (28. Februar 2022: 0,44 %)			1,40		
200 Alibaba Group Holding Ltd, 2,125 %, fällig 09.02.2031			Macau — 1,40 % (28. Februar 2022: 1,07 %)		
	166	0,12	580 Sands China Ltd, 5,625 %, fällig am 08.08.2025		
240 Alibaba Group Holding Ltd, 3,150 %, fällig 09.02.2051			200 Sands China Ltd, 4,300 %, fällig am 01.08.2026		
	159	0,11	200 Sands China Ltd, 5,900 %, fällig am 08.08.2028		
260 Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,840 %, fällig 22.04.2051			270 Sands China Ltd, 3,100 %, fällig am 03.08.2029		
	194	0,14	200 Sands China Ltd, 4,875 %, fällig 18.06.2030		
	519	0,37	200 Sands China Ltd, 4,875 %, fällig 18.06.2030		
Kolumbien — 0,20 % (28. Februar 2022: 0,23 %)			200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 15.01.2026		
170 Ecopetrol SA, 4,625 %, fällig 02.11.2031			200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01.10.2027		
	133	0,09	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig am 26.08.2028		
100 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig am 28.05.2045			200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig am 15.12.2029		
	69	0,05	139		
130 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 02.11.2051			1,40		
	87	0,06	1,40		
	289	0,20	1,40		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
Mexiko — 0,47 % (28. Februar 2022: 0,43 %)					
200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 8,375 %, unbefristet *	195	0,14	165 Reynolds American Inc, 8,125 %, fällig 01.05.2040	179	0,13
200 Comision Federal de Electricidad, 144A, 3,348 %, fällig 09.02.2031	159	0,11	200 Standard Chartered Plc, 144A, 1,214 %, fällig 23.03.2025 *	188	0,13
200 Comision Federal de Electricidad, 144A, 4,677 %, fällig 09.02.2051	136	0,10	80 Vodafone Group Plc, 6,150 %, fällig 27.02.2037	84	0,06
220 Fresnillo Plc, 144A, 4,250 %, fällig 02.10.2050	170	0,12		4.076	2,88
	660	0,47	USA — 64,21 % (28. Februar 2022: 61,52 %)		
Marokko — 0,12 % (28. Februar 2022: 0,10 %)					
200 OCP SA, 144A, 3,750 %, fällig 23.06.2031	165	0,12	160 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig am 30.11.2036	169	0,12
Niederlande — 0,96 % (28. Februar 2022: 0,56 %)					
250 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,649 %, fällig 06.04.2028 *	235	0,17	700 AbbVie Inc, 2,950 %, fällig am 21.11.2026	661	0,47
440 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,758 %, fällig 06.04.2033 *	391	0,28	260 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig am 21.11.2029	238	0,17
470 ING Groep NV, 4,252 %, fällig 28.03.2033 *	435	0,31	20 AbbVie Inc, 4,550 %, fällig 15.03.2035	19	0,01
170 Shell International Finance BV, 4,375 %, fällig 11.05.2045	159	0,11	490 AbbVie Inc, 4,050 %, fällig 21.11.2039	432	0,31
170 Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	135	0,09	10 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig am 21.11.2029	9	0,01
	1.355	0,96	610 Air Lease Corp, 0,700 %, fällig 15.02.2024	576	0,41
Norwegen — 0,20 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
290 DNB Bank ASA, 144A, 2,968 %, fällig 28.03.2025 *	283	0,20	440 Air Lease Corp, 3,375 %, fällig am 01.07.2025	418	0,30
Peru — 0,15 % (28. Februar 2022: 0,16 %)					
200 Petroleos del Peru SA, 144A, 5,625 %, fällig am 19.06.2047	138	0,10	470 Air Lease Corp, 1,875 %, fällig 15.08.2026	411	0,29
80 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	77	0,05	220 Alexandria Real Estate Equities Inc, 2,000 %, fällig am 18.05.2032	174	0,12
	215	0,15	270 Alexandria Real Estate Equities Inc, 3,000 %, fällig am 18.05.2051	184	0,13
Portugal — 0,19 % (28. Februar 2022: 0,16 %)					
310 EDP Finance BV, 144A, 1,710 %, fällig 24.01.2028	263	0,19	40 Alphabet Inc, 2,250 %, fällig 15.08.2060	26	0,02
Katar — 0,25 % (28. Februar 2022: 0,44 %)					
410 Qatar Energy, 144A, 2,250 %, fällig 12.07.2031	358	0,25	146 Altria Group Inc, 4,400 %, fällig am 14.02.2026	145	0,10
Singapur — 0,16 % (28. Februar 2022: 0,14 %)					
240 BOC Aviation USA Corp, 144A, 1,625 %, fällig am 29.04.2024	228	0,16	130 Altria Group Inc, 4,800 %, fällig am 14.02.2029	126	0,09
Südafrika — 0,30 % (28. Februar 2022: 0,27 %)					
200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 10.04.2027	196	0,14	480 Altria Group Inc, 2,450 %, fällig am 04.02.2032	363	0,26
240 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2028	229	0,16	810 Altria Group Inc, 3,400 %, fällig 04.02.2041	548	0,39
	425	0,30	300 Amazon.com Inc, 2,100 %, fällig 12.05.2031	259	0,18
Spanien — 0,90 % (28. Februar 2022: 0,33 %)					
400 Banco Santander SA, 1,722 %, fällig 14.09.2027 *	345	0,24	140 Amazon.com Inc, 3,600 %, fällig 13.04.2032	134	0,09
800 Banco Santander SA, 4,175 %, fällig 24.03.2028 *	751	0,53	120 Amazon.com Inc, 3,875 %, fällig 22.08.2037	113	0,08
200 Banco Santander SA, 3,306 %, fällig 27.06.2029	180	0,13	200 Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	139	0,10
	1.276	0,90	40 Amazon.com Inc, 3,100 %, fällig 12.05.2051	31	0,02
Supranational — 0,13 % (28. Februar 2022: 0,11 %)					
200 African Export-Import Bank.The, 144A, 2,634 %, fällig 17.05.2026	181	0,13	70 Amazon.com Inc, 3,950 %, fällig 13.04.2052	64	0,04
Schweiz — 2,83 % (28. Februar 2022: 1,46 %)					
340 Credit Suisse Group AG, 144A, 3,091 %, fällig am 14.05.2032 *	257	0,18	13 American Airlines 2015-1 Klasse A Pass Through Trust, 3,375 %, fällig 01.05.2027	11	0,01
730 Credit Suisse Group AG, 144A, 6,537 %, fällig am 08.12.2033 *	698	0,49	175 American Airlines 2017-1 Klasse B Pass Through Trust, Serie B, 4,950 %, fällig 15.02.2025	162	0,11
1.110 Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, unbefristet *	1.124	0,80	380 American Airlines Inc, 144A, 11,750 %, fällig 15.07.2025	420	0,30
890 Credit Suisse Group AG, 144A, 5,250 %, unbefristet *	671	0,48	120 American Airlines Inc/AA Advantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 20.04.2026	114	0,08
200 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, unbefristet *	165	0,12	170 American Airlines Inc/AA Advantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029	154	0,11
600 UBS Group AG, 144A, 4,751 %, fällig 12.05.2028 *	589	0,42	400 American Express Co, 4,050 %, fällig 03.05.2029	388	0,27
200 UBS Group AG, 144A, 3,126 %, fällig am 13.08.2030 *	175	0,12	100 American Express Co, 3,550 %, Perpetual *	86	0,06
200 UBS Group AG, 144A, 3,179 %, fällig 11.02.2043 *	148	0,10	50 American International Group Inc, 4,750 %, fällig 01.04.2048	47	0,03
200 UBS Group AG, 144A, 4,875 %, unbefristet *	173	0,12	160 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig am 15.01.2032	135	0,09
	4.000	2,83	90 Americo Life Inc, 144A, 3,450 %, fällig 15.04.2031	73	0,05
Taiwan — 0,40 % (28. Februar 2022: 0,37 %)					
280 TSMC Arizona Corp, 2,500 %, fällig 25.10.2031	237	0,17	150 AmFam Holdings Inc, 144A, 2,805 %, fällig 11.03.2031	126	0,09
200 TSMC Arizona Corp, 3,125 %, fällig 25.10.2041	164	0,12	130 AmFam Holdings Inc, 144A, 3,833 %, fällig 11.03.2051	102	0,07
200 TSMC Arizona Corp, 3,250 %, fällig 25.10.2051	160	0,11	80 Amgen Inc, 4,400 %, fällig 01.05.2045	72	0,05
	561	0,40	70 Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15.06.2051	66	0,05
Vereinigte Arabische Emirate — 0,19 % (28. Februar 2022: 0,31 %)					
290 DAE Funding LLC, 144A, 1,550 %, fällig 01.08.2024	271	0,19	10 Apache Corp, 4,750 %, fällig am 15.04.2043	8	0,01
Vereinigtes Königreich — 2,88 % (28. Februar 2022: 2,47 %)					
280 Barclays Plc, 5,088 %, fällig am 20.06.2030 *	262	0,19	150 Apache Corp, 5,350 %, fällig 01.07.2049	123	0,09
760 BAT Capital Corp, 2,259 %, fällig 25.03.2028	642	0,45	370 Apple Inc, 2,650 %, fällig 11.05.2050	271	0,19
50 British Telecommunications Plc, 9,625 %, fällig 15.12.2030	62	0,04	220 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 15.02.2027	216	0,15
210 HSBC Holdings Plc, 1,589 %, fällig 24.05.2027 *	183	0,13	80 AT&T Inc, 4,250 %, fällig 01.03.2027	79	0,06
440 HSBC Holdings Plc, 3,973 %, fällig 22.05.2030 *	398	0,28	500 AT&T Inc, 6,950 %, fällig 15.01.2028	544	0,38
60 HSBC Holdings Plc, 7,625 %, fällig 17.05.2032	68	0,05	410 AT&T Inc, 4,300 %, fällig 15.02.2030	394	0,28
430 HSBC Holdings Plc, 2,804 %, fällig 24.05.2032 *	341	0,24	280 AT&T Inc, 4,500 %, fällig 15.05.2035	263	0,19
430 HSBC Holdings Plc, 4,762 %, fällig 29.03.2033 *	383	0,27	50 AT&T Inc, 6,375 %, fällig 01.03.2041	55	0,04
200 HSBC Holdings Plc, 5,402 %, fällig 11.08.2033 *	191	0,14	302 AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15.09.2053	223	0,16
400 Lloyds Banking Group Plc, 3,511 %, fällig 18.03.2026 *	385	0,27	163 AT&T Inc, 3,550 %, fällig 15.09.2055	120	0,08
400 Lloyds Banking Group Plc, 4,375 %, fällig am 22.03.2028	387	0,27	240 AT&T Inc, 3,800 %, fällig am 01.12.2057	182	0,13
340 NatWest Group Plc, 3,754 %, fällig 01.11.2029 *	323	0,23	260 AT&T Inc, 3,500 %, fällig 01.02.2061	186	0,13
			120 Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.12.2024	118	0,08
			290 Bank of America Corp, 4,200 %, fällig am 26.08.2024	290	0,20
			80 Bank of America Corp, 3,841 %, fällig 25.04.2025 *	79	0,06
			230 Bank of America Corp, 4,376 %, fällig am 27.04.2028 *	224	0,16
			132 Bank of America Corp, 3,419 %, fällig am 20.12.2028 *	122	0,09
			250 Bank of America Corp, 4,271 %, fällig 23.07.2029 *	239	0,17
			70 Bank of America Corp, 3,974 %, fällig am 07.02.2030 *	66	0,05
			420 Bank of America Corp, 2,884 %, fällig am 22.10.2030 *	365	0,26
			110 Bank of America Corp, 2,592 %, fällig am 29.04.2031 *	93	0,07
			70 Bank of America Corp, 1,898 %, fällig 23.07.2031 *	55	0,04
			360 Bank of America Corp, 1,922 %, fällig 24.10.2031 *	285	0,20
			380 Bank of America Corp, 2,687 %, fällig 22.04.2032 *	315	0,22
			350 Bank of America Corp, 2,299 %, fällig 21.07.2032 *	280	0,20
			130 Bank of America Corp, 2,572 %, fällig am 20.10.2032 *	106	0,07
			380 Bank of America Corp, 4,571 %, fällig 27.04.2033 *	363	0,26
			120 Bank of America Corp, 5,015 %, fällig 22.07.2033 *	119	0,08
			620 Bank of America Corp, 2,482 %, fällig 21.09.2036 *	481	0,34
			140 Bank of America Corp, 2,676 %, fällig 19.06.2041 *	100	0,07
			180 Bank of America Corp, 3,311 %, fällig 22.04.2042 *	141	0,10
			20 Bank of America Corp, 4,443 %, fällig 20.01.2048 *	18	0,01
			90 Bank of America Corp, 4,330 %, fällig am 15.03.2050 *	81	0,06
			360 Bank of America Corp, 2,831 %, fällig 24.10.2051 *	245	0,17

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
United States — (Fortsetzung)					
340 BankUnited Inc, 4,875 %, fällig 17.11.2025	340	0,24	50 Continental Resources Inc/OK, 4,500 %, fällig am 15.04.2023	50	0,04
180 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.11.2025	149	0,10	100 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,268 %, fällig 15.11.2026	88	0,06
320 Bed Bath & Beyond Inc, 3,749 %, fällig 01.08.2024	136	0,10	370 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig am 15.01.2028	349	0,25
450 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2026	423	0,30	140 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,875 %, fällig 01.04.2032	109	0,08
130 Blackstone Holdings Finance Co LLC, 144A, 3,200 %, fällig 30.01.2052	94	0,07	40 Corning Inc, 3,900 %, fällig 15.11.2049	31	0,02
130 Blackstone Mortgage Trust Inc, 5,500 %, fällig am 15.03.2027	120	0,08	110 Costco Wholesale Corp, 1,600 %, fällig am 20.04.2030	93	0,07
1.000 Boeing Co/The, 2,196 %, fällig am 04.02.2026	915	0,65	30 Costco Wholesale Corp, 1,750 %, fällig am 20.04.2032	25	0,02
980 Boeing Co/The, 3,100 %, fällig am 01.05.2026	926	0,65	290 Coterra Energy Inc, 144A, 4,375 %, fällig am 01.06.2024	288	0,20
330 Boeing Co.The, 3,250 %, fällig 01.02.2028	300	0,21	520 Coterra Energy Inc, 144A, 3,900 %, fällig 15.05.2027	497	0,35
110 Boeing Co/The, 3,300 %, fällig 01.03.2035	86	0,06	189 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	187	0,13
270 Boeing Co/The, 3,750 %, fällig am 01.02.2050	194	0,14	70 CVS Health Corp, 3,250 %, fällig 15.08.2029	64	0,04
210 Boeing Co/The, 5,805 %, fällig am 01.05.2050	202	0,14	240 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15.09.2031	196	0,14
440 Boeing Co/The, 3,950 %, fällig 01.08.2059	306	0,22	10 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	10	0,01
70 Bon Secours Mercy Health Inc, 3,464 %, fällig am 01.06.2030	65	0,05	570 CVS Health Corp, 2,700 %, fällig 21.08.2040	413	0,29
260 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig am 24.02.2050	190	0,13	150 DanaHER Corp, 2,800 %, fällig 10.12.2051	107	0,08
180 Bristol-Myers Squibb Co, 2,350 %, fällig 13.11.2040	132	0,09	590 DCP Midstream LP, Serie A, 7,375 %, fortwährend *	589	0,42
120 Bristol-Myers Squibb Co, 4,250 %, fällig 26.10.2049	111	0,08	140 DCP Midstream Operating LP, 3,250 %, fällig 15.02.2032	118	0,08
354 Broadcom Inc, 144A, 3,187 %, fällig 15.11.2036	263	0,19	40 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig am 03.11.2036	40	0,03
130 Burlington Northern Santa Fe LLC, 4,400 %, fällig am 15.03.2042	124	0,09	92 Dell International LLC / EMC Corp, 8,100 %, fällig am 15.07.2036	40	0,03
90 California Institute of Technology, 3,650 %, fällig 01.09.2119	65	0,05	200 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig am 01.05.2025	207	0,15
40 Cameron LNG LLC, 144A, 3,701 %, fällig 15.01.2039	34	0,02	50 Delta Air Lines Inc, 3,375 %, fällig am 15.01.2026	51	0,04
70 Carlyle Finance LLC, 144A, 5,650 %, fällig 15.09.2048	67	0,05	480 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig am 20.10.2025	470	0,33
32 Carrier Global Corp, 2,493 %, fällig 15.02.2027	29	0,02	640 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig am 20.10.2028	612	0,43
340 Centene Corp, 3,000 %, fällig am 15.10.2030	285	0,20	110 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	114	0,08
90 CenterPoint Energy Houston Electric LLC, Serie AA, 3,000 %, fällig am 01.02.2027	86	0,06	182 Devon Energy Corp, 5,875 %, fällig 15.06.2028	188	0,13
100 Charles Schwab Corp.The, 2,000 %, fällig 20.03.2028	90	0,06	274 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	260	0,18
400 Charles Schwab Corp/The, Serie H, 4,000 %, fortwährend *	326	0,23	70 Devon Energy Corp, 7,950 %, fällig 15.04.2032	81	0,06
230 Charter Communications Operating LLC - Charter Communications Operating Capital, 3,750 %, fällig 15.02.2028	213	0,15	230 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	228	0,16
50 Charter Communications Operating LLC - Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	47	0,03	350 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	323	0,23
310 Charter Communications Operating LLC - Charter Communications Operating Capital, 2,250 %, fällig 15.01.2029	255	0,18	260 Devon OEI Operating LLC, 7,500 %, fällig 15.09.2027	285	0,20
420 Charter Communications Operating LLC - Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.06.2041	291	0,21	370 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig am 01.12.2029	336	0,24
140 Charter Communications Operating LLC - Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.03.2042	97	0,07	220 Diamondback Energy Inc, 4,400 %, fällig 24.03.2051	187	0,13
50 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.05.2047	43	0,03	610 DISH DBS Corp, 5,000 %, fällig 15.03.2023	598	0,42
60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	49	0,03	200 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	154	0,11
340 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,250 %, fällig 01.04.2053	285	0,20	110 Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, fällig 01.05.2024	99	0,07
80 Charter Communications Operating LLC - Charter Communications Operating Capital, 3,850 %, fällig 01.04.2061	51	0,04	190 Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, fällig am 15.02.2040	197	0,14
150 Charter Communications Operating LLC - Charter Communications Operating Capital, 3,950 %, fällig 30.06.2062	99	0,07	60 Duke Energy Corp, 3,150 %, fällig 15.08.2027	57	0,04
140 Chesapeake Energy Corp, 144A, 5,500 %, fällig am 01.02.2026	135	0,10	210 Duke Energy Florida LLC, 2,400 %, fällig 15.12.2031	179	0,13
40 Chevron USA Inc, 2,343 %, fällig 12.08.2050	28	0,02	240 Duke Energy Indiana LLC, Serie YYY, 3,250 %, fällig am 01.10.2049	185	0,13
160 Cigna Corp, 4,375 %, fällig 15.10.2028	158	0,11	110 Duke Energy Ohio Inc, 2,125 %, fällig 01.06.2030	93	0,07
530 Cigna Corp, 2,400 %, fällig 15.03.2030	454	0,32	130 Eaton Corp, 4,150 %, fällig 02.11.2042	117	0,08
160 Cigna Corp, 3,200 %, fällig 15.03.2040	126	0,09	90 eBay Inc, 2,600 %, fällig 10.05.2031	75	0,05
150 Cimarex Energy Co, 4,375 %, fällig 15.03.2029	131	0,09	150 Edison International, 4,950 %, fällig 15.04.2025	150	0,11
70 Cintas Corp No. 2, 3,700 %, fällig am 01.04.2027	69	0,05	100 Edison International, Serie A, 5,375 %, unbefristet *	90	0,06
130 Citigroup Inc, 3,980 %, fällig am 20.03.2030 *	122	0,09	130 Edison International, Serie B, 5,000 %, fortwährend *	112	0,08
280 Citigroup Inc, 2,976 %, fällig 05.11.2030 *	244	0,17	280 El Paso Natural Gas Co LLC, 7,500 %, fällig 15.11.2026	308	0,22
1.010 Citigroup Inc, 2,561 %, fällig 01.05.2032 *	827	0,58	380 Elevance Health Inc, 4,100 %, fällig 15.05.2032	366	0,26
210 Citigroup Inc, 3,785 %, fällig am 17.03.2033 *	189	0,13	70 Elevance Health Inc, 4,375 %, fällig 01.12.2047	64	0,05
390 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig am 15.07.2039	510	0,36	200 Energy Transfer LP, Serie SY, 4,200 %, fällig 15.09.2023	200	0,14
130 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 23.07.2048	123	0,09	90 Energy Transfer LP, 3,900 %, fällig 15.07.2026	86	0,06
280 Citigroup Inc, Serie Y, 4,150 %, fortwährend *	238	0,17	250 Energy Transfer LP, 5,500 %, fällig am 01.06.2027	253	0,18
200 Clorox Co.The, 1,800 %, fällig 15.05.2030	163	0,12	250 Energy Transfer LP, 4,950 %, fällig am 15.06.2028	246	0,17
100 Coca-Cola Co.The, 1,375 %, fällig 15.03.2031	81	0,06	10 Energy Transfer LP, Serie 20Y, 5,800 %, fällig 15.06.2038	9	0,01
180 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	139	0,10	40 Energy Transfer LP, 6,125 %, fällig 15.12.2045	39	0,03
50 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	47	0,03	110 Energy Transfer LP, Serie H, 6,500 %, fortwährend *	102	0,07
260 Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	256	0,18	130 Energy Transfer LP, Serie B, 6,625 %, fortwährend *	105	0,07
40 Comcast Corp, 7,050 %, fällig 15.03.2033	47	0,03	210 Energy Transfer LP, Serie F, 6,750 %, fortwährend*	191	0,13
91 Comcast Corp, 6,500 %, fällig 15.11.2035	103	0,07	1.200 Energy Transfer LP, Serie G, 7,125 %, fortwährend*	1.095	0,77
80 Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	70	0,05	340 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig am 16.10.2028	334	0,24
50 Comcast Corp, 3,969 %, fällig 01.11.2047	43	0,03	110 Enterprise Products Operating LLC, Serie D, 6,875 %, fällig 01.03.2033	125	0,09
372 Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	262	0,19	460 Enterprise Products Operating LLC, 4,250 %, fällig 15.02.2048	393	0,28
190 Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	187	0,13	190 Enterprise Products Operating LLC, 3,300 %, fällig 15.02.2053	141	0,10
70 CommonSpirit Health, 2,782 %, fällig 01.10.2030	59	0,04	80 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig am 31.01.2060	62	0,04
80 CommonSpirit Health, 3,910 %, fällig 01.10.2050	63	0,04	560 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig am 15.02.2078 *	461	0,33
240 Commonwealth Edison Co, 6,450 %, fällig 15.01.2038	279	0,20	250 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	250	0,18
30 Commonwealth Edison Co, 4,000 %, fällig 01.03.2048	27	0,02	180 EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, fällig am 01.06.2027	178	0,13
40 Constellation Brands Inc, 3,700 %, fällig 06.12.2026	39	0,03	330 EQT Corp, 6,125 %, fällig 01.02.2025	340	0,24
30 Constellation Brands Inc, 3,500 %, fällig am 09.05.2027	29	0,02	90 EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15.05.2026	85	0,06
40 Consumers Energy Co, 2,500 %, fällig 01.05.2060	25	0,02	140 EQT Corp, 3,900 %, fällig 01.10.2027	133	0,09
			140 EQT Corp, 7,000 %, fällig 01.02.2030	150	0,11
			30 EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.05.2031	27	0,02
			270 Equifax Inc, 2,350 %, fällig 15.09.2031	218	0,15
			80 Extra Space Storage LP, 3,900 %, fällig am 01.04.2029	74	0,05
			60 Exxon Mobil Corp, 3,482 %, fällig 19.03.2030	58	0,04
			30 Exxon Mobil Corp, 2,995 %, fällig 16.08.2039	25	0,02
			160 Exxon Mobil Corp, 4,227 %, fällig 19.03.2040	152	0,11
			40 Exxon Mobil Corp, 4,114 %, fällig 01.03.2046	37	0,03
			50 Exxon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15.04.2051	41	0,03
			130 FirstEnergy Corp, Serie B, 4,400 %, fällig am 15.07.2027	123	0,09
			30 FirstEnergy Corp, Serie C, 5,350 %, fällig am 15.07.2047	28	0,02

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
United States — (Fortsetzung)					
650 Florida Gas Transmission Co LLC, 144A, 2,300 %, fällig 01.10.2031	522	0,37	400 Kyndryl Holdings Inc, 144A, 3,150 %, fällig 15.10.2031	280	0,20
50 Florida Power & Light Co, 3,150 %, fällig am 01.10.2049	40	0,03	270 Kyndryl Holdings Inc, 144A, 4,100 %, fällig 15.10.2041	167	0,12
250 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	196	0,14	130 Lam Research Corp, 1,900 %, fällig 15.06.2030	109	0,08
50 Ford Motor Co, 4,750 %, fällig am 15.01.2043	37	0,03	50 Lam Research Corp, 2,875 %, fällig 15.06.2050	37	0,03
200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,300 %, fällig 10.02.2025	183	0,13	70 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig am 08.08.2024	66	0,05
300 Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, fällig 10.08.2026	260	0,18	1.070 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig am 25.06.2025	987	0,70
200 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig am 28.05.2027	188	0,13	100 Lennox International Inc, 1,700 %, fällig 01.08.2027	87	0,06
200 Ford Motor Credit Co LLC, 4,125 %, fällig am 17.08.2027	180	0,13	80 Lithia Motors Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.12.2027	74	0,05
140 Fortinet Inc, 2,200 %, fällig 15.03.2031	111	0,08	160 Lithia Motors Inc, 144A, 3,875 %, fällig 01.06.2029	135	0,10
180 Fox Corp, 5,476 %, fällig 25.01.2039	177	0,13	250 Lockheed Martin Corp, 3,900 %, fällig 15.06.2032	245	0,17
210 Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, fällig am 14.11.2034	200	0,14	80 Lockheed Martin Corp, 4,150 %, fällig 15.06.2053	75	0,05
130 General Motors Co, 4,875 %, fällig am 02.10.2023	131	0,09	90 Lockheed Martin Corp, 4,300 %, fällig 15.06.2062	84	0,06
290 General Motors Co, 6,125 %, fällig am 01.10.2025	299	0,21	320 Lowe's Cos Inc, 1,700 %, fällig 15.10.2030	257	0,18
150 General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032	144	0,10	110 Lowe's Cos Inc, 2,800 %, fällig 15.09.2041	78	0,06
140 General Motors Co, 6,600 %, fällig am 01.04.2036	141	0,10	150 Lowe's Cos Inc, 3,000 %, fällig 15.10.2050	103	0,07
20 General Motors Co, 6,750 %, fällig 01.04.2046	20	0,01	40 M&T Bank Corp, 3,500 %, fortwährend *	32	0,02
100 General Motors Co, 5,950 %, fällig am 01.10.2049	93	0,07	170 Magallanes Inc, 144A, 4,279 %, fällig 15.03.2032	148	0,10
40 General Motors Financial Co Inc, 3,700 %, fällig 09.05.2023	40	0,03	490 Magallanes Inc, 144A, 5,050 %, fällig 15.03.2042	401	0,28
630 Genting New York LLC / GENNY Capital Inc, 144A, 3,300 %, fällig am 15.02.2026	559	0,40	910 Magallanes Inc, 144A, 5,141 %, fällig 15.03.2052	730	0,52
100 Gilead Sciences Inc, 4,000 %, fällig 01.09.2036	91	0,06	190 Mars Inc, 144A, 2,375 %, fällig 16.07.2040	138	0,10
250 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, fällig 21.10.2025	247	0,17	270 Marsh & McLennan Cos Inc, 2,375 %, fällig 15.12.2031	228	0,16
430 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig 12.02.2026 *	392	0,28	60 Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375 %, fällig 15.04.2050	46	0,03
540 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16.11.2026	519	0,37	140 Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 4,900 %, fällig 01.04.2077	128	0,09
1.170 Goldman Sachs Group Inc/The, Serie VAR, 1,093 %, fällig 09.12.2026 *	1.042	0,74	300 Mastercard Inc, 3,350 %, fällig 26.03.2030	286	0,20
300 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,387 %, fällig 15.06.2027 *	295	0,21	200 Mastercard Inc, 1,900 %, fällig 15.03.2031	171	0,12
710 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, fällig 15.03.2028 *	672	0,48	80 Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	73	0,05
100 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800 %, fällig 15.03.2030	92	0,06	120 McDonald's Corp, 2,125 %, fällig 01.03.2030	103	0,07
450 Goldman Sachs Group Inc/The, Serie DMTN, 2,383 %, fällig 21.07.2032 *	365	0,26	90 McDonald's Corp, 4,450 %, fällig 01.03.2047	84	0,06
290 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,650 %, fällig 21.10.2032 *	238	0,17	200 McDonald's Corp, 4,450 %, fällig 01.09.2048	184	0,13
70 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	67	0,05	190 MDC Holdings Inc, 2,500 %, fällig 15.01.2031	136	0,10
50 Halliburton Co, 2,920 %, fällig 01.03.2030	44	0,03	70 MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	57	0,04
880 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 20.01.2026	804	0,57	190 Merck & Co Inc, 1,900 %, fällig 10.12.2028	168	0,12
100 HCA Inc, 5,125 %, fällig 15.06.2039	90	0,06	80 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	66	0,05
150 Hershey Co/The, 1,700 %, fällig 01.06.2030	125	0,09	100 Merck & Co Inc, 2,350 %, fällig 24.06.2040	74	0,05
40 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	34	0,02	200 Meta Platforms Inc, 144A, 3,850 %, fällig 15.08.2032	188	0,13
100 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	80	0,06	180 Meta Platforms Inc, 144A, 4,450 %, fällig 15.08.2052	164	0,12
70 Humana Inc, 4,950 %, fällig 01.10.2044	67	0,05	270 Micron Technology Inc, 2,703 %, fällig 15.04.2032	210	0,15
540 ILFC E-Capital Trust I, 144A, 4,850 %, fällig 21.12.2065 *	385	0,27	224 Microsoft Corp, 3,450 %, fällig 08.08.2036	211	0,15
100 ILFC E-Capital Trust II, 144A, 5,100 %, fällig am 21.12.2065 *	72	0,05	67 Microsoft Corp, 2,525 %, fällig 01.06.2050	49	0,03
140 Intel Corp, 2,800 %, fällig 12.08.2041	104	0,07	89 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	70	0,05
70 Intel Corp, 4,900 %, fällig 05.08.2052	68	0,05	50 MidAmerican Energy Co, 3,650 %, fällig 15.04.2029	49	0,03
220 Intel Corp, 3,200 %, fällig 12.08.2061	155	0,11	180 MidAmerican Energy Co, 3,150 %, fällig 15.04.2050	140	0,10
270 Intercontinental Exchange Inc, 4,600 %, fällig 15.03.2033	268	0,19	310 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 20.06.2027	311	0,22
40 Intercontinental Exchange Inc, 4,950 %, fällig 15.06.2052	40	0,03	40 Molson Coors Beverage Co, 3,000 %, fällig am 15.07.2026	37	0,03
390 Invitation Homes Operating Partnership LP, 4,150 %, fällig 15.04.2032	351	0,25	80 Molson Coors Beverage Co, 4,200 %, fällig am 15.07.2046	66	0,05
80 Jersey Central Power & Light Co, 144A, 4,300 %, fällig am 15.01.2026	79	0,06	40 Mondelez International Inc, 2,625 %, fällig 04.09.2050	27	0,02
270 Johnson & Johnson, 2,100 %, fällig am 09.01.2040	197	0,14	270 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig am 28.04.2026 *	254	0,18
90 Johnson & Johnson, 2,450 %, fällig am 09.01.2060	60	0,04	1.710 Morgan Stanley, 0,985 %, fällig 10.12.2026 *	1.515	1,07
70 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	67	0,05	50 Morgan Stanley, 1,593 %, fällig 04.05.2027 *	45	0,03
570 JPMorgan Chase & Co, 2,739 %, fällig 15.10.2030 *	494	0,35	70 Morgan Stanley, 1,794 %, fällig 13.02.2032 *	55	0,04
20 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	17	0,01	210 Morgan Stanley, 2,239 %, fällig 21.07.2032 *	169	0,12
400 JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, fällig 13.05.2031 *	343	0,24	150 Morgan Stanley, 2,511 %, fällig am 20.10.2032 *	123	0,09
900 JPMorgan Chase & Co, 1,953 %, fällig 04.02.2032 *	714	0,50	520 Morgan Stanley, 2,484 %, fällig am 16.09.2036 *	401	0,28
260 JPMorgan Chase & Co, 2,580 %, fällig 22.04.2032 *	215	0,15	160 Morgan Stanley, 5,297 %, fällig 20.04.2037 *	153	0,11
90 JPMorgan Chase & Co, 2,545 %, fällig 08.11.2032 *	74	0,05	20 MPLX LP, 4,800 %, fällig am 15.02.2029	20	0,01
380 JPMorgan Chase & Co, 4,586 %, fällig 26.04.2033 *	366	0,26	430 MPLX LP, 4,500 %, fällig am 15.04.2038	381	0,27
140 JPMorgan Chase & Co, 4,260 %, fällig 22.02.2048 *	124	0,09	10 Nasdaq Inc, 2,500 %, fällig 21.12.2040	7	-
70 JPMorgan Chase & Co, 3,964 %, fällig 15.11.2048 *	59	0,04	90 New York Life Insurance Co, 144A, 3,750 %, fällig 15.05.2050	75	0,05
120 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, fällig 23.01.2049 *	100	0,07	80 New York Life Insurance Co, 144A, 4,450 %, fällig 15.05.2069	71	0,05
10 JPMorgan Chase & Co, 3,328 %, fällig 22.04.2052 *	8	0,01	70 NextEra Energy Operating Partners LP, 144A, 4,250 %, fällig am 15.07.2024	68	0,05
240 JPMorgan Chase & Co, Serie KK, 3,650 %, fortwährend *	209	0,15	70 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 1,050 %, fällig 08.03.2024	66	0,05
100 Kaiser Foundation Hospitals, Serie 2021, 2,810 %, fällig 01.06.2041	77	0,05	90 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,000 %, fällig 09.03.2026	79	0,06
70 Kaiser Foundation Hospitals, Serie 2019, 3,266 %, fällig 01.11.2049	55	0,04	110 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, fällig 09.03.2028	91	0,06
20 Kaiser Foundation Hospitals, Serie 2021, 3,002 %, fällig 01.06.2051	15	0,01	310 Nordstrom Inc, 2,300 %, fällig 08.04.2024	293	0,21
310 Kimco Realty Corp, 2,250 %, fällig 01.12.2031	249	0,18	120 Norfolk Southern Railway Co., 7,875 %, fällig am 15.05.2043	153	0,11
60 Kinder Morgan Energy Partners LP, 7,300 %, fällig 15.08.2033	67	0,05	80 Northwest Pipeline LLC, 7,125 %, fällig 01.12.2025	85	0,06
100 Kinder Morgan Inc, 5,300 %, fällig am 01.12.2034	98	0,07	480 Northwest Pipeline LLC, 4,000 %, fällig am 01.04.2027	463	0,33
90 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig am 01.03.2048	84	0,06	170 Northwestern Mutual Life Insurance Co.The, 144A, 3,850 %, fällig 30.09.2047	143	0,10
130 KKR Group Finance Co III LLC, 144A, 5,125 %, fällig 01.06.2044	123	0,09	90 Northwestern Mutual Life Insurance Co.The, 144A, 3,625 %, fällig 30.09.2059	69	0,05
40 KKR Group Finance Co VII LLC, 144A, 3,625 %, fällig 25.02.2050	31	0,02	340 NRG Energy Inc, 144A, 2,450 %, fällig 02.12.2027	291	0,21
150 KLA Corp, 4,650 %, fällig 15.07.2032	153	0,11	130 Nuveen LLC, 144A, 4,000 %, fällig 01.11.2028	126	0,09
30 KLA Corp, 4,950 %, fällig 15.07.2052	30	0,02	50 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	43	0,03

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
United States — (Fortsetzung)					
40 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	33	0,02	240 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01.03.2030	207	0,15
150 Occidental Petroleum Corp, 8,000 %, fällig 15.07.2025	163	0,12	120 Texas Instruments Inc, 2,250 %, fällig am 04.09.2029	107	0,08
50 Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, fällig am 15.09.2031	58	0,04	200 Texas Instruments Inc, 3,650 %, fällig 16.08.2032	193	0,14
40 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig am 15.09.2036	43	0,03	300 Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2039	280	0,20
50 Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, fällig 15.06.2039	59	0,04	480 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig am 01.07.2038	494	0,35
40 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig am 15.04.2046	35	0,02	90 Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig 15.06.2039	88	0,06
100 Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, fällig am 15.02.2047	83	0,06	254 Time Warner Entertainment Co LP, 8,375 %, fällig am 15.07.2033	293	0,21
190 Ohio Edison Co, 6,875 %, fällig 15.07.2036	221	0,16	60 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	52	0,04
150 Oncor Electric Delivery Co LLC, 144A, 4,150 %, fällig 01.06.2032	150	0,11	260 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	217	0,15
20 Oncor Electric Delivery Co LLC, 3,100 %, fällig am 15.09.2049	16	0,01	70 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	59	0,04
380 Oracle Corp, 4,000 %, fällig 15/07/2046	279	0,20	120 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.11.2031	96	0,07
80 Otis Worldwide Corp, 2,565 %, fällig 15.02.2030	69	0,05	480 T-Mobile USA Inc, 2,700 %, fällig 15.03.2032	400	0,28
130 Pacific Gas and Electric Co, 4,250 %, fällig 01.08.2023	129	0,09	20 T-Mobile USA Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2040	18	0,01
100 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig am 01.08.2027	85	0,06	180 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041	132	0,09
100 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.12.2027	88	0,06	150 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15.02.2051	108	0,08
170 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig am 01.02.2031	130	0,09	335 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig am 01.02.2026	366	0,26
10 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig am 01.08.2040	7	–	460 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,250 %, fällig 01.12.2026	499	0,35
80 Pacific Gas and Electric Co, 4,750 %, fällig 15.02.2044	62	0,04	50 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 4,450 %, fällig 01.08.2042	45	0,03
60 Pacific Gas and Electric Co, 4,950 %, fällig 01.07.2050	48	0,03	230 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950 %, fällig 15.05.2050	191	0,13
100 Parsley Energy LLC - Parsley Finance Corp, 144A, 5,625 %, fällig 15.10.2027	97	0,07	380 Trust Financial Corp, 1,267 %, fällig 02.03.2027 *	341	0,24
170 Parsley Energy LLC - Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2028	159	0,11	320 Union Pacific Corp, 2,973 %, fällig 16.09.2062	221	0,16
90 PayPal Holdings Inc, 2,300 %, fällig 01.06.2030	77	0,05	90 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05.02.2070	72	0,05
250 PayPal Holdings Inc, 4,400 %, fällig am 01.06.2032	246	0,17	207 United Airlines 2020-1 Klasse B Pass Through Trust, 4,875 %, fällig 15.01.2026	197	0,14
30 PayPal Holdings Inc, 3,250 %, fällig 01.06.2050	23	0,02	110 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	94	0,07
20 PayPal Holdings Inc, 5,050 %, fällig 01.06.2052	20	0,01	120 UnitedHealth Group Inc, 3,500 %, fällig 15.08.2039	104	0,07
150 PepsiCo Inc, 2,625 %, fällig 29.07.2029	138	0,10	90 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15.05.2040	70	0,05
360 PepsiCo Inc, 3,900 %, fällig 18.07.2032	353	0,25	120 UnitedHealth Group Inc, 4,750 %, fällig 15.07.2045	118	0,08
60 Pfizer Inc, 2,550 %, fällig 28.05.2040	46	0,03	30 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	29	0,02
420 Philip Morris International Inc, 1,750 %, fällig 01.11.2030	325	0,23	110 UnitedHealth Group Inc, 4,750 %, fällig 15.05.2052	109	0,08
380 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig am 15.01.2031	313	0,22	230 Verizon Communications Inc, 1,500 %, fällig 18.09.2030	183	0,13
70 Plains All American Pipeline LP Serie B, 6,125 %, unbefristet *	60	0,04	680 Verizon Communications Inc, 4,272 %, fällig 15.01.2036	628	0,44
40 Plains All American Pipeline LP - PAA Finance Corp, 6,700 %, fällig 15.05.2036	40	0,03	10 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig am 16.03.2027	10	0,01
10 Procter & Gamble Co, 3,000 %, fällig 25.03.2030	9	0,01	100 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig am 20.11.2040	72	0,05
230 Procter & Gamble Co.The, 1,200 %, fällig 29.10.2030	187	0,13	150 Verizon Communications Inc, 3,400 %, fällig am 22.03.2041	121	0,09
200 Prologis LP, 1,250 %, fällig 15.10.2030	160	0,11	60 Verizon Communications Inc, 2,850 %, fällig 03.09.2041	45	0,03
130 QUALCOMM Inc, 4,250 %, fällig 20.05.2032	131	0,09	40 Verizon Communications Inc, 6,550 %, fällig 15.09.2043	47	0,03
70 QUALCOMM Inc, 4,500 %, fällig 20.05.2052	68	0,05	60 Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig am 15.08.2046	52	0,04
100 Range Resources Corp, 4,875 %, fällig am 15.05.2025	97	0,07	70 Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig am 22.03.2050	60	0,04
190 Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15.01.2029	200	0,14	80 Verizon Communications Inc, 3,550 %, fällig 22.03.2051	63	0,04
70 Raymond James Financial Inc, 4,950 %, fällig am 15.07.2046	68	0,05	30 Verizon Communications Inc, 2,987 %, fällig 30.10.2056	20	0,01
90 Raymond James Financial Inc, 3,750 %, fällig am 01.04.2051	74	0,05	60 Verizon Communications Inc, 3,000 %, fällig 20.11.2060	40	0,03
100 Republic Services Inc, 3,375 %, fällig 15.11.2027	95	0,07	240 Verizon Communications Inc, 3,700 %, fällig 22.03.2061	185	0,13
150 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, fällig am 15.10.2026	126	0,09	100 VICI Properties LP, 4,950 %, fällig 15.02.2030	96	0,07
70 S&P Global Inc, 1,250 %, fällig 15.08.2030	56	0,04	360 VICI Properties LP, 5,125 %, fällig 15.05.2032	344	0,24
30 S&P Global Inc, 3,250 %, fällig 01.12.2049	24	0,02	90 Visa Inc, 2,050 %, fällig 15.04.2030	79	0,06
230 Salesforce Inc, 1,500 %, fällig 15.07.2028	202	0,14	70 Visa Inc, 2,700 %, fällig 15.04.2040	56	0,04
60 Salesforce Inc, 1,950 %, fällig 15.07.2031	51	0,04	70 Visa Inc, 3,650 %, fällig am 15.09.2047	62	0,04
130 Salesforce Inc, 2,900 %, fällig 15.07.2051	96	0,07	220 Vontier Corp, 1,800 %, fällig 01.04.2026	193	0,14
90 Salesforce Inc, 3,050 %, fällig 15.07.2061	65	0,05	450 Vontier Corp, 2,400 %, fällig 01.04.2028	365	0,26
200 San Diego Gas & Electric Co, Serie VVV, 1,700 %, fällig am 01.10.2030	165	0,12	330 Walmart Inc, 1,800 %, fällig am 22.09.2031	278	0,20
200 San Diego Gas & Electric Co, Serie RRR, 3,750 %, fällig am 01.06.2047	170	0,12	150 Walmart Inc, 2,650 %, fällig 22.09.2051	113	0,08
180 Service Properties Trust, 4,500 %, fällig 15.06.2033	177	0,12	20 Walt Disney Co.The, 6,200 %, fällig 15.12.2034	23	0,02
390 Southern California Edison Co, 2,250 %, fällig am 01.06.2030	327	0,23	23 Walt Disney Co.The, 6,400 %, fällig 15.12.2035	27	0,02
150 Southern California Edison Co, Serie G, 2,500 %, fällig am 01.06.2031	126	0,09	80 Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig am 15.11.2037	95	0,07
10 Southern California Edison Co, 4,000 %, fällig am 04.01.2047	8	0,01	50 Walt Disney Co.The, 5,400 %, fällig 01.10.2043	54	0,04
160 Southern California Edison Co, Serie C, 4,125 %, fällig am 01.03.2048	133	0,09	10 Walt Disney Co.The, 4,950 %, fällig 15.10.2045	10	0,01
100 Southern California Edison Co, 3,650 %, fällig am 01.02.2050	77	0,05	170 Waste Management Inc, 3,150 %, fällig 15.11.2027	162	0,11
260 Southwest Airlines Co, 5,250 %, fällig 04.05.2025	267	0,19	200 Wells Fargo & Co, 0,805 %, fällig 19.05.2025 *	188	0,13
70 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	62	0,04	110 Wells Fargo & Co, 2,406 %, fällig 30.10.2025 *	105	0,07
570 SVB Financial Group, 4,570 %, fällig 29.04.2033 *	531	0,37	740 Wells Fargo & Co, 4,540 %, fällig 15.08.2026 *	735	0,52
270 Targa Resources Corp, 5,200 %, fällig 01.07.2027	269	0,19	10 Wells Fargo & Co, 3,000 %, fällig 23.10.2026	9	0,01
330 Targa Resources Corp, 4,200 %, fällig 01.02.2033	297	0,21	10 Wells Fargo & Co, 3,196 %, fällig 17.06.2027 *	9	0,01
180 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig am 01.02.2031	167	0,12	110 Wells Fargo & Co, 3,584 %, fällig am 22.05.2028 *	104	0,07
170 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners FinanzenCorp, 4,000 %, fällig 15.01.2032	149	0,11	80 Wells Fargo & Co, 3,068 %, fällig 30.04.2041 *	61	0,04
50 Target Corp, 3,375 %, fällig 15.04.2029	48	0,03	200 Wells Fargo & Co, 5,375 %, fällig am 11.02.2043	200	0,14
640 TD SYNNEX Corp, 1,250 %, fällig 09.08.2024	595	0,42	170 Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig am 12.07.2046	156	0,11
100 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,270 %, fällig 15.05.2047	90	0,06	170 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig am 04.04.2051 *	166	0,12
270 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, fällig 15.03.2027	289	0,20	630 Wells Fargo & Co, 4,611 %, fällig 25.04.2053 *	579	0,41
340 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, fällig 15.10.2028	367	0,26	90 Welltower Inc, 3,850 %, fällig 15.06.2032	82	0,06
			230 Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig am 01.06.2025	220	0,16
			80 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig am 15.08.2048	70	0,05
			130 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig am 01.02.2050	113	0,08
			10 Williams Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2051	7	–
			390 Workday Inc, 3,800 %, fällig 01.04.2032	357	0,25
			Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 146.734\$)	90.769	64,21
				127.980	90,53

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 7,79 % (28. Februar 2022: 9,07 %)		
Bermudas — 0,20 % (28. Februar 2022: 0,18 %)		
330 Bermuda Government International Bond, 144A, 2,375 %, fällig 20.08.2030	279	0,20
Chile — 0,22 % (28. Februar 2022: 0,20 %)		
200 Chile Government International Bond, 2,550 %, fällig 27.07.2033	161	0,11
200 Chile Government International Bond, 3,100 %, fällig 07.05.2041	147	0,11
	308	0,22
Ghana — 0,06 % (28. Februar 2022: 0,09 %)		
250 Ghana Government International Bond, 144A, 8,627 %, fällig 16.06.2049	89	0,06
Jordanien — 0,18 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
270 Jordan Government International Bond, 144A, 4,950 %, fällig 07.07.2025	256	0,18
Mexiko — 0,95 % (28. Februar 2022: 1,06 %)		
MXN 17.350 Mexican Bonos, Serie M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	823	0,58
290 Mexico Government International Bond, 3,500 %, fällig 12.02.2034	243	0,17
350 Mexico Government International Bond, 4,280 %, fällig 14.08.2041	281	0,20
	1.347	0,95
Panama — 0,26 % (28. Februar 2022: 0,24 %)		
470 Panama Government International Bond, 2,252 %, fällig 29.09.2032	367	0,26
Paraguay — 0,15 % (28. Februar 2022: 0,15 %)		
260 260 Paraguay Government International Bond, 144A, 5,400 %, fällig 30.03.2050	218	0,15
Peru — 0,06 % (28. Februar 2022: 0,05 %)		
100 Peruvian Government International Bond, 2,783 %, fällig 23.01.2031	85	0,06
USA — 5,71 % (28. Februar 2022: 5,69 %)		
770 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 30/06/2024	764	0,54
350 United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 30/06/2027	348	0,25
1.120 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31/07/2027	1.090	0,77
580 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2032	566	0,40
2.300 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15/08/2032	2.219	1,57
1.440 United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 15/05/2042	1.378	0,98
390 United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 15/08/2042	381	0,27
1.340 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2052	1.235	0,87
90 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15/08/2052	85	0,06
	8.066	5,71
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 11.940\$)	11.015	7,79
Schuldscheindarlehen — 0,81 % (28. Februar 2022: 0,85 %)		
337 Carnival Corp, 5,877 %, fällig 30.06.2025 *	323	0,23
277 Horizon Therapeutics USA Inc, 4,313 %, fällig 26.02.2028 *	270	0,19
79 Schweitzer-Mauduit International Inc, 6,125 %, fällig am 06.05.2029 *	75	0,05
150 SkyMiles IP Ltd, 6,460 %, fällig 16.09.2027 *	152	0,11
149 Southwestern Energy, 4,704 %, fällig am 08.06.2027 *	148	0,11
178 United Airlines Inc, 6,533 %, fällig am 14.04.2028 *	174	0,12
Summe Schuldverschreibungen (Kosten 1.163 USD)	1.142	0,81
Kommunale Anleihen — 0,81 % (28. Februar 2022: 0,68 %)		
95 Alabama Economic Settlement Authority, 3,163 %, fällig am 15.09.2025	94	0,07
150 American Municipal Power Inc, 7,834 %, fällig 15.02.2041	196	0,14
210 Port Authority of New York & New Jersey, 4,458 %, fällig am 01.10.2062	204	0,14
160 Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 4,132 %, fällig 15.05.2032	158	0,11
210 Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 3,006 %, fällig 15.05.2050	156	0,11
210 State of California, 7,300 %, fällig 01.10.2039	267	0,19
70 State of Illinois, 5,100 %, fällig 01.06.2033	70	0,05

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzinheit — Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA. HY, 5,000 % — Buy	20.06.2027	2.921	\$ 37
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % — Buy	20.06.2027	3.110	(11)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				\$ 37
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				(11)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				\$ 26

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Kommunale Anleihen insgesamt (Kosten 1.218 USD)		
Organismen für gemeinsame Anlagen — 0,79 % (28. Februar 2022: 6,44 %)		
1.110 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.110	0,79
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 1.110\$)	1.110	0,79
Vorzugsaktien — 0,16 % (28. Februar 2022: 0,29 %)		
USA — 0,16 % (28. Februar 2022: 0,29 %)		
8 KeyCorp	206	0,14
1 Prudential Financial Inc	27	0,02
	233	0,16
Summe Vorzugsaktien (Kosten 234 USD)	233	0,16
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 162.631\$)		
	142.838	101,04
Credit Default Swaps — 0,03 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	37	0,03
Devisenterminkontrakte — 0,06 % (28. Februar 2022: 0,08 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	82	0,06
Futures — (0,10 %) (28. Februar 2022: 0,12 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	146	0,10
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	143.103	101,23
Credit Default Swaps — 0,01 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(11)	(0,01)
Devisenterminkontrakte — (3,53 %) (28. Februar 2022: (0,99 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(4.983)	(3,53)
Futures — (0,07 %) (28. Februar 2022: (0,09 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(104)	(0,07)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	(5.098)	(3,61)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	138.005	97,62
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
	3.366	2,38
Gesamtnettovermögen	141.371\$	100,00

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

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 35.974.000\$ und machten 25,48 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.

ABKÜRZUNGEN:

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

MXN – Mexikanischer Peso

	% des Gesamtnettovermögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,29
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	0,77
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,75
Finanzderivate	0,18
Sonstige Vermögenswerte	3,01
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	128	Verkauf	EUR	128	\$ –
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2.896	Verkauf	GBP	2.464	33
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	106.276	Verkauf	USD	128.415	(4.918)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.586	Verkauf	USD	3.664	(57)
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	EUR	1.402	Verkauf	USD	1.422	(8)
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	422	Verkauf	GBP	350	15
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	BRL	1.461	Verkauf	USD	260	17
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	MXN	12.140	Verkauf	USD	580	17
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 143\$)								\$ 82
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.739))\$								(4.983)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.596))\$								\$ (4.901)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(34)	(3,975)	USD	\$ 34
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(18)	(2,253)		18
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	36	7,500		(13)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	112	12,412		(66)
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	(69)	(9,373)		94
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2022	Bank of America Merrill Lynch	67	10,016		(25)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 202\$)					\$ 146
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (158))\$					(104)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 44\$)					\$ 42

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 2,22 % (28. Februar 2022: 3,57 %)			Kanada — 1,09 % (28. Februar 2022: 0,96 %)		
260 Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Ctf Ser 2004-R10, Serie 2004 R10, Klasse M6, 4,499 %, fällig 25.11.2034 *	227	1,19	30 Bank of Montreal, 1,850 %, fällig am 01.05.2025	28	0,15
58 Ameriquest Mortgage Securities Trust 2006-R1, Serie 2006 R1, Klasse M1, 3,029 %, fällig 25.03.2036 *	58	0,31	20 Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, fällig am 11.06.2025	19	0,10
55 RAMP Serie 2006-RZ3 Trust, Serie 2006 RZ3, Klasse M1, 2,794 %, fällig 25.08.2036 *	53	0,28	20 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig am 30.05.2041	21	0,11
100 Saxon Asset Securities Trust 2006-3, Serie 2006 3, Klasse A4, 2,684 %, fällig 25.10.2046 *	84	0,44	20 Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,950 %, fällig am 23.06.2023	20	0,10
Asset-Backed Securities insgesamt (Kosten 460 USD)	422	2,22	10 MEG Finance Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.02.2029	9	0,05
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 21,00 % (28. Februar 2022: 17,27 %)			40 Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig am 10.06.2025	37	0,19
100 BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Klasse C, 4,149 %, fällig 15.09.2060 *	90	0,47	10 Teck Resources Ltd, 3,900 %, fällig 15.07.2030	9	0,05
7.861 Benchmark 2018-B7 Mortgage Trust, Serie 2018 B7, Klasse XA, 0,587 %, fällig 15.05.2053 *	146	0,77	70 Toronto-Dominion Bank.The, 1,150 %, fällig 12.06.2025	64	0,34
100 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Serie 2021 R03, Klasse 1B1, 144A, 4,933 %, fällig 25.12.2041 *	91	0,48		207	1,09
19 Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930 %, fällig am 01.06.2030	18	0,10	Kolumbien — 0,36 % (28. Februar 2022: 0,40 %)		
20 Fannie Mae Pool 'AN5386', 3,250 %, fällig am 01.05.2029	19	0,10	100 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig am 28.05.2045	69	0,36
22 Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, fällig am 01.07.2043	21	0,11	Frankreich — 1,00 % (28. Februar 2022: 0,97 %)		
40 Fannie Mae Pool 'BM6898', 2,149 %, fällig 01.02.2032 *	35	0,18	200 BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14.08.2028	190	1,00
89 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, fällig 03.01.2051	77	0,41	Israel — 1,14 % (28. Februar 2022: 1,04 %)		
135 Fannie Mae Pool 'CA5220', 3,000 %, fällig 02.01.2050	125	0,66	120 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig am 21.07.2023	115	0,61
93 Fannie Mae Pool 'CA9390', 2,500 %, fällig 03.01.2051	84	0,44	120 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	102	0,53
92 Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000 %, fällig 10.01.2051	86	0,45		217	1,14
189 Fannie Mae Pool 'CB2164', 3,000 %, fällig 11.01.2051	177	0,93	Macau — 0,74 % (28. Februar 2022: 0,79 %)		
95 Fannie Mae Pool 'CB2375', 2,500 %, fällig 12.01.2051	85	0,45	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig am 26.08.2028	140	0,74
308 Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000 %, fällig 09.01.2048	306	1,61	Peru — 0,51 % (28. Februar 2022: 0,53 %)		
93 Fannie Mae Pool 'FM9195', 2,500 %, fällig 10.01.2051	83	0,44	100 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	97	0,51
93 Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000 %, fällig 11.01.2051	87	0,46	Vereinigtes Königreich — 1,22 % (28. Februar 2022: 0,35 %)		
93 Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, fällig 07.01.2051	81	0,42	40 BAT Capital Corp, 3,557 %, fällig am 15.08.2027	37	0,19
97 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 02.01.2052	84	0,44	40 BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig 15.08.2047	29	0,16
94 Fannie Mae Pool 'FS1107', 2,500 %, fällig 12.01.2051	85	0,45	200 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.07.2031	165	0,87
200 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, fällig 06.01.2049	194	1,02		231	1,22
78 Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000 %, fällig 10.01.2050	67	0,35	USA — 22,36 % (28. Februar 2022: 20,29 %)		
88 Fannie Mae Pool 'MA4305', 2,000 %, fällig 04.01.2051	76	0,40	10 Abbott Laboratories, 3,750 %, fällig am 30.11.2026	10	0,05
80 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, fällig am 11.01.2050	72	0,38	10 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig am 30.11.2036	11	0,06
90 Freddie Mac Pool 'RA5921', 2,500 %, fällig am 09.01.2051	81	0,43	20 Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig am 30.11.2046	21	0,11
75 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig am 10.01.2041	63	0,33	100 AbbVie Inc, 3,600 %, fällig am 14.05.2025	98	0,52
19 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, fällig am 11.01.2041	16	0,08	80 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig am 21.11.2029	73	0,38
381 Freddie Mac Pool 'SD0176', 3,500 %, fällig am 12.01.2049	366	1,93	20 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig am 21.11.2029	18	0,09
94 Freddie Mac Pool 'SD0777', 2,500 %, fällig am 11.01.2051	84	0,44	20 Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15.08.2030	16	0,09
109 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Serie 2020 DNA2, Klasse M2, 144A, 4,294 %, fällig am 25.02.2050 *	109	0,58	20 Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15.08.2050	13	0,07
155 Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000 %, fällig 20.05.2050	155	0,81	32 Altria Group Inc, 4,400 %, fällig am 14.02.2026	32	0,17
246 Ginnie Mae II Pool 'MA7473', 3,000 %, fällig am 20.07.2051	231	1,22	8 Altria Group Inc, 4,800 %, fällig am 14.02.2029	8	0,04
262 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, fällig am 20.09.2051	248	1,30	20 Altria Group Inc, 5,800 %, fällig am 14.02.2039	19	0,10
98 Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500 %, fällig am 20.02.2052	94	0,50	30 Altria Group Inc, 5,950 %, fällig am 14.02.2049	27	0,14
100 Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,500 % ±	96	0,51	40 Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	33	0,18
99 Government National Mortgage Association, Serie 2022 3, Klasse IO, 0,640 %, fällig am 16.02.2061 *	6	0,03	50 Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	35	0,18
41 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQ2R, Klasse A3, 144A, 1,353 %, fällig am 25.10.2058 *	38	0,20	50 AT&T Inc, 1,650 %, fällig am 01.02.2028	43	0,23
250 Towd Point Mortgage Trust 2017-4, Serie 2017 4, Klasse B2, 144A, 3,426 %, fällig 25.06.2057 *	213	1,12	10 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	8	0,04
Summe Mortgage-Backed Securities (Anschaffungskosten 4.278 USD)	3.989	21,00	20 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	19	0,10
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 31,17 % (28. Februar 2022: 27,98 %)			40 Boeing Co/The, 4,875 %, fällig am 01.05.2025	40	0,21
Australien — 0,41 % (28. Februar 2022: 0,30 %)			50 Boeing Co/The, 5,150 %, fällig am 01.05.2030	49	0,26
20 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,00 %, fällig 30.09.2043	20	0,11	40 Boeing Co/The, 5,705 %, fällig am 01.05.2040	38	0,20
20 Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2041	19	0,10	50 Boeing Co/The, 5,805 %, fällig am 01.05.2050	48	0,25
40 Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, fällig am 27.03.2027	39	0,20	40 BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, fällig am 04.05.2026	39	0,20
	78	0,41	20 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig am 06.04.2030	19	0,10
Belgien — 0,49 % (28. Februar 2022: 0,49 %)			20 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig am 24.02.2050	15	0,08
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 01.06.2030	38	0,20	13 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	12	0,07
20 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	18	0,10	260 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	211	1,11
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,500 %, fällig 01.06.2050	36	0,19	10 Centene Corp, 4,250 %, fällig am 15.12.2027	10	0,05
	92	0,49	10 Centene Corp, 4,625 %, fällig am 15.12.2029	9	0,05
Brasilien — 1,85 % (28. Februar 2022: 1,75 %)			40 Charter Communications Communications Operating, 4,908 %, fällig 23.07.2025	40	0,21
200 Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01.02.2029	200	1,05	80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	76	0,40
60 Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, fällig am 15.01.2032	48	0,25	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	35	0,18
100 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 21.11.2036	104	0,55	10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	8	0,04
	352	1,85	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	31	0,17
			10 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig am 31.01.2032	8	0,04
			40 Cigna Corp, 4,375 %, fällig 15.10.2028	39	0,21
			20 Cigna Corp, 4,800 %, fällig 15.08.2038	19	0,10

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
United States — (Fortsetzung)					
20 Cigna Corp, 4,900 %, fällig 15.12.2048	19	0,10	20 Williams Cos Inc/The, 4,850 %, fällig am 01.03.2048	18	0,09
150 Citigroup Inc, 5,500 %, fällig am 13.09.2025	154	0,81	10 Workday Inc, 3,500 %, fällig 01.04.2027	10	0,05
200 Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	167	0,88	10 Workday Inc, 3,700 %, fällig 01.04.2029	9	0,05
10 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig am 15.07.2039	13	0,07		4.248	22,36
50 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 23.07.2048	47	0,25	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 7.1205)		
50 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 15.03.2051	36	0,19		5.921	31,17
40 Comcast Corp, 4,150 %, due 15.10.2028	40	0,21	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 27,86 % (28. Februar 2022: 33,90 %)		
10 Consolidated Edison Co of New York Inc, Serie 20A, 3,350 %, fällig am 01.04.2030	9	0,05	Brasilien — 0,82 % (28. Februar 2022: 1,98 %)		
60 Coterra Energy Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.03.2029	58	0,30	200 Brazilian Government International Bond, 5,000 %, fällig 27.01.2045	155	0,82
30 Deere & Co, 3,750 %, fällig am 15.04.2050	28	0,15	Indonesien — 2,32 % (28. Februar 2022: 2,20 %)		
150 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig am 15.01.2026	153	0,81	200 Indonesia Government International Bond, 4,625 %, fällig 15.04.2043	189	0,99
160 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig am 20.10.2028	153	0,80	IDR 1.145.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	78	0,41
40 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	41	0,22	IDR 2.677.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR87, 6,500 %, fällig 15.02.2031	174	0,92
40 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	37	0,19		441	2,32
20 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig am 01.12.2029	18	0,10	Mexiko — 6,80 % (28. Februar 2022: 6,36 %)		
10 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2026	8	0,04	MXN 25.890 Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	1.135	5,97
30 Elevance Health Inc, 3,650 %, fällig am 01.12.2027	29	0,15	200 Mexico Government International Bond, 4,350 %, fällig 15.01.2047	157	0,83
20 Energy Transfer LP, 5,250 %, fällig am 15.04.2029	20	0,10		1.292	6,80
20 Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig am 15.04.2049	20	0,10	Peru — 0,17 % (28. Februar 2022: 0,29 %)		
10 Energy Transfer LP, Serie G, 7,125 %, fortwährend*	9	0,05	30 Peruvian Government International Bond, 6,550 %, fällig 14.03.2037	33	0,17
20 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	20	0,11	Polen — 0,26 % (28. Februar 2022: 0,24 %)		
20 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	21	0,11	50 Republic of Poland Government International Bond, 4,000 %, fällig 22.01.2024	50	0,26
150 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2029	147	0,77	Russia — 1,09 % (28. Februar 2022: 0,84 %)		
10 Exelon Corp, 5,625 %, fällig 15.06.2035	11	0,06	RUB 39.311 Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig 23.05.2029 ty	207	1,09
10 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig am 19.08.2032	10	0,05	USA — 16,40 % (28. Februar 2022: 21,99 %)		
230 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig am 28.05.2027	216	1,14	20 United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.10.2024	19	0,10
220 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig am 13.11.2030	184	0,97	180 United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31.12.2025	162	0,86
20 General Motors Co, 5,950 %, fällig am 01.10.2049	19	0,10	10 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 30.04.2027	10	0,05
20 Home Depot Inc/The, 3,250 %, fällig 15.04.2032	18	0,10	470 United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 31.12.2027	408	2,15
40 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	34	0,18	210 United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 29.02.2028	187	0,98
20 Humana Inc, 3,700 %, fällig 23.03.2029	19	0,10	10 United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.08.2030	8	0,04
10 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, fällig 23.01.2049 *	8	0,04	10 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	9	0,05
20 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig am 01.03.2048	19	0,10	230 United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 15.08.2041	171	0,90
40 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig am 08.08.2024	38	0,20	10 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.02.2042	8	0,04
10 MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	8	0,04	50 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	45	0,24
30 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	25	0,13	50 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.08.2049	40	0,21
110 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 20.06.2027	110	0,58	220 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig am 15.08.2050	141	0,74
40 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig am 04.05.2025	37	0,20	260 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig am 15.11.2050	178	0,94
110 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig am 28.04.2026 *	103	0,54	500 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	365	1,92
70 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig am 01.04.2031 *	64	0,34	630 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	519	2,73
20 MPLX LP, 4,800 %, fällig am 15.02.2029	20	0,10	50 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	38	0,20
20 MPLX LP, 5,500 %, fällig am 15.02.2049	19	0,10	370 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	270	1,42
20 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig 15.03.2031	15	0,08	202 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	161	0,85
20 NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	17	0,09	367 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	338	1,78
40 Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig 15.01.2028	38	0,20	40 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	38	0,20
20 Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01.05.2050	21	0,11		3.115	16,40
20 PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig 01.05.2030	17	0,09	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 6.7855)		
20 Philip Morris International Inc, 2,100 %, fällig am 01.05.2030	16	0,08		5.293	27,86
20 Philip Morris International Inc, 4,500 %, fällig am 20.03.2042	17	0,09	Schuldseindarlehen — 7,22 % (28. Februar 2022: 7,67 %)		
40 Raytheon Technologies Corp, 2,250 %, fällig 01.07.2030	34	0,18	69 1011778 BC ULC, 4,122 %, fällig 14.11.2026 *	67	0,36
10 Raytheon Technologies Corp, 4,500 %, fällig 01.06.2042	10	0,05	59 Allied Universal Holdco LLC, 6,122 %, fällig am 14.05.2028 *	57	0,30
60 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig am 20.09.2025	61	0,32	10 AmWINS Group, Inc., 4,622 %, fällig am 17.02.2028 *	10	0,05
10 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig am 01.02.2031	9	0,05	59 Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 4,618 %, fällig am 01.12.2027 *	58	0,31
10 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.02.2026	9	0,05			
10 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	9	0,05			
10 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	9	0,05			
70 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	58	0,31			
10 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	8	0,04			
20 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	18	0,09			
20 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig am 01.02.2026	22	0,11			
50 Union Pacific Corp, 2,891 %, fällig 06.04.2036	42	0,22			
40 Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig 20.03.2060	34	0,18			
10 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	9	0,05			
20 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	18	0,09			
40 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	34	0,18			
20 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15.05.2040	15	0,08			
20 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	17	0,09			
40 US Bancorp, 1,450 %, fällig 12.05.2025	37	0,20			
10 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig am 10.08.2033	10	0,05			
20 Visa Inc, 2,050 %, fällig 15.04.2030	18	0,09			
30 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.03.2045	29	0,15			
140 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig am 01.02.2050	121	0,64			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. Aug 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
10 Brookfield WEC Holdings Inc., 5,122 %, fällig 01.08.2025 *	10	0,05	Credit Default Swaps — 0,12 % (28. Februar 2022: 0,78 %)		
20 Brown Group Holding LLC, 4,872 %, fällig 07.06.2028 *	20	0,10	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	23	0,12
69 Caesars Resort Collection LLC, 5,122 %, fällig am 22.12.2024 *	68	0,36	Index-Swaps — 4,87 % (28. Februar 2022: 1,09 %)		
47 Change Healthcare Holdings LLC, 4,872 %, fällig 01.03.2024 *	46	0,25	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	924	4,87
69 Charter Communications Operating LLC, 4,130 %, fällig 30.04.2025 *	68	0,36	Inflationsswaps — 0,17 % (28. Februar 2022: 0,10 %)		
49 Citadel Securities, 4,941 %, fällig am 27.02.2028 *	48	0,26	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	32	0,17
10 CSC Holding LLC, 4,641 %, fällig am 15.01.2026 *	10	0,05	Zinsswaps — 0,16 % (28. Februar 2022: 0,10 %)		
10 DCert Buyer, Inc., 6,372 %, fällig am 16.10.2026 *	10	0,05	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	31	0,16
49 Energizer Holdings, Inc., 4,625 %, fällig am 16.12.2027 *	48	0,25	Devisenterminkontrakte — 0,22 % (28. Februar 2022: 0,55 %)		
10 FleetCor Technologies Operating Co, LLC, 4,122 %, fällig 22.04.2028 *	10	0,05	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	41	0,22
10 Four Seasons Hotels Ltd, 4,372 %, fällig am 30.11.2023 *	10	0,05	Futures — (0,61 %) (28. Februar 2022: 0,87 %)		
20 Gainwell Acquisition Corp, 6,250 %, fällig 01.10.2027 *	19	0,10	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	115	0,61
69 Genesee & Wyoming Inc, 4,250 %, fällig am 30.12.2026 *	68	0,36	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	18.796	98,96
59 GoDaddy Operating Co, 4,122 %, fällig am 15.02.2024 *	58	0,31	Geschriebene Optionen — (0,15 %) (28. Februar 2022: (0,37 %))		
65 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 4,372 %, fällig am 15.11.2027 *	63	0,33	EUR		
10 GVC Holdings Gibraltar Ltd, 3,743 %, fällig am 16.03.2027 *	10	0,05	– Euro-Bund October 2022 Call 150,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
59 Harbor Freight Tools USA Inc, 5,122 %, fällig 19.10.2027 *	56	0,30	– IMM Euro\$ December 2022 Call 96,50, fällig am 19.12.2022 — Morgan Stanley	(1)	(0,01)
50 Hunter Douglas Inc, 6,340 %, fällig 09.02.2029 *	44	0,23	– IMM Euro\$ December 2022 Call 97,00, fällig am 19.12.2022 — Morgan Stanley	(2)	(0,01)
27 ICON Luxembourg Sarl, 4,563 %, fällig 01.07.2028 *	26	0,14	– U.S. 10 Year November 2022 Call 120,00, fällig 21.10.2022 — Morgan Stanley	(1)	(0,01)
9 iHeartCommunications Inc, 5,372 %, fällig 01.05.2026 *	9	0,05	– U.S. 10 Year November 2022 Call 121,00, fällig 21.10.2022 — Morgan Stanley	(1)	–
7 Indigo Merger Sub, Inc., 4,563 %, fällig am 01.07.2028 *	7	0,03	– U.S. 10 Year November 2022 Call 122,00, fällig 21.10.2022 — Morgan Stanley	–	–
40 Jazz Financing Lux Sarl, 5,872 %, fällig am 22.04.2028 *	39	0,21	– U.S. 10 Year October 2022 Call 118,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(2)	(0,01)
15 Level 3 Parent LLC, 4,122 %, fällig am 01.03.2027 *	15	0,08	– U.S. 10 Year October 2022 Call 119,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(1)	(0,01)
39 Nextar Broadcasting Inc, 4,872 %, fällig am 19.09.2026 *	39	0,20	– U.S. 10 Year October 2022 Call 119,50, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
20 Quikrete Holdings, Inc., 5,372 %, fällig am 11.06.2028 *	19	0,10	– U.S. 10 Year October 2022 Call 120,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
10 Rackspace Technology Global, Inc, 5,617 %, fällig 09.02.2028 *	8	0,04	– U.S. 10 Year October 2022 Call 120,50, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(1)	–
20 RealPage Inc, 5,372 %, fällig 18.02.2028 *	19	0,10	– U.S. 10 Year October 2022 Call 121,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(1)	–
46 Reynolds Consumer Products LLC, 4,122 %, fällig 04.02.2027 *	45	0,24	– U.S. 10 Year October 2022 Call 121,50, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
60 Sotera Health, 5,122 %, fällig am 13.12.2026 *	58	0,31	– U.S. 10 Year October 2022 Call 122,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(1)	–
30 Station Casinos LLC, 4,630 %, fällig am 08.02.2027 *	29	0,15	– U.S. 10 Year October 2022 Call 123,50, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
18 UFC Holdings Plc, 5,520 %, fällig 29.04.2026 *	18	0,09	– U.S. 10 Year October 2022 Call 123,50, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
30 United Airlines Inc, 6,533 %, fällig am 14.04.2028 *	29	0,15	– U.S. 10 Year October 2022 Call 120,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
10 Univision Communications Inc, 5,622 %, fällig 24.03.2026 *	10	0,05	– U.S. 10 Year October 2022 Call 121,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(1)	–
69 Verscend Holding Corp., 6,372 %, fällig am 27.08.2025 *	69	0,36	– U.S. 10 Year October 2022 Call 121,50, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(1)	–
60 Virgin Media Bristol LLC, 4,891 %, fällig am 04.01.2028 *	59	0,31	– U.S. 10 Year October 2022 Call 122,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(1)	–
15 Zebra Buyer LLC, 5,563 %, fällig 22.04.2028 *	15	0,08	– U.S. 10 Year October 2022 Call 122,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(1)	–
Summe Schuldverschreibungen (Kosten 1.407 USD)	1.371	7,22	– U.S. 10 Year October 2022 Call 123,50, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
Organismen für gemeinsame Anlagen — 3,28 % (28. Februar 2022: 5,54 %)			– U.S. 10 Year October 2022 Call 123,50, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
32 Franklin Templeton China Funds — Western Asset China Bond Fund — Klasse LM	463	2,44	– U.S. 10 Year October 2022 Call 123,50, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
159 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	159	0,84	– U.S. 10 Year October 2022 Put 120,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(6)	(0,04)
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 6215)	622	3,28	– US 10 Year W1 September 2022 Call 118,00, fällig am 02.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 20.6715)	17.618	92,75	– US 10 Year W1 September 2022 Call 119,50, fällig am 02.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert			
Gekaufte Optionen — 0,06 % (28. Februar 2022: 0,02 %)			– U.S. 5 Year October 2022 Call 111,75, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(1)	(0,01)
– U.S. 10 Year October 2022 Call 117,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	2	0,01	– U.S. 5 Year October 2022 Call 112,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(2)	(0,01)
– U.S. 10 Year October 2022 Call 117,50, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	1	0,01	– U.S. 5 Year October 2022 Call 112,50, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
– U.S. 10 Year October 2022 Put 120,50, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	4	0,02	– U.S. 5 Year October 2022 Call 113,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
– US 10 Year W1 September 2022 Call 117,00, fällig am 02.09.2022 — Morgan Stanley	1	–	– U.S. 5 Year October 2022 Call 113,25, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
– US 10 Year W1 September 2022 Put 117,00, fällig am 02.09.2022 — Morgan Stanley	1	–	– U.S. Bond November 2022 Call 144,00, fällig 21.10.2022 — Morgan Stanley	(1)	–
– U.S. 5 Year December 2022 Call 111,75, fällig 25.11.2022 — Morgan Stanley	1	0,01	– U.S. Bond October 2022 Call 143,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
– U.S. 5 Year October 2022 Call 111,25, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	1	0,01	– U.S. Bond October 2022 Call 144,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
– U.S. 5 Year October 2022 Call 112,75, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	–	–	– U.S. Bond October 2022 Put 140,00, fällig 23.09.2022 — Morgan Stanley	(5)	(0,03)
– US 5 Year W1 September 2022 Call 111,00, fällig am 02.09.2022 — Morgan Stanley	–	–	– US Long Bond W1. September 2022 Call 138,00, fällig am 02.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
97 USD Put/CAD Call 1,2670, fällig 08.10.2022 — Morgan Stanley	–	–	– US Long Bond W1. September 2022 Call 138,50, fällig am 02.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
306 USD Put/CAD Call 1,27, fällig 15.10.2022 — Goldman Sachs	–	–	– US Long Bond W1. September 2022 Call 140,00, fällig am 02.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
162 USD Put/JPY Call 131,50, fällig 07.10.2022 — Goldman Sachs	–	–	– US Long Bond W1. September 2022 Call 140,00, fällig am 02.09.2022 — Morgan Stanley	–	–
257 USD Put/JPY Call 131,55, fällig 06.10.2022 — Goldman Sachs	1	–	(148) USD Put/GBP Call 1,2015, fällig 25.10.2022 — JP Morgan	(1)	(0,01)
			(142) USD Put/GBP Call 1,2056, fällig 28.10.2022 — Citi	(1)	–
Gekaufte Optionen insgesamt (Kosten 215)	12	0,06	Summe geschriebene Optionen (Kosten (87) USD)	(28)	(0,15)
			Credit Default Swaps — 0,07 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(14)	(0,07)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Inflationsswaps — (0,16 %) (28. Februar 2022: (0,07 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(29)	(0,16)
Zinsswaps — (0,63 %) (28. Februar 2022: (0,24 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(120)	(0,63)
Devisenterminkontrakte — (0,28 %) (28. Februar 2022: (0,86 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(53)	(0,28)
Futures — (2,42 %) (28. Februar 2022: (2,43 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(459)	(2,42)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(703)	(3,71)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	18.093	95,25
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	902	4,75
Gesamtvermögen	18.995\$	100,00

- † Nicht liquide.
- ± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.
- γ Aufgrund der Ungewissheit der Zinszahlungen werden während und/oder nach dem zum 31. August 2022 endenden Geschäftsjahr keine Erträge aus dem Wertpapier mehr gezahlt.

ABKÜRZUNGEN:

- Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
- REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.
- TBA – Wird noch bekanntgegeben.
- EUR – Euro
- IDR – Indonesische Rupiah
- MXN – Mexikanischer Peso
- RUB – Russischer Rubel

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.430.000\$ und machten 7,52 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	77,53
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	6,80
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,09
Finanzderivate	5,84
Sonstige Vermögenswerte	6,74
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzinheit — Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.NA. HY, 5.000 % — Verkaufen	20.06.2027	1.138	\$ (14)
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1.000 % — Verkaufen	20.06.2027	6.935	\$ 23
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 171\$)				\$ 23
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				(14)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 171\$)				\$ 9

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Pay Floating USD 3M Libor BBA, Receive Fixed 0,820 %	06.04.2024	4.094	\$ (120)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,350 %, Receive Floating USD 3M Libor BBA	15.02.2028	317	\$ 31
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 22\$)				\$ 31
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (52))\$				(120)
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (30))\$				\$ (89)

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzinheit	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Pay Fixed 0,710 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.05.2027	3.594	\$ 375
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,130 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.08.2028	613	\$ 63
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,220 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.08.2028	122	\$ 12
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20.11.2026	660	\$ 26
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.02.2047	325	\$ 73
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,630 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.05.2047	1.540	\$ 319
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,650 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15.08.2047	73	\$ 15
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,733 %, Receive Floating USD SOFR Compound	20.10.2031	420	\$ 17
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,000 %, Receive Floating USD SOFR Compound	18.03.2032	239	\$ 18
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,500 %, Receive Floating USD SOFR Compound	21.04.2052	150	\$ 6
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 238\$)				\$ 924
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				–
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 238\$)				\$ 924

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitsstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	USD — VPI Städtische Verbraucher	18.11.2023	570	\$ 20
Morgan Stanley	USD — VPI Städtische Verbraucher	20.10.2026	150	9
Morgan Stanley	USD — VPI Städtische Verbraucher	18.11.2026	570	(21)
Morgan Stanley	USD — SOFR Compound	15.02.2029	377	3
Morgan Stanley	USD — VPI Städtische Verbraucher	20.10.2031	150	(8)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 22\$)				\$ 32
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): (16))\$				(29)
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 6\$)				\$ 3

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
10.07.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	79	Verkauf	JPY	10.638	\$ 2
10.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	48	Verkauf	JPY	6.538	1
10.11.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	42	Verkauf	CAD	53	1
17.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	131	Verkauf	CAD	168	4
18.10.2022	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	102	Verkauf	EUR	100	1
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	USD	270	Verkauf	EUR	264	3
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	NOK	1.919	Verkauf	EUR	186	6
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	CAD	1.620	Verkauf	USD	1.252	(19)
18.10.2022	BNP Paribas	Kauf	JPY	91.330	Verkauf	USD	675	(15)
18.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	GBP	244	Verkauf	USD	294	(11)
18.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD	408	Verkauf	CNH	2.738	12
18.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD	29	Verkauf	GBP	25	–
18.10.2022	JP Morgan	Kauf	AUD	771	Verkauf	USD	530	(2)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	276	Verkauf	CNH	1.847	8
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	211	Verkauf	MXN	4.418	(6)
18.10.2022	Morgan Stanley	Kauf	IDR	3.089.752	Verkauf	USD	205	3
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 120\$)							\$ 41	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (189))\$							(53)	
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (69))\$							\$ (12)	

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
90 Day Euro\$ Dezember 2022	Morgan Stanley	47	11.272 \$	\$ (218)
90 Day Euro\$ Juni 2023	Morgan Stanley	9	2.158	(75)
90 Day Euro\$ September 2023	Morgan Stanley	2	480	(15)
Australia 10 Year Bond September 2022	Morgan Stanley	5	410	–
Australischer Dollar Währung September 2022	Morgan Stanley	6	411	(8)
Euribor 3 Monate Dezember 2022	Morgan Stanley	9	2.220	(26)
Euro-FX Währung September 2022	Morgan Stanley	2	251	(11)
Euro-Bund September 2022	Morgan Stanley	(10)	(1.487)	73
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2022	Morgan Stanley	(1)	(165)	15
Euro-OAT September 2022	Morgan Stanley	2	277	(10)
Japanische Yen-Währung September 2022	Morgan Stanley	7	632	(23)
Long Gilt Dezember 2022	Morgan Stanley	2	251	(4)
Mexikanischer Peso Währung September 2022	Morgan Stanley	11	272	(3)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Morgan Stanley	(5)	(584)	4
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2022	Morgan Stanley	(6)	(751)	2
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2022	Morgan Stanley	3	625	(1)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Morgan Stanley	109	12.079	(37)
U.S. 5 Year Note (CBT) September 2022	Morgan Stanley	(1)	(111)	–
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2022	Morgan Stanley	(15)	(2.038)	21
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2022	Morgan Stanley	36	5.382	(28)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 191\$)				\$ 115
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (533))\$				(459)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (342))\$				\$ (344)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 80,44 % (28. Februar 2022: 92,11 %)			USA — 24,90 % (28. Februar 2022: 29,46 %)		
Australien — 1,05 % (28. Februar 2022: 1,25 %)			120 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig am 21.11.2029 110 1,22		
EUR	100 AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1,625 %, fällig am 11.03.2081 *	78 0,87	60 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig am 14.11.2048 58 0,65		
	20 Westpac Banking Corp, 2,668 %, fällig 15.11.2035 *	16 0,18	100 Air Lease Corp, 1,875 %, fällig 15.08.2026 88 0,97		
		94 1,05	130 AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15.09.2053 96 1,07		
Belgien — 0,90 % (28. Februar 2022: 2,46 %)			EUR	100 Ball Corp, 1,500 %, fällig 15.03.2027 88 0,97	
EUR	100 UCB SA, 1,000 %, fällig 30.03.2028 81 0,90		60 Bank of America Corp, 3,550 %, fällig am 05.03.2024 * 60 0,67		
Dänemark — 2,24 % (28. Februar 2022: 2,14 %)			80 Bank of America Corp, 2,676 %, fällig 19.06.2041 * 57 0,64		
EUR	200 Danske Bank A/S, 1,44A, 5,375 %, fällig am 12.01.2024 202 2,24		19 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029 18 0,20		
Finnland — 0,98 % (28. Februar 2022: 1,09 %)			40 Centene Corp, 4,625 %, fällig am 15.12.2029 38 0,42		
EUR	100 Neste Oyj, 0,750 %, fällig am 25.03.2028 88 0,98		60 Cigna Corp, 2,400 %, fällig 15.03.2030 51 0,57		
Frankreich — 8,95 % (28. Februar 2022: 10,08 %)			60 Cigna Corp, 3,400 %, fällig 15.03.2050 45 0,50		
EUR	100 AXA SA, 5,125 %, fällig 04.07.2043 * 103 1,15		60 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig am 15.07.2039 79 0,87		
	230 BNP Paribas SA, 1,44A, 3,052 %, fällig 13.01.2031 * 194 2,16		50 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 15.03.2051 36 0,40		
EUR	100 Engie SA, 0,500 %, fällig 24.10.2030 80 0,90		80 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048 77 0,86		
EUR	200 GELF Bond Issuer I SA, 1,125 %, fällig am 18.07.2029 163 1,81		20 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045 19 0,21		
EUR	100 JCDecaux SA, 1,625 %, fällig 07.02.2030 82 0,91		30 Elevance Health Inc, 3,650 %, fällig am 01.12.2027 29 0,32		
EUR	100 Orange SA, 5,000 %, fortwährend * 104 1,16		70 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig am 15.02.2078 * 58 0,64		
EUR	100 Terega SA, 0,875 %, fällig 17.09.2030 78 0,86		EUR	30 Exelon Corp, 3,400 %, fällig 15.04.2026 29 0,32	
		804 8,95	70 Goldman Sachs Group Inc.The, 3,375 %, fällig 27.03.2025 71 0,79		
Deutschland — 8,42 % (28. Februar 2022: 9,38 %)			80 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045 76 0,85		
EUR	200 Allianz SE, 3,200 %, fortwährend * 153 1,70		80 HCA Inc, 3,500 %, fällig am 01.09.2030 70 0,78		
EUR	100 alstria office REIT-AG, 1,500 %, fällig 15.11.2027 79 0,89		30 Humana Inc, 3,125 %, fällig 15.08.2029 27 0,31		
EUR	60 Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, fällig 15.06.2030 74 0,82		EUR	100 JPMorgan Chase & Co, 1,090 %, fällig 11.03.2027 * 93 1,04	
EUR	100 Hannover Rück SE, 1,125 %, fällig 09.10.2039 * 80 0,90		50 Lowe's Cos Inc, 3,000 %, fällig 15.10.2050 34 0,38		
EUR	100 Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München, 3,250 %, fällig 26.05.2049 * 94 1,04		20 Magallanes Inc, 1,44A, 5,050 %, fällig 15.03.2042 16 0,18		
EUR	100 Sirius Real Estate Ltd, 1,125 %, fällig 22.06.2026 86 0,96		30 Magallanes Inc, 1,44A, 5,141 %, fällig 15.03.2052 24 0,27		
EUR	120 Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, fällig 01.10.2024 118 1,31		70 McDonald's Corp, 3,700 %, fällig am 30.01.2026 69 0,77		
EUR	100 Vonovia SE, 0,750 %, fällig 01.09.2032 72 0,80		120 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052 95 1,05		
		756 8,42	30 MPLX LP, 4,500 %, fällig am 15.04.2038 27 0,30		
Irland — 1,35 % (28. Februar 2022: 1,44 %)			EUR	100 Prologis Euro Finance LLC, 1,000 %, fällig 06.02.2035 73 0,81	
EUR	150 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig am 30.01.2032 121 1,35		30 Prudential Financial Inc, 3,000 %, fällig 10.03.2040 24 0,27		
Italien — 4,13 % (28. Februar 2022: 4,79 %)			80 Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2039 75 0,83		
EUR	150 Enel Finance International NV, 1,44A, 6,000 %, fällig 07.10.2039 146 1,63		60 United Rentals North America Inc, 3,750 %, fällig am 15.01.2032 50 0,56		
EUR	200 Intesa Sanpaolo SpA, 1,44A, 4,198 %, fällig 01.06.2032 * 146 1,62		130 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig am 16.03.2027 132 1,47		
EUR	100 Terna — Rete Elettrica Nazionale, 2,375 %, fortwährend* 79 0,88		EUR	100 Wells Fargo & Co, 1,000 %, fällig am 02.02.2027 90 1,01	
		371 4,13	60 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig am 04.04.2051 * 59 0,65		
Niederlande — 3,84 % (28. Februar 2022: 4,23 %)			130 Williams Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2051 97 1,08		
EUR	80 ABN AMRO Bank NV, 1,000 %, fällig 16.04.2025 78 0,87			2.238 24,90	
EUR	200 Cooperatieve Rabobank UA, 3,250 %, unbefristet * 169 1,88		Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 9.079\$) 7.227 80,44		
EUR	100 ING Groep NV, 2,500 %, fällig 15.02.2029 * 98 1,09		Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 8,02 % (28. Februar 2022: 2,87 %)		
		345 3,84	Deutschland — 3,02 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Portugal — 0,96 % (28. Februar 2022: 1,05 %)			EUR	100 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig am 15.02.2029 94 1,04	
EUR	100 EDV — Energias de Portugal SA, 1,875 %, fällig am 02.08.2081 * 86 0,96		EUR	90 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031 80 0,90	
Südafrika — 2,18 % (28. Februar 2022: 2,18 %)			EUR	70 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Serie 2007, 4,250 %, fällig 04.07.2039 97 1,08	
EUR	200 Anglo American Capital Plc, 1,44A, 4,750 %, fällig am 10.04.2027 196 2,18			271 3,02	
Spanien — 2,61 % (28. Februar 2022: 1,89 %)			USA — 5,00 % (28. Februar 2022: 2,87 %)		
EUR	100 Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 1,375 %, fällig am 26.01.2032 81 0,91		140 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15/02/2025 135 1,51		
EUR	100 Iberdrola Finanzas SA, 1,375 %, fällig 11.03.2032 87 0,97		60 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2032 58 0,65		
EUR	60 Telefonica Emisiones SA, 7,045 %, fällig 20.06.2036 66 0,73		170 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/02/2052 136 1,51		
		234 2,61	130 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2052 120 1,33		
Schweden — 1,11 % (28. Februar 2022: 1,14 %)				449 5,00	
EUR	100 Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, fällig am 02.03.2028 * 100 1,11		Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 757\$) 720 8,02		
Schweiz — 3,96 % (28. Februar 2022: 4,36 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen — 6,86 % (28. Februar 2022: 0,65 %)		
EUR	200 Credit Suisse Group AG, 6,375 %, unbefristet * 157 1,75		617 Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend) 617 6,86		
EUR	200 UBS Group AG, 1,500 %, fällig 30.11.2024 198 2,21		Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 617\$) 617 6,86		
		355 3,96	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 10.453\$) 8.564 95,32		
Vereinigtes Königreich — 12,86 % (28. Februar 2022: 13,23 %)			Devisenterminkontrakte — 2,66 % (28. Februar 2022: 2,73 %)		
EUR	100 Annington Funding Plc, 1,650 %, fällig am 12.07.2024 98 1,09		Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 239 2,66		
GBP	100 Associated British Foods Plc, 2,500 %, fällig am 16.06.2034 95 1,05		Futures — (0,36 %) (28. Februar 2022: 0,21 %)		
EUR	100 Barclays Plc, 3,375 %, fällig 02.04.2025 * 101 1,12		Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 32 0,36		
GBP	100 Barclays Plc, 1,700 %, fällig 03.11.2026 * 103 1,15		Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 8.835 98,34		
EUR	200 HSBC Holdings Plc, 4,950 %, fällig 31.03.2030 194 2,16		Devisenterminkontrakte — (0,81 %) (28. Februar 2022: (0,26 %))		
GBP	100 Lloyds Banking Group Plc, 1,985 %, fällig 15.12.2031 * 98 1,09		Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (72) (0,81)		
EUR	100 Segro Capital Sarl, 1,875 %, fällig am 23.03.2030 89 0,99		Futures — (0,11 %) (28. Februar 2022: 0,00 %)		
EUR	100 SSE Plc, 4,000 %, fortwährend * 93 1,03		Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (10) (0,11)		
EUR	200 Standard Chartered Plc, 1,44A, 2,608 %, fällig 12.01.2028 * 177 1,97		Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten (82) (0,92)		
GBP	100 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500 %, fällig am 02.05.2025 108 1,21		Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 8.753 97,42		
		1.156 12,86	Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen 232 2,58		
			Gesamtvermögen 8.985\$ 100,00		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.101.000\$ und machten 12,25 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.

ABKÜRZUNGEN:

- Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
- EUR – Euro
- GBP – Britisches Pfund Sterling

Analise des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	87,21
Organismen für gemeinsame Anlagen	6,77
Finanzderivate	2,97
Sonstige Vermögenswerte	3,05
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)			
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2.632	Verkauf	BRL	13.342	\$	67
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	13.194	Verkauf	USD	2.443		93
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	148	Verkauf	USD	28		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	3	Verkauf	EUR	2		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	1		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	78	Verkauf	USD	80		(1)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	33	Verkauf	USD	40		(1)
10.04.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	13.149	Verkauf	USD	2.576		(70)
16.11.2022	Citi	Kauf	USD	3.493	Verkauf	EUR	3.403		56
16.11.2022	Citi	Kauf	USD	462	Verkauf	GBP	381		18
16.11.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	42	Verkauf	EUR	41		1
16.11.2022	JP Morgan	Kauf	USD	185	Verkauf	EUR	180		3
16.11.2022	Royal Bank of Canada	Kauf	USD	33	Verkauf	EUR	32		1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 270\$)								\$	239
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (26))\$									(72)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 244\$)								\$	167

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
Euro-Bobl September 2022	Morgan Stanley	(5)	(619) USD	\$	18	
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2022	Morgan Stanley	(1)	(165)		14	
Long Gilt Dezember 2022	Morgan Stanley	1	126		(2)	
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Morgan Stanley	3	351		(3)	
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Morgan Stanley	5	554		(2)	
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2022	Morgan Stanley	4	543		(3)	
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 21\$)					\$	32
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)						(10)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 21\$)					\$	22

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 8,79 % (28. Februar 2022: 7,64 %)					
Supranational — 8,79 % (28. Februar 2022: 7,64 %)					
RUB 368.000	International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig 22.01.2026	3.863	2,07		
ZAR 36.500	International Bank for Reconstruction & Development, 6,500 %, fällig 21.01.2027	2.030	1,09		
RUB 349.000	International Bank for Reconstruction & Development, 6,750 %, fällig 21.01.2027	3.711	1,99		
MXN 94.000	International Bank for Reconstruction & Development, 7,250 %, fällig 21.01.2027	4.459	2,39		
BRL 12.660	International Bank for Reconstruction & Development, 9,500 %, fällig 09.02.2029	2.320	1,25		
		16.383	8,79		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 18.619\$)					
		16.383	8,79		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 89,81 % (28. Februar 2022: 90,20 %)					
Australien — 2,56 % (28. Februar 2022: 8,15 %)					
AUD 1.560	New South Wales Treasury Corp, 4,000 %, fällig am 20.04.2023	1.075	0,58		
AUD 2.580	Queensland Treasury Corp, Serie 23, 144A, 4,250 %, fällig am 21.07.2023	1.786	0,96		
AUD 2.710	Western Australian Treasury Corp, Serie 23, 6,000 %, fällig am 16.10.2023	1.911	1,02		
		4.772	2,56		
Brasilien — 3,81 % (28. Februar 2022: 3,35 %)					
BRL 38.410	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFB, 10,000 %, fällig 01.01.2025	7.091	3,81		
Chile — 0,77 % (28. Februar 2022: 0,74 %)					
1.690	Chile Government International Bond, 2,450 %, fällig 31.01.2031	1.430	0,77		
Kolumbien — 4,73 % (28. Februar 2022: 4,14 %)					
COP 51.000.000	Colombian TES, Serie B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	8.823	4,73		
Frankreich — 6,86 % (28. Februar 2022: 4,99 %)					
EUR 11.580	French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032	9.543	5,12		
EUR 5.070	French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, fällig 25.05.2052	3.236	1,74		
		12.779	6,86		
Deutschland — 3,53 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
EUR 6.460	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,000 %, fällig 15.08.2023	6.576	3,53		
Ungarn — 2,93 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
HUF 2.200.000	Hungary Government Bond, Serie 22.B, 1,750 %, fällig 26.10.2022	5.465	2,93		
Italien — 3,59 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
EUR 6.670	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0,950 %, fällig 15.03.2023	6.700	3,59		
Malaysia — 4,05 % (28. Februar 2022: 4,23 %)					
MYR 21.850	Malaysia Government Bond, Serie 0313, 3,480 %, fällig 15.03.2023	4.902	2,63		
MYR 3.960	Malaysia Government Bond, Serie 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	899	0,48		
MYR 7.750	Malaysia Government Bond, Serie 0417, 3,899 %, fällig 16.11.2027	1.744	0,94		
		7.545	4,05		
Mexiko — 12,97 % (28. Februar 2022: 10,64 %)					
MXN 110.500	Mexican Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig am 31.05.2029	5.343	2,86		
MXN 124.100	Mexican Bonos, Serie M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	5.884	3,16		
MXN 155.600	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	6.823	3,66		
MXN 137.000	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	6.126	3,29		
		24.176	12,97		
Neuseeland — 1,74 % (28. Februar 2022: 4,10 %)					
NZD 2.670	New Zealand Government Bond, Serie 0423, 5,500 %, fällig 15.04.2023	1.651	0,89		
NZD 3.510	New Zealand Government Bond, Serie 0551, 2,750 %, fällig 15.05.2051	1.594	0,85		
		3.245	1,74		
Polen — 0,85 % (28. Februar 2022: 5,99 %)					
PLN 3.100	Republic of Poland Government Bond, Serie 1023, 4,000 %, fällig 25.10.2023	641	0,34		
PLN 6.490	Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	950	0,51		
		1.591	0,85		
Südafrika — 3,91 % (28. Februar 2022: 4,07 %)					
ZAR 98.500	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	3.625	1,95		
ZAR 79.600	Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	3.660	1,96		
		7.285	3,91		
Südkorea — 4,67 % (28. Februar 2022: 5,42 %)					
KRW 13.300.000	Korea Treasury Bond, Serie 4412, 2,750 %, fällig am 12.10.2044	8.705	4,67		
Schweden — 3,83 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
SEK 76.700	Sweden Government Bond, Serie 1057, 144A, 1,500 %, fällig 13.11.2023	7.139	3,83		
Vereinigtes Königreich — 5,20 % (28. Februar 2022: 5,31 %)					
GBP 10.440	United Kingdom Gilt, 0,250 %, fällig 31.07.2031	9.698	5,20		
USA — 23,81 % (28. Februar 2022: 24,77 %)					
7.770	United States Treasury Floating Rate Note — bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023 *	7.777	4,17		
5.190	United States Treasury Floating Rate Note — bei Ausgabe, 2,046 %, fällig 30.04.2024 *	5.179	2,78		
5.050	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/02/2032	4.516	2,42		
27.980	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15/11/2051	20.384	10,94		
8.150	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/02/2052	6.512	3,50		
		44.368	23,81		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 203.149\$)					
		167.388	89,81		
Organismen für gemeinsame Anlagen — 1,94 % (28. Februar 2022: 1,92 %)					
3.607	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Institutionell Klasse	3.607	1,94		
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 3.607\$)					
		3.607	1,94		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 225.375\$)					
		187.378	100,54		
Devisenterminkontrakte — 1,18 % (28. Februar 2022: 1,98 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	2.196	1,18		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
		189.574	101,72		
Devisenterminkontrakte — (2,93 %) (28. Februar 2022: (2,08 %))					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(5.457)	(2,93)		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
		(5.457)	(2,93)		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
		184.117	98,79		
Gewinn oder Verlust					
		2.262	1,21		
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen					
		186.379\$	100,00		
Gesamtnettovermögen					
		186.379\$	100,00		
<p>– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.</p> <p>144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 8.925.000\$ und machten 4,79 % des Nettovermögens aus.</p> <p>* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.</p>					
ABKÜRZUNGEN:					
AUD	– Australischer Dollar				
BRL	– Brasilianischer Real				
COP	– Kolumbianischer Peso				
EUR	– Euro				
GBP	– Britisches Pfund Sterling				
HUF	– Ungarischer Forint				
KRW	– Südkoreanischer Won				
MXN	– Mexikanischer Peso				
MYR	– Malaysischer Ringgit				
NZD	– Neuseeländischer Dollar				
PLN	– Polnischer Zloty				
RUB	– Russischer Rubel				
SEK	– Schwedische Kronen				
ZAR	– Südafrikanischer Rand				

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

	% des Gesamtvermögens
Analyse des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,74
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,86
Finanzderivate	1,13
Sonstige Vermögenswerte	2,27
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	145	Verkauf	GBP	124	\$ 1
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	245	Verkauf	USD	287	(1)
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	1	–
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	8	Verkauf	USD	9	–
09.06.2022	HSBC	Kauf	USD	3.568	Verkauf	CLP	3.280.000	(89)
09.06.2022	HSBC	Kauf	USD	3.369	Verkauf	CLP	3.020.000	3
09.06.2022	HSBC	Kauf	CLP	9.540.000	Verkauf	USD	10.457	175
09.06.2022	HSBC	Kauf	CLP	5.320.000	Verkauf	USD	6.360	(431)
09.07.2022	JP Morgan	Kauf	USD	8.441	Verkauf	AUD	12.160	120
09.07.2022	JP Morgan	Kauf	AUD	5.810	Verkauf	USD	3.929	47
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	AUD	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	401	Verkauf	AUD	575	7
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	AUD	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	388	Verkauf	AUD	569	1
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	113	Verkauf	AUD	199	(4)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	CAD	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	530	Verkauf	CAD	695	5
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	547	Verkauf	CAD	702	12
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	CAD	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	154	Verkauf	CAD	242	(5)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	181	Verkauf	CNY	1.488	(6)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	CNY	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	CNY	6	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	619	Verkauf	CNY	4.264	5
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	639	Verkauf	CNY	4.316	13
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	93	Verkauf	DKK	690	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	28	Verkauf	DKK	241	(1)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	96	Verkauf	DKK	697	2
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	DKK	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	DKK	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	ILS	3	Verkauf	EUR	1	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	1	Verkauf	EUR	1	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NOK	–	Verkauf	EUR	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	MXN	120	Verkauf	EUR	6	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	MXN	51	Verkauf	EUR	2	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	–	Verkauf	EUR	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	8.964	Verkauf	EUR	8.786	124
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	5	Verkauf	EUR	3	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	16	Verkauf	EUR	3	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	404	Verkauf	EUR	405	(3)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	–	Verkauf	EUR	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	ILS	9	Verkauf	EUR	3	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	26.448	Verkauf	EUR	196	(3)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	29	Verkauf	EUR	1	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NOK	21	Verkauf	EUR	1	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	2.542	Verkauf	EUR	3.035	(96)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	22	Verkauf	EUR	13	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CNY	183	Verkauf	EUR	24	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	30	Verkauf	EUR	21	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	–	Verkauf	EUR	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	5	Verkauf	EUR	1	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	1	Verkauf	EUR	1	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CNY	9	Verkauf	EUR	2	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	EUR	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	DKK	8	Verkauf	EUR	1	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	DKK	22	Verkauf	EUR	3	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.360	Verkauf	GBP	1.140	42
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	GBP	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	ILS	–	Verkauf	GBP	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	DKK	8	Verkauf	GBP	1	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	264	Verkauf	GBP	1	\$	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.446	Verkauf	GBP	1.195		56
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	7	Verkauf	GBP	4		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	1	Verkauf	GBP	1		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	2	Verkauf	GBP	1		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	7.143	Verkauf	GBP	44		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	ILS	3	Verkauf	GBP	1		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NOK	–	Verkauf	GBP	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CNY	52	Verkauf	GBP	6		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	MXN	47	Verkauf	GBP	2		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	7	Verkauf	GBP	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	–	Verkauf	GBP	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	6	Verkauf	GBP	1		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	6	Verkauf	GBP	3		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NOK	6	Verkauf	GBP	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	30	Verkauf	ILS	116		(2)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	98	Verkauf	ILS	335		(1)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	71	Verkauf	ILS	237		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	ILS	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	31	Verkauf	ILS	102		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	ILS	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	4.458	Verkauf	JPY	596.572		160
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	JPY	38		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	4.328	Verkauf	JPY	589.112		108
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.263	Verkauf	JPY	205.161		(10)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	MXN	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	200	Verkauf	MXN	4.113		(4)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	57	Verkauf	MXN	1.422		(5)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	MXN	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	194	Verkauf	MXN	4.084		(6)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	16	Verkauf	NOK	179		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	54	Verkauf	NOK	522		1
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	NOK	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	53	Verkauf	NOK	516		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	30	Verkauf	PLN	172		(1)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	104	Verkauf	PLN	494		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	PLN	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	PLN	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	107	Verkauf	PLN	499		2
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	64	Verkauf	SEK	662		1
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	66	Verkauf	SEK	669		3
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SEK	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	18	Verkauf	SEK	231		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	30	Verkauf	SGD	51		(2)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	SGD	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SGD	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	107	Verkauf	SGD	149		2
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	104	Verkauf	SGD	148		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	22	Verkauf	USD	17		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	5	Verkauf	USD	3		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	DKK	22	Verkauf	USD	3		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	21	Verkauf	USD	2		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	16	Verkauf	USD	3		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	MXN	123	Verkauf	USD	6		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CNY	134	Verkauf	USD	20		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	18.765	Verkauf	USD	136		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	12.478	Verkauf	USD	12.725		(174)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NOK	16	Verkauf	USD	2		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	ILS	10	Verkauf	USD	3		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	3.677	Verkauf	USD	4.470		(198)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	18	Verkauf	USD	12		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	268	Verkauf	USD	269		1
13.09.2022	Citi	Kauf	USD	8.933	Verkauf	KRW	11.650.000		235
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	26	Verkauf	AUD	38		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	39	Verkauf	EUR	39		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	19	Verkauf	EUR	18		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.596	Verkauf	GBP	1.340		37
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	650	Verkauf	USD	454		(9)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.289	Verkauf	USD	1.316		(20)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	6	Verkauf	USD	6		–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	18.700	Verkauf	USD	22.587	\$	(855)
21.09.2022	Barclays	Kauf	USD	6.998	Verkauf	MYR	30.920		92
26.09.2022	Citi	Kauf	JPY	1.051.000	Verkauf	USD	7.797		(216)
26.09.2022	JP Morgan	Kauf	USD	6.785	Verkauf	JPY	914.500		188
26.09.2022	JP Morgan	Kauf	JPY	6.110.000	Verkauf	USD	46.370		(2.296)
10.05.2022	HSBC	Kauf	USD	1.338	Verkauf	NZD	2.140		29
10.05.2022	HSBC	Kauf	NZD	4.780	Verkauf	USD	2.989		(64)
10.07.2022	Citi	Kauf	USD	1.530	Verkauf	SEK	15.600		64
10.07.2022	HSBC	Kauf	SEK	28.400	Verkauf	USD	2.792		(123)
19.10.2022	HSBC	Kauf	USD	5.816	Verkauf	BRL	32.300		(316)
27.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD	5.628	Verkauf	COP	25.540.000		(82)
31.10.2022	Citi	Kauf	USD	27.431	Verkauf	MXN	559.400		(2)
11.02.2022	Barclays	Kauf	EUR	20.780	Verkauf	USD	21.299		(326)
11.02.2022	JP Morgan	Kauf	EUR	3.930	Verkauf	USD	4.032		(65)
11.10.2022	HSBC	Kauf	THB	67.300	Verkauf	USD	1.891		(37)
17.11.2022	HSBC	Kauf	ZAR	10.700	Verkauf	USD	624		(4)
17.11.2022	HSBC	Kauf	USD	10.181	Verkauf	ZAR	167.200		489
12.05.2022	JP Morgan	Kauf	USD	9.783	Verkauf	GBP	8.260		171
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 4.267\$)								\$	2.196
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (4.493))\$									(5.457)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (226))\$								\$	(3.261)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert				
Forderungenbesicherte Wertpapiere — 8,10 % (28. Februar 2022: 5,38 %)									
1.231	Angel Oak Mortgage Trust 2019-6, Serie 2019 6, Klasse A1, 144A, 2,620 %, fällig 25.11.2059 *	1,208	0,22	104.730	United States Treasury Floating Rate Note — bei Ausgabe, 2,046 %, fällig 30.04.2024 *	104.513	19,45		
5.330	Angel Oak Mortgage Trust 2020-1, Serie 2020 1, Klasse A1, 144A, 2,466 %, fällig 25.12.2059 *	5,194	0,97	22.990	United States Treasury Floating Rate Note — When Issued, 2,796 %, fällig 31.07.2024 *	22.962	4,27		
56	Angel Oak Mortgage Trust I LLC 2019-2, Serie 2019 2, Klasse A1, 144A, 3,628 %, fällig 25.03.2049 *	55	0,01	55.440	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15/05/2052	51.109	9,51		
11.380	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust, Serie 2017 COR2, Klasse A3, 3,510 %, fällig 10.09.2050	10,865	2,02	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 483.454\$)			456.009	84,84	
4.950	COMM 2017-PANW Mortgage Trust, Serie 2017 PANW, Klasse D, 144A, 4,343 %, fällig 10.10.2029 *	4,684	0,87	Organismen für gemeinsame Anlagen — 5,14 % (28. Februar 2022: 0,10 %)					
8.350	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C34, Serie 2017 C34, Klasse A3, 3,276 %, fällig 15.11.2052	7,896	1,47	27.632	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Institutionelle Klasse	27.632	5,14		
EUR 1.769	Newgate Funding Plc, Serie 2007 1X, Klasse BB, 0,000 %, fällig am 01.12.2050 *	1,549	0,29	Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 27.632\$)			27.632	5,14	
EUR 2.809	Newgate Funding Plc, Serie 2007 2X, Klasse BB, 0,000 %, fällig 15.12.2050 *	2,480	0,46	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 561.747\$)					
2.570	Towd Point Mortgage Trust 2018-3, Serie 2018 3, Klasse A2, 144A, 3,875 %, fällig 25.05.2058 *	2,419	0,45	Devisenterminkontrakte — 2,17 % (28. Februar 2022: 2,92 %)					
7.554	Towd Point Mortgage Trust 2018-5, Serie 2018 5, Klasse A1, 144A, 3,250 %, fällig 25.07.2058 *	7,205	1,34	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)					
Summe Mortgage-Backed Securities (Anschaffungskosten 47.614 USD)			8,10	Futures — (1,25 %) (28. Februar 2022: 0,17 %)					
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 0,48 % (28. Februar 2022: 19,33 %)				Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)					
USA — 0,48 % (28. Februar 2022: 8,23 %)				Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
3.065	Jabil Inc, 3,000 %, fällig 15.01.2031	2,561	0,48	548.123					
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 3.047\$)			0,48	Devisenterminkontrakte — (4,17 %) (28. Februar 2022: (2,95 %))					
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 84,84 % (28. Februar 2022: 70,51 %)				Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)					
Brasilien — 7,33 % (28. Februar 2022: 5,12 %)				Futures — (0,09 %) (28. Februar 2022: (0,65 %))					
BRL 21.500	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, fällig am 01.01.2029	3,768	0,70	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)					
BRL 207.080	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, fällig am 01.01.2031	35,622	6,63	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
		39.390	7,33	(22.906)					
Kolumbien — 4,95 % (28. Februar 2022: 3,16 %)				Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
COP 42.910.000	Colombian TES, Serie B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	7,424	1,38	525.217					
COP 138.520.000	Colombian TES, Serie B, 7,250 %, fällig 26.10.2050	19,161	3,57	Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen					
		26.585	4,95	12.288					
Frankreich — 4,03 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				Gesamtvermögen					
EUR 22.570	French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032	18,600	3,46	537.505\$					
EUR 4.840	French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, fällig 25.05.2052	3,089	0,57	100,00					
		21.689	4,03	-					
Mexiko — 5,55 % (28. Februar 2022: 6,24 %)				-					
MXN 193.700	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	8,661	1,61	-					
MXN 476.700	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	21,196	3,94	-					
		29.857	5,55	-					
Peru — 3,60 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				-					
PEN 85.200	Peru Government Bond, 6,150 %, fällig 12.08.2032	19,339	3,60	-					
Polen — 0,52 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				-					
PLN 19.160	Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	2,805	0,52	-					
Südafrika — 3,43 % (28. Februar 2022: 3,96 %)				-					
ZAR 400.900	Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	18,435	3,43	-					
Vereinigtes Königreich — 1,32 % (28. Februar 2022: 1,91 %)				-					
GBP 11.240	United Kingdom Gilt, 0,625 %, fällig 22.10.2050	7,077	1,32	-					
USA — 54,11 % (28. Februar 2022: 32,83 %)				-					
112.155	United States Treasury Floating Rate Note — bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023 *	112,248	20,88	-					

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

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 20.765.000\$ und machten 3,86 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.

ABKÜRZUNGEN:

- BRL – Brasilianischer Real
- COP – Kolumbianischer Peso
- EUR – Euro
- GBP – Britisches Pfund Sterling
- MXN – Mexikanischer Peso
- PEN – Peruanisches neues Sol
- PLN – Polnischer Zloty
- ZAR – Südafrikanischer Rand

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	89,07
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,90
Finanzderivate	3,26
Sonstige Vermögenswerte	2,77
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
09.06.2022	HSBC	Kauf	USD 20.135	Verkauf	CLP 17.790.000	\$ 308
09.06.2022	HSBC	Kauf	USD 795	Verkauf	CLP 740.000	(30)
09.06.2022	HSBC	Kauf	CLP 37.290.000	Verkauf	USD 46.713	(5.153)
09.07.2022	Goldman Sachs	Kauf	AUD 41.780	Verkauf	USD 28.435	156
09.07.2022	Goldman Sachs	Kauf	AUD 38.720	Verkauf	USD 26.528	(31)
09.07.2022	JP Morgan	Kauf	USD 117.872	Verkauf	AUD 169.740	1.715
09.07.2022	JP Morgan	Kauf	AUD 89.240	Verkauf	USD 61.832	(763)
09.07.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD 60.045	Verkauf	AUD 86.630	761

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
13.09.2022	Citi	Kauf	USD	41.180	Verkauf	KRW	53.920.000	\$ 923
13.09.2022	Citi	Kauf	KRW	53.920.000	Verkauf	USD	41.595	(1.338)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	14	Verkauf	GBP	12	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	1	Verkauf	USD	–	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	10.327	Verkauf	USD	12.475	(474)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	91.093	Verkauf	USD	93.063	(1.426)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	502.287	Verkauf	USD	350.764	(6.988)
15.09.2022	Citi	Kauf	USD	16.736	Verkauf	CHF	16.200	143
15.09.2022	JP Morgan	Kauf	USD	27.230	Verkauf	CHF	26.470	117
15.09.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	27.439	Verkauf	CHF	26.290	510
26.09.2022	HSBC	Kauf	USD	27.195	Verkauf	JPY	3.593.000	1.277
26.09.2022	JP Morgan	Kauf	USD	49.108	Verkauf	JPY	6.599.000	1.507
26.09.2022	JP Morgan	Kauf	JPY	8.613.000	Verkauf	USD	64.430	(2.300)
26.09.2022	Morgan Stanley	Kauf	JPY	2.109.000	Verkauf	USD	15.756	(543)
26.09.2022	UBS	Kauf	USD	3.964	Verkauf	JPY	530.000	141
10.05.2022	HSBC	Kauf	NZD	25.340	Verkauf	USD	15.829	(326)
10.05.2022	Morgan Stanley	Kauf	NZD	25.000	Verkauf	USD	16.059	(763)
19.10.2022	HSBC	Kauf	USD	10.123	Verkauf	BRL	53.190	24
19.10.2022	HSBC	Kauf	USD	28.413	Verkauf	BRL	157.180	(1.428)
19.10.2022	HSBC	Kauf	BRL	57.150	Verkauf	USD	11.118	(268)
19.10.2022	HSBC	Kauf	BRL	172.230	Verkauf	USD	31.227	1.472
20.10.2022	JP Morgan	Kauf	PLN	131.130	Verkauf	USD	27.589	72
25.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD	26.578	Verkauf	CAD	34.350	432
27.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD	28.204	Verkauf	COP	127.120.000	(215)
31.10.2022	Citi	Kauf	USD	30.633	Verkauf	MXN	624.700	(2)
11.02.2022	Barclays	Kauf	USD	38.196	Verkauf	EUR	37.280	570
11.02.2022	HSBC	Kauf	USD	4.170	Verkauf	EUR	4.080	52
11.02.2022	UBS	Kauf	EUR	11.590	Verkauf	USD	11.632	66
11.07.2022	HSBC	Kauf	USD	18.937	Verkauf	PEN	74.900	(394)
11.07.2022	HSBC	Kauf	PEN	59.800	Verkauf	USD	15.236	197
17.11.2022	HSBC	Kauf	USD	20.738	Verkauf	ZAR	340.600	996
21.11.2022	Citi	Kauf	CZK	409.000	Verkauf	USD	16.503	111
12.05.2022	JP Morgan	Kauf	USD	7.320	Verkauf	GBP	6.180	128
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 21.946\$)							\$	11.678
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (22.185))\$								(22.442)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (239))\$							\$	(10.764)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-BTP September 2022	Morgan Stanley	194	\$ 23.300	\$ (464)
Euro-Buxl 30 Year Bond September 2022	Morgan Stanley	(278)	(45.986)	5.402
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Morgan Stanley	(3.299)	(365.596)	1.286
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1.272\$)				\$ 6.688
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (4.865))\$				(464)
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (3.593))\$				\$ 6.224

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 95,83 % (28. Februar 2022: 91,17 %)					
Australien — 1,74 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
220	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375 %, fällig 01.04.2031	1,74	180	1,74	
Brasilien — 2,85 % (28. Februar 2022: 4,98 %)					
375	MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	2,85	295	2,85	
Kanada — 5,47 % (28. Februar 2022: 2,60 %)					
125	1011778 BC ULC - New Red Finance Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2030	0,98	102	0,98	
140	ATS Automation Tooling Systems Inc, 144A, 4,125 %, fällig am 15.12.2028	1,19	123	1,19	
270	Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	2,15	223	2,15	
130	Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	1,15	119	1,15	
		5,47	567	5,47	
Chile — 3,26 % (28. Februar 2022: 3,21 %)					
200	ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig am 27.04.2026	1,70	176	1,70	
200	Kenbourne Invest SA, 4,700 %, fällig am 22.01.2028	1,56	161	1,56	
		3,26	337	3,26	
China — 1,92 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
200	Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, fällig 27.07.2032	1,92	199	1,92	
Kolumbien — 1,42 % (28. Februar 2022: 3,21 %)					
200	SierraCol Energy Andina LLC, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2028	1,42	147	1,42	
Irland — 1,85 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
240	Cimpres Plc, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2026	1,85	192	1,85	
Israel — 5,90 % (28. Februar 2022: 2,46 %)					
120	Energiean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 30.03.2028	1,05	108	1,05	
90	Energiean Israel Finance Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 30.03.2031	0,76	79	0,76	
279	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, fällig am 30.06.2030	2,57	267	2,57	
120	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, fällig am 18.12.2022	1,15	119	1,15	
40	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig am 21.07.2023	0,37	38	0,37	
		5,90	611	5,90	
Mexiko — 1,67 % (28. Februar 2022: 5,19 %)					
200	Braskem Idesa SAPI, 144A, 4,400 %, fällig am 15.11.2029	1,67	173	1,67	
Nigeria — 1,64 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
200	IHS Holding Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 29.11.2028	1,64	170	1,64	
Panama — 1,68 % (28. Februar 2022: 1,67 %)					
200	AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030	1,68	174	1,68	
Vereinigtes Königreich — 3,63 % (28. Februar 2022: 5,36 %)					
245	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 6,750 %, fällig am 01.10.2026	2,17	225	2,17	
200	NatWest Group Plc, 4,600 %, fortwährend *	1,46	150	1,46	
		3,63	375	3,63	
USA — 62,80 % (28. Februar 2022: 57,01 %)					
260	Affinity Gaming, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027	2,18	226	2,18	
115	Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig am 15.08.2027	1,14	114	1,10	
260	ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2028	1,91	197	1,91	
215	Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2029	1,74	180	1,74	
90	Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, fällig am 01.09.2028	0,76	79	0,76	
60	Block Inc, 3,500 %, fällig 01.06.2031	0,48	49	0,48	
40	Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig am 01.02.2026	0,35	36	0,35	
250	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2030	2,14	221	2,14	
75	CCM Merger Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.05.2026	0,68	71	0,68	
90	Century Communities Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2029	0,70	72	0,70	
70	Cobra AcquisitionCo LLC, 144A, 6,375 %, fällig 01.11.2029	0,50	52	0,50	
100	Cogent Communications Group Inc, 144A, 3,500 %, fällig 01.05.2026	0,87	90	0,87	
35	Consolidated Communications Inc, 6,500 %, fällig 01.10.2028	0,27	28	0,27	
110	Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125 %, fällig 31.12.2024	1,00	104	1,00	
80	Credit Acceptance Corp, 6,625 %, fällig 15.03.2026	0,76	79	0,76	
25	Crocs Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.03.2029	0,20	20	0,20	
115	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig am 20.10.2025	1,09	113	1,09	
35	Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig 15.07.2029	0,29	30	0,29	
145	FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 01.09.2028	1,21	126	1,21	
35	FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 01.01.2030	0,30	31	0,30	
55	Forestar Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.03.2028	0,44	46	0,44	
65	Freedom Mortgage Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15.04.2025	0,54	56	0,54	
135	Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.05.2026	1,07	111	1,07	
180	Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.01.2027	1,31	136	1,31	
95	General Motors Co, 5,000 %, fällig 01.04.2035	0,82	85	0,82	
140	GrubHub Holdings Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.07.2027	1,06	109	1,06	
105	Hightower Holding LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.04.2029	0,86	89	0,86	
130	Home BancShares Inc.AR, 3,125 %, fällig 30.01.2032 *	1,10	114	1,10	
60	IAA Inc, 144A, 5,500 %, fällig 15.06.2027	0,55	57	0,55	
220	LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2027	2,01	208	2,01	
75	Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01.02.2030	0,55	57	0,55	
275	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig am 01.08.2026	2,57	266	2,57	
54	Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,625 %, fällig am 01.06.2028	0,52	54	0,52	
275	Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.10.2026	2,42	251	2,42	
55	Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig am 01.05.2029	0,47	48	0,47	
70	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2025	0,65	68	0,65	
60	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026	0,55	57	0,55	
85	NFP Corp, 144A, 7,500 %, fällig 01.10.2030	0,81	84	0,81	
80	Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.08.2026	0,76	79	0,76	
80	PennyMac Financial Services Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.09.2031	0,63	65	0,63	
170	Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.03.2029	1,40	145	1,40	
60	PRA Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2029	0,50	52	0,50	
170	PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2029	1,38	143	1,38	
125	ROBLOX Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.05.2030	1,01	104	1,01	
55	Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625 %, fällig 01.04.2026	0,52	54	0,52	
185	Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144A, 4,875 %, fällig am 01.11.2027	1,57	163	1,57	
135	Standard Industries Inc.NJ, 144A, 4,375 %, fällig am 15.07.2030	1,04	107	1,04	
50	Station Casinos LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.02.2028	0,42	43	0,42	
120	Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.12.2031	0,97	100	0,97	
85	Texas Capital Bancshares Inc, 4,000 %, fällig 06.05.2031 *	0,73	75	0,73	
130	TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	1,23	128	1,23	
60	Travel + Leisure Co, 144A, 4,625 %, fällig 01.03.2030	0,46	48	0,46	
75	Truist Financial Corp, 4,916 %, fällig am 28.07.2033 *	0,69	72	0,69	
135	Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 15.02.2026	1,16	120	1,16	
55	Twillio Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2031	0,43	44	0,43	
120	United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.06.2027	0,96	99	0,96	
155	United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2029	1,17	121	1,17	
105	Vector Group Ltd, 5,750 %, fällig 01.02.2029	0,88	91	0,88	
145	Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 01.02.2029	1,22	126	1,22	
170	Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2027	1,51	157	1,51	
90	Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.05.2025	0,78	81	0,78	
150	Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15.05.2025	1,52	158	1,52	
40	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	0,33	34	0,33	
215	World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, fällig 01.11.2026	1,45	150	1,45	
135	Wynn Las Vegas LLC - Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025	1,25	129	1,25	
		62,80	6.502	62,80	
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 10.377\$)				9.922	95,83
Organismen für gemeinsame Anlagen — 5,93 % (28. Februar 2022: 4,64 %)					
614	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	5,93	614	5,93	
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 614\$)				614	5,93
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 10.991\$)					
Devisenterminkontrakte — 0,06 % (28. Februar 2022: 0,44 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				6	0,06
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
				10.542	101,82
Devisenterminkontrakte — (2,28 %) (28. Februar 2022: (0,18 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				(236)	(2,28)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
				(236)	(2,28)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
				10.306	99,54
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen				48	0,46
Gesamtvermögen				10.354\$	100,00
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 8.115.000\$ und machten 78,35 % des Nettovermögens aus.					
* Variabel verzinsliches Wertpapier. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.					
ABKÜRZUNGEN:					
Fortwährend – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.					
Analyse des Gesamtvermögens				% des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden				90,04	
Organismen für gemeinsame Anlagen				5,57	
Finanzderivate				0,05	
Sonstige Vermögenswerte				4,34	
Gesamtvermögen				100,00	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)			
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	114	Verkauf	CAD	148	\$	1
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	25	Verkauf	CAD	32		1
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	2	Verkauf	CAD	4		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CHF	–	Verkauf	CAD	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	–	Verkauf	CAD	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	–	Verkauf	CHF	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	4	Verkauf	CHF	3		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	CHF	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	2.336	Verkauf	EUR	1.784		(16)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	12	Verkauf	EUR	15		(1)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CHF	–	Verkauf	GBP	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	247	Verkauf	GBP	159		4
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	1		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	GBP	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	–	Verkauf	GBP	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SEK	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SEK	–		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	3	Verkauf	SEK	21		–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	59	Verkauf	USD	71		(3)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	10.799	Verkauf	USD	8.410		(188)
11.02.2022	Barclays	Kauf	EUR	1.570	Verkauf	USD	1.609		(24)
12.05.2022	JP Morgan	Kauf	GBP	170	Verkauf	USD	201		(4)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 50\$)								\$	6
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (20))\$									(236)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 30\$)								\$	(230)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 0,02 % (28. Februar 2022: 0,90 %)			Russia — 0,22 % (28. Februar 2022: 0,17 %)		
EUR	48	0,02	RUB	83.000	0,22
	48 IM Pastor 4 FTA 4, Klasse A, 0,000 %, fällig am 22.03.2044 *			Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig 10.04.2030 ty	
Summe Mortgage-Backed Securities (Anschaffungskosten 58 USD)			Südafrika — 4,04 % (28. Februar 2022: 4,13 %)		
	40	0,02	ZAR	108.600	3,996
	40		ZAR	90.500	4,162
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 98,07 % (28. Februar 2022: 78,35 %)				8.158	4,04
Australien — 2,63 % (28. Februar 2022: 8,59 %)			Südkorea — 6,80 % (28. Februar 2022: 7,17 %)		
AUD	1.520	0,52	KRW	15.700.000	10,246
AUD	2.905	0,99	KRW	6.600.000	3,486
	1.520 New South Wales Treasury Corp, 4,000 %, fällig am 20.04.2023			13.732	
	2.905 Queensland Treasury Corp, Serie 23, 144A, 4,250 %, fällig am 21.07.2023			6,80	
	3.200 Western Australian Treasury Corp, Serie 23, 6,000 %, fällig am 16.10.2023		Schweden — 3,81 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
	5.315	2,63	SEK	82.700	7,698
Brasilien — 5,79 % (28. Februar 2022: 5,18 %)				3,81	
BRL	29.620	2,64	Vereinigtes Königreich — 4,74 % (28. Februar 2022: 5,08 %)		
BRL	9.240	0,80	GBP	10.300	9,568
BRL	9.230	0,79	USA — 25,95 % (28. Februar 2022: 6,30 %)		
BRL	18.690	1,56		5.110	2,53
	11.695	5,79		7.450	3,68
	29.620 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig am 01.01.2027			6.320	3,12
	9.240 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig am 01.01.2029			5.660	2,51
	9.230 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig am 01.01.2031			23.370	8,43
	18.690 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig am 01.01.2033			14.370	5,68
	8.392	4,15		52.430	25,95
Chile — 4,15 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 232.3635)		
CLP	7.750.000	4,15		198.118	98,07
	7.750.000 Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 144A, 4,000 %, fällig am 01.03.2023		Organismen für gemeinsame Anlagen — 1,98 % (28. Februar 2022: 1,36 %)		
Kolumbien — 4,71 % (28. Februar 2022: 3,29 %)				3.997	1,98
COP	12.600.000	1,22		3.997	1,98
COP	21.200.000	1,82	Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 3.9975)		
COP	14.690.000	1,22		3.997	1,98
COP	6.640.000	0,45	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 236.4185)		
	9.504	4,71		202.155	100,07
Frankreich — 6,52 % (28. Februar 2022: 4,79 %)			Devisenterminkontrakte — 1,59 % (28. Februar 2022: 1,17 %)		
EUR	11.950	4,88	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
EUR	5.200	1,64		3.218	1,59
	13.167	6,52	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	11.950 French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032			205.373	101,66
	5.200 French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, fällig 25.05.2052		Devisenterminkontrakte — (2,85 %) (28. Februar 2022: (1,67 %))		
Deutschland — 3,85 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				(5.755)	(2,85)
EUR	7.650	3,85	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	7.650 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,000 %, fällig 15.08.2023			199.618	98,81
Ungarn — 2,95 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
HUF	2.400.000	2,95		2.396	1,19
	5.962	2,95	Gesamtnettovermögen		
	2.400.000 Hungary Government Bond, Serie 22.B, 1,750 %, fällig 26.10.2022			202.014\$	100,00
Italien — 3,92 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
EUR	7.890	3,92	144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 18.101.000\$ und machten 8,95 % des Nettovermögens aus.		
	7.890 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0,950 %, fällig 15.03.2023		* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.		
Malaysia — 3,20 % (28. Februar 2022: 4,45 %)			† Nicht liquide.		
MYR	13.430	3,013	γ Aufgrund der Ungewissheit der Zinszahlungen werden während und/oder nach dem zum 31. August 2022 endenden Geschäftsjahr keine Erträge aus dem Wertpapier mehr gezahlt.		
MYR	5.595	0,63	ABKÜRZUNGEN:		
MYR	9.735	1,08	AUD	– Australischer Dollar	
	6.474	3,20	BRL	– Brasilianischer Real	
Mexiko — 11,72 % (28. Februar 2022: 9,09 %)			CLP	– Chilenischer Peso	
MXN	111.600	2,67	COP	– Kolumbianischer Peso	
MXN	118.500	2,78	EUR	– Euro	
MXN	116.700	2,53	GBP	– Britisches Pfund Sterling	
MXN	80.300	1,78	HUF	– Ungarischer Forint	
MXN	88.900	1,96	KRW	– Südkoreanischer Won	
	23.675	11,72			
Neuseeland — 1,83 % (28. Februar 2022: 4,01 %)					
NZD	3.140	0,96			
NZD	3.860	0,87			
	3.695	1,83			
Polen — 1,24 % (28. Februar 2022: 8,75 %)					
PLN	7.180	0,73			
PLN	6.970	0,51			
	2.505	1,24			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

ABKÜRZUNGEN — (Fortsetzung):

MXN	– Mexikanischer Peso
MYR	– Malaysischer Ringgit
NZD	– Neuseeländischer Dollar
PLN	– Polnischer Zloty
RUB	– Russischer Rubel
SEK	– Schwedische Kronen
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,74
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,91
Finanzderivate	1,54
Sonstige Vermögenswerte	1,81
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	\$ –
09.07.2022	JP Morgan	Kauf	USD	9.767	Verkauf	AUD	14.070 139
09.07.2022	JP Morgan	Kauf	AUD	6.660	Verkauf	USD	4.504 54
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	AUD	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	33	Verkauf	AUD	58 (1)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	351	Verkauf	AUD	317 (2)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	480	Verkauf	CAD	387 (2)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	46	Verkauf	CAD	71 (1)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	CAD	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	CNY	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	53	Verkauf	CNY	436 (2)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	560	Verkauf	CNY	2.377 (2)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	DKK	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	84	Verkauf	DKK	385 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	8	Verkauf	DKK	70 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	7.729	Verkauf	EUR	4.766 (65)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	732	Verkauf	EUR	873 (28)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	1.746	Verkauf	GBP	11 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	DKK	2	Verkauf	GBP	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CNY	12	Verkauf	GBP	2 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	1.132	Verkauf	GBP	585 13
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	GBP	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	37	Verkauf	GBP	31 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	25	Verkauf	GBP	21 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	2	Verkauf	GBP	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	MXN	11	Verkauf	GBP	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	2	Verkauf	GBP	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	2	Verkauf	GBP	2 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	ILS	1	Verkauf	GBP	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	2	Verkauf	GBP	1 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NOK	2	Verkauf	GBP	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	89	Verkauf	ILS	188 (2)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	8	Verkauf	ILS	34 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	ILS	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	370	Verkauf	JPY	60.167 (3)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	3.912	Verkauf	JPY	328.303 28
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	175	Verkauf	MXN	2.276 (5)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	MXN	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	17	Verkauf	MXN	417 (1)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	NOK	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	47	Verkauf	NOK	287 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	5	Verkauf	NOK	52 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	11	Verkauf	NZD	2 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	216	Verkauf	NZD	347 3
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	JPY	10.199	Verkauf	NZD	120 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	3	Verkauf	NZD	3 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	147	Verkauf	NZD	238 3
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	MXN	67	Verkauf	NZD	5 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	ILS	5	Verkauf	NZD	3 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CNY	73	Verkauf	NZD	17 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	19	Verkauf	NZD	35 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	11	Verkauf	NZD	14 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	10	Verkauf	NZD	11 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	DKK	12	Verkauf	NZD	3 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NOK	8	Verkauf	NZD	2 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	8	Verkauf	NZD	3 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	9	Verkauf	PLN	50 –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	PLN	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	95	Verkauf	PLN	275 –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	6	Verkauf	SEK	67	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	58	Verkauf	SEK	369	\$ –
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	SGD	–	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	9	Verkauf	SGD	15	–
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	95	Verkauf	SGD	82	(1)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	NZD	11.279	Verkauf	USD	7.083	(181)
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.068	Verkauf	USD	1.298	(58)
13.09.2022	Citi	Kauf	USD	14.221	Verkauf	KRW	18.400.000	483
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	–	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	8	Verkauf	GBP	7	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	198	Verkauf	USD	240	(9)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	USD	1	–
21.09.2022	Barclays	Kauf	USD	6.258	Verkauf	MYR	27.650	82
26.09.2022	Citi	Kauf	JPY	709.000	Verkauf	USD	5.256	(142)
26.09.2022	JP Morgan	Kauf	USD	14.908	Verkauf	JPY	2.009.000	417
26.09.2022	JP Morgan	Kauf	JPY	7.337.000	Verkauf	USD	55.634	(2.710)
26.09.2022	UBS	Kauf	JPY	676.000	Verkauf	USD	4.886	(10)
10.05.2022	HSBC	Kauf	USD	1.425	Verkauf	NZD	2.280	30
10.05.2022	HSBC	Kauf	NZD	5.700	Verkauf	USD	3.561	(73)
10.07.2022	Citi	Kauf	USD	2.099	Verkauf	SEK	21.400	88
10.07.2022	HSBC	Kauf	SEK	44.000	Verkauf	USD	4.326	(191)
19.10.2022	HSBC	Kauf	USD	10.347	Verkauf	BRL	57.460	(562)
19.10.2022	HSBC	Kauf	BRL	21.710	Verkauf	USD	4.164	(42)
20.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	714	Verkauf	PLN	3.350	8
27.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD	487	Verkauf	COP	2.100.000	17
27.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD	5.646	Verkauf	COP	25.620.000	(82)
31.10.2022	Citi	Kauf	USD	22.331	Verkauf	MXN	455.400	(2)
11.02.2022	Barclays	Kauf	EUR	20.390	Verkauf	USD	20.891	(312)
11.02.2022	JP Morgan	Kauf	EUR	4.530	Verkauf	USD	4.648	(75)
11.08.2022	HSBC	Kauf	USD	11.515	Verkauf	CLP	11.470.000	(1.107)
11.08.2022	HSBC	Kauf	CLP	14.070.000	Verkauf	USD	14.226	1.258
11.10.2022	HSBC	Kauf	THB	81.800	Verkauf	USD	2.299	(45)
17.11.2022	HSBC	Kauf	ZAR	11.100	Verkauf	USD	647	(4)
17.11.2022	HSBC	Kauf	USD	8.877	Verkauf	ZAR	145.800	426
23.11.2022	HSBC	Kauf	HUF	340.000	Verkauf	USD	870	(35)
12.05.2022	JP Morgan	Kauf	USD	9.677	Verkauf	GBP	8.170	169
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 2.854\$)								\$ 3.218
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (4.074))\$								(5.755)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.220))\$								\$ (2.537)

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert		
Forderungenbesicherte Wertpapiere — 15,12 % (28. Februar 2022: 15,72 %)							
3.500	Bellemeade Re 2020-3 Ltd, Serie 2020 3A, Klasse M1C, 144A, 6,144 %, fällig 25.10.2030 *	3.557	0,29	1.335	Embraer Netherlands Finance BV, 144A, 6,950 %, fällig 17.01.2028	1.333	0,11
6.100	Bellemeade Re 2020-3 Ltd, Serie 2020 3A, Klasse M2, 144A, 7,294 %, fällig 25.10.2030 *	6.148	0,51	6.745	Gol Finance SA, 8,000 %, fällig 30.06.2026	4.827	0,40
8.008	Bellemeade Re Ltd, Serie 2021 2A, Klasse M1A, 144A, 3,383 %, fällig 25.06.2031 *	7.919	0,65	6.645	Rumo Luxembourg Sarl, 144A, 4,200 %, fällig am 18.01.2032	5.559	0,46
220	COMM 2017-PANW Mortgage Trust, Serie 2017 PANW, Klasse D, 144A, 4,343 %, fällig 10.10.2029 *	208	0,02	13.775	XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026	12.338	1,02
11.135	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Serie 2020 SBT1, Klasse 1M2, 144A, 6,094 %, fällig 25.02.2040 *	11.178	0,92	Kanada — 2,64 % (28. Februar 2022: 1,85 %)			
12.085	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Serie 2020 SBT1, Klasse 2M2, 144A, 6,094 %, fällig 25.02.2040 *	12.255	1,01	6.209	Air Canada, 144A, 3,875 %, fällig am 15.08.2026	5.549	0,46
295	Eagle RE 2021-1 Ltd, Serie 2021 1, Klasse M1C, 144A, 4,883 %, fällig 25.10.2033 *	296	0,02	8.696	Air Canada 2020-2 Klasse A Pass Through Trust, 144A, 5,250 %, fällig 01.04.2029	8.367	0,69
200	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C01, Klasse 1B1, 8,194 %, fällig 25.07.2029 *	219	0,02	5.590	Antares Holdings LP, 144A, 2,750 %, fällig 15.01.2027	4.641	0,38
7.602	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C02, Klasse 2M2C, 6,094 %, fällig 25.09.2029 *	7.817	0,65	8.930	Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	7.380	0,61
2.921	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C06, Klasse 2M2, 5,244 %, fällig 25.02.2030 *	2.900	0,24	6.600	Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	6.036	0,50
9.179	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Klasse B1, 144A, 7,544 %, fällig 25.06.2050 *	9.467	0,78	Chile — 1,02 % (28. Februar 2022: 0,54 %)			
37	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA3, Serie 2020 HQA3, Klasse M2, 144A, 6,044 %, fällig 25.07.2050 *	37	-	6.680	ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig am 27.04.2026	5.871	0,48
2.760	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA4, Serie 2020 HQA4, Klasse B1, 144A, 7,694 %, fällig 25.09.2050 *	2.857	0,24	6.729	Kenbourne Invest SA, 6,875 %, fällig am 26.11.2024	6.529	0,54
3.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA2, Serie 2021 HQA2, Klasse B1, 144A, 5,333 %, fällig 25.12.2033 *	2.693	0,22	China — 1,86 % (28. Februar 2022: 0,59 %)			
2.168	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Serie 2019 DNA3, Klasse M2, 144A, 4,494 %, fällig 25.07.2049 *	2.177	0,18	3.120	Alibaba Group Holding Ltd, 3,400 %, fällig 06.12.2027	2.948	0,25
5.935	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Serie 2019 DNA4, Klasse B1, 144A, 5,144 %, fällig 25.10.2049 *	5.785	0,48	8.095	Alibaba Group Holding Ltd, 4,200 %, fällig 06.12.2047	6.496	0,54
658	Freddie Mac STACR Trust 2019-HQA2, Serie 2019 HQA2, Klasse M2, 144A, 4,494 %, fällig 25.04.2049 *	659	0,05	1.060	JD.com Inc, 3,375 %, fällig 14.01.2030	970	0,08
5.855	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2020 HQA5, Klasse B1, 144A, 6,183 %, fällig 25.11.2050 *	5.871	0,49	705	NXP BV . NXP Funding LLC . NXP USA Inc, 3,400 %, fällig 01.05.2030	625	0,05
19.385	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2021 DNA2, Klasse M2, 144A, 4,483 %, fällig 25.08.2033 *	19.111	1,58	4.375	Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,680 %, fällig 22.04.2041	3.402	0,28
370	Home RE 2021-1 Ltd, Serie 2021 1, Klasse M1B, 144A, 3,994 %, fällig 25.07.2033 *	368	0,03	4.015	Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,240 %, fällig 03.06.2050	2.682	0,22
6.749	Oaktown Re V Ltd, Serie 2020 2A, Klasse M1B, 144A, 6,044 %, fällig 25.10.2030 *	6.772	0,56	740	Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,840 %, fällig 22.04.2051	550	0,05
6.131	Radnor RE 2021-1 Ltd, Serie 2021 1, Klasse M1A, 144A, 3,833 %, fällig 27.12.2033 *	6.117	0,50	340	Tencent Music Entertainment Group, 2,000 %, fällig am 03.09.2030	257	0,02
6.648	Radnor RE 2021-2 Ltd, Serie 2021 2, Klasse M1A, 144A, 4,033 %, fällig 25.11.2031 *	6.622	0,55	1.875	Weibo Corp, 3,375 %, fällig 08.07.2030	1.486	0,12
5.000	Radnor RE 2021-2 Ltd, Serie 2021 2, Klasse M1B, 144A, 5,883 %, fällig 25.11.2031 *	4.923	0,41	3.805	Xiaomi Best Time International Ltd, 144A, 3,375 %, fällig am 29.04.2030	3.036	0,25
4.512	STACR Trust 2018-HRP2, Serie 2018 HRP2, Klasse B1, 144A, 6,644 %, fällig 25.02.2047 *	4.534	0,37	Kolumbien — 0,61 % (28. Februar 2022: 0,26 %)			
5.893	Towd Point Mortgage Trust 2017-6, Serie 2017 6, Klasse B2, 144A, 3,206 %, fällig 25.10.2057 *	5.067	0,42	3.715	Ecopetrol SA, 4,125 %, fällig 16.01.2025	3.497	0,29
17.590	Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Serie 2018 2, Klasse B1, 144A, 3,308 %, fällig 25.03.2058 *	15.493	1,28	4.420	Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 17.01.2027	3.846	0,32
6.755	Towd Point Mortgage Trust 2018-3, Serie 2018 3, Klasse B1, 144A, 3,629 %, fällig 25.05.2058 *	5.912	0,49	Deutschland — 0,35 % (28. Februar 2022: 0,27 %)			
11.850	Triangle Re 2021-3 Ltd, Serie 2021 3, Klasse M1A, 144A, 4,083 %, fällig 25.02.2034 *	11.810	0,98	4.485	Siemens Finanzierungsmaatschappij NV, 144A, 0,650 %, fällig 11.03.2024	4.287	0,35
290	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NX55, Serie 2016 NX55, Klasse C, 5,148 %, fällig 15.01.2059 *	275	0,02	Israel — 1,69 % (28. Februar 2022: 1,42 %)			
14.975	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Serie 2014 LC14, Klasse D, 144A, 4,586 %, fällig 15.03.2047 *	14.105	1,16	1.370	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 30.03.2024	1.322	0,11
Summe Mortgage-Backed Securities (Anschaffungskosten 192.909 USD)							
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 62,05 % (28. Februar 2022: 56,53 %)							
Australien — 0,41 % (28. Februar 2022: 0,32 %)							
AUD	730 NBN Co Ltd, 2,200 %, fällig 16.12.2030	387	0,03	4.035	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 30.03.2026	3.732	0,31
	5.430 NBN Co Ltd, 2,625 %, fällig 05.05.2031	4.589	0,38	7.920	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig am 21.07.2023	7.607	0,63
		4.976	0,41	2.830	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig am 31.01.2025	2.806	0,23
Brazilien — 2,93 % (28. Februar 2022: 2,72 %)							
	1.880 Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, fällig am 28.01.2028	1.744	0,14	5.970	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	5.040	0,41
	4.900 B3 SA — Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig am 20.09.2031	4.147	0,34	Japan — 0,74 % (28. Februar 2022: 0,61 %)			
	4.710 Banco do Brasil SA, Cayman, 144A, 3,250 %, fällig 30.09.2026	4.334	0,36	9.715	Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345 %, fällig am 17.09.2027	9.000	0,74
	1.205 BRF SA, 144A, 3,950 %, fällig 22.05.2023	1.187	0,10	Luxemburg — 0,77 % (28. Februar 2022: 0,74 %)			
China — 1,86 % (28. Februar 2022: 0,59 %)							
				2.535	Alice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	2.045	0,17
				10.770	Alice France Holding SA, 144A, 6,000 %, fällig 15.02.2028	7.320	0,60
				Mexiko — 0,54 % (28. Februar 2022: 0,31 %)			
				3.770	Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig am 15.11.2029	3.261	0,27
				4.141	Total Play Telecomunicaciones SA de CV, 144A, 6,375 %, fällig am 20.09.2028	3.267	0,27
				Panama — 0,29 % (28. Februar 2022: 0,21 %)			
				3.955	AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig am 31.05.2030	3.443	0,29
				Supranational — 1,10 % (28. Februar 2022: 0,93 %)			
				8.685	Arab Petroleum Investments Corp, 1,483 %, fällig 06.10.2026	7.970	0,66

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)					
Supernational — (Fortsetzung)					
MXN 61.000	International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig 22.01.2026	2.601	0,21		
BRL 17.100	International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, fällig 22.01.2026	2.773	0,23		
		13.344	1,10		
Schweiz — 0,15 % (28. Februar 2022: 0,12 %)					
	1.930 UBS AG.London, 144A, 0,700 %, fällig 09.08.2024	1.803	0,15		
Vereinigtes Königreich — 1,18 % (28. Februar 2022: 0,84 %)					
	2.220 Ashted Capital Inc, 144A, 5,500 %, fällig 11.08.2032	2.181	0,18		
	5.610 HSBC Holdings Plc, 4,292 %, fällig 12.09.2026 *	5.452	0,45		
GBP 1.075	Nationwide Building Society, 5,750 %, unbefristet *	1.112	0,09		
	400 NatWest Group Plc, 2,359 %, fällig 22.05.2024 *	393	0,03		
	3.625 NatWest Group Plc, 4,600 %, fortwährend *	2.727	0,23		
	2.900 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	2.391	0,20		
		14.256	1,18		
USA — 43,95 % (28. Februar 2022: 43,77 %)					
	170 AES Corp.The, 144A, 3,300 %, fällig 15.07.2025	162	0,01		
	247 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, fällig am 15.02.2026	247	0,02		
	5.100 Air Lease Corp, 0,800 %, fällig 18.08.2024	4.709	0,39		
	7.559 Alaska Airlines 2020-1 Klasse A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, fällig 15.08.2027	7.490	0,62		
	9.095 American Tower Corp, 1,600 %, fällig 15.04.2026	8.162	0,67		
	1.604 AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5,625 %, fällig am 20.05.2024	1.586	0,13		
	2.021 Antero Resources Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.02.2029	2.058	0,17		
	5.515 Ardagh Packaging Finance Plc . Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2026	4.764	0,39		
	435 Ardagh Packaging Finance Plc . Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	315	0,03		
	9.530 Ares Capital Corp, 3,250 %, fällig 15.07.2025	8.942	0,74		
	9.063 Ares Capital Corp, 2,150 %, fällig 15.07.2026	7.878	0,65		
	2.530 Ares Capital Corp, 2,875 %, fällig 15.06.2028	2.104	0,17		
	3.890 AT&T Inc, 1,700 %, fällig 25.03.2026	3.553	0,29		
	11.500 AT&T Inc, 2,750 %, fällig 01.06.2031	9.865	0,81		
	11.980 Athene Global Funding, 144A, 0,914 %, fällig 19.08.2024	11.066	0,91		
	9.925 Bain Capital Specialty Finance Inc, 2,950 %, fällig am 10.03.2026	8.809	0,73		
	5.605 Blackstone Private Credit Fund, 2,625 %, fällig am 15.12.2026	4.736	0,39		
	1.545 Blackstone Secured Lending Fund, 3,650 %, fällig 14.07.2023	1.531	0,13		
	2.280 Blackstone Secured Lending Fund, 3,625 %, fällig 15.01.2026	2.140	0,18		
	9.170 Blackstone Secured Lending Fund, 2,125 %, fällig 15.02.2027	7.612	0,63		
	2.645 Blackstone Secured Lending Fund, 2,850 %, fällig 30.09.2028	2.107	0,17		
	4.645 Block Financial LLC, 3,875 %, fällig 15.08.2030	4.230	0,35		
	2.775 Broadcom Inc, 3,459 %, fällig 15.09.2026	2.664	0,22		
	4.105 Broadcom Inc, 144A, 1,950 %, fällig 15.02.2028	3.525	0,29		
	437 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	332	0,03		
	353 Broadcom Inc, 144A, 4,926 %, fällig 15.05.2037	315	0,03		
	6.055 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742 %, fällig 31.12.2039	4.728	0,39		
	7.540 CHS.Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.03.2026	7.059	0,58		
	630 CNH Industrial Capital LLC, 1,875 %, fällig 15.01.2026	574	0,05		
	4.817 CNX Resources Corp, 144A, 7,250 %, fällig 14.03.2027	4.791	0,40		
	464 CommScope Inc, 144A, 6,000 %, fällig am 01.03.2026	439	0,04		
	11.635 CommScope Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.07.2028	9.590	0,79		
	6.860 Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2028	5.294	0,44		
	160 Crown Castle Inc, 3,700 %, fällig 15.06.2026	155	0,01		
	10.930 Crown Castle Inc, 1,050 %, fällig 15.07.2026	9.582	0,79		
	1.560 Dell International LLC/EMC Corp, 6,020 %, fällig am 15.06.2026	1.621	0,13		
	5.015 Delta Air Lines Inc . SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20.10.2025	4.915	0,41		
	195 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	150	0,01		
	27.582 DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	19.916	1,64		
	680 DPL Inc, 4,125 %, fällig 01.07.2025	643	0,05		
	220 Embarq Corp, 7,995 %, fällig 01.06.2036	171	0,01		
	2.530 FedEx Corp, 0,450 %, fällig 04.05.2029	2.128	0,18		
	3.620 Ford Motor Credit Co LLC, 2,300 %, fällig 10.02.2025	3.304	0,27		
	6.000 Freedom Mortgage Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15.04.2025	5.199	0,43		
	8.115 FS KKR Capital Corp, 3,125 %, fällig 12.10.2028	6.615	0,55		
	2.160 Global Payments Inc, 1,200 %, fällig am 01.03.2026	1.908	0,16		
	6.820 Goldman Sachs Group Inc.The, 0,673 %, fällig 08.03.2024 *	6.687	0,55		
	3.545 Goldman Sachs Group Inc.The, 0,855 %, fällig 12.02.2026 *	3.229	0,27		
	9.560 Golub Capital BDC Inc, 2,500 %, fällig 24.08.2026	8.315	0,69		
	6.560 Golub Capital BDC Inc, 2,050 %, fällig 15.02.2027	5.438	0,45		
	13.773 Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.08.2028	11.846	0,98		
	10.398 Graphic Packaging International LLC, 144A, 1,512 %, fällig am 15.04.2026	9.303	0,77		
	2.695 Harsco Corp, 144A, 5,750 %, fällig 31.07.2027	1.915	0,16		
	4.090 HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	4.119	0,34		
	16.591 Hercules Capital Inc, 2,625 %, fällig 16.09.2026	13.973	1,15		
	8.200 Horizon Therapeutics USA Inc, 144A, 5,500 %, fällig am 01.08.2027	7.869	0,65		
	5.060 HP Inc, 4,750 %, fällig 15.01.2028	4.980	0,41		
	4.870 Intel Corp, 4,150 %, fällig 05.08.2032	4.716	0,39		
	3.025 Jabil Inc, 1,700 %, fällig 15.04.2026	2.702	0,22		
	2.585 Jabil Inc, 3,600 %, fällig 15.01.2030	2.278	0,19		
	2.025 JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc, 144A, 5,125 %, fällig am 01.02.2028	2.026	0,17		
	6.580 Level 3 Financing Inc, 144A, 3,750 %, fällig 15.07.2029	5.295	0,44		
	1.025 Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01.02.2030	786	0,06		
	2.640 Main Street Capital Corp, 5,200 %, fällig 01.05.2024	2.650	0,22		
	12.100 Main Street Capital Corp, 3,000 %, fällig 14.07.2026	10.571	0,87		
	6.830 Meta Platforms Inc, 144A, 4,450 %, fällig 15.08.2052	6.230	0,51		
	6.945 MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2028	5.806	0,48		
	14.125 Mileage Plus Holdings LLC . Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	14.178	1,17		
	8.820 Mohegan Gaming & Entertainment, 144A, 8,000 %, fällig am 01.02.2026	7.772	0,64		
	13.560 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2025	13.135	1,08		
	4.480 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026	4.250	0,35		
	1.705 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, fällig 09.03.2028	1.417	0,12		
	3.255 Nordstrom Inc, 2,300 %, fällig 08.04.2024	3.072	0,25		
	1.160 Owl Rock Capital Corp, 4,000 %, fällig 30.03.2025	1.118	0,09		
	4.330 Owl Rock Capital Corp, 2,625 %, fällig 15.01.2027	3.656	0,30		
	12.365 OWL Rock Core Income Corp, 3,125 %, fällig am 23.09.2026	10.769	0,89		
	4.040 Owl Rock Technology Finance Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.12.2025	3.763	0,31		
	10.861 Owl Rock Technology Finance Corp, 144A, 3,750 %, fällig am 17.06.2026	9.721	0,80		
	5.345 Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC, 144A, 4,000 %, fällig am 15.10.2027	4.673	0,39		
	4.430 ROBLOX Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.05.2030	3.703	0,31		
	890 Seagate HDD Cayman, 4,125 %, fällig am 15.01.2031	730	0,06		
	12.350 Sealed Air Corp, 144A, 1,573 %, fällig 15.10.2026	10.839	0,89		
	5.247 Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC, 144A, 4,738 %, fällig am 20.03.2025	5.269	0,44		
	12.250 Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC, 144A, 5,152 %, fällig am 20.03.2028	12.336	1,02		
	1.220 Stellantis NV, 5,250 %, fällig 15.04.2023	1.227	0,10		
	3.022 SVB Financial Group, 1,800 %, fällig 02.02.2031	2.278	0,19		
	4.315 Travel + Leisure Co, 144A, 6,625 %, fällig am 31.07.2026	4.189	0,35		
	12.860 Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC, 144A, 7,875 %, fällig am 15.02.2025	12.721	1,05		
	6.290 Univision Communications Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.02.2025	6.084	0,50		
	4.080 Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.06.2027	3.943	0,33		
	14.235 Valero Energy Corp, 3,650 %, fällig 01.12.2051	10.869	0,90		
	6.945 Verizon Communications Inc, 1,450 %, fällig 20.03.2026	6.339	0,52		
	7.940 Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2027	7.316	0,60		
	7.500 Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.05.2025	6.710	0,55		
	1.070 Vista Outdoor Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2029	798	0,07		
	5.955 Vontier Corp, 1,800 %, fällig 01.04.2026	5.217	0,43		
	5.240 Vontier Corp, 2,400 %, fällig 01.04.2028	4.247	0,35		
	5.920 Vontier Corp, 2,950 %, fällig 01.04.2031	4.562	0,38		
	15.185 Western Digital Corp, 1,500 %, fällig 01.02.2024	14.487	1,20		
	6.000 World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, fällig 01.11.2026	4.181	0,35		
	6.523 Wynn Las Vegas LLC . Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025	6.254	0,52		
		532.241	43,95		
Sambia — 1,82 % (28. Februar 2022: 1,03 %)					
	7.175 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 01.03.2024	7.112	0,59		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — (Fortsetzung)		
Sambia — (Fortsetzung)		
15.590 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	14.890	1,23
	22.002	1,82
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 855.274\$)	751.389	62,05
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 8,48 % (28. Februar 2022: 16,67 %)		
Kanada — 1,03 % (28. Februar 2022: 0,79 %)		
13.285 CPPIB Capital Inc, 144A, 0,500 %, fällig 16.09.2024	12.485	1,03
Kolumbien — 1,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
COP 72.240.000 Colombian TES, Serie B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	12.073	1,00
Frankreich — 1,21 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
EUR 22.870 French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, fällig 25.05.2052	14.595	1,21
Deutschland — 0,73 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
EUR 14.330 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2052	8.894	0,73
USA — 4,51 % (28. Februar 2022: 12,04 %)		
68.340 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15/02/2052	54.608	4,51
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 112.160\$)	102.655	8,48
Organismen für gemeinsame Anlagen — 9,04 % (28. Februar 2022: 2,53 %)		
109.532 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Institutionelle Klasse	109.532	9,04
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 109.532\$)	109.532	9,04
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.269.875 USD)		
	1.146.728	94,69
Credit Default Swaps — 0,21 % (28. Februar 2022: 1,41 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	2.535	0,21
Devisenterminkontrakte — 0,66 % (28. Februar 2022: 0,57 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	8.043	0,66
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	1.157.306	95,56
Credit Default Swaps — 0,11 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.315)	(0,11)
Devisenterminkontrakte — (1,33 %) (28. Februar 2022: (1,07 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(16.144)	(1,33)

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit — Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 % — Sell	20.12.2023	135.734	\$ 2.327
Citi	CDX.NA.IG, 1,000 % — Verkaufen	20.06.2025	55.620	183
Citi	iTraxx Europe, 1,000 % — Sell	20.06.2025	23.060	16
Citi	iTraxx Europe, 1,000 % — Sell	20.12.2024	3.160	6
JP Morgan	Altice France SA, 5,000 % — Sell	20.12.2025	1.605	(44)
JP Morgan	Altice France SA, 5,000 % — Sell	20.06.2026	15.700	(660)
JP Morgan	Altice France SA, 5,000 % — Sell	20.12.2025	3.390	(93)
JP Morgan	Altice Luxembourg SA, 5,000 % — Sell	20.12.2025	1.605	(163)
JP Morgan	Altice Luxembourg SA, 5,000 % — Sell	20.12.2025	3.495	(355)
Morgan Stanley	Dell Inc, 1,000 % — Sell	20.12.2022	1.925	3
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 22.750\$)				\$ 2.535
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -\$)				(1.315)
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 22.750\$)				\$ 1.220

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 2 Verkauf	\$ —
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	HKD — Verkauf	—
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP — Verkauf	—
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 2.203 Verkauf	57
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL 11.162 Verkauf	79
09.07.2022	HSBC	Kauf	USD 38.937 Verkauf	820
09.07.2022	JP Morgan	Kauf	USD 26.689 Verkauf	418
09.07.2022	JP Morgan	Kauf	AUD 94.090 Verkauf	(1.417)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 83 Verkauf	2

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Futures — (0,00 %) (28. Februar 2022: (0,08 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		(14)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	(17.473)	(1,44)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	1.139.833	94,12
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
	71.175	5,88
Gesamtnettvermögen		
	1.211.008\$	100,00

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

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 582.677.000\$ und machten 48,14 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.

ABKÜRZUNGEN:

Fortwährend –	Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
REMIC –	Real Estate Mortgage Investment Conduit.
AUD –	Australischer Dollar
BRL –	Brasilianischer Real
COP –	Kolumbianischer Peso
EUR –	Euro
GBP –	Britisches Pfund Sterling
MXN –	Mexikanischer Peso

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	83,82
Organismen für gemeinsame Anlagen	8,85
Finanzderivate	0,85
Sonstige Vermögenswerte	6,48
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	137	Verkauf	CNH	938	\$	1
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	4.479	Verkauf	EUR	4.407		48
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2.436	Verkauf	EUR	2.441		(19)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	272	Verkauf	GBP	223		12
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	11	Verkauf	SEK	118		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	74	Verkauf	SEK	775		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	773	Verkauf	SGD	1.068		8
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	257	Verkauf	SGD	361		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	430.448	Verkauf	USD	439.778		(6.760)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	27.142	Verkauf	USD	32.784		(1.246)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	81	Verkauf	USD	57		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.553	Verkauf	USD	2.554		14
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CZK	1.181	Verkauf	USD	49		(1)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	7.027	Verkauf	USD	1.039		(22)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	25.954	Verkauf	USD	2.558		(122)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	8.600	Verkauf	USD	6.006		(120)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	96.291	Verkauf	USD	69.855		(945)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CHF	1.324	Verkauf	USD	1.391		(35)
15.09.2022	HSBC	Kauf	USD	5.344	Verkauf	CHF	5.250		(33)
15.09.2022	JP Morgan	Kauf	CHF	5.250	Verkauf	USD	5.544		(167)
26.09.2022	Barclays	Kauf	USD	7.425	Verkauf	JPY	1.015.000		104
26.09.2022	HSBC	Kauf	JPY	9.094.000	Verkauf	USD	67.378		(1.780)
26.09.2022	JP Morgan	Kauf	USD	167.127	Verkauf	JPY	22.386.000		5.647
26.09.2022	JP Morgan	Kauf	JPY	14.307.000	Verkauf	USD	106.618		(3.415)
10.04.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	11.592	Verkauf	USD	2.271		(62)
27.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD	11.217	Verkauf	COP	48.600.000		352
31.10.2022	Citi	Kauf	USD	809	Verkauf	MXN	16.500		–
11.02.2022	HSBC	Kauf	USD	17.322	Verkauf	EUR	16.850		316
11.02.2022	National Australia Bank	Kauf	USD	11.075	Verkauf	EUR	10.810		165
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 9.078\$)								\$	8.043
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (17.153))\$									(16.144)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (8.075))\$								\$	(8.101)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2022	Citi	708	105.846\$	\$ (14)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.309))\$				(14)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.309))\$				\$ (14)

Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 12,29 % (28. Februar 2022: 19,58 %)			United Republic of Tanzania — 0,43 % (28. Februar 2022: 0,84 %)		
700			235		
American Credit Acceptance Receivables Trust 2020-4, Serie 2020 4, Klasse F, 144A, 5,220 %, fällig 13.08.2027	684	1,34	HTA Group Ltd.Mauritius, 7,000 %, fällig 18.12.2025	222	0,43
1.365			USA — 7,37 % (28. Februar 2022: 9,05 %)		
Atrium XIV LLC 14A, Klasse E, 144A, 8,390 %, fällig 23.08.2030 *	1.213	2,37	720		
1.310			Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig am 15.08.2027	716	1,40
BlueMountain CLO XXII Ltd, Serie 2018 22A, Klasse C, 144A, 4,462 %, fällig 15.07.2031 *	1.222	2,38	325		
805			DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	235	0,46
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 Ltd, Serie 2017 26A, Klasse D, 144A, 5,390 %, fällig 18.10.2030 *	762	1,49	280		
520			Freedom Mortgage Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15.04.2025	243	0,47
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd, Serie 2018 29A, Klasse D, 144A, 5,838 %, fällig 19.10.2031 *	496	0,97	520		
2.000			Horizon Therapeutics USA Inc, 144A, 5,500 %, fällig am 01.08.2027	499	0,97
Westlake Automobile Receivables Trust 2020-3, Serie 2020 3A, Klasse D, 144A, 1,650 %, fällig 17.02.2026	1.918	3,74	795		
			Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig am 01.08.2026	768	1,50
			270		
			TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	265	0,52
			1.000		
			Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15.05.2025	1.051	2,05
				3.777	7,37
Asset-Backed Securities insgesamt (Kosten 6.666 USD)	6.295	12,29			
Forderungsbesicherte Wertpapiere — 64,09 % (28. Februar 2022: 56,32 %)			Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 4.6955)		
1.000				4.471	8,73
Bellemeade Re 2020-2 Ltd, Serie 2020 2A, Klasse M2, 144A, 8,444 %, fällig 26.08.2030 *	1.027	2,00	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 9,43 % (28. Februar 2022: 7,89 %)		
440			USA — 9,43 % (28. Februar 2022: 5,24 %)		
Bellemeade Re 2020-3 Ltd, Serie 2020 3A, Klasse M2, 144A, 7,294 %, fällig 25.10.2030 *	443	0,87	910		
2.180			United States Treasury Floating Rate Note — bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023 *	911	1,78
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC15, Serie 2013 GC15, Klasse C, 5,335 %, fällig 10.09.2046 *	2.145	4,19	3.930		
1.297			United States Treasury Floating Rate Note — bei Ausgabe, 2,046 %, fällig 30.04.2024 *	3.922	7,65
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC17, Serie 2013 GC17, Klasse C, 5,252 %, fällig 10.11.2046 *	1.263	2,47		4.833	9,43
460			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 4.8365)		
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Serie 2014 GC23, Klasse D, 144A, 4,631 %, fällig 10.07.2047 *	426	0,83		4.833	9,43
745			Organismen für gemeinsame Anlagen — 3,73 % (28. Februar 2022: 3,67 %)		
COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust, Serie 2014 CR18, Klasse AM, 4,103 %, fällig 15.07.2047	727	1,42	1.912		
1.039			Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	1.912	3,73
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R04, Serie 2019 R04, Klasse 2B1, 144A, 7,694 %, fällig 25.06.2039 *	1.069	2,09	Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 1.9125)		
509				1.912	3,73
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Serie 2019 R05, Klasse 1B1, 144A, 6,544 %, fällig 25.10.2039 *	513	1,00	Stammaktien — 0,07 % (28. Februar 2022: 0,06 %)		
1.180			USA — 0,07 % (28. Februar 2022: 0,06 %)		
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R06, Serie 2019 R06, Klasse 2B1, 144A, 6,194 %, fällig 25.09.2039 *	1.160	2,26	8		
1.180			Danimer Scientific Inc	38	0,07
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Klasse 1B1, 144A, 5,844 %, fällig 25.10.2039 *	1.159	2,26	Summe Stammaktien (Kosten 534 USD)		
570				38	0,07
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Serie 2020 R01, Klasse 1B1, 144A, 5,694 %, fällig 25.01.2040 *	535	1,04	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 52.3995)		
1.131				50.381	98,34
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C07, Klasse 2M2, 6,794 %, fällig 25.05.2029 *	1.155	2,25	Credit Default Swaps — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,29 %)		
590			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C01, Klasse 1B1, 8,194 %, fällig 25.07.2029 *	646	1,26		1	–
430			Devisenterminkontrakte — 0,32 % (28. Februar 2022: 0,15 %)		
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C06, Klasse 1B1, 6,594 %, fällig 25.02.2030 *	444	0,87	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
1.300				165	0,32
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Klasse 1B1, 5,994 %, fällig 25.07.2030 *	1.322	2,58	Futures — (0,08 %) (28. Februar 2022: 0,16 %)		
1.863			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Klasse 1M2, 4,694 %, fällig 25.07.2030 *	1.875	3,66		40	0,08
1.415			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Klasse 1B1, 6,194 %, fällig 25.10.2030 *	1.425	2,78		50.587	98,74
1.200			Devisenterminkontrakte — (0,34 %) (28. Februar 2022: (0,28 %))		
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA4, Serie 2020 DNA4, Klasse B1, 144A, 8,444 %, fällig am 25.08.2050 *	1.263	2,46	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
1.440				(174)	(0,34)
Freddie Mac STACR Trust 2019-HRP1, Serie 2019 HRP1, Klasse M3, 144A, 4,694 %, fällig 25.02.2049 *	1.381	2,70	Futures — (0,73 %) (28. Februar 2022: (0,15 %))		
31.083			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
GS Mortgage Securities Trust 2017-G55, Serie 2017 G55, Klasse XA, 0,990 %, fällig 10.03.2050 *	971	1,90		(374)	(0,73)
EUR			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
600				50.039	97,67
IM Pastor 3 FTH 3, Klasse B, 0,112 %, fällig 22.03.2043 *	380	0,75	Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
EUR				1.193	2,33
500			Gesamtvermögen		
IM Pastor 4 FTA 4, Klasse B, 0,012 %, fällig am 22.03.2044 *	278	0,54		51.232\$	100,00
920			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C28, Serie 2015 C28, Klasse C, 4,281 %, fällig 15.10.2048 *	860	1,68	144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 24.311.000\$ und machten 47,44 % des Nettovermögens aus.		
EUR			* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.		
1.024			ABKÜRZUNGEN:		
Landmark Mortgage Securities No 2 Plc 2, Klasse BC, 0,418 %, fällig am 17.06.2039 *	901	1,76	REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.		
1.275			EUR – Euro		
LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5, Serie 2017 5, Klasse D, 144A, 4,830 %, fällig 10.03.2050 *	1.063	2,07			
2.440					
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C14, Serie 2014 C14, Klasse A5, 4,064 %, fällig 15.02.2047	2.420	4,72			
595					
STACR Trust 2018-DNA3, Serie 2018 DNA3, Klasse M2A, 144A, 4,544 %, fällig 25.09.2048 *	595	1,16			
2.000					
STACR Trust 2018-HRP1, Serie 2018 HRP1, Klasse B1, 144A, 6,194 %, fällig 25.04.2043 *	1.971	3,85			
1.860					
STACR Trust 2018-HRP2, Serie 2018 HRP2, Klasse B1, 144A, 6,644 %, fällig 25.02.2047 *	1.869	3,65			
645					
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Serie 2015 C28, Klasse D, 4,219 %, fällig 15.05.2048 *	570	1,11			
52.498					
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC22, Serie 2015 LC22, Klasse XA, 0,921 %, fällig 15.09.2058 *	976	1,91			
Summe Mortgage-Backed Securities (Anschaffungskosten 33.756 USD)	32.832	64,09			
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 8,73 % (28. Februar 2022: 11,46 %)					
Israel — 0,51 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
270					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig am 21.07.2023	259	0,51			
Japan — 0,42 % (28. Februar 2022: 0,92 %)					
230					
Nissan Motor Co Ltd, 4,345 %, fällig 17.09.2027	213	0,42			
			Analyse des Gesamtvermögens		
			% des Gesamtvermögens		
			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
			93,40		
			Organismen für gemeinsame Anlagen		
			3,68		
			Finanzderivate		
			0,40		
			Sonstige Vermögenswerte		
			2,52		
			Gesamtvermögen		
			100,00		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit — Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Dell Inc, 1.000 % — Sell	20.12.2022	925	\$ 1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 154\$)				\$ 1
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 154\$)				\$ 1

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
09.07.2022	Barclays	Kauf	USD	1.030	Verkauf	AUD	1.510	\$ (4)
09.07.2022	HSBC	Kauf	AUD	1.510	Verkauf	USD	1.072	(39)
09.07.2022	JP Morgan	Kauf	USD	1.053	Verkauf	AUD	1.470	47
09.07.2022	JP Morgan	Kauf	AUD	1.470	Verkauf	USD	1.037	(31)
13.09.2022	Citi	Kauf	USD	1.028	Verkauf	KRW	1.340.000	28
13.09.2022	Citi	Kauf	KRW	1.340.000	Verkauf	USD	1.033	(32)
11.02.2022	Barclays	Kauf	USD	2.039	Verkauf	EUR	1.990	30
11.02.2022	HSBC	Kauf	EUR	1.330	Verkauf	USD	1.366	(24)
11.02.2022	UBS	Kauf	USD	443	Verkauf	EUR	430	9
11.09.2022	Citi	Kauf	CNH	10.430	Verkauf	USD	1.556	(44)
11.09.2022	HSBC	Kauf	USD	3.080	Verkauf	CNH	20.900	51
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 79\$)							\$	165
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (145))\$								(174)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (66))\$							\$	(9)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
E-Mini Nasdaq 100 Index September 2022	Citi	(8)	(1.966) USD	\$ (82)
Euro-Bobl September 2022	Citi	(22)	(2.721)	(21)
Euro-Bund September 2022	Citi	(9)	(1.338)	(27)
Russell 2000 Index September 2022	Citi	(23)	(2.121)	(179)
S&P 500 Index September 2022	Citi	(10)	(1.978)	(47)
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2022	Citi	68	7.949	(18)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2022	Citi	(103)	(11.415)	40
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 86\$)				\$ 40
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (81))\$				(374)
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 5\$)				\$ (334)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 94,95 % (28. Februar 2022: 88,64 %)					
Australien — 1,71 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
165 FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375 %, fällig 01.04.2031	135	1,71			
Brasilien — 2,80 % (28. Februar 2022: 5,68 %)					
280 MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	221	2,80			
Kanada — 5,64 % (28. Februar 2022: 2,28 %)					
100 1011778 BC ULC . New Red Finance Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2030	81	1,03			
105 ATS Automation Tooling Systems Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.12.2028	92	1,17			
205 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	170	2,16			
110 Teime Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	101	1,28			
	444	5,64			
Chile — 4,29 % (28. Februar 2022: 3,66 %)					
200 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig am 27.04.2026	176	2,24			
200 Kenbourne Invest SA, 4,700 %, fällig am 22.01.2028	161	2,05			
	337	4,29			
China — 2,52 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
200 Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, fällig 27.07.2032	198	2,52			
Irland — 1,68 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
165 Cimpress Plc, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2026	132	1,68			
Israel — 5,92 % (28. Februar 2022: 4,56 %)					
95 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 30.03.2028	86	1,09			
70 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 30.03.2031	61	0,78			
220 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, fällig am 30.06.2030	210	2,67			
80 Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, fällig am 18.12.2022	79	1,01			
30 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig am 21.07.2023	29	0,37			
	465	5,92			
Italien — 1,08 % (28. Februar 2022: 1,08 %)					
EUR 100 Verde Bidco SpA, 4,625 %, fällig am 01.10.2026	85	1,08			
Mexiko — 2,20 % (28. Februar 2022: 5,70 %)					
200 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig am 15.11.2029	173	2,20			
Panama — 2,21 % (28. Februar 2022: 1,90 %)					
200 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig am 31.05.2030	174	2,21			
Vereinigtes Königreich — 1,87 % (28. Februar 2022: 3,48 %)					
160 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 6,750 %, fällig am 01.10.2026	147	1,87			
USA — 63,03 % (28. Februar 2022: 50,72 %)					
195 Affinity Gaming, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027	170	2,16			
90 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig am 15.08.2027	89	1,14			
205 ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2028	156	1,98			
165 Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2029	138	1,76			
60 Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, fällig am 01.09.2028	53	0,67			
50 Block Inc, 3,500 %, fällig 01.06.2031	41	0,52			
30 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2026	27	0,35			
200 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2030	177	2,25			
55 CCM Merger Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.05.2026	52	0,66			
65 Century Communities Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2029	52	0,67			
50 Cobra AcquisitionCo LLC, 144A, 6,375 %, fällig 01.11.2029	37	0,47			
75 Cogent Communications Group Inc, 144A, 3,500 %, fällig 01.05.2026	68	0,86			
95 Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125 %, fällig 31.12.2024	90	1,14			
70 Credit Acceptance Corp, 6,625 %, fällig 15.03.2026	69	0,87			
85 Delta Air Lines Inc . SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20.10.2025	83	1,06			
80 Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig 15.07.2029	68	0,86			
115 FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, fällig am 01.09.2028	100	1,27			
35 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 01.01.2030	31	0,40			
45 Forestar Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.03.2028	37	0,48			
25 Freedom Mortgage Corp, 144A, 8,125 %, fällig 15.11.2024	22	0,28			
50 Freedom Mortgage Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15.04.2025	43	0,55			
100 Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.05.2026	82	1,04			
135 Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.01.2027	102	1,30			
80 General Motors Co, 5,000 %, fällig 01.04.2035	72	0,91			
100 Home BancShares Inc.AR, 3,125 %, fällig 30.01.2032 *	88	1,11			
45 IAA Inc, 144A, 5,500 %, fällig 15.06.2027	42	0,54			
210 LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2027	199	2,53			
200 Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01.02.2030	153	1,95			
350 Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig am 01.08.2026	338	4,30			
40 Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,625 %, fällig am 01.06.2028	36	0,45			
210 Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.10.2026	192	2,44			
45 Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig am 01.05.2029	40	0,50			
50 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2025	48	0,62			
45 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026	43	0,54			
75 NFP Corp, 144A, 7,500 %, fällig 01.10.2030	74	0,94			
65 Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.08.2026	64	0,81			
60 PennyMac Financial Services Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.09.2031	49	0,62			
125 Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.03.2029	107	1,36			
45 PRA Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2029	39	0,49			
95 ROBLOX Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.05.2030	79	1,01			
45 Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625 %, fällig 01.04.2026	44	0,56			
145 Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144A, 4,875 %, fällig am 01.11.2027	128	1,62			
100 Standard Industries Inc/NJ, 144A, 4,375 %, fällig am 15.07.2030	80	1,01			
55 Station Casinos LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.02.2028	47	0,60			
105 Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.12.2031	88	1,12			
25 Synaptics Inc, 4,000 %, fällig 15.06.2029	22	0,28			
65 Texas Capital Bancshares Inc, 4,000 %, fällig 06.05.2031 *	57	0,73			
100 TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	98	1,25			
40 Travel + Leisure Co, 144A, 4,625 %, fällig 01.03.2030	32	0,41			
70 Truist Financial Corp, 4,916 %, fällig am 28.07.2033 *	67	0,85			
105 Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 15.02.2026	93	1,19			
40 Twilio Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2031	32	0,41			
95 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.06.2027	78	1,00			
125 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2029	97	1,24			
205 Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 01.02.2029	178	2,26			
125 Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2027	115	1,47			
40 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	34	0,43			
165 World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, fällig 01.11.2026	115	1,46			
105 Wynn Las Vegas LLC . Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025	101	1,28			
	4.956	63,03			
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 7.849\$)				7.467	94,95
Organismen für gemeinsame Anlagen — 6,27 % (28. Februar 2022: 8,68 %)					
493 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Institutionelle Klasse	493	6,27			
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 493\$)				493	6,27
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 8.342\$)					
Devisenterminkontrakte — 0,09 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				7.960	101,22
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)					
			7		0,09
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
			7.967		101,31
Devisenterminkontrakte — (1,36 %) (28. Februar 2022: (1,93 %))					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)					
			(107)		(1,36)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
			(107)		(1,36)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
			7.860		99,95
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen					
			4		0,05
Gesamtvermögen				7.864\$	100,00
<p>– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.</p> <p>144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 5.794.000\$ und machten 73,69 % des Nettovermögens aus.</p> <p>* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.</p>					
ABKÜRZUNGEN:					
EUR	– Euro				
Analyse des Gesamtvermögens					
					% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					90,60
Organismen für gemeinsame Anlagen					5,98
Finanzderivate					0,08
Sonstige Vermögenswerte					3,34
Gesamtvermögen					100,00

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	56	Verkauf	CAD	73	\$	1
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	194	Verkauf	GBP	162		6
13.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	6.026	Verkauf	USD	6.145		(83)
11.02.2022	Barclays	Kauf	EUR	1.310	Verkauf	USD	1.342		(20)
12.05.2022	JP Morgan	Kauf	GBP	170	Verkauf	USD	202		(4)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)								\$	7
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (196))\$									(107)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (196))\$								\$	(100)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen — 92,83 % (28. Februar 2022: 76,03 %)		
Brasilien — 11,36 % (28. Februar 2022: 10,36 %)		
BRL 25.680	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig am 01.01.2029	4.501 6,36
BRL 20.580	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig am 01.01.2031	3.540 5,00
		8.041 11,36
Kolumbien — 8,03 % (28. Februar 2022: 3,21 %)		
COP 11.900.000	Colombian TES, Serie B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	2.059 2,91
COP 22.400.000	Colombian TES, Serie B, 7,000 %, fällig 30.06.2032	3.623 5,12
		5.682 8,03
Tschechische Republik — 4,41 % (28. Februar 2022: 4,86 %)		
CZK 98.900	Czech Republic Government Bond, Serie 138, 1,750 %, fällig 23.06.2032	3.117 4,41
Frankreich — 6,09 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
EUR 3.910	French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032	3.222 4,56
EUR 1.700	French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, fällig 25.05.2052	1.085 1,53
		4.307 6,09
Malaysia — 2,73 % (28. Februar 2022: 3,74 %)		
MYR 3.990	Malaysia Government Bond, Serie 0313, 3,480 %, fällig 15.03.2023	895 1,27
MYR 1.510	Malaysia Government Bond, Serie 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	343 0,48
MYR 3.070	Malaysia Government Bond, Serie 0417, 3,899 %, fällig 16.11.2027	691 0,98
		1.929 2,73
Mexiko — 18,26 % (28. Februar 2022: 17,20 %)		
MXN 39.500	Mexican Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig am 31.05.2029	1.910 2,70
MXN 38.600	Mexican Bonos, Serie M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	1.830 2,59
MXN 167.700	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	7.353 10,39
MXN 40.900	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	1.829 2,58
		12.922 18,26
Russien — 1,55 % (28. Februar 2022: 0,98 %)		
RUB 209.000	Russian Federal Bond — OFZ, 0,000 %, fällig 10.04.2030 †	1.098 1,55
Südafrika — 9,05 % (28. Februar 2022: 9,44 %)		
ZAR 33.500	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	1.233 1,74
ZAR 112.400	Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	5.168 7,31
		6.401 9,05
Südkorea — 6,33 % (28. Februar 2022: 6,92 %)		
KRW 5.190.000	Korea Treasury Bond, Serie 3106, 2,000 %, fällig am 10.06.2031	3.387 4,79
KRW 2.070.000	Korea Treasury Bond, Serie 5103, 1,875 %, fällig am 10.03.2051	1.094 1,54
		4.481 6,33
USA — 25,02 % (28. Februar 2022: 9,65 %)		
7.860	United States Treasury Floating Rate Note — bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023 *	7.866 11,12
8.730	United States Treasury Floating Rate Note — bei Ausgabe, 2,046 %, fällig 30.04.2024 *	8.712 12,31

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
09.07.2022	Citi	Kauf	USD 103	Verkauf	AUD 150	\$ —
09.07.2022	JP Morgan	Kauf	AUD 2.870	Verkauf	USD 2.056	(92)
09.07.2022	UBS	Kauf	USD 118	Verkauf	AUD 170	1
09.12.2022	HSBC	Kauf	USD 109	Verkauf	THB 4.000	—
09.12.2022	HSBC	Kauf	USD 169	Verkauf	THB 6.000	5
09.12.2022	HSBC	Kauf	THB 95.000	Verkauf	USD 2.795	(188)
13.09.2022	Citi	Kauf	USD 5.377	Verkauf	KRW 7.000.000	151
13.09.2022	Citi	Kauf	KRW 800.000	Verkauf	USD 610	(13)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 4	Verkauf	USD 4	—
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD 106.211	Verkauf	USD 74.171	(1.478)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD 101	Verkauf	USD 73	(1)
26.09.2022	HSBC	Kauf	USD 1.467	Verkauf	JPY 197.000	46

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
1.130	United States Treasury Floating Rate Note — bei Ausgabe, 2,796 %, fällig 31.07.2024 *	1.129 1,59
		17.707 25,02
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 76.289\$)		
Organismen für gemeinsame Anlagen — 5,39 % (28. Februar 2022: 4,07 %)		
30	Legg Mason Global Funds Plc — Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund — LM Klasse US\$ Thesaurierend	3.816 5,39
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 3.499\$)		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
Devisenterminkontrakte — 1,32 % (28. Februar 2022: 3,38 %)		
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	934 1,32
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
Devisenterminkontrakte — (4,68 %) (28. Februar 2022: (4,37 %))		
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(3.309) (4,68)
Futures — (0,19 %) (28. Februar 2022: (1,37 %))		
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(132) (0,19)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
Gesamtnettvermögen		
		70.760\$ 100,00

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

* Variabel verzinsliches Wertpapier. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2022.

† Nicht liquide.

‡ Aufgrund der Ungewissheit der Zinszahlungen werden während und/oder nach dem zum 31. August 2022 endenden Geschäftsjahr keine Erträge aus dem Wertpapier mehr gezahlt.

ABKÜRZUNGEN:

BRL	–	Brasilianischer Real
COP	–	Kolumbianischer Peso
CZK	–	Tschechische Krone
EUR	–	Euro
KRW	–	Südkoreanischer Won
MXN	–	Mexikanischer Peso
MYR	–	Malaysischer Ringgit
RUB	–	Russischer Rubel
ZAR	–	Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	86,34
Organismen für gemeinsame Anlagen	5,02
Finanzderivate	1,23
Sonstige Vermögenswerte	7,41
Gesamtvermögen	100,00

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
26.09.2022	JP Morgan	Kauf	JPY	2.323.000	Verkauf	USD	17.700	\$ (943)
26.09.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	895	Verkauf	JPY	123.000	8
10.05.2022	HSBC	Kauf	NZD	7.200	Verkauf	USD	4.499	(94)
10.05.2022	JP Morgan	Kauf	USD	124	Verkauf	NZD	200	1
10.07.2022	HSBC	Kauf	SEK	77.900	Verkauf	USD	7.659	(338)
10.07.2022	Morgan Stanley	Kauf	USD	389	Verkauf	SEK	4.000	13
20.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.806	Verkauf	PLN	13.160	30
20.10.2022	UBS	Kauf	PLN	13.160	Verkauf	USD	2.742	34
25.10.2022	Goldman Sachs	Kauf	CAD	7.060	Verkauf	USD	5.464	(90)
27.10.2022	JP Morgan	Kauf	USD	1.966	Verkauf	COP	8.920.000	(28)
11.02.2022	Barclays	Kauf	USD	2.807	Verkauf	EUR	2.740	42
11.02.2022	JP Morgan	Kauf	EUR	1.500	Verkauf	USD	1.539	(25)
11.08.2022	HSBC	Kauf	USD	366	Verkauf	CLP	350.000	(19)
11.08.2022	HSBC	Kauf	CLP	5.930.000	Verkauf	USD	5.996	530
17.11.2022	HSBC	Kauf	USD	664	Verkauf	ZAR	10.900	32
21.11.2022	UBS	Kauf	USD	3.323	Verkauf	CZK	80.800	41
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 3.520\$)								\$ 934
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (4.556))\$								(3.309)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.036))\$								(2.375)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-BTP September 2022	Morgan Stanley	55	6.606\$	\$ (132)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1.151\$)				
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.426))\$				
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (275))\$				

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen — 3,60 % (28. Februar 2022: 4,24 %)		
68	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	68 3,60
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 68\$)		
68 3,60		
Stammaktien — 98,43 % (28. Februar 2022: 98,48 %)		
Werbung — 1,33 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
25	– Omnicom Group Inc	1,33
Banken — 12,81 % (28. Februar 2022: 22,10 %)		
2	Bank of America Corp	56 2,98
4	– BOK Financial Corp	0,20
11	– Citizens Financial Group Inc	0,59
7	– Comerica Inc	0,35
14	– Fifth Third Bancorp	0,77
10	1 KeyCorp	0,54
59	1 Morgan Stanley	3,12
12	1 Regions Financial Corp	0,64
3	– Synovus Financial Corp	0,18
3	– UMB Financial Corp	0,14
57	1 Wells Fargo & Co	3,03
5	– Zions Bancorp NA	0,27
241 12,81		
Biotechnologie — 1,14 % (28. Februar 2022: 2,90 %)		
21	– Regeneron Pharmaceuticals Inc	1,14
Baustoffe — 1,35 % (28. Februar 2021: 2,73 %)		
17	– Builders FirstSource Inc	0,93
8	– Louisiana-Pacific Corp	0,42
25 1,35		
Chemische Stoffe — 0,73 % (28. Februar 2022: 1,45 %)		
3	– Eastman Chemical Co	0,15
11	– Huntsman Corp	0,58
14 0,73		
Kommerzielle Dienstleistungen — 1,30 % (28. Februar 2022: 0,24 %)		
16	– Service Corp International/US	0,85
8	– TriNet Group Inc	0,45
24 1,30		
Kosmetik & Körperpflege — 1,16 % (28. Februar 2022: 2,00 %)		
22	– Procter & Gamble Co/The	1,16
Distribution und Großhandel — 1,46 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
28	1 LKQ Corp	1,46
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 8,05 % (28. Februar 2022: 5,87 %)		
3	– Affiliated Managers Group Inc	0,18
7	– Ally Financial Inc	0,35
57	– American Express Co	3,04
19	– Ameriprise Financial Inc	0,98
25	– Capital One Financial Corp	1,35
4	– Credit Acceptance Corp	0,20
17	– Discover Financial Services	0,90
2	– Janus Henderson Group Plc	0,13
5	– Jefferies Financial Group Inc	0,26
3	– OneMain Holdings Inc	0,13
10	– Synchrony Financial	0,53
152 8,05		
Elektrik — 2,56 % (28. Februar 2022: 4,34 %)		
8	– Dominion Energy Inc	0,41
9	– Duke Energy Corp	0,50
6	– Exelon Corp	0,33
15	– NextEra Energy Inc	0,81
10	– Southern Co/The	0,51
48 2,56		
Elektronik — 0,84 % (28. Februar 2022: 1,42 %)		
16	– Jabil Inc	0,84
Lebensmittel — 5,26 % (28. Februar 2022: 1,88 %)		
57	1 Kroger Co/The	3,03
5	– Mondelez International Inc	0,27
37	– Tyson Foods Inc 'A'	1,96
99 5,26		
Gas — 0,62 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
12	– National Fuel Gas Co	0,62
Medizinische Produkte — 1,47 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
28	– Hologic Inc	1,47
Medizinische Dienstleistungen — 4,62 % (28. Februar 2022: 9,44 %)		
15	– DaVita Inc	0,77

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
36	– Laboratory Corp of America Holdings	1,91
26	– Quest Diagnostics Inc	1,39
10	– Universal Health Services Inc	0,55
87 4,62		
Bauunternehmen — 6,08 % (28. Februar 2022: 1,66 %)		
39	1 DR Horton Inc	2,09
32	– Lennar Corp	1,67
21	– NVR Inc	1,10
15	– PulteGroup Inc	0,80
8	– Toll Brothers Inc	0,42
115 6,08		
Einrichtungsgegenstände — 0,76 % (28. Februar 2022: 0,85 %)		
14	– Whirlpool Corp	0,76
Versicherung — 13,40 % (28. Februar 2022: 8,03 %)		
23	– Aflac Inc	1,23
7	– American Financial Group Inc/OH	0,36
25	– American International Group Inc	1,33
10	– Arch Capital Group Ltd	0,56
49	– Chubb Ltd	2,60
6	– CNA Financial Corp	0,35
7	– Everest Re Group Ltd	0,36
7	– Fidelity National Financial Inc	0,36
4	– First American Financial Corp	0,19
3	– Hanover Insurance Group Inc/The	0,16
13	– Hartford Financial Services Group Inc/The	0,68
5	– Lincoln National Corp	0,26
32	– MetLife Inc	1,70
12	– Principal Financial Group Inc	0,63
22	– Prudential Financial Inc	1,16
24	– Travelers Cos Inc/The	1,27
4	– Voya Financial Inc	0,20
253 13,40		
Medien — 2,22 % (28. Februar 2022: 2,20 %)		
4	– Charter Communications Inc	0,19
11	– Comcast Corp	0,59
13	– Nexstar Media Group Inc 'A'	0,67
14	– Walt Disney Co/The	0,77
42 2,22		
Bergbau — 0,24 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
5	– Southern Copper Corp	0,24
Diverse Fertigung — 1,09 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
9	– 3M Co	0,46
12	– A O Smith Corp	0,63
21 1,09		
Öl und Gas — 3,60 % (28. Februar 2022: 0,94 %)		
27	– Chevron Corp	1,44
13	– ConocoPhillips	0,66
28	– Exxon Mobil Corp	1,50
68 3,60		
Pharma — 4,32 % (28. Februar 2022: 7,05 %)		
11	– Bristol-Myers Squibb Co	0,58
11	– CVS Health Corp	0,57
31	– Johnson & Johnson	1,67
9	– Merck & Co Inc	0,46
19	– Pfizer Inc	1,04
81 4,32		
Private Equity — 0,98 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
18	– KKR & Co Inc	0,98
Einzelhandel — 7,17 % (28. Februar 2022: 8,29 %)		
17	– Advance Auto Parts Inc	0,90
2	– AutoNation Inc	0,09
11	– Dick's Sporting Goods Inc	0,58
12	– Murphy USA Inc	0,63
15	– Penske Automotive Group Inc	0,78
36	– Ulta Beauty Inc	1,91
4	– Walgreens Boots Alliance Inc	0,22
20	– Walmart Inc	1,08
18	– Williams-Sonoma Inc	0,98
135 7,17		
Halbleiter — 7,23 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
72	1 Applied Materials Inc	3,80
3	– KLA Corp	0,18
61	1 Micron Technology Inc	3,25
136 7,23		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Analise des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Software — 0,90 % (28. Februar 2022: 1,48 %)			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,16
– Black Knight Inc	17	0,90	Organismen für gemeinsame Anlagen	3,53
Telekommunikation — 5,74 % (28. Februar 2022: 1,47 %)			Sonstige Vermögenswerte	0,31
1 AT&T Inc	11	0,59	Gesamtvermögen	100,00
2 Cisco Systems Inc	97	5,15		
	108	5,74		
Summe Stammaktien (Kosten 1.857 USD)	1.855	98,43		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.925\$)	1.923	102,03		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	1.923	102,03		
Devisenterminkontrakte — (1,08 %) (28. Februar 2022: (1,32 %))				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(20)	(1,08)		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(20)	(1,08)		
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.903	100,95		
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	(18)	(0,95)		
Gesamtnettvermögen	1.885\$	100,00		

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

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei		Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	78	Verkauf	EUR	79	\$ –
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.241	Verkauf	USD	1.268	(20)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1\$)								–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (29))\$								(20)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (28))\$								(20)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Value Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien — 98,04 % (28. Februar 2022: 96,99 %)		
Automobilhersteller — 1,17 % (28. Februar 2022: 1,26 %)		
269 General Motors Co	10.265	1,17
Banken — 11,85 % (28. Februar 2022: 12,59 %)		
860 Bank of America Corp	28.913	3,28
29 Goldman Sachs Group Inc/The	9.747	1,11
108 M&T Bank Corp	19.537	2,22
97 Signature Bank/New York NY	16.970	1,92
670 Wells Fargo & Co	29.257	3,32
	104.424	11,85
Getränkeindustrie — 1,36 % (28. Februar 2022: 1,10 %)		
48 Constellation Brands Inc 'A'	11.937	1,36
Biotechnologie — 4,56 % (28. Februar 2022: 5,27 %)		
217 BioMarin Pharmaceutical Inc	19.378	2,20
74 Vertex Pharmaceuticals Inc	20.792	2,36
	40.170	4,56
Chemische Stoffe — 1,95 % (28. Februar 2022: 0,75 %)		
EUR 51 Air Liquide SA	6.427	0,73
199 Mosaic Co/The	10.730	1,22
	17.157	1,95
Kommerzielle Dienstleistungen — 1,47 % (28. Februar 2022: 1,85 %)		
92 Quanta Services Inc	12.979	1,47
Computer — 1,36 % (28. Februar 2022: 2,20 %)		
485 DXC Technology Co	12.020	1,36
Kosmetik & Körperpflege — 1,89 % (28. Februar 2022: 1,61 %)		
1.924 Coty Inc 'A'	14.455	1,64
GBP 725 Haleon Plc	2.180	0,25
	16.635	1,89
Distribution und Großhandel — 0,95 % (28. Februar 2022: 0,94 %)		
JPY 799 Marubeni Corp	8.324	0,95
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 4,36 % (28. Februar 2022: 5,81 %)		
142 Charles Schwab Corp/The	10.111	1,15
134 Intercontinental Exchange Inc	13.542	1,54
240 OneMain Holdings Inc	8.370	0,95
195 Synchrony Financial	6.394	0,72
	38.417	4,36
Elektrik — 6,75 % (28. Februar 2022: 3,02 %)		
818 AES Corp/The	20.821	2,37
241 American Electric Power Co Inc	24.162	2,74
585 Vistra Corp	14.468	1,64
	59.451	6,75
Energie — Alternative Quellen — 2,31 % (28. Februar 2022: 1,74 %)		
25 Enphase Energy Inc	7.121	0,81
341 Fluence Energy Inc	6.800	0,77
23 SolarEdge Technologies Inc	6.427	0,73
	20.348	2,31
Medizinische Produkte — 1,75 % (28. Februar 2022: 3,40 %)		
145 Zimmer Biomet Holdings Inc	15.391	1,75
Medizinische Dienstleistungen — 2,66 % (28. Februar 2022: 2,15 %)		
45 UnitedHealth Group Inc	23.411	2,66
Holdinggesellschaften — Diversifiziert — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,32 %)		
142 East Resources Acquisition Co	29	–
Einrichtungsgegenstände — 1,09 % (28. Februar 2022: 1,18 %)		
122 Sony Group Corp ADR	9.643	1,09
Versicherung — 4,69 % (28. Februar 2022: 6,77 %)		
477 American International Group Inc	24.649	2,80
561 Equitable Holdings Inc	16.692	1,89
	41.341	4,69
Internet — 7,81 % (28. Februar 2022: 5,54 %)		
116 Alphabet Inc	12.691	1,44
194 Meta Platforms Inc 'A'	31.624	3,59
229 TripAdvisor Inc	5.453	0,62
661 Uber Technologies Inc	19.020	2,16
	68.788	7,81
Unterkunft — 1,41 % (28. Februar 2022: 2,61 %)		
381 MGM Resorts International	12.432	1,41
Maschinen — diversifiziert — 1,23 % (28. Februar 2022: 1,08 %)		
884 CNH Industrial NV	10.810	1,23

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Bergbau — 4,08 % (28. Februar 2022: 2,86 %)		
134 Alcoa Corp	6.643	0,76
578 Freeport-McMoRan Inc	17.106	1,94
133 Royal Gold Inc	12.178	1,38
	35.927	4,08
Öl und Gas — 10,89 % (28. Februar 2022: 9,93 %)		
710 EQT Corp	33.930	3,85
141 Hess Corp	17.082	1,94
119 Pioneer Natural Resources Co	30.151	3,42
291 TotalEnergies SE ADR	14.745	1,68
	95.908	10,89
Öl- und Gasdienstleistungen — 3,82 % (28. Februar 2022: 1,57 %)		
611 Baker Hughes Co 'A'	15.415	1,75
479 Schlumberger NV	18.273	2,07
	33.688	3,82
Pharma — 7,99 % (28. Februar 2022: 3,33 %)		
122 AbbVie Inc	16.378	1,86
197 AstraZeneca Plc ADR	12.284	1,39
73 Cigna Corp	20.748	2,35
465 Pfizer Inc	21.016	2,39
	70.426	7,99
Pipelines — 2,20 % (28. Februar 2022: 2,08 %)		
471 Enbridge Inc	19.409	2,20
Immobilien — 0,70 % (28. Februar 2022: 0,94 %)		
97 Howard Hughes Corp/The	6.148	0,70
Einzelhandel — 1,04 % (28. Februar 2022: 1,09 %)		
454 Bloomin' Brands Inc	9.167	1,04
Software — 4,96 % (28. Februar 2022: 4,85 %)		
147 Fiserv Inc	14.884	1,69
292 Oracle Corp	21.645	2,46
62 VMware Inc	7.190	0,81
	43.719	4,96
Telekommunikation — 1,74 % (28. Februar 2022: 3,09 %)		
106 T-Mobile US Inc	15.308	1,74
Summe Stammaktien (Kosten 819.604 USD)		
	863.672	98,04
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 819.604\$)		
	863.672	98,04
Devisenterminkontrakte — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	31	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	863.703	98,04
Devisenterminkontrakte — (0,07 % (28. Februar 2022: (0,07 %)))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(637)	(0,07)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	(637)	(0,07)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	863.066	97,97
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
	17.905	2,03
Gesamtneutvermögen\$		
	880.971\$	100,00

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

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt.
 EUR – Euro
 GBP – Britisches Pfund Sterling
 JPY – Japanischer Yen

Analyse des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,59
Finanzderivate	–
Sonstige Vermögenswerte	2,41
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Value Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.814	Verkauf	EUR	1.819	\$	(16)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	855	Verkauf	EUR	835		15
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	46	Verkauf	SGD	64		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	1		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	2.054	Verkauf	USD	1.490		(20)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.085	Verkauf	USD	2.081		16
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	37.293	Verkauf	USD	38.116		(601)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 14\$)								\$	31
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (641))\$									(637)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (627))\$								\$	(606)

Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien — 94,13 % (28. Februar 2022: 95,93 %)			Unterkunft — 0,35 % (28. Februar 2022: 0,16 %)		
28 General Motors Co	1.060	4,29	4 Marriott International Inc/MD	671	0,35
Banken — 5,51 % (28. Februar 2022: 6,86 %)			Medien — 2,15 % (28. Februar 2022: 2,92 %)		
100 Bank of America Corp	3.357	1,77	66 Comcast Corp	2.392	1,26
40 JPMorgan Chase & Co	4.603	2,43	15 Walt Disney Co/The	1.685	0,89
1 SVB Financial Group	596	0,31		4.077	2,15
16 Truist Financial Corp	756	0,40	Diverse Fertigung — 0,81 % (28. Februar 2022: 0,57 %)		
25 US Bancorp	1.147	0,60	11 Eaton Corp Plc	1.530	0,81
	10.459	5,51	Öl und Gas — 1,93 % (28. Februar 2022: 1,62 %)		
Getränkindustrie — 2,89 % (28. Februar 2022: 2,50 %)			14 Pioneer Natural Resources Co	3.665	1,93
40 Coca-Cola Co/The	2.485	1,31	Verpackung und Behälter — 0,64 % (28. Februar 2022: 0,90 %)		
17 PepsiCo Inc	2.995	1,58	22 Ball Corp	1.223	0,64
	5.480	2,89	Pharma — 8,14 % (28. Februar 2022: 6,90 %)		
Baustoffe — 0,63 % (28. Februar 2021: 0,61 %)			7 Becton Dickinson and Co	1.754	0,92
7 Vulcan Materials Co	1.201	0,63	7 Eli Lilly & Co	2.070	1,09
Chemische Stoffe — 4,52 % (28. Februar 2022: 4,36 %)			29 Johnson & Johnson	4.697	2,47
12 Air Products & Chemicals Inc	2.988	1,57	50 Merck & Co Inc	4.264	2,25
9 Ecolab Inc	1.406	0,74	59 Pfizer Inc	2.667	1,41
22 PPG Industries Inc	2.735	1,44		15.452	8,14
6 Sherwin-Williams Co/The	1.456	0,77	Pipelines — 0,60 % (28. Februar 2022: 0,51 %)		
	8.585	4,52	63 Kinder Morgan Inc	1.148	0,60
Kommerzielle Dienstleistungen — 2,16 % (28. Februar 2022: 1,69 %)			Einzelhandel — 4,30 % (28. Februar 2022: 4,29 %)		
17 Automatic Data Processing Inc	4.100	2,16	11 Home Depot Inc/The	3.316	1,74
Computer — 6,65 % (28. Februar 2022: 6,40 %)			55 TJX Cos Inc/The	3.433	1,81
80 Apple Inc	12.636	6,65	11 Walmart Inc	1.421	0,75
Kosmetik & Körperpflege — 1,47 % (28. Februar 2022: 1,48 %)				8.170	4,30
20 Procter & Gamble Co/The	2.799	1,47	Halbleiter — 0,72 % (28. Februar 2022: 1,45 %)		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 3,86 % (28. Februar 2022: 4,04 %)			3 ASML Holding NV	1.367	0,72
7 CME Group Inc	1.393	0,73	Software — 9,82 % (28. Februar 2022: 11,76 %)		
10 Intercontinental Exchange Inc	959	0,51	6 Adobe Inc	2.062	1,09
25 Visa Inc 'A'	4.980	2,62	10 Fidelity National Information Services Inc	911	0,48
	7.332	3,86	53 Microsoft Corp	13.857	7,30
Elektrik — 0,96 % (28. Februar 2022: 0,77 %)			24 Oracle Corp	1.813	0,95
10 NextEra Energy Inc	852	0,45		18.643	9,82
6 Sempra Energy	981	0,51	Telekommunikation — 2,62 % (28. Februar 2022: 3,33 %)		
	1.833	0,96	9 Arista Networks Inc	1.023	0,54
Elektronik — 2,43 % (28. Februar 2022: 2,16 %)			17 T-Mobile US Inc	2.415	1,27
24 Honeywell International Inc	4.608	2,43	37 Verizon Communications Inc	1.546	0,81
Energie — Alternative Quellen — 0,67 % (28. Februar 2022: 0,48 %)				4.984	2,62
4 Enphase Energy Inc	1.270	0,67	Transport — 2,95 % (28. Februar 2022: 2,75 %)		
Umweltkontrolle — 1,89 % (28. Februar 2022: 1,43 %)			16 Canadian Pacific Railway Ltd	1.203	0,64
21 Waste Management Inc	3.591	1,89	4 Union Pacific Corp	971	0,51
Lebensmittel — 1,05 % (28. Februar 2022: 0,99 %)			18 United Parcel Service Inc 'B'	3.423	1,80
32 Mondelez International Inc	2.001	1,05		5.597	2,95
Medizinische Produkte — 3,19 % (28. Februar 2022: 2,88 %)			Summe Stammaktien (Kosten 138.288 USD)		
4 Medtronic Plc	350	0,19		178.740	94,13
4 Stryker Corp	764	0,40	Real Estate Investment Trusts (Immobilienfonds) — 1,58 % (28. Februar 2022: 1,25 %)		
9 Thermo Fisher Scientific Inc	4.936	2,60	REITs — 1,58 % (28. Februar 2022: 1,25 %)		
	6.050	3,19	12 American Tower Corp	2.998	1,58
Medizinische Dienstleistungen — 3,49 % (28. Februar 2022: 2,83 %)			Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 1.939 USD)		
13 UnitedHealth Group Inc	6.632	3,49		2.998	1,58
Bauunternehmen — 0,35 % (28. Februar 2022: 0,75 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
15 Toll Brothers Inc	658	0,35		181.738	95,71
Versicherung — 6,85 % (28. Februar 2022: 6,35 %)			Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
– Berkshire Hathaway Inc	5.910	3,11		181.738	95,71
12 Hartford Financial Services Group Inc/The	778	0,41	Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
17 Progressive Corp/The	2.097	1,11		8.136	4,29
26 Travelers Cos Inc/The	4.213	2,22	Gesamtnettvermögen		
	12.998	6,85		189.874\$	100,00
Internet — 9,12 % (28. Februar 2022: 10,60 %)			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
48 Alphabet Inc	5.185	2,73	Analyse des Gesamtvermögens		
44 Alphabet Inc 'A'	4.752	2,50	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
52 Amazon.com Inc	6.585	3,47	Sonstige Vermögenswerte		
5 Meta Platforms Inc 'A'	788	0,42	Gesamtvermögen		
	17.310	9,12	100,00		
Eisen/Stahl — 0,85 % (28. Februar 2022: 0,99 %)					
68 ArcelorMittal SA	1.610	0,85			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien — 93,87 % (28. Februar 2022: 97,57 %)			Halbleiter — 5,03 % (28. Februar 2022: 6,96 %)		
Bekleidung — 1,82 % (28. Februar 2022: 1,68 %)			30 ASML Holding NV 14.713 1,14		
220 NIKE Inc	23.429	1,82	364 Intel Corp	11.615	0,90
Autoteile und Ausstattung — 1,28 % (28. Februar 2022: 1,54 %)			254 NVIDIA Corp	38.405	2,99
176 Aptiv Plc	16.458	1,28		64.733	5,03
Getränkeindustrie — 2,22 % (28. Februar 2022: 1,63 %)			Software — 16,75 % (28. Februar 2022: 19,87 %)		
321 Monster Beverage Corp	28.507	2,22	56 Adobe Inc	20.995	1,63
Chemische Stoffe — 1,31 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			96 Atlassian Corp Plc	23.771	1,85
73 Sherwin-Williams Co/The	16.925	1,31	41 Fidelity National Information Services Inc	3.784	0,29
Kommerzielle Dienstleistungen — 4,94 % (28. Februar 2022: 3,83 %)			356 Microsoft Corp	92.986	7,23
306 PayPal Holdings Inc	28.628	2,23	198 Salesforce Inc	30.853	2,40
99 S&P Global Inc	34.907	2,71	179 Splunk Inc	16.088	1,25
	63.535	4,94	241 UiPath Inc	3.960	0,31
Computer — 4,80 % (28. Februar 2022: 4,50 %)			129 Unity Software Inc	5.500	0,43
393 Apple Inc	61.701	4,80	107 Workday Inc 'A'	17.571	1,36
Distribution und Großhandel — 2,38 % (28. Februar 2022: 2,08 %)				215.508	16,75
55 WW Grainger Inc	30.668	2,38	Transport — 2,52 % (28. Februar 2022: 2,84 %)		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 5,30 % (28. Februar 2022: 4,64 %)			167 United Parcel Service Inc 'B'	32.466	2,52
343 Visa Inc 'A'	68.243	5,30	Summe Stammaktien (Kosten 1.061.806 USD)		
Elektrik — 1,08 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				1.207.810	93,87
163 NextEra Energy Inc	13.855	1,08	Real Estate Investment Trusts (Immobilienfonds) — 1,61 % (28. Februar 2022: 1,51 %)		
Elektronik — 2,11 % (28. Februar 2022: 1,97 %)			REITs — 1,61 % (28. Februar 2022: 1,51 %)		
143 Honeywell International Inc	27.101	2,11	31 Equinix Inc	20.698	1,61
Medizinische Produkte — 8,19 % (28. Februar 2022: 6,23 %)			Summe Immobilienfonds (REITs) (Kosten 14.600 USD)		
344 Alcon Inc	22.593	1,76		20.698	1,61
102 Intuitive Surgical Inc	20.909	1,62	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.076.406\$)		
79 Stryker Corp	16.301	1,27		1.228.508	95,48
83 Thermo Fisher Scientific Inc	45.524	3,54	Devisenterminkontrakte — 0,15 % (28. Februar 2022: 0,26 %)		
	105.327	8,19	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
Medizinische Dienstleistungen — 4,80 % (28. Februar 2022: 3,99 %)				2.012	0,15
119 UnitedHealth Group Inc	61.830	4,80	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
Internet — 19,60 % (28. Februar 2022: 23,84 %)				1.230.520	95,63
906 Amazon.com Inc	114.782	8,92	Devisenterminkontrakte — (0,10 %) (28. Februar 2022: (0,10 %))		
261 Meta Platforms Inc 'A'	42.460	3,30	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
101 Netflix Inc	22.599	1,76		(1.310)	(0,10)
81 Palo Alto Networks Inc	45.215	3,51	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
146 Sea Ltd ADR	9.026	0,70		(1.310)	(0,10)
628 Uber Technologies Inc	18.069	1,41	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	252.151	19,60		1.229.210	95,53
Medien — 1,41 % (28. Februar 2022: 1,62 %)			Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
162 Walt Disney Co/The	18.120	1,41		57.433	4,47
Diverse Fertigung — 1,99 % (28. Februar 2022: 1,67 %)			Gesamtnettovermögen		
187 Eaton Corp Plc	25.591	1,99		1.286.643\$	100,00
Pharma — 3,71 % (28. Februar 2022: 3,43 %)			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
304 CVS Health Corp	29.789	2,31	ABKÜRZUNGEN:		
219 Dexcom Inc	17.980	1,40	ADR – American Depositary Receipt.		
	47.769	3,71			
Einzelhandel — 2,63 % (28. Februar 2022: 4,67 %)			Analyse des Gesamtvermögens		
110 Advance Auto Parts Inc	18.502	1,44	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
83 Tractor Supply Co	15.391	1,19	Finanzderivate		
	33.893	2,63	Sonstige Vermögenswerte		
			Gesamtvermögen		
			100,00		

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 9	Verkauf	GBP 8	\$ –
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP –	Verkauf	USD –	–
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 34.501	Verkauf	BRL 175.047	854
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL 5.637	Verkauf	USD 1.095	(12)
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL 169.410	Verkauf	USD 31.439	1.126
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 2.432	Verkauf	EUR 2.437	(18)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 2.127	Verkauf	EUR 2.082	31
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 27.441	Verkauf	USD 28.038	(433)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 102	Verkauf	USD 101	1
10.04.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL 159.460	Verkauf	USD 31.235	(847)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 4.603\$)					\$ 2.012	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.709))\$					(1.310)	
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 2.894\$)					\$ 702	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien — 98,01 % (28. Februar 2022: 99,69 %)					
Getränkeindustrie — 1,29 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
30 Diageo Plc ADR	5.310	1,29	166 Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	6.884	1,67
			345 Warner Bros Discovery Inc	4.560	1,11
				55.362	13,43
Biotechnologie — 14,93 % (28. Februar 2022: 14,56 %)					
57 Biogen Inc	11.144	2,70	Pharma — 1,63 % (28. Februar 2022: 1,04 %)		
88 Guardant Health Inc	4.377	1,06	50 AbbVie Inc	6.734	1,63
223 Ionis Pharmaceuticals Inc	9.491	2,30	Halbleiter — 12,31 % (28. Februar 2022: 11,73 %)		
90 Ultragenyx Pharmaceutical Inc	4.278	1,04	56 Broadcom Inc	27.731	6,73
115 Vertex Pharmaceuticals Inc	32.293	7,83	203 Wolfspeed Inc	23.025	5,58
				50.756	12,31
			Software — 8,75 % (28. Februar 2022: 9,33 %)		
Baustoffe — 2,93 % (28. Februar 2021: 2,69 %)					
223 Johnson Controls International plc	12.078	2,93	93 Autodesk Inc	18.779	4,56
Computer — 7,91 % (28. Februar 2022: 7,53 %)					
80 CrowdStrike Holdings Inc	14.659	3,55	65 DocuSign Inc 'A'	3.757	0,91
189 Seagate Technology Holdings Plc	12.622	3,06	86 Doximity Inc	2.847	0,69
126 Western Digital Corp	5.341	1,30	32 HubSpot Inc	10.690	2,59
				36.073	8,75
			Summe Stammaktien (Kosten 325.195 USD)		
				404.115	98,01
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 0,58 % (28. Februar 2022: 0,50 %)					
33 Cohen & Steers Inc	2.379	0,58	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 325.195\$)		
				404.115	98,01
Elektronik — 6,91 % (28. Februar 2022: 6,74 %)					
226 TE Connectivity Ltd	28.493	6,91	Devisenterminkontrakte — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,02 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)					
				2	–
Unterhaltung — 4,90 % (28. Februar 2022: 4,52 %)					
138 Madison Square Garden Entertainment Corp	7.679	1,86	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
78 Madison Square Garden Sports Corp	12.510	3,04		404.117	98,01
			Devisenterminkontrakte — (0,04 %) (28. Februar 2022: (0,02 %))		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
				(181)	(0,04)
Medizinische Produkte — 1,69 % (28. Februar 2022: 2,03 %)					
27 Insulet Corp	6.972	1,69	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
				(181)	(0,04)
Medizinische Dienstleistungen — 10,09 % (28. Februar 2022: 8,72 %)					
34 Charles River Laboratories International Inc	7.001	1,70	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
67 UnitedHealth Group Inc	34.622	8,39		403.936	97,97
			Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
				8.378	2,03
			Gesamtvermögen		
				412.314\$	100,00
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
ABKÜRZUNGEN:					
ADR – American Depositary Receipt.					
Analyse des Gesamtvermögens					
					% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					97,59
Finanzderivate					–
Sonstige Vermögenswerte					2,41
Gesamtvermögen					100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 2	–
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 45	–
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP –	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 332	1
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 2	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 37	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 40	1
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 25	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 13	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 2	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 52	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 6	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CHF 49	(1)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD 2.282	(22)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK –	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK 208	(1)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 359	(17)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 766	(12)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 1	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CNH 7.840	(26)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD 7.300	(102)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 113\$)				\$ 2
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (123))\$				(181)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (10))\$				\$ (179)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien — 71,47 % (28. Februar 2022: 74,41 %)					
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung — 1,64 % (28. Februar 2022: 1,75 %)					
7 Raytheon Technologies Corp	664	1,64	10 TC Energy Corp	460	1,13
Banken — 2,88 % (28. Februar 2022: 3,47 %)			23 Williams Cos Inc/The	772	1,90
19 Bank of America Corp	640	1,58		4.668	11,50
5 JPMorgan Chase & Co	529	1,30	Private Equity — 1,35 % (28. Februar 2022: 1,72 %)		
	1.169	2,88	6 Blackstone Inc	548	1,35
Getränkindustrie — 1,81 % (28. Februar 2022: 1,71 %)			Halbleiter — 4,54 % (28. Februar 2022: 6,30 %)		
12 Coca-Cola Co/The	733	1,81	– ASML Holding NV	212	0,52
Biotechnologie — 1,27 % (28. Februar 2022: 1,13 %)			11 Intel Corp	359	0,88
2 Amgen Inc	517	1,27	1 NXP Semiconductors NV	194	0,48
Chemische Stoffe — 1,97 % (28. Februar 2022: 2,08 %)			5 QUALCOMM Inc	627	1,54
2 Air Products & Chemicals Inc	403	0,99	2 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	189	0,47
14 Huntsman Corp	396	0,98	2 Texas Instruments Inc	262	0,65
	799	1,97		1.843	4,54
Computer — 4,76 % (28. Februar 2022: 6,60 %)			Software — 9,03 % (28. Februar 2022: 9,22 %)		
12 Apple Inc	1.932	4,76	6 Activision Blizzard Inc	505	1,24
Kosmetik & Körperpflege — 1,49 % (28. Februar 2022: 1,58 %)			8 Microsoft Corp	2.203	5,43
4 Procter & Gamble Co/The	604	1,49	9 Oracle Corp	663	1,63
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 3,29 % (28. Februar 2022: 3,57 %)			2 Paychex Inc	297	0,73
3 Apollo Global Management Inc	179	0,44		3.668	9,03
39 Blue Owl Capital Inc 'A'	434	1,07	Telekommunikation — 2,08 % (28. Februar 2022: 2,88 %)		
1 CME Group Inc	291	0,72	9 Cisco Systems Inc	407	1,00
4 Intercontinental Exchange Inc	431	1,06	11 Verizon Communications Inc	439	1,08
	1.335	3,29		846	2,08
Elektrik — 3,65 % (28. Februar 2022: 3,22 %)			Transport — 0,73 % (28. Februar 2022: 0,74 %)		
4 Brookfield Renewable Corp	157	0,39	2 United Parcel Service Inc 'B'	298	0,73
19 Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP #	711	1,75		29.018	71,47
4 NextEra Energy Inc	353	0,87	Summe Stammaktien (Kosten 21.752 USD)		
2 Semptra Energy	262	0,64	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen — 1,23 % (28. Februar 2022: 1,93 %)		
	1.483	3,65	Airlines — 1,23 % (28. Februar 2022: 1,43 %)		
Elektrische Komponenten und Zubehör — 0,88 % (28. Februar 2022: 0,94 %)			460 American Airlines Group Inc, 6,500 %, fällig 01.07.2025		
4 Emerson Electric Co	357	0,88	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Kosten 493\$)		
Elektronik — 0,77 % (28. Februar 2022: 0,49 %)			500		
2 TE Connectivity Ltd	311	0,77	500		
Energie — Alternative Quellen — 1,03 % (28. Februar 2022: 0,92 %)			Vorzugsaktien — 10,74 % (28. Februar 2022: 13,76 %)		
5 NextEra Energy Partners LP	418	1,03	Autoteile und Ausstattung — 0,94 % (28. Februar 2022: 1,18 %)		
Hand- und Maschinenwerkzeuge — 0,47 % (28. Februar 2022: 1,81 %)			4 Aptiv Plc, Series A		
2 Stanley Black & Decker Inc	193	0,47	Elektrik — 2,73 % (28. Februar 2022: 2,51 %)		
Medizinische Produkte — 1,65 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			10 DTE Energy Co		
2 Danaher Corp	671	1,65	11 NextEra Energy Inc		
Haushaltswaren und -artikel — 0,94 % (28. Februar 2022: 0,90 %)			530		
3 Kimberly-Clark Corp	382	0,94	581		
Versicherung — 1,45 % (28. Februar 2022: 1,32 %)			1.111		
2 Chubb Ltd	306	0,75	Gas — 1,01 % (28. Februar 2022: 0,96 %)		
2 Progressive Corp/The	282	0,70	4 South Jersey Industries Inc		
	588	1,45	147		
Internet — 0,76 % (28. Februar 2022: 0,92 %)			410		
14 NortonLifeLock Inc	310	0,76	1,01		
Investmentgesellschaften — 3,33 % (28. Februar 2022: 3,58 %)			Medizinische Produkte — 0,32 % (28. Februar 2022: 1,88 %)		
9 Ares Capital Corp	170	0,42	1 Boston Scientific Corp, Series A		
29 Barings BDC Inc	286	0,70	Medien — 0,80 % (28. Februar 2022: 1,05 %)		
37 Trinity Capital Inc	548	1,35	9 Paramount Global, Series A		
26 TriplePoint Venture Growth BDC Corp	347	0,86	Private Equity — 2,14 % (28. Februar 2022: 2,41 %)		
	1.351	3,33	14 KKR & Co Inc, Series C		
Maschinen — diversifiziert — 1,28 % (28. Februar 2022: 1,26 %)			Halbleiter — 2,80 % (28. Februar 2022: 3,77 %)		
7 Otis Worldwide Corp	520	1,28	1 Broadcom Inc, Series A		
Öl und Gas — 1,08 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Summe Vorzugsaktien (Kosten 3.834 USD)		
3 Diamondback Energy Inc	440	1,08	4.363		
Pharma — 5,84 % (28. Februar 2022: 5,07 %)			Real Estate Investment Trusts (Immobilienfonds) — 7,84 % (28. Februar 2022: 7,43 %)		
3 Johnson & Johnson	515	1,27	REITS — 7,84 % (28. Februar 2022: 7,43 %)		
10 Merck & Co Inc	870	2,14	4 Alexandria Real Estate Equities Inc		
22 Pfizer Inc	985	2,43	2 American Tower Corp		
	2.370	5,84	6 Apartment Income REIT Corp		
Pipelines — 11,50 % (28. Februar 2022: 11,23 %)			1 Crown Castle Inc		
7 DT Midstream Inc	362	0,89	1 Equinix Inc		
18 Enbridge Inc	747	1,84	3 Equity LifeStyle Properties Inc		
59 Equitrans Midstream Corp	546	1,35	7 Gaming and Leisure Properties Inc		
37 Kinder Morgan Inc	681	1,68	9 Global Medical REIT Inc		
6 ONEOK Inc	352	0,87	2 Prologis Inc		
62 Plains GP Holdings LP 'A'	748	1,84	1 SBA Communications Corp 'A'		
			3 Weyerhaeuser Co		
			104		
			3.182		
			Summe Immobilienfonds (REITs) (Kosten 2.475 USD)		
			3.182		
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 28.554\$)		
			37.063		
			91,28		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Devisenterminkontrakte — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,05 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	–	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	37.063	91,28
Devisenterminkontrakte — (0,15 %) (28. Februar 2022: (0,09 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(62)	(0,15)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(62)	(0,15)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	37.001	91,13
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen	3.603	8,87
Gesamtnettvermögen\$	40.604\$	100,00

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

Master Limited Partnership.

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt.

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	90,81
Sonstige Vermögenswerte	9,19
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	67	Verkauf	AUD	96	\$ –
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	CNH	14	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	46	Verkauf	EUR	45	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	51	Verkauf	SGD	71	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.703	Verkauf	USD	1.235	(15)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.414	Verkauf	USD	1.445	(23)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	455	Verkauf	USD	67	(1)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	1.607	Verkauf	USD	1.123	(23)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	17	Verkauf	USD	13	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 20\$)								–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (38))\$								(62)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (18))\$								\$ (62)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien — 95,17 % (28. Februar 2022: 100,01 %)			Diverse Fertigung — 3,46 % (28. Februar 2022: 3,51 %)		
Bekleidung — 1,29 % (28. Februar 2022: 1,63 %)			207 Eaton Corp Plc 28.285 1,73		
198 Nike Inc 21.097 1,29			184 Trane Technologies Plc 28.273 1,73		
Autoteile und Ausstattung — 0,97 % (28. Februar 2022: 1,33 %)			56.558 3,46		
170 Aptiv Plc 15.910 0,97			Verpackung und Behälter — 1,33 % (28. Februar 2022: 2,10 %)		
Banken — 5,87 % (28. Februar 2022: 6,68 %)			390 Ball Corp 21.783 1,33		
1.088 Bank of America Corp 36.576 2,24			Pharma — 4,19 % (28. Februar 2022: 2,62 %)		
170 First Republic Bank/CA 25.854 1,58			413 CVS Health Corp 40.534 2,48		
392 Morgan Stanley 33.430 2,05			173 Johnson & Johnson 27.833 1,71		
95.860 5,87			68.367 4,19		
Biotechnologie — 3,72 % (28. Februar 2022: 3,26 %)			Einzelhandel — 6,40 % (28. Februar 2022: 6,37 %)		
299 BioMarin Pharmaceutical Inc 26.628 1,63			81 Costco Wholesale Corp 42.284 2,59		
537 Gilead Sciences Inc 34.093 2,09			116 Home Depot Inc/The 33.510 2,05		
60.721 3,72			193 Williams-Sonoma Inc 28.744 1,76		
104.538 6,40			Halbleiter — 2,79 % (28. Februar 2022: 3,87 %)		
Baustoffe — 1,00 % (28. Februar 2021: 1,47 %)			550 Intel Corp 17.557 1,07		
349 Trex Co Inc 16.321 1,00			408 ON Semiconductor Corp 28.068 1,72		
Chemische Stoffe — 1,12 % (28. Februar 2022: 1,19 %)			45.625 2,79		
111 Ecolab Inc 18.222 1,12			Software — 10,13 % (28. Februar 2022: 11,51 %)		
Kommerzielle Dienstleistungen — 1,16 % (28. Februar 2022: 0,97 %)			384 Microsoft Corp 100.270 6,14		
470 Prognvy Inc 18.876 1,16			124 Salesforce Inc 19.422 1,19		
Computer — 5,26 % (28. Februar 2022: 5,47 %)			85 Synopsys Inc 29.233 1,79		
547 Apple Inc 85.959 5,26			101 Workday Inc 'A' 16.562 1,01		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 4,75 % (28. Februar 2022: 5,28 %)			165.487 10,13		
33 BlackRock Inc 21.988 1,34			Telekommunikation — 1,66 % (28. Februar 2022: 1,92 %)		
381 Charles Schwab Corp/The 27.066 1,66			607 Cisco Systems Inc 27.124 1,66		
144 Visa Inc 'A' 28.535 1,75			Spielzeug, Spiele und Hobbys — 1,69 % (28. Februar 2022: 1,92 %)		
77.589 4,75			350 Hasbro Inc 27.554 1,69		
Elektrik — 3,42 % (28. Februar 2022: 3,15 %)			Summe Stammaktien (Kosten 1.648.660 USD)		
730 Brookfield Renewable Corp 28.006 1,72			1.554.197 95,17		
327 NextEra Energy Inc 27.787 1,70			Real Estate Investment Trusts (Immobilienfonds) — 2,69 % (28. Februar 2022: 1,22 %)		
55.793 3,42			REITs — 2,69 % (28. Februar 2022: 1,22 %)		
Elektronik — 3,72 % (28. Februar 2022: 3,84 %)			29 Equinix Inc 19.326 1,18		
175 Keysight Technologies Inc 28.634 1,75			197 Prologis Inc 24.565 1,51		
254 TE Connectivity Ltd 32.094 1,97			43.891 2,69		
60.728 3,72			Summe Immobilienfonds (REITs) (Kosten 43.866 USD)		
Energie — Alternative Quellen — 2,86 % (28. Februar 2022: 2,25 %)			43.891 2,69		
95 Enphase Energy Inc 27.268 1,67			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 1.692.526\$)		
71 SolarEdge Technologies Inc 19.476 1,19			1.598.088 97,86		
46.744 2,86			Devisenterminkontrakte — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,01 %)		
Lebensmittel — 1,84 % (28. Februar 2022: 3,77 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 53 —		
357 McCormick & Co Inc/MD 30.036 1,84			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
Hand- und Maschinenwerkzeuge — 1,98 % (28. Februar 2022: 2,14 %)			1.598.141 97,86		
235 Regal Rexnord Corp 32.310 1,98			Devisenterminkontrakte — (0,20 %) (28. Februar 2022: (0,13 %))		
Medizinische Produkte — 4,99 % (28. Februar 2022: 5,71 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) (3.281) (0,20)		
71 Cooper Cos Inc/The 20.505 1,26			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
117 Danaher Corp 31.525 1,93			(3.281) (0,20)		
54 Thermo Fisher Scientific Inc 29.457 1,80			Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
81.487 4,99			1.594.860 97,66		
Medizinische Dienstleistungen — 3,08 % (28. Februar 2022: 2,93 %)			Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
97 UnitedHealth Group Inc 50.380 3,08			38.171 2,34		
Versicherung — 4,36 % (28. Februar 2022: 3,99 %)			Gesamtneutrovermögen		
492 Hartford Financial Services Group Inc/The 31.646 1,94			1.633.031\$ 100,00		
323 Progressive Corp/The 39.593 2,42					
71.239 4,36					
Internet — 5,97 % (28. Februar 2022: 4,21 %)					
348 Alphabet Inc 'A' 37.675 2,31					
260 Amazon.com Inc 32.919 2,02					
14 Booking Holdings Inc 26.824 1,64					
97.418 5,97					
Unterkunft — 1,87 % (28. Februar 2022: 2,26 %)					
198 Marriott International Inc/MD 30.501 1,87					
Maschinen — Bau und Bergbau — 0,74 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
473 Bloom Energy Corp 'A' 12.031 0,74					
Maschinen — diversifiziert — 1,84 % (28. Februar 2022: 1,51 %)					
82 Deere & Co 30.086 1,84					
Medien — 1,71 % (28. Februar 2022: 3,15 %)					
249 Walt Disney Co/The 27.853 1,71					

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

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,07
Finanzderivate	—
Sonstige Vermögenswerte	2,93
Gesamtvermögen	100,00

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.420	Verkauf	GBP	1.214	\$	5
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	288	Verkauf	USD	336		(2)
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	304	Verkauf	GBP	260		3
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	105	Verkauf	USD	123		(1)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2.191	Verkauf	EUR	2.192		(16)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	35	Verkauf	EUR	35		1
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	4.829	Verkauf	GBP	4.120		42
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	60.698	Verkauf	USD	73.348		(2.812)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	300	Verkauf	USD	300		2
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	28.179	Verkauf	USD	28.798		(450)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 145\$)								\$	53
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (2.099))\$									(3.281)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.954))\$								\$	(3.228)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	26	Verkauf	SGD	37	€	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	570	Verkauf	SGD	800		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	12.596	Verkauf	USD	12.606		60
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	6.139	Verkauf	USD	6.271		(99)
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.176	Verkauf	AUD	2.029		(21)
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.076	Verkauf	AUD	1.574		6
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	3.482	Verkauf	AUD	3.889		(12)
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	2.761	Verkauf	CAD	4.265		(38)
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.408	Verkauf	CAD	3.154		24
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	2.029	Verkauf	CAD	2.642		17
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	839	Verkauf	EUR	841		(6)
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	7.284	Verkauf	EUR	8.595		(185)
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	21.464	Verkauf	EUR	16.390		(161)
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.733	Verkauf	GBP	1.469		38
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.053	Verkauf	GBP	897		11
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	5.610	Verkauf	GBP	3.632		50
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	842	Verkauf	JPY	115.514		15
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	923	Verkauf	JPY	149.483		(5)
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	2.734	Verkauf	JPY	286.476		14
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	12.983	Verkauf	USD	13.113		(43)
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CAD	42.145	Verkauf	USD	32.511		(426)
27.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	14.235	Verkauf	USD	16.970		(422)
10.04.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	43.533	Verkauf	EUR	8.510		(274)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 3.195€)								€	3.351
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (438)€)									(1.936)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 2.757€)								€	1.415

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien — 93,69 % (28. Februar 2022: 95,07 %)			Vorzugsaktien — 2,01 % (28. Februar 2022: 1,57 %)		
Brasilien — 20,13 % (28. Februar 2022: 14,71 %)			Brasilien — 2,01 % (28. Februar 2022: 1,57 %)		
BRL	19	Auren Energia SA	57	2,41	
BRL	40	CCR SA	107	4,51	
BRL	14	CPFL Energia SA	93	3,89	
BRL	44	EcoRodovias Infraestrutur e Logistica SA	50	2,09	
BRL	15	Equatorial Energia SA	69	2,91	
BRL	32	Neoenergia SA	103	4,32	
			479	20,13	
China — 24,74 % (28. Februar 2022: 27,29 %)			Summe Vorzugsaktien (Kosten 50 USD)		
HKD	43	China Longyuan Power Group Corp Ltd	69	2,89	
HKD	31	China Merchants Port Holdings Co Ltd	47	1,99	
HKD	104	China Power International Development Ltd	58	2,43	
HKD	16	China Resources Gas Group Ltd	61	2,57	
HKD	30	China Resources Power Holdings Co Ltd	60	2,53	
HKD	480	China Tower Corp Ltd, 144A	60	2,50	
HKD	3	ENN Energy Holdings Ltd	44	1,86	
HKD	62	Guangdong Investment Ltd	57	2,40	
HKD	37	Jiangsu Expressway Co Ltd	32	1,35	
HKD	37	Shenzhen Expressway Corp Ltd	33	1,38	
HKD	167	Xinyi Energy Holdings Ltd	68	2,84	
			589	24,74	
Indien — 15,55 % (28. Februar 2022: 19,68 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 2.531\$)		
INR	8	Container Corp Of India Ltd	66	2,76	
INR	24	Indraprastha Gas Ltd	125	5,28	
INR	10	Indus Towers Ltd	25	1,03	
INR	28	NTPC Ltd	58	2,44	
INR	34	Power Grid Corp of India Ltd	96	4,04	
			370	15,55	
Indonesien — 5,83 % (28. Februar 2022: 4,32 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
IDR	422	Jasa Marga Persero Tbk PT	98	4,11	
IDR	331	Perusahaan Gas Negara Tbk PT	41	1,72	
			139	5,83	
Malaysia — 4,39 % (28. Februar 2022: 4,65 %)			Devisenterminkontrakte — (0,87 % (28. Februar 2022: (1,14 %))		
MYR	80	Malaysia Airports Holdings Bhd	104	4,39	
Mexiko — 15,46 % (28. Februar 2022: 15,19 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
MXN	27	ALEATICA SAB de CV	21	0,87	
MXN	22	GMexico Transportes SAB de CV, 144A	34	1,45	
MXN	10	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV 'B'	68	2,84	
MXN	9	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	125	5,24	
MXN	4	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	77	3,26	
MXN	43	Operadora De Sites Mexicanos SAB de CV	43	1,80	
			368	15,46	
Nigeria — 1,09 % (28. Februar 2022: 1,13 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
Philippinen — 4,96 % (28. Februar 2022: 7,06 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
PHP	58	Aboitiz Power Corp	32	1,35	
PHP	27	International Container Terminal Services Inc	86	3,61	
			118	4,96	
Thailand — 1,54 % (28. Februar 2022: 1,04 %)			Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
THB	18	Airports of Thailand PCL	37	1,54	
			2.230	93,69	
Summe Stammaktien (Kosten 2.418 USD)			Gesamtvermögen		
			2.380\$ 100,00		

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

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 94.000\$ und machten 3,95 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

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

Analyse des Gesamtvermögens		% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		97,02
Sonstige Vermögenswerte		2,98
Gesamtvermögen		100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	Verkauf	
		EUR	1.302	USD
				1.330 \$ (21)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): –\$)				
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (30)\$)				
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (30)\$)				
				\$ (21)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien — 89,74 % (28. Februar 2022: 90,89 %)		
Australien — 9,17 % (28. Februar 2022: 9,51 %)		
AUD 1.929 APA Group	14.536	3,51
AUD 1.554 Atlas Arteria Ltd	8.450	2,04
AUD 1.577 Transurban Group	14.966	3,62
	37.952	9,17
Brasilien — 6,41 % (28. Februar 2022: 3,30 %)		
BRL 2.976 CCR SA	7.900	1,91
BRL 1.681 CPFL Energia SA	11.300	2,73
BRL 940 Engie Brasil Energia SA	7.325	1,77
	26.525	6,41
Kanada — 14,78 % (28. Februar 2022: 13,00 %)		
CAD 356 Emera Inc	16.466	3,98
CAD 453 Enbridge Inc	18.714	4,52
CAD 476 Gibson Energy Inc	9.001	2,17
CAD 381 Pembina Pipeline Corp	13.434	3,24
CAD 75 TC Energy Corp	3.606	0,87
	61.221	14,78
Frankreich — 3,98 % (28. Februar 2022: 4,86 %)		
EUR 526 Getlink SE	9.881	2,38
EUR 72 Vinci SA	6.615	1,60
	16.496	3,98
Italien — 4,79 % (28. Februar 2022: 4,00 %)		
EUR 1.126 Italgas SpA	5.790	1,40
EUR 2.956 Snam SpA	14.048	3,39
	19.838	4,79
Portugal — 4,21 % (28. Februar 2022: 2,59 %)		
EUR 3.654 EDP — Energias de Portugal SA	17.449	4,21
Spanien — 13,47 % (28. Februar 2022: 13,05 %)		
EUR 55 Aena SME SA, 144A	6.742	1,63
EUR 631 Enagas SA	11.530	2,79
EUR 402 Ferrovial SA	10.075	2,43
EUR 1.928 Iberdrola SA	20.073	4,85
EUR 402 Red Electrica Corp SA	7.343	1,77
	55.763	13,47
Vereinigtes Königreich — 10,64 % (28. Februar 2022: 11,53 %)		
GBP 1.339 National Grid Plc	16.679	4,03
GBP 783 SSE Plc	14.998	3,62
GBP 1.009 United Utilities Group Plc	12.363	2,99
	44.040	10,64
USA — 22,29 % (28. Februar 2022: 25,48 %)		
282 Brookfield Renewable Corp	10.825	2,62
331 Cleanway Energy Inc 'C'	12.274	2,96
124 Entergy Corp	14.340	3,46
211 NextEra Energy Partners LP	17.356	4,19
303 OGE Energy Corp	12.284	2,97
290 Public Service Enterprise Group Inc	18.689	4,51

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
192 Williams Cos Inc/The	6.525	1,58
	92.293	22,29
Summe Stammaktien (Kosten 387.924 USD)		
	371.577	89,74
Real Estate Investment Trusts (Immobilienfonds) — 3,44 % (28. Februar 2022: 3,77 %)		
USA — 3,44 % (28. Februar 2022: 2,80 %)		
83 Crown Castle Inc	14.244	3,44
Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 15.272 USD)		
	14.244	3,44
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 403.196\$)		
	385.821	93,18
Devisenterminkontrakte — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,05 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	13	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	385.834	93,18
Devisenterminkontrakte — (0,34 %) (28. Februar 2022: (0,19 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	(1.405)	(0,34)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	(1.405)	(0,34)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	384.429	92,84
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
	29.644	7,16
Gesamtvermögen		
	414.073\$	100,00

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

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 6.742.000\$ und machten 1,63 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

- AUD – Australischer Dollar
- BRL – Brasilianischer Real
- CAD – Kanadischer Dollar
- EUR – Euro
- GBP – Britisches Pfund Sterling

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,04
Finanzderivate	–
Sonstige Vermögenswerte	7,96
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	USD –	–	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 295	Verkauf AUD 430	1
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 26	Verkauf CNH 183	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 526	Verkauf EUR 524	(1)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 4	Verkauf EUR 4	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 127	Verkauf GBP 109	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 655	Verkauf SGD 906	6
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 2.487	Verkauf SGD 3.478	(3)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD 3.155	Verkauf USD 2.257	1
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD 91.841	Verkauf USD 66.610	(884)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 9.603	Verkauf USD 9.814	(154)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CNH 5.929	Verkauf USD 877	(19)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD 13.683	Verkauf USD 9.557	(190)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 3.500	Verkauf USD 4.220	(154)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 639	Verkauf USD 638	5
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 82\$)				\$ 13	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (332)\$)				(1.405)	
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (250)\$)				\$ (1.392)	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen — 4,05 % (28. Februar 2022: 4,57 %)					
26.649	Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	4,05	2.624	TrueBlue Inc	0,40
			23.839		3,62
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 26.649\$)					
	26.649	4,05	Computer — 1,23 % (28. Februar 2022: 0,62 %)		
Stammaktien — 94,56 % (28. Februar 2022: 95,20 %)					
Werbung — 0,47 % (28. Februar 2022: 0,09 %)					
527	Entravision Communications Corp	0,41	469	Conduent Inc	0,29
233	Marin Software Inc	0,06	219	SecureWorks Corp	0,34
			75	TTEC Holdings Inc	0,60
	3.112	0,47			8.101
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung — 4,78 % (28. Februar 2022: 4,91 %)					
109	AAR Corp	0,71	Kosmetik & Körperpflege — 0,25 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
80	Aerojet Rocketdyne Holdings Inc	0,52	21	Inter Parfums Inc	0,25
397	Astronics Corp	0,56	Distribution und Großhandel — 4,07 % (28. Februar 2022: 3,50 %)		
115	Barnes Group Inc	0,54	366	Hudson Technologies Inc	0,46
105	Ducommun Inc	0,71	101	IAA Inc	0,57
77	Hexcel Corp	0,69	14	KAR Auction Services Inc	0,03
96	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	0,44	473	Manitex International Inc	0,39
308	Triumph Group Inc	0,61	170	Resideo Technologies Inc	0,54
			144	Univar Solutions Inc	0,55
	31.436	4,78	120	VSE Corp	0,77
			38	WESCO International Inc	0,76
					26.767
					4,07
Airlines — 0,90 % (28. Februar 2022: 1,43 %)			Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 1,92 % (28. Februar 2022: 1,48 %)		
48	Alaska Air Group Inc	0,32	114	Air Lease Corp 'A'	0,63
24	Allegiant Travel Co	0,35	102	B. Riley Financial Inc	0,77
613	Mesa Air Group Inc	0,23	218	Canaccord Genuity Group Inc	0,20
			50	Moelis & Co 'A'	0,32
	5.919	0,90			12.613
					1,92
Bekleidung — 0,80 % (28. Februar 2022: 1,44 %)			Elektrische Komponenten und Zubehör — 0,72 % (28. Februar 2022: 0,32 %)		
55	Fossil Group Inc	0,04	124	American Superconductor Corp	0,10
94	Rocky Brands Inc	0,37	44	Insteel Industries Inc	0,19
68	Skechers USA Inc	0,39	227	nLight Inc	0,43
		0,80			4.765
					0,72
Automobilhersteller — 0,76 % (28. Februar 2022: 0,64 %)			Elektronik — 5,35 % (28. Februar 2022: 5,13 %)		
304	Wabash National Corp	0,76	57	Advanced Energy Industries Inc	0,77
			52	Avnet Inc	0,35
			135	Benchmark Electronics Inc	0,56
			257	Comtech Telecommunications Corp	0,44
			112	CTS Corp	0,72
			262	GoPro Inc 'A'	0,24
			136	Identiv Inc	0,31
			215	Knowlps Corp	0,50
			259	Stoneridge Inc	0,75
			153	Vishay Intertechnology Inc	0,46
			48	Vishay Precision Group Inc	0,25
					35.169
					5,35
Autoteile und Ausstattung — 2,61 % (28. Februar 2022: 3,05 %)			Energie — Alternative Quellen — 0,37 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
62	Adient Plc	0,31	131	TPI Composites Inc	0,37
478	Commercial Vehicle Group Inc	0,48	Engineering & Bauwesen — 3,62 % (28. Februar 2022: 2,83 %)		
205	Dana Inc	0,48	64	Arcosa Inc	0,57
416	Garrett Motion Inc	0,43	17	Comfort Systems USA Inc	0,26
191	Goodyear Tire & Rubber Co/The	0,41	462	Concrete Pumping Holdings Inc	0,47
137	Shyft Group Inc/The	0,50	169	Construction Partners Inc 'A'	0,75
			379	Limbach Holdings Inc	0,46
	17.161	2,61	412	Mistras Group Inc	0,35
			509	Orion Group Holdings Inc	0,25
			165	Primoris Services Corp	0,51
					23.791
					3,62
Banken — 2,09 % (28. Februar 2022: 2,27 %)			Umweltkontrolle — 0,67 % (28. Februar 2022: 0,48 %)		
135	BayCom Corp	0,38	134	Heritage-Crystal Clean Inc	0,67
88	First Bancshares Inc/The	0,40	Lebensmittel — 1,29 % (28. Februar 2022: 0,80 %)		
97	First Foundation Inc	0,28	37	Calavo Growers Inc	0,23
111	Hilltop Holdings Inc	0,44	242	Healthcare Services Group Inc	0,52
121	Seacoast Banking Corp of Florida	0,59	142	Krispy Kreme Inc	0,25
			190	SunOpta Inc	0,29
	13.777	2,09			8.504
					1,29
Biotechnologie — 0,29 % (28. Februar 2022: 0,27 %)			Forstprodukte und Papier — 0,13 % (28. Februar 2022: 0,43 %)		
188	NeoGenomics Inc	0,29	177	Glatfelter Corp	0,13
			Hand- und Maschinenwerkzeuge — 0,68 % (28. Februar 2022: 0,61 %)		
Baustoffe — 3,18 % (28. Februar 2021: 2,09 %)					
30	Apogee Enterprises Inc	0,19	20	Hurco Cos Inc	0,08
72	Gibraltar Industries Inc	0,46	241	Luxfer Holdings Plc	0,60
156	Griffon Corp	0,74			4.453
103	JELD-WEN Holding Inc	0,17	Medizinische Produkte — 2,32 % (28. Februar 2022: 1,26 %)		
381	Modine Manufacturing Co	0,87	872	Accuray Inc	0,32
85	PGT Innovations Inc	0,27	106	Apyx Medical Corp	0,09
111	Summit Materials Inc 'A'	0,48	194	Artivion Inc	0,66
	20.920	3,18			
Chemische Stoffe — 1,35 % (28. Februar 2022: 2,35 %)					
120	Huntsman Corp	0,51			
183	Tronox Holdings Plc	0,41			
250	Unifi Inc	0,43			
		1,35			
	8.889	1,35			
Kommerzielle Dienstleistungen — 3,62 % (28. Februar 2022: 3,39 %)					
91	Aaron's Co Inc/The	0,16			
35	Adtalem Global Education Inc	0,20			
157	American Public Education Inc	0,25			
265	Arlo Technologies Inc	0,24			
141	Cross Country Healthcare Inc	0,54			
102	Evercel Inc	0,02			
33	Herc Holdings Inc	0,56			
68	Korn Ferry	0,63			
143	Resources Connection Inc	0,43			
58	Sterling Check Corp	0,19			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien — (Fortsetzung)			Metallherstellung und -elemente — 1,48 % (28. Februar 2022: 1,84 %)		
Healthcare-Products — (Fortsetzung)			158 Northwest Pipe Co	5.023	0,76
316 Bioventus Inc	2.316	0,35	63 Olympic Steel Inc	1.668	0,25
135 MilMedx Group Inc	475	0,07	200 TimkenSteel Corp	3.066	0,47
52 Orthofix Medical Inc	1.031	0,16		9.757	1,48
128 Tactile Systems Technology Inc	1.060	0,16	Bergbau — 1,86 % (28. Februar 2022: 2,28 %)		
160 Varex Imaging Corp	3.372	0,51	150 Century Aluminum Co	1.158	0,18
	15.243	2,32	171 Coeur Mining Inc	472	0,07
Medizinische Dienstleistungen — 1,06 % (28. Februar 2022: 0,97 %)			644 Ferroglobe Plc	4.512	0,68
483 ATI Physical Therapy Inc	437	0,07	115 Livent Corp	3.690	0,56
290 Community Health Systems Inc	773	0,12	CAD 355 Major Drilling Group International Inc	2.418	0,37
41 Innovage Holding Corp	151	0,02		12.250	1,86
142 RadNet Inc	2.855	0,43	Diverse Fertigung — 2,59 % (28. Februar 2022: 3,11 %)		
106 Select Medical Holdings Corp	2.724	0,42	47 EnPro Industries Inc	4.241	0,64
	6.940	1,06	38 Fabrinet	3.934	0,60
Bauunternehmen — 2,58 % (28. Februar 2022: 2,73 %)			126 Haynes International Inc	5.030	0,77
107 Beazer Homes USA Inc	1.526	0,23	158 Trinity Industries Inc	3.841	0,58
11 Cavco Industries Inc	2.466	0,38		17.046	2,59
32 Century Communities Inc	1.504	0,23	Büro- und Geschäftsausstattung — 0,02 % (28. Februar 2022: 0,42 %)		
644 Horizon Global Corp	960	0,15	39 Pitney Bowes Inc	112	0,02
28 M/I Homes Inc	1.211	0,18	Büroeinrichtung — 0,81 % (28. Februar 2022: 0,84 %)		
69 Skyline Champion Corp	3.935	0,60	213 Interface Inc 'A'	2.383	0,36
95 Taylor Morrison Home Corp 'A'	2.395	0,36	261 Steelcase Inc	2.912	0,45
32 Toll Brothers Inc	1.392	0,21		5.295	0,81
93 Tri Pointe Homes Inc	1.607	0,24	Öl und Gas — 3,37 % (28. Februar 2022: 2,84 %)		
	16.996	2,58	367 Baytex Energy Corp	1.903	0,29
Einrichtungsgegenstände — 0,54 % (28. Februar 2022: 0,99 %)			47 Chesapeake Energy Corp	4.701	0,71
103 MillerKnoll Inc	2.851	0,43	255 Earthstone Energy Inc 'A'	3.874	0,59
397 VIA Optronics AG ADR	701	0,11	455 Mammoth Energy Services Inc	1.889	0,29
	3.552	0,54	75 Matador Resources Co	4.476	0,68
Haushaltswaren und -artikel — 0,62 % (28. Februar 2022: 0,77 %)			89 Northern Oil and Gas Inc	2.801	0,43
17 Central Garden & Pet Co 'A'	631	0,10	337 Southwestern Energy Co	2.528	0,38
55 Spectrum Brands Holdings Inc	3.433	0,52		22.172	3,37
	4.064	0,62	Öl- und Gasdienstleistungen — 1,70 % (28. Februar 2022: 0,99 %)		
Versicherung — 0,41 % (28. Februar 2022: 1,24 %)			276 Archrock Inc	2.045	0,31
57 Brighthouse Financial Inc	2.693	0,41	121 DMC Global Inc	2.698	0,41
Internet — 2,39 % (28. Februar 2022: 1,82 %)			415 Matrix Service Co	2.363	0,36
139 Cars.com Inc	1.776	0,27	213 MRC Global Inc	2.066	0,31
738 comScore Inc	1.613	0,25	55 NOW Inc	672	0,10
348 DHI Group Inc	1.776	0,27	137 Ranger Energy Services Inc	1.354	0,21
341 Edgio Inc	1.252	0,19		11.198	1,70
140 EverQuote Inc	1.213	0,18	Verpackung und Behälter — 0,49 % (28. Februar 2022: 0,50 %)		
6 IAC Inc	405	0,06	118 TriMas Corp	3.239	0,49
240 LifeMD Inc	614	0,09	Pharma — 1,03 % (28. Februar 2022: 1,65 %)		
154 Magnite Inc	1.154	0,18	109 Option Care Health Inc	3.378	0,51
47 Overstock.com Inc	1.232	0,19	120 Organon & Co	3.411	0,52
391 QuinStreet Inc	4.700	0,71		6.789	1,03
	15.735	2,39	Immobilien — 0,16 % (28. Februar 2022: 0,43 %)		
Eisen/Stahl — 2,47 % (28. Februar 2022: 2,81 %)			104 Anywhere Real Estate Inc	1.018	0,16
177 ATI Inc	5.300	0,81	Einzelhandel — 7,35 % (28. Februar 2022: 8,23 %)		
121 Carpenter Technology Corp	4.109	0,62	25 Asbury Automotive Group Inc	4.401	0,67
167 Cleveland-Cliffs Inc	2.882	0,44	321 Barnes & Noble Education Inc	817	0,12
98 Commercial Metals Co	3.965	0,60	38 BlueLinx Holdings Inc	2.692	0,41
	16.256	2,47	160 Caleres Inc	4.096	0,62
Unterkunft — 0,56 % (28. Februar 2022: 0,61 %)			504 Carrrols Restaurant Group Inc	1.111	0,17
154 Century Casinos Inc	1.134	0,17	309 Chico's FAS Inc	1.753	0,27
158 Marcus Corp/The	2.540	0,39	247 Designer Brands Inc	4.210	0,64
	3.674	0,56	13 Dillard's Inc	3.937	0,60
Maschinen — Bau und Bergbau — 1,29 % (28. Februar 2022: 0,65 %)			585 Express Inc	886	0,13
671 Babcock & Wilcox Enterprises Inc	5.358	0,81	25 Franchise Group Inc	861	0,13
61 BWX Technologies Inc	3.158	0,48	67 Guess? Inc	1.167	0,18
	8.516	1,29	334 iMedia Brands Inc	336	0,05
Maschinen — diversifiziert — 1,84 % (28. Februar 2022: 1,67 %)			150 J Jill Inc	2.411	0,37
116 CIRCOR International Inc	1.892	0,29	322 JOANN Inc	2.282	0,35
151 Ichor Holdings Ltd	4.633	0,70	20 LL Flooring Holdings Inc	163	0,02
453 Intevac Inc	2.249	0,34	426 Noodles & Co 'A'	2.022	0,31
721 NN Inc	1.544	0,24	134 Nordstrom Inc	2.296	0,35
193 Power Solutions International Inc	387	0,06	180 Ruth's Hospitality Group Inc	3.284	0,50
153 Twin Disc Inc	1.406	0,21	75 Sonic Automotive Inc 'A'	3.966	0,60
	12.111	1,84	192 Sportsman's Warehouse Holdings Inc	1.530	0,23
Medien — 0,53 % (28. Februar 2022: 1,23 %)			258 Vera Bradley Inc	1.023	0,16
135 Thryv Holdings Inc	3.451	0,53	93 Victoria's Secret & Co	3.118	0,47
				48.362	7,35

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien — (Fortsetzung)			Real Estate Investment Trusts (Immobilienfonds) — 1,72 % (28. Februar 2022: 2,12 %)		
Sparguthaben und Kredite — 0,51 % (28. Februar 2022: 0,52 %)			REITs — 1,72 % (28. Februar 2022: 2,12 %)		
81 Axos Financial Inc	3.363	0,51	129 Alexander & Baldwin Inc	2.415	0,37
Halbleiter — 5,07 % (28. Februar 2022: 5,12 %)			242 Braemar Hotels & Resorts Inc	1.248	0,19
78 Alpha & Omega Semiconductor Ltd	3.028	0,46	107 Chatham Lodging Trust	1.301	0,20
210 Amkor Technology Inc	4.236	0,64	280 Macerich Co/The	2.680	0,41
323 Amtech Systems Inc	3.583	0,54	14 Ryman Hospitality Properties Inc	1.125	0,17
167 Cohu Inc	4.491	0,68	165 Tanger Factory Outlet Centers Inc	2.543	0,38
105 FormFactor Inc	3.065	0,47		11.312	1,72
70 Kulicke & Soffa Industries Inc	2.928	0,45	Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 12.808 USD)	11.312	1,72
43 Onto Innovation Inc	3.089	0,47	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 727.495\$)	660.017	100,33
139 Ultra Clean Holdings Inc	4.070	0,62	Devisenterminkontrakte — 0,11 % (28. Februar 2022: 0,16 %)		
229 Veeco Instruments Inc	4.843	0,74	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	707	0,11
	33.333	5,07	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	660.724	100,44
Software — 2,07 % (28. Februar 2022: 2,90 %)			Devisenterminkontrakte — (0,19 %) (28. Februar 2022: (0,20 %))		
86 ACV Auctions Inc	728	0,11	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	(1.256)	(0,19)
106 Avid Technology Inc	2.889	0,44	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(1.256)	(0,19)
163 Digi International Inc	5.404	0,82	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	659.468	100,25
69 HireRight Holdings Corp	1.113	0,17	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	(1.628)	(0,25)
349 Immersion Corp	2.074	0,32	Gesamtnettovermögen	657.840\$	100,00
138 ON24 Inc	1.234	0,19			
611 Zovio Inc 'A'	162	0,02			
	13.604	2,07			
Telekommunikation — 4,53 % (28. Februar 2022: 5,02 %)					
221 A10 Networks Inc	3.067	0,47			
221 ADTRAN Holdings Inc	5.119	0,78			
103 Aviat Networks Inc	3.227	0,49			
472 CalAmp Corp	2.917	0,44			
135 Cambium Networks Corp	2.625	0,40			
307 DZS Inc	4.084	0,62			
145 Frequency Electronics Inc	944	0,14			
389 Infinera Corp	2.125	0,32			
201 Ooma Inc	2.423	0,37			
540 PCTEL Inc	2.942	0,45			
81 Terran Orbital Corp	339	0,05			
	29.812	4,53			
Textilstoffe — 0,02 % (28. Februar 2022: 0,13 %)					
137 Dixie Group Inc/The	155	0,02			
Transport — 3,74 % (28. Februar 2022: 3,50 %)					
355 Ardmore Shipping Corp	3.425	0,52			
18 Atlas Air Worldwide Holdings Inc	1.834	0,28			
363 Daseke Inc	2.194	0,33			
307 Diana Shipping Inc	1.482	0,23			
262 Dorian LPG Ltd	3.812	0,58			
38 Hub Group Inc 'A'	3.020	0,46			
273 Navigator Holdings Ltd	3.293	0,50			
347 Radiant Logistics Inc	2.430	0,37			
75 Scorpio Tankers Inc	3.106	0,47			
	24.596	3,74			
Summe Stammaktien (Kosten 688.038 USD)	622.056	94,56			

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

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt.
CAD – Kanadischer Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,28
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,01
Finanzderivate	0,11
Sonstige Vermögenswerte	0,60
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 15	Verkauf	GBP 14	\$ –
09.01.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 242	Verkauf	USD 282	(2)
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 11.398	Verkauf	BRL 57.831	283
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	USD –	Verkauf	GBP –	–
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL 4.241	Verkauf	USD 825	(10)
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL 53.590	Verkauf	USD 9.935	367
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD 33	Verkauf	USD 23	–
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 1	Verkauf	USD 1	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 908	Verkauf	AUD 1.314	9
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 95	Verkauf	CNH 660	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 90	Verkauf	CNH 619	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 1.436	Verkauf	EUR 1.439	(10)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 1.784	Verkauf	EUR 1.737	36
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 31	Verkauf	GBP 26	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 118	Verkauf	PLN 568	(3)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 324	Verkauf	PLN 1.500	5
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 57	Verkauf	SEK 606	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 51	Verkauf	SEK 529	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte — (Fortsetzung)

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	550	Verkauf	SGD	759	\$ 7
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	1.752	Verkauf	SGD	2.448	(1)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	2.396	Verkauf	USD	235	(12)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	–	Verkauf	USD	–	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	16.023	Verkauf	USD	3.467	(67)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	36	Verkauf	USD	25	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	9.018	Verkauf	USD	6.303	(130)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	19.511	Verkauf	USD	19.946	(316)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	15.738	Verkauf	USD	2.329	(51)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	11	Verkauf	USD	11	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	35.879	Verkauf	USD	26.031	(353)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP	386	Verkauf	USD	467	(18)
10.04.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL	53.220	Verkauf	USD	10.425	(283)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1.468\$)							\$	707
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.791)\$)								(1.256)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (323)\$)							\$	(549)

Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen — 3,85 % (28. Februar 2022: 3,45 %)			Maschinen — diversifiziert — 5,78 % (28. Februar 2022: 3,41 %)		
10 iShares Russell 2000 Value ETF — ETF	1.446	1,92	33 Enovis Corp	1.694	2,25
1.456 Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.456	1,93	25 Esab Corp	1.045	1,38
			9 Kadant Inc	1.619	2,15
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 2.8675)	2.902	3,85		4.358	5,78
Stammaktien — 96,64 % (28. Februar 2022: 97,15 %)			Metallherstellung und -elemente — 0,61 % (28. Februar 2022: 0,53 %)		
Bekleidung — 2,52 % (28. Februar 2022: 1,62 %)			Diverse Fertigung — 5,18 % (28. Februar 2022: 4,62 %)		
10 Carter's Inc	746	0,99	15 Northwest Pipe Co	460	0,61
59 Wolverine World Wide Inc	1.152	1,53	25 ESCO Technologies Inc	2.036	2,70
	1.898	2,52	18 John Bean Technologies Corp	1.869	2,48
				3.905	5,18
Autoteile und Ausstattung — 3,58 % (28. Februar 2022: 4,77 %)			Öl- und Gasdienstleistungen — 1,31 % (28. Februar 2022: 1,92 %)		
44 Gentex Corp	1.205	1,60	CAD 93 Pason Systems Inc	985	1,31
63 Miller Industries Inc/TN	1.489	1,98			
	2.694	3,58	Verpackung und Behälter — 0,70 % (28. Februar 2022: 0,56 %)		
Baustoffe — 2,60 % (28. Februar 2022: 4,76 %)			Pharma — 4,29 % (28. Februar 2022: 3,26 %)		
13 Gibraltar Industries Inc	555	0,74	6 UFP Technologies Inc	529	0,70
26 Louisiana-Pacific Corp	1.405	1,86	83 Catalyst Pharmaceuticals Inc	1.127	1,50
	1.960	2,60	21 Harmony Biosciences Holdings Inc	933	1,24
Chemische Stoffe — 3,33 % (28. Februar 2022: 3,30 %)			Immobilien — 3,83 % (28. Februar 2022: 3,72 %)		
21 Innospec Inc	1.923	2,55	123 Kennedy-Wilson Holdings Inc	2.156	2,86
3 Quaker Chemical Corp	587	0,78	20 Marcus & Millichap Inc	734	0,97
	2.510	3,33		2.890	3,83
Kommerzielle Dienstleistungen — 6,45 % (28. Februar 2022: 9,47 %)			Einzelhandel — 1,94 % (28. Februar 2022: 1,67 %)		
125 Computer Task Group Inc	982	1,30	27 Movado Group Inc	862	1,14
41 Forrester Research Inc	1.724	2,29	11 Patrick Industries Inc	601	0,80
4 Heidrick & Struggles International Inc	115	0,15		1.463	1,94
33 Korn Ferry	2.041	2,71	Halbleiter — 9,42 % (28. Februar 2022: 10,20 %)		
	4.862	6,45	60 Cohu Inc	1.602	2,12
Kosmetik & Körperpflege — 2,36 % (28. Februar 2022: 2,01 %)			Software — 7,51 % (28. Februar 2022: 6,42 %)		
23 Inter Parfums Inc	1.777	2,36	29 FormFactor Inc	849	1,12
Distribution und Großhandel — 2,90 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Transport — 3,54 % (28. Februar 2022: 2,01 %)		
92 Hudson Technologies Inc	760	1,01	12 Forward Air Corp	1.116	1,48
38 IAA Inc	1.423	1,89	11 Landstar System Inc	1.550	2,06
	2.183	2,90		2.666	3,54
Diversifizierte Finanzdienstleistungen — 5,93 % (28. Februar 2022: 5,50 %)			Summe Stammaktien (Kosten 76.714 USD)		
51 Air Lease Corp 'A'	1.868	2,48		72.838	96,64
37 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	1.244	1,65	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 79.5815)		
11 Houlihan Lokey Inc 'A'	858	1,14		75.740	100,49
14 Lazard Ltd 'A'	500	0,66	Devisenterminkontrakte — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
	4.470	5,93	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
Elektronik — 5,11 % (28. Februar 2022: 5,29 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
37 FARO Technologies Inc	1.233	1,64		75.740	100,49
57 Kimball Electronics Inc	1.216	1,61	Devisenterminkontrakte — (0,01 %) (28. Februar 2022: 0,00 %)		
41 Vishay Precision Group Inc	1.405	1,86	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	3.854	5,11		(6)	(0,01)
Engineering & Bauwesen — 2,63 % (28. Februar 2022: 3,64 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
34 Arcosa Inc	1.985	2,63		(6)	(0,01)
Umweltkontrolle — 0,92 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
21 Heritage-Crystal Clean Inc	694	0,92		75.734	100,48
Medizinische Produkte — 1,84 % (28. Februar 2022: 4,64 %)			Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
4 Bio-Techne Corp	1.388	1,84		(364)	(0,48)
Bauunternehmen — 2,52 % (28. Februar 2022: 1,60 %)			Gesamtnettovermögen		
4 LCI Industries	470	0,62		75.370\$	100,00
25 Skyline Champion Corp	1.429	1,90			
	1.899	2,52			
Versicherung — 5,10 % (28. Februar 2022: 4,13 %)					
15 RLI Corp	1.679	2,23			
2 White Mountains Insurance Group Ltd	2.162	2,87			
	3.841	5,10			
Internet — 0,57 % (28. Februar 2022: 1,67 %)					
29 ChannelAdvisor Corp	432	0,57			
Freizeit — 2,37 % (28. Februar 2022: 2,40 %)					
14 Brunswick Corp/DE	1.038	1,38			
31 MasterCraft Boat Holdings Inc	748	0,99			
	1.786	2,37			
Unterkunft — 1,80 % (28. Februar 2022: 2,40 %)					
184 Century Casinos Inc	1.355	1,80			

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

ABKÜRZUNGEN:

ETF – Börsengehandelter Fonds (Exchange Traded Fund)

CAD – Kanadischer Dollar

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,92
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,82
Sonstige Vermögenswerte	0,26
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)		Währungsverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	11	Verkauf	EUR	11 \$ –
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	38	Verkauf	SEK	403 –
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	34	Verkauf	SEK	358 –
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SEK	779	Verkauf	USD	77 (3)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR	155	Verkauf	USD	158 (3)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1\$)							–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (5)\$)							(6)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (4)\$)							\$ (6)

Royce Global Small Cap Premier Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen — 2,45 % (28. Februar 2022: 3,09 %)					
97	Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	2,45	63	Colliers International Group Inc	1,58
Summe kollektive Kapitalanlagen (Kosten 97\$)					
97		2,45	71	Dorman Products Inc	1,78
Stammaktien — 97,84 % (28. Februar 2022: 97,25 %)					
Australien — 4,17 % (28. Februar 2022: 6,94 %)					
AUD	22 Hansen Technologies Ltd	1,82	30	Esab Corp	0,74
AUD	14 IPH Ltd	2,35	40	ESCO Technologies Inc	1,01
			61	FirstService Corporation	1,52
		166	65	FormFactor Inc	1,62
			73	Forrester Research Inc	1,84
			78	Forward Air Corp	1,97
			53	Gentex Corp	1,34
			87	Haemonetics Corp	2,17
			29	Houlihan Lokey Inc 'A'	0,73
			53	IAA Inc	1,34
			90	Innospec Inc	2,25
			61	Inter Parfums Inc	1,53
			67	John Bean Technologies Corp	1,67
			69	Kadant Inc	1,74
			75	Kennedy-Wilson Holdings Inc	1,89
			60	Landstar System Inc	1,50
			29	LCI Industries	0,74
			58	Lincoln Electric Holdings Inc	1,45
			35	Littelfuse Inc	0,88
			31	LKQ Corp	0,79
			32	Marcus & Millichap Inc	0,79
			80	MKS Instruments Inc	2,01
			63	Quaker Chemical Corp	1,58
			67	Ralph Lauren Corp 'A'	1,69
			68	SEI Investments Co	1,71
			39	UFP Industries Inc	0,99
			73	Valmont Industries Inc	1,82
			72	Ziff Davis Inc	1,80
			2.007		50,38
			3.899		97,84
			Summe Stammaktien (Kosten 4.816 USD)		
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		3.996 100,29
			Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		3.996 100,29
			Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		(12) (0,29)
			Gesamtvermögen		3.984\$ 100,00
			<p>– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.</p> <p>144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 190.000\$ und machten 4,77 % des Nettovermögens aus.</p>		
			ABKÜRZUNGEN:		
			AUD	– Australischer Dollar	
			BRL	– Brasilianischer Real	
			CAD	– Kanadischer Dollar	
			CHF	– Schweizer Franken	
			EUR	– Euro	
			GBP	– Britisches Pfund Sterling	
			JPY	– Japanischer Yen	
			KRW	– Südkoreanischer Won	
			PLN	– Polnischer Zloty	
			SEK	– Schwedische Kronen	
			Analyse des Gesamtvermögens		% des Gesamtvermögens
			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		97,28
			Organismen für gemeinsame Anlagen		2,42
			Sonstige Vermögenswerte		0,30
			Gesamtvermögen		100,00
			Vereinigtes Königreich — 11,89 % (28. Februar 2022: 10,02 %)		
GBP	1 Croda International Plc	1,05	42		
GBP	2 Diploma Plc	1,31	52		
GBP	7 DiscoverIE Group Plc	1,56	62		
GBP	1 Intertek Group Plc	0,97	39		
GBP	33 Learning Technologies Group Plc	1,09	44		
GBP	5 Marlowe Plc	1,01	41		
GBP	17 Restore Plc	2,19	87		
GBP	– Spirax-Sarco Engineering Plc	1,52	60		
GBP	2 Victrex Plc	1,19	47		
		474			11,89
			USA — 50,38 % (28. Februar 2022: 48,79 %)		
			55	Arcosa Inc	1,39
			74	Avid Technology Inc	1,86
			67	Brunswick Corp/DE	1,69
			39	Cognex Corp	0,97

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^μ

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR
Stammaktien — 0,00 % (28. Februar 2022: 97,09 %)	
Russia — 0,00 % (28 February 2022: 0,45 %)	
GBP 54 Evraz Plc †	–
Summe Stammaktien (Kosten 313 EUR)	–
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	–
Gesamtvermögen	€ –

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

† Nicht liquide.

μ Mit Wirkung zum 11. Juli 2022 stellte der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^μ den Handel ein.

ABKÜRZUNGEN:

GBP – Britisches Pfund Sterling

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

^μ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	67	Verkauf	AUD	96	\$	2
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	50	Verkauf	USD	36		(1)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	PLN	62	Verkauf	USD	13		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	1.234	Verkauf	USD	183		(4)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	3.646	Verkauf	USD	2.546		(51)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 34\$)								\$	2
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (139)\$)									(56)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (105)\$)								\$	(54)

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^]F

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD
Stammaktien — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)	
Griechenland — 0,00 % (28. February 2022: 0,00 %)	
EUR 1 FF Group †	–
Hong Kong — 0,00 % (28 February 2022: 0,00 %)	
HKD 38 Hanergy Mobile Energy Holding Group Co Ltd †	–
Summe Stammaktien (Kosten 44 USD)	–
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	–
Gesamtvermögen	\$–

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

† Nicht liquide.

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

ABKÜRZUNGEN:

EUR – Euro

HKD – Hongkong-Dollar

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^α

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD
Stammaktien — 0,00 % (28. Februar 2022: 90,46 %)	
Russia — 0,00 % (28 February 2022: 0,16 %)	
8 Gazprom PJSC ADR †	–
Summe Stammaktien (Kosten 54 USD)	–
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	–
Gesamtvermögen	\$–

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

† Nicht liquide.

α Mit Wirkung vom 27. April 2022 stellte der Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^α den Handel ein.

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

^α In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien — 99,71 % (28. Februar 2022: 100,64 %)		
Australien — 3,85 % (28. Februar 2022: 2,97 %)		
AUD 29 CSL Ltd	5.833	3,85
China — 6,71 % (28. Februar 2022: 5,85 %)		
HKD 84 Tencent Holdings Ltd	3.469	2,29
HKD 758 Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	6.687	4,42
	10.156	6,71
Dänemark — 4,09 % (28. Februar 2022: 3,01 %)		
DKK 54 Coloplast A/S	6.191	4,09
Frankreich — 6,92 % (28. Februar 2022: 7,01 %)		
EUR 8 Kering SA	4.042	2,67
EUR 19 L'Oreal SA	6.437	4,25
	10.479	6,92
Deutschland — 1,62 % (28. Februar 2022: 2,13 %)		
EUR 16 adidas AG	2.453	1,62
Hong Kong — 3,22 % (28. Februar 2022: 2,86 %)		
HKD 508 AIA Group Ltd	4.884	3,22
Irland — 6,53 % (28. Februar 2022: 7,96 %)		
EUR 40 Kerry Group Plc	4.168	2,75
EUR 101 Kingspan Group Plc	5.727	3,78
	9.895	6,53
Italien — 7,14 % (28. Februar 2022: 7,27 %)		
EUR 28 Ferrari NV	5.367	3,54
EUR 123 Moncler SpA	5.450	3,60
	10.817	7,14
Niederlande — 5,47 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
EUR 17 ASML Holding NV	8.293	5,47
Schweden — 10,17 % (28. Februar 2022: 10,75 %)		
SEK 217 Assa Abloy AB	4.413	2,91
SEK 574 Atlas Copco AB	5.832	3,85
SEK 503 Hexagon AB	5.156	3,41
	15.401	10,17
Vereinigtes Königreich — 6,56 % (28. Februar 2022: 6,55 %)		
GBP 256 Dr Martens Plc	699	0,46
171 Farfetch Ltd	1.720	1,13
27 Linde Plc	7.525	4,97
	9.944	6,56
USA — 37,43 % (28. Februar 2022: 38,07 %)		
12 Adobe Inc	4.661	3,08
18 ANSYS Inc	4.543	3,00
22 Autodesk Inc	4.431	2,92
17 Illumina Inc	3.503	2,31
33 Masimo Corp	4.789	3,16
20 Mastercard Inc	6.341	4,19

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
35 Microsoft Corp	9.107	6,01
44 NVIDIA Corp	6.589	4,35
34 ResMed Inc	7.556	4,99
26 Veeva Systems Inc 'A'	5.189	3,42
	56.709	37,43
Summe Stammaktien (Kosten 196.896 USD)		
	151.055	99,71
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 196.896\$)		
	151.055	99,71
Devisenterminkontrakte — 0,04 % (28. Februar 2022: 0,12 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	56	0,04
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	151.111	99,75
Devisenterminkontrakte — (0,91 %) (28. Februar 2022: (1,25 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	(1.378)	(0,91)
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	(1.378)	(0,91)
Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	149.733	98,84
Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
	1.760	1,16
Gesamtvermögen		
	151.493\$	100,00

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

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 6.687.000\$ und machten 4,42 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

- AUD – Australischer Dollar
- DKK – Dänische Krone
- EUR – Euro
- GBP – Britisches Pfund Sterling
- HKD – Hongkong-Dollar
- SEK – Schwedische Kronen

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,56
Finanzderivate	0,04
Sonstige Vermögenswerte	1,40
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 9.881 Verkauf	EUR 9.899 \$ (80)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 1.356 Verkauf	EUR 1.325 23
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 197 Verkauf	GBP 167 3
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 12.335 Verkauf	USD 12.378 30
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 84.715 Verkauf	USD 86.458 (1.235)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	GBP 1.386 Verkauf	USD 1.675 (63)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 197\$)				\$ 56
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (2.114\$))				(1.378)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (1.917\$))				\$ (1.322)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien — 58,16 % (28. Februar 2022: 54,78 %)			Indien — 5,09 % (28. Februar 2022: 5,04 %)		
Australien — 13,72 % (28. Februar 2022: 11,72 %)			Neuseeland — 1,96 % (28. Februar 2022: 1,31 %)		
AUD	155	AGL Energy Ltd	809	3,17	
AUD	68	APA Group	516	2,02	
AUD	337	Aurizon Holdings Ltd	853	3,34	
AUD	140	Transurban Group	1.325	5,19	
			3.503	13,72	
China — 10,87 % (28. Februar 2022: 11,69 %)			Singapur — 6,94 % (28. Februar 2022: 9,97 %)		
HKD	492	China Merchants Port Holdings Co Ltd	738	2,89	
HKD	3.080	China Tower Corp Ltd, 144A	382	1,50	
HKD	1.116	Guangdong Investment Ltd	1.023	4,01	
HKD	1.318	Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	632	2,47	
			2.775	10,87	
Hong Kong — 5,77 % (28. Februar 2022: 6,17 %)			Summe Immobilienfonds (REIT) (Kosten 11.022 USD)		
HKD	101	CLP Holdings Ltd	870	3,41	
HKD	413	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	345	1,35	
HKD	57	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	259	1,01	
			1.474	5,77	
Indien — 10,77 % (28. Februar 2022: 8,08 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 26.460\$)		
INR	3.201	NHPC Ltd	1.525	5,97	
INR	428	Power Grid Corp of India Ltd	1.225	4,80	
			2.750	10,77	
Malaysia — 2,48 % (28. Februar 2022: 2,53 %)			Devisenterminkontrakte — 0,00 % (28. Februar 2022: 0,04 %)		
MYR	56	Petronas Gas Bhd	215	0,84	
MYR	541	Westports Holdings Bhd	419	1,64	
			634	2,48	
Neuseeland — 6,64 % (28. Februar 2022: 2,83 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
NZD	193	Chorus Ltd	943	3,69	
NZD	157	Contact Energy Ltd	752	2,95	
			1.695	6,64	
Philippinen — 1,02 % (28. Februar 2022: 3,60 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
PHP	48	Manila Electric Co	259	1,02	
Singapur — 3,78 % (28. Februar 2022: 3,43 %)			Devisenterminkontrakte — (0,07 %) (28. Februar 2022: (0,04 %))		
SGD	759	Ascendas India Trust	615	2,41	
SGD	524	NETLINK NBN MANAGEMENT PTE Ltd	351	1,37	
			966	3,78	
Thailand — 3,11 % (28. Februar 2022: 4,73 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
THB	2.156	Digital Telecommunications Infrastructure Fund	795	3,11	
Summe Stammaktien (Kosten 15.438 USD)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
			14.851	58,16	
Real Estate Investment Trusts (Immobilienfonds) — 40,91 % (28. Februar 2022: 44,07 %)			Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Australien — 18,61 % (28. Februar 2022: 21,10 %)			Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
AUD	89	Charter Hall Long Wale REIT	269	1,05	
AUD	416	Charter Hall Retail REIT	1.156	4,53	
AUD	162	GPT Group/The	460	1,80	
AUD	592	Scentre Group	1.175	4,60	
AUD	369	Shopping Centres Australasia Property Group	680	2,66	
AUD	146	Stockland	360	1,41	
AUD	500	Vicinity Centres	653	2,56	
			4.753	18,61	
Hong Kong — 8,31 % (28. Februar 2022: 6,65 %)			Gesamtvermögen		
HKD	1.152	Fortune Real Estate Investment Trust	936	3,67	
HKD	153	Link REIT	1.185	4,64	
			2.121	8,31	
			Gesamtvermögen		
			25.535\$		
			100,00		

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

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2022 beliefen sich diese Wertpapiere auf 382.000\$ und machten 1,50 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

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

Analyse des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,59
Sonstige Vermögenswerte	5,41
Gesamtvermögen	100,00

Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2022 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)			Währungsverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	26	Verkauf	AUD	37	\$	–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	CNH	–		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD	13	Verkauf	SGD	19		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	SGD	452	Verkauf	USD	328		(4)
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	CNH	7	Verkauf	USD	1		–
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	AUD	904	Verkauf	USD	631		(13)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 11\$)									–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (10)\$)									(17)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1\$)									\$ (17)

Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^]

Anlagenportfolio zum 31. August 2022

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien — 99,47% (28. Februar 2022: 99,66%)			GBP 1.566 Oxford Nanopore Technologies Plc		
Dänemark — 4,02% (28. Februar 2022: 4,42%)			23.220 11,59		
DKK 70 Coloplast A/S	8.059	4,02	USA — 6,30% (28. Februar 2022: 5,54%)		
Frankreich — 20,13% (28. Februar 2022: 18,59%)			USD 10 Mettler-Toledo International Inc		
227 Dassault Systemes SE	8.717	4,35	Summe Stammaktien (Kosten 41.488 USD)		
21 Kering SA	10.404	5,19	199.312 99,47		
29 L'Oreal SA	9.848	4,91	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Kosten 253.149€)		
31 Sartorius Stedim Biotech	11.372	5,68	199.312 99,47		
	40.341	20,13	Devisenterminkontrakte — 0,10% (28. Februar 2022: 0,09%)		
Deutschland — 10,58% (28. Februar 2022: 11,97%)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
39 adidas AG	5.806	2,90	196 0,10		
352 Infineon Technologies AG	8.546	4,27	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
117 Nemetschek SE	6.842	3,41	(80) (0,04)		
	21.194	10,58	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
Irland — 7,00% (28. Februar 2022: 7,86%)			(80) (0,04)		
65 Kerry Group Plc	6.640	3,31	Summe erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
131 Kingspan Group Plc	7.389	3,69	199.428 99,53		
	14.029	7,00	Sonstiges die Verbindlichkeiten übersteigendes Vermögen		
Italien — 13,06% (28. Februar 2022: 11,91%)			941 0,47		
86 Ferrari NV	16.542	8,25	Gesamtvermögen		
218 Moncler SpA	9.634	4,81	200.369€ 100,00		
	26.176	13,06	— Beträge, die mit „—“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
Niederlande — 9,24% (28. Februar 2022: 9,59%)			ABKÜRZUNGEN:		
38 ASML Holding NV	18.513	9,24	CHF — Schweizer Franken		
Schweden — 13,87% (28. Februar 2022: 13,96%)			DKK — Dänische Krone		
SEK 449 Assa Abloy AB	9.091	4,54	GBP — Britisches Pfund Sterling		
SEK 910 Atlas Copco AB	9.205	4,59	SEK — Schwedische Kronen		
SEK 930 Hexagon AB	9.490	4,74	USD — US-Dollar		
	27.786	13,87	Analyse des Gesamtvermögens		
Schweiz — 3,68% (28. Februar 2022: 3,91%)			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
CHF 8 Partners Group Holding AG	7.371	3,68	99,38		
Vereinigtes Königreich — 11,59% (28. Februar 2022: 11,91%)			Finanzderivate		
602 Allfunds Group Plc	4.704	2,35	0,10		
906 Dr Martens Plc	2.458	1,23	Sonstige Vermögenswerte		
167 Farfetch Ltd	1.663	0,83	0,52		
34 Linde Plc	9.448	4,71	Gesamtvermögen		
			100,00		

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Währungskauf (in Tsd.)	Währungsverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 2.609 Verkauf	BRL 13.229 € 79
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 143 Verkauf	BRL 764 (2)
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL 216 Verkauf	EUR 42 (1)
09.02.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL 13.776 Verkauf	EUR 2.520 114
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 2 Verkauf	EUR 2 —
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	USD 84 Verkauf	EUR 82 2
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 8 Verkauf	USD 8 —
15.09.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 3 Verkauf	USD 2 —
10.04.2022	BNY Mellon	Kauf	EUR 45 Verkauf	BRL 232 1
10.04.2022	BNY Mellon	Kauf	BRL 12.339 Verkauf	EUR 2.412 (77)
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 281€)				€ 196
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (69)€)				(80)
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 212€)				€ 116

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund		Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund		Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund		Legg Mason Western Asset EUR Core Plus Bond Fund	
	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022
UMLAUFVERMÖGEN								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 3	\$ 1	\$ 16	\$ 16	\$ 12.409	\$ 20.859	€ 596	€ 1.027
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	3.979	4.462	17.656	18.123	4.607	2.338
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	865.780	939.444	187.328	234.866	1.280.831	1.477.772	136.323	146.614
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	280	–	–
Optionen	–	–	22	58	193	383	1	–
Swapkontrakte	–	–	4.401	2.494	26.633	11.755	–	72
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	1.371	3.409	76	59
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	59	726	1.840	5.952	620	567
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	1.320	2.086	18.764	14.432	–	3
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	229	153	3.561	948	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	815	313	1.351	1.348	9.828	8.588	1.038	1.156
Dividendenforderungen	–	–	18	3	10	8	11	28
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	44	–	101	–	1	1
Gesamtumlaufvermögen	866.598	939.758	198.767	246.212	1.373.197	1.562.509	143.273	151.865
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	–	1.712	659	–	1.199	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	3.624	2.642	9.665	2.114	–	508
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	36	229	272	1.476	244	3
Swapkontrakte	–	–	1.050	421	8.004	3.508	1.661	743
Swaptions	–	–	–	–	–	258	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	32	50	2.139	7.304	209	569
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	1.364	1.522	10.414	8.964	946	590
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	19.972	4.326	5.654	70.579	44.980	–	1
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	975	6	195	55	166	48	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	444	55	111	141	626	668	4	2
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	27	22	19	17	94	78	13	10
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	13	16	27	31	–	1
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	2.704	1.814	1.032	3.508	70	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	330	379	74	86	290	283	41	52
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	1.776	20.434	15.260	13.306	103.308	74.419	3.188	2.479
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 864.822	\$ 919.324	\$ 183.507	\$ 232.906	\$ 1.269.889	\$ 1.488.090	€ 140.085	€ 149.386

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	
	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022
UMLAUFVERMÖGEN								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 2.125	\$ 5.997	\$ 14	\$ 14	\$ 17	\$ 17	\$ 51	\$ 776
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	155	168	–	–	–	–	326	993
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	59.703	75.783	–	–	–	–	9.742	57.903
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	3	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	26
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	133	193	–	–	–	–	109	353
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	419	51	–	–	–	–	21	315
Forderungen aus verkauften Anlagen	146	466	–	–	–	–	–	1
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	30	37	–	–	–	–	1	–
Zinsen und sonstige Erträge	861	846	–	–	–	–	27	214
Dividendenforderungen	1	5	–	–	–	–	1	–
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	2	1
Gesamtumlaufvermögen	63.573	83.546	14	14	17	17	10.283	60.582
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	14	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	433	51	–	–	–	–	1	181
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	13	2
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	102	286
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	356	139	–	–	–	–	4	298
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	46	236
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	361	158	–	–	–	–	24	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	91	29	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	50	72	–	–	–	–	4	9
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	11	9	–	5	–	2	7	7
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	5	8	–	–	–	–	–	1
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	202	1.011	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	77	91	14	9	17	15	32	37
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	1.586	1.568	14	14	17	17	247	1.057
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 61.987	\$ 81.978	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 10.036	\$ 59.525

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 ^{αβ}	
Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022
\$ 270 23	\$ 2.087 5	\$ 22.244 2.930	\$ 14.249 3.447	\$ 8 1.160	\$ 5 1.156	\$ 4.997 125	\$ 3.396 318	\$ 30 -	\$ 459 88
38.235	50.718	228.204	283.356	187.311	255.876	40.426	37.277	-	27.090
-	-	25	89	-	-	-	9	-	-
33	-	-	-	224	112	-	-	-	9
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	1	1.803	4.595	-	-	21	155	-	-
-	-	170	104	-	47	39	-	-	1
226	167	31	1.435	62	4.839	-	-	-	-
30	170	80	23	255	347	-	-	-	-
595	707	2.830	2.987	2.885	3.416	569	460	-	347
-	-	6	-	3	2	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	-	1	-	5	-	-	-	-	-
39.417	53.855	258.324	310.285	191.913	265.800	46.177	41.615	30	27.994
369	-	-	-	801	578	166	-	-	-
-	-	42	330	144	190	39	127	-	-
-	-	-	-	-	-	-	6	-	-
5	-	339	657	55	19	-	8	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
53	29	3.582	2.265	36	41	62	174	-	39
-	-	1.563	1.281	45	72	-	89	-	27
43	214	31	42	61	341	-	-	-	-
42	16	94	28	180	59	10	3	-	-
36	49	103	114	90	119	7	18	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	24	23	20	19	18	10	19	4	6
2	5	7	7	9	9	1	1	-	-
52	488	109	2.408	225	5.179	622	10	-	44
27	38	169	164	63	75	55	42	26	29
655	863	6.062	7.316	1.728	6.700	972	497	30	146
\$ 38.762	\$ 52.992	\$ 252.262	\$ 302.969	\$ 190.185	\$ 259.100	\$ 45.205	\$ 41.118	\$ -	\$ 27.848
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 ^α		Legg Mason Western Asset Global Credit Fund ^α		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund ^{αβ}	
Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022
\$ 3.800 674	\$ 3.674 2.793	\$ 1.074 7.690	\$ 3.114 1.944	\$ 2.511 6.121	\$ 3.512 4.353	\$ 451 1.739	\$ 418 1.374	€ 35 -	€ 4.275 223
435.082	492.770	359.370	445.353	158.686	199.783	63.163	74.454	-	32.770
-	-	-	-	-	314	-	-	-	-
-	-	-	-	43	-	-	-	-	-
-	7.755	-	-	-	142	31	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
509	378	4.743	4.176	2.019	1.797	801	827	-	8
-	-	2.831	2.194	429	837	302	437	-	-
17	120	147	5.009	112	3.851	23	3	-	-
54	122	674	392	2	2	23	4	-	-
4.638	6.174	1.873	2.276	1.173	1.218	726	800	-	431
3	2	41	4	5	41	3	9	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	-	4	-	-	-	-	-	1	-
444.779	513.788	378.447	464.462	171.101	215.850	67.262	78.326	36	37.707
-	-	74	161	1	5	-	9	-	-
200	-	28	1.642	106	777	26	339	-	-
-	-	-	-	206	8	-	-	-	-
-	-	-	-	2.452	1.508	354	393	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
923	594	9.675	4.645	2.494	1.907	96	116	-	66
273	1.113	380	181	1.637	1.170	73	44	-	-
17	120	146	5.838	4.973	3.922	23	3	-	140
16	7	1	-	-	-	-	-	-	-
224	241	124	137	21	32	2	2	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
34	30	30	26	17	15	10	9	4	5
16	19	9	10	-	-	-	-	-	-
214	1.467	89	7.487	-	3.467	-	5	-	-
306	403	80	86	83	91	43	53	32	48
2.223	3.994	10.636	20.213	11.990	12.902	627	973	36	259
\$ 442.556	\$ 509.794	\$ 367.811	\$ 444.249	\$ 159.111	\$ 202.948	\$ 66.635	\$ 77.353	€ -	€ 37.448

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund [^]		Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund [^]	
	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022
	UMLAUFVERMÖGEN							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 189.905	\$ 104.039	\$ 30	\$ 30	\$ 5.072	\$ 9.344	\$ –	\$ –
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	398.881	717.419	–	–	2.726	4.542	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	2.259.213	3.826.412	–	–	244.959	358.203	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	21.873	28.173	–	–	545	382	–	–
Swapkontrakte	300.031	227.706	–	–	488	207	–	–
Swaptions	399	7	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	29.492	112.006	–	–	748	5.345	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	19.036	213.705	–	–	576	774	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	2.177	9.667	–	–	1.934	2.208	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	795	7.091	–	–	675	2	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	39.107	54.650	–	–	2.980	3.647	–	–
Dividendenforderungen	142	3	–	–	7	9	–	–
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	6	–	–	–	1	1.002	–	–
Gesamtumlaufvermögen	3.261.057	5.300.878	30	30	260.711	385.665	–	–
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	122.976	101.514	–	–	–	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	134.829	266.033	–	–	189	836	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	50.034	127.700	–	–	168	177	–	–
Swapkontrakte	129.063	239.384	–	–	703	572	–	–
Swaptions	–	528	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	40.681	98.156	–	–	7.945	7.240	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	146.271	237.864	–	–	1.564	2.239	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	2.177	14.790	–	–	1.249	2.415	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	2.720	4.149	–	–	27	27	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	183	243	–	5	21	22	–	–
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	198	279	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	3.818	23.005	–	–	596	61	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	1.686	3.399	30	25	183	177	–	–
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	634.636	1.117.044	30	30	12.645	13.766	–	–
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 2.626.421	\$ 4.183.834	\$ –	\$ –	\$ 248.066	\$ 371.899	\$ –	\$ –

(in Tsd.)	Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]	
	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022
	UMLAUFVERMÖGEN							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 45	\$ 47	\$ 114	\$ 210	\$ 98	\$ 13.991	\$ –	\$ –
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	136	43	1.081	101	9.860	14.317	1	22
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	8.564	9.435	187.378	215.108	529.757	728.758	10.536	11.416
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	97
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	239	270	2.196	4.267	11.678	21.946	6	50
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	32	21	–	–	6.688	1.272	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	–	343	230	708	–	303	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	253	163	–	3	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	85	94	2.340	1.992	4.846	4.812	171	179
Dividendenforderungen	2	2	261	754	131	319	2	1
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	1	13	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	8	–	–	–	2	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	9.112	9.925	193.966	222.825	563.768	785.418	11.019	11.765
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	–	215	3	165	13	28	1
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	18	5	390	1.190	1.340	5.014	–	90
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	12
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	72	26	5.457	4.493	22.442	22.185	236	20
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	10	–	–	–	464	4.865	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	–	574	230	1.417	–	359	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	1	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	110	124	148	150	1	2
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	6	5	21	16	40	42	7	5
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	17	18	1	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	391	638	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	21	23	412	478	246	431	33	45
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	127	59	7.587	7.190	26.263	32.700	665	175
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 8.985	\$ 9.866	\$ 186.379	\$ 215.635	\$ 537.505	\$ 752.718	\$ 10.354	\$ 11.590

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 [^]	
Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022
\$ 648	\$ 1.313 3.553	\$ 112 3.039	\$ 112 6.058	£ 620 249	£ 2.378 154	\$ 1.202 641	\$ 293 564	\$ 59 1.104	\$ 222 1.344
662.029	1.054.614	1.163.094	1.283.066	63.591	70.140	142.838	174.022	17.618	21.064
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	12	5
-	1.058	-	1.296	-	-	37	-	1.010	453
-	2.784	-	-	-	-	-	-	-	-
1	203	-	-	3	8	82	143	41	120
507	502	335	1.640	38	59	146	202	115	191
-	-	46.966	55.814	-	-	1.084	788	29	15
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2.309	2.369	4.175	3.603	1.022	982	1.501	1.417	158	126
16	3	46	1	3	3	7	2	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	7	7
-	1	8	2	-	-	1	-	1	-
665.510	1.066.400	1.217.775	1.351.592	65.526	73.724	147.539	177.431	20.154	23.547
1.437	-	11.929	189	-	-	-	10	1	-
-	380	310	2.408	1	-	105	280	263	-
-	-	-	-	-	-	-	-	28	81
-	592	-	-	-	-	11	-	163	68
-	1.269	-	-	-	-	-	-	-	-
1.629	3.513	34	14	192	35	4.983	1.739	53	189
35	2.083	618	666	94	10	104	158	459	533
-	-	91.444	200.768	-	-	893	-	128	661
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
98	255	12	-	-	-	6	5	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
46	56	74	60	7	7	15	13	24	17
3	2	-	-	-	-	1	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
336	309	220	207	34	39	50	57	40	40
3.584	8.459	104.641	204.312	328	91	6.168	2.262	1.159	1.589
\$ 661.926	\$ 1.057.941	\$ 1.113.134	\$ 1.147.280	£ 65.198	£ 73.633	\$ 141.371	\$ 175.169	\$ 18.995	\$ 21.958
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]		Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund		Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]		Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	
Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022
\$ 911	\$ 420 351	\$ 1.005 -	\$ 246 -	\$ 55.964 10.528	\$ 3 14.599	\$ 11 1.036	\$ - 571	\$ - 1	\$ - 20
202.155	242.628	-	-	1.146.728	1.522.073	50.381	51.853	7.960	10.165
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	2.535	22.750	1	154	-	80
3.218	2.854	-	-	8.043	9.078	165	79	7	-
-	-	-	-	-	-	40	86	-	-
263	-	-	-	1.755	120.110	-	-	149	-
-	3	-	-	456	2.047	4	-	-	-
2.080	2.266	-	-	11.227	14.572	251	335	122	149
530	866	-	-	148	10	3	-	2	-
-	-	-	7	-	-	-	-	1	-
1	-	-	-	44	7	3	-	-	-
209.163	249.388	1.005	253	1.237.428	1.705.249	51.895	53.078	8.242	10.414
230	4	-	-	389	10.850	-	325	28	-
350	610	-	-	-	2.390	-	20	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	1.315	-	-	-	-	12
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5.755	4.074	-	-	16.144	17.153	174	145	107	196
-	-	-	-	14	1.309	374	81	-	-
512	-	-	-	6.593	61.079	-	-	209	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
110	119	-	-	103	37	-	-	-	-
-	-	-	-	833	998	49	46	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
22	17	-	-	77	83	13	7	6	5
1	1	-	-	92	107	1	1	-	-
16	1	-	-	791	3.099	-	-	-	-
153	166	1.005	253	69	71	52	67	28	38
7.149	4.992	1.005	253	26.420	97.176	663	692	378	251
\$ 202.014	\$ 244.396	\$ -	\$ -	\$ 1.211.008	\$ 1.608.073	\$ 51.232	\$ 52.386	\$ 7.864	\$ 10.163

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund [^]		Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022
\$ 58	\$ 58	\$ 55	\$ 57	\$ 2	\$ 1	\$ 8.356	\$ 18.115	\$ 39.026	\$ 30.686
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	181.738	207.470	1.228.508	1.756.332
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	2.012	4.603
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	364	6.645
-	-	-	-	-	-	2	3	21.814	2.327
-	-	-	-	-	-	2	-	6	-
-	-	-	-	-	-	178	193	1.224	1.081
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	20	-	13	-
58	58	55	57	2	1	190.296	225.781	1.292.967	1.801.674
-	-	-	-	-	-	10	-	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	2.140	4.240
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	1.310	1.709
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	364	1.938
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	192	196	944	1.137
-	-	-	5	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	26	23	151	158
-	-	-	-	-	-	31	31	132	148
29	29	-	-	-	-	99	11.979	932	19.322
29	29	55	52	2	1	64	72	351	326
58	58	55	57	2	1	422	12.301	6.324	28.979
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 189.874	\$ 213.480	\$ 1.286.643	\$ 1.772.695
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^]		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022
€ 33.389	€ 13.373	\$ 59	\$ 75	\$ 25.433	\$ 6.456	\$ 1	\$ 93	\$ -	\$ 12
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.050.018	648.298	2.377	2.667	385.821	164.133	660.017	933.530	75.740	88.460
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3.351	3.195	-	-	13	82	707	1.468	-	1
4.416	961	-	-	2.262	3.945	2.668	13.964	165	293
2.804	8.689	-	-	3.700	1.113	584	1.026	8	35
-	-	2	-	-	-	-	-	-	-
2.935	1.626	11	7	1.943	725	756	323	22	10
-	-	1	-	-	-	-	-	-	-
8	-	-	-	12	-	3	-	5	-
1.096.921	676.142	2.450	2.749	419.184	176.454	664.736	950.404	75.940	88.811
12	2	3	-	1	14	932	56	176	341
689	340	-	-	-	-	540	1.170	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.936	438	21	30	1.405	332	1.256	1.791	6	5
4.416	1.204	-	-	2.870	2.075	2.285	14.230	149	99
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
957	549	-	2	408	186	659	747	94	91
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
76	53	6	5	31	14	66	68	15	12
119	69	-	-	84	42	111	130	15	15
4.049	1.968	-	-	100	368	821	15.803	62	249
86	95	40	47	212	29	226	200	53	64
12.340	4.718	70	84	5.111	3.060	6.896	34.195	570	876
€ 1.084.581	€ 671.424	\$ 2.380	\$ 2.665	\$ 414.073	\$ 173.394	\$ 657.840	\$ 916.209	\$ 75.370	\$ 87.935

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]		Legg Mason Global Funds Plc	
	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022	Zum 31. August 2022	Zum 28. Februar 2022
UMLAUFVERMÖGEN				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	€ 1.002	€ 1.581	\$ 489.309	\$ 295.765
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	478.773	808.667
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:				
Anlagen	199.312	302.551	17.778.995	22.173.582
Verpfändete Anlagen	–	–	25	683
Optionen	–	–	22.692	29.019
Swapkontrakte	–	–	335.424	276.166
Swaptions	–	–	399	2.791
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	196	281	74.881	186.626
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	34.252	230.923
Forderungen aus verkauften Anlagen	–	86	96.431	269.885
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	7	26	46.655	35.931
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	102.395	124.101
Dividendenforderungen	41	36	11.337	8.925
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	15	34
Sonstige Vermögenswerte	4	–	362	1.015
Gesamtumlautvermögen	200.562	304.561	19.471.945	24.444.113
KURZFRISTIGE PASSIVA:				
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	–	142.812	125.131
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	156.267	294.640
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten:				
Optionen	–	–	51.002	129.683
Swapkontrakte	–	–	145.285	248.273
Swaptions	–	–	–	2.055
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	80	69	140.562	191.714
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	166.900	266.598
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	86	206.219	394.100
Fällige Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	1.874	288
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	63	99	11.210	12.569
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	3
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	33	34	1.688	1.654
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	1	2	1.155	1.208
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	1	662	26.867	136.182
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	15	19	9.803	11.337
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	193	971	1.061.644	1.815.435
Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	€ 200.369	€ 303.590	\$ 18.410.301	\$ 22.628.678

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

Die Euro-Beträge für den Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, den Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, den Franklin MV European Equity Growth and Income Fund, den Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], den Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und den Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc zum 31. August 2022 zum USD/EUR-Wechselkurs von 0,9951 umgerechnet (28. Februar 2022: 0,8919)

Die Yen-Beträge für den Legg Mason Congruix Japan Equity Fund[^] wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022 zum USD/JPY-Wechselkurs von 138,9250 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2022: 114,9650)

Die britischen Pfund-Beträge für den Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022 zum USD/GBP-Wechselkurs von 0,8608 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2022: 0,7454)

α Mit Wirkung vom 27. April 2022 stellte der Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

β Mit Wirkung zum 21. Juni 2022 stellten der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und der Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] den Handel ein.

μ Mit Wirkung zum 11. Juli 2022 stellte der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2022			28. Februar 2022			28. Februar 2021		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 152.389	1.387	109,90	\$ 131.265	1.197	109,62	\$ 153.935	1.404	109,61
Klasse A USD, ausschüttend (D)	546.440	546.454	1,00	640.232	640.245	1,00	624.449	624.463	1,00
Klasse B USD, thesaurierend	73	1	105,07	73	1	104,91	73	1	104,90
Klasse B USD, ausschüttend (D)	218	218	1,00	–	–	–	300	300	1,00
Klasse C USD, thesaurierend	5.083	49	103,80	5.317	51	103,69	5.098	49	103,68
Klasse C USD, ausschüttend (D)	140	140	1,00	140	140	1,00	235	235	1,00
Klasse X USD, ausschüttend (D)	159.756	159.758	1,00	141.538	141.540	1,00	97.422	97.424	1,00
Klasse A (G) USD, thesaurierend	489	4	110,12	488	4	109,85	491	4	109,84
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	227	227	1,00	264	264	1,00	285	285	1,00
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	7	7	1,00	7	7	1,00	42	42	1,00
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 30.945	237	130,38	\$ 35.416	245	144,44	\$ 47.716	316	151,06
Klasse A USD, ausschüttend (D)	71.086	764	93,02	80.771	775	104,18	87.128	789	110,48
Klasse B USD, ausschüttend (D)	–	–	–	2	–	104,24	2	–	110,58
Klasse C USD, thesaurierend	5.949	49	120,56	8.586	64	133,90	14.666	104	140,75
Klasse C USD, ausschüttend (D)	2.653	29	93,05	3.580	34	104,21	8.392	76	110,52
Klasse E USD, thesaurierend	994	11	89,32	2.222	22	99,25	5.613	54	104,43
Klasse F USD, thesaurierend	34.069	287	118,71	58.355	445	131,23	84.508	619	136,50
Klasse F USD, ausschüttend (D)	10.909	119	91,46	14.031	137	102,43	19.500	179	108,64
Klasse X USD thesaurierend	2.165	21	103,79	2.384	21	114,69	4.213	35	119,38
Klasse X USD, ausschüttend (D)	280	3	90,48	298	3	101,33	341	3	107,49
Klasse Premier USD, thesaurierend	17.971	173	104,03	19.841	173	114,85	21.197	178	119,17
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.989	21	94,90	2.570	22	105,86	4.329	32	110,80
Klasse LM USD, thesaurierend	3.352	38	88,11	3.558	37	97,13	–	–	–
Klasse GA USD, thesaurierend	1.091	8	128,86	1.232	9	142,64	1.462	10	148,76
Klasse GE USD, thesaurierend	54	–	119,89	60	–	133,11	63	–	139,67
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 101.382	694	146,19	\$ 122.223	748	163,35	\$ 199.266	1.165	171,09
Klasse A USD, ausschüttend (D)	36.195	358	101,02	47.095	412	114,18	55.980	461	121,54
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	5.233	62	84,33	7.597	79	95,64	29.227	282	103,46
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	8.076	144	81,84	6.011	89	93,32	1.749	22	101,27
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	731	8	92,73	1.452	12	104,74	9.308	70	110,74
Klasse B USD, ausschüttend (D)	61	1	100,97	86	1	114,12	218	2	121,48
Klasse C USD, thesaurierend	16.571	125	132,43	23.167	156	148,35	36.691	235	156,16
Klasse C USD, ausschüttend (D)	8.687	85	101,74	10.764	94	114,99	14.460	118	122,39
Klasse E USD, thesaurierend	13.814	127	108,40	21.829	180	121,50	40.138	314	128,02
Klasse F USD, thesaurierend	501.648	4.334	115,73	675.110	5.237	128,91	448.724	3.348	134,01
Klasse F USD, ausschüttend (D)	8.878	94	94,74	11.889	111	107,08	15.158	133	113,97
Klasse X USD thesaurierend	6.760	63	107,62	8.356	70	119,85	29.448	236	124,81
Klasse X USD, ausschüttend (D)	5.247	60	88,11	5.357	54	99,58	4.093	39	106,00
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.047	23	87,87	2.903	26	98,90	17.281	138	103,98
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	421	4	97,03
Klasse Premier USD, thesaurierend	497.386	3.580	138,95	491.421	3.179	154,57	658.972	4.111	160,28
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	2.903	30	95,88	2.929	27	108,14	1.627	14	115,10
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	30.947	313	98,43	22.936	185	110,65	79.619	570	115,80
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	19.585	237	82,57	22.527	242	93,11	–	–	–
Klasse LM EUR, thesaurierend	1.453	11	126,35	1.726	12	125,79	2.000	14	120,86
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	73	–	156,34
Klasse A (G) USD, thesaurierend	179	1	148,49	200	1	165,90	209	1	173,50
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	859	8	101,82	1.106	10	115,07	1.267	10	122,48
Klasse B (G) USD, ausschüttend (D)	3	–	101,83	4	–	115,09	4	–	122,50
Klasse L (G) USD, thesaurierend	209	2	137,50	234	2	154,01	246	2	161,87
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1.016	10	101,83	1.141	10	115,09	1.239	10	122,50
Legg Mason Western Asset EUR Core Plus Bond Fund									
Klasse A USD, ausschüttend (D)	€ 37	–	93,72	€ 50	–	117,82	€ 258	2	132,74
Klasse A EUR, ausschüttend (D)	966	10	96,77	1.190	11	108,97	1.293	11	114,08
Klasse C USD, ausschüttend (D)	57	1	93,14	65	1	117,09	162	1	132,39
Klasse F EUR, ausschüttend (Q)	–	–	–	1	–	124,95	1	–	130,68
Klasse Premier EUR, thesaurierend	8.447	89	95,04	1.825	17	106,44	1.181	11	110,48
Klasse LM EUR, thesaurierend	129.517	1.316	98,42	145.011	1.317	110,07	106.972	939	113,90
Klasse GA EUR, thesaurierend	656	6	118,16	741	6	132,69	907	7	138,44
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	305	3	107,19	391	3	120,65	431	3	126,21
Klasse GE EUR, thesaurierend	100	1	109,94	112	1	123,83	118	1	129,98
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 13.777	91	151,35	\$ 23.402	144	162,96	\$ 7.428	46	161,04
Klasse A USD, ausschüttend (D)	5.530	70	79,31	7.876	90	87,34	3.027	34	89,16
Klasse A USD, ausschüttend (M)	222	3	84,03	252	3	92,27	194	2	94,22
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	188	2	83,28	207	2	91,74	323	3	95,63
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	25	–	80,48	30	–	89,13	33	–	93,23
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.134	9	131,39	1.481	9	142,92	817	5	142,45
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	301	28	83,96	452	38	92,09	461	38	95,29
Klasse B USD, thesaurierend	12	–	144,84	13	–	156,15	28	–	154,71
Klasse B USD, ausschüttend (D)	50	1	79,29	64	1	87,30	99	1	89,14
Klasse C USD, thesaurierend	6.477	46	140,05	7.053	47	151,17	3.374	22	150,15
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1.888	24	79,27	4.005	46	87,30	1.842	21	89,13
Klasse F USD, thesaurierend	2.738	27	100,75	3.094	29	108,26	2.234	21	106,56
Klasse Premier USD, thesaurierend	1	–	91,95	1	–	98,57	–	–	–
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	1	–	88,81	1	–	97,46	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.057	22	94,11	–	–	–	268	2	115,77
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	1	–	92,31	–	–	–	–	–	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend	703	5	149,65	757	5	161,24	748	5	159,33
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	2.842	35	80,73	3.274	37	88,89	4.507	50	90,76
Klasse B (G) USD, ausschüttend (D)	5	–	80,81	5	–	88,98	5	–	90,85
Klasse L (G) USD, thesaurierend	715	5	138,67	890	6	149,79	884	6	148,76
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	95	1	80,74	135	2	88,90	161	2	90,76
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 10.011	65	153,81	\$ 12.161	74	165,33	\$ 17.681	103	172,05
Klasse A USD, ausschüttend (D)	13.684	136	100,60	15.078	137	109,94	30.274	258	117,46
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1.975	23	85,43	2.287	25	93,16	2.766	28	99,54
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	682	9	78,96	879	10	86,54	1.188	13	94,09
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	177	3	76,38	47	1	84,12	60	1	91,77
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	3.039	23	131,05	4.100	26	142,38	7.761	43	149,53
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	2.658	37	71,72	3.395	38	79,05	4.956	48	85,25
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	181	3	61,01	252	3	67,69	337	4	73,99
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	457	5	83,85	581	5	91,73	655	5	98,21
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	50	5	77,03	110	10	84,03	119	10	90,69
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	940	1.607	0,82	1.033	1.563	0,90	989	1.353	0,97
Klasse B USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	34	–	161,33
Klasse B USD, ausschüttend (D)	273	3	100,58	531	5	109,92	506	4	117,46
Klasse C USD, thesaurierend	5.972	43	138,78	6.780	45	149,55	8.648	55	156,41
Klasse C USD, ausschüttend (D)	8.966	89	100,56	10.758	98	109,90	12.439	106	117,45
Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	403	10	709,93	451	9	788,67	1.219	21	882,77
Klasse E USD, thesaurierend	1.288	11	121,88	1.505	11	131,41	1.995	14	137,57
Klasse E USD, ausschüttend (D)	599	7	83,75	661	7	91,53	784	8	97,82

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2022			28. Februar 2022			28. Februar 2021		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund (Fortsetzung)									
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	\$ 132	1	97,45	\$ 125	1	106,18	\$ 268	2	112,17
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	30	–	73,14	36	–	80,64	42	–	86,96
Klasse F USD, thesaurierend	17.961	126	142,91	20.347	133	153,16	20.252	128	158,42
Klasse F USD, ausschüttend (D)	5.035	60	83,76	5.501	60	91,53	7.007	72	97,83
Klasse X USD, ausschüttend (D)	900	11	83,89	1.399	15	91,68	2.769	28	97,99
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	60	1	80,12	76	1	87,81	85	1	94,05
Klasse Premier USD, thesaurierend	53.351	308	173,05	44.980	243	185,22	53.511	280	191,11
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	1.778	17	104,45	12.098	106	113,85	8.814	72	121,64
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	2.983	28	102,68	3.442	28	111,13	1.972	15	115,93
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	3.460	26	130,62	4.740	30	141,32	5.709	32	147,15
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	38	1	69,31	69	1	76,38	80	1	82,36
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	29.271	195	129,47	49.523	266	138,99	67.295	336	143,71
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1.022	11	80,92	2.899	24	88,49	25.240	191	94,73
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	201	2	70,85	205	2	77,65	185	2	83,56
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	2.711	105	121,09	3.664	121	127,30	7.095	203	131,13
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	81.868	1.279	93,54	93.108	1.251	102,46	80.077	947	109,85
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	106	1	135,38	148	1	145,04	283.119	1.361	149,34
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund									
Klasse A USD thesaurierend	22.706	128	176,74	\$ 25.055	129	194,84	\$ 22.041	113	194,57
Klasse A USD, ausschüttend (D)	29.989	434	69,03	34.889	446	78,15	34.730	428	81,22
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1.578	19	83,54	2.271	24	94,27	1.568	16	97,97
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1.337	19	71,83	2.424	30	81,29	7.832	91	85,88
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1.377	20	69,81	1.414	16	79,66	1.543	15	83,50
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	–	–	97,12	–	–	93,84	–	–	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	376	768	0,69	–	–	0,78	548	891	0,82
Klasse B USD, thesaurierend	–	–	–	520	907	–	–	–	–
Klasse B USD, ausschüttend (D)	57	1	69,05	106	1	78,17	14	–	193,00
Klasse C USD, thesaurierend	4.140	25	168,26	3.170	17	185,96	3.756	20	186,64
Klasse C USD, ausschüttend (D)	2.203	32	69,04	2.748	35	78,16	2.914	36	81,24
Klasse E USD, thesaurierend	3.704	23	158,91	3.837	22	175,71	3.706	21	176,53
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1.007	12	86,27	1.106	11	97,67	1.123	11	101,51
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	331	3	94,32	413	3	105,40	319	2	106,80
Klasse F USD, thesaurierend	5.734	35	162,18	7.467	42	178,39	6.330	36	177,08
Klasse F USD, ausschüttend (D)	314	4	82,16	226	2	93,01	42	–	96,61
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	2	–	109,71
Klasse Premier USD, thesaurierend	53.243	316	168,60	101.736	549	185,21	67.635	369	183,40
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	1	–	101,45	1	–	111,69	972	6	110,82
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	1	–	90,02	–	–	–	–	–	–
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	46	1	89,09	–	–	–	–	–	–
Klasse LM USD, thesaurierend	38.766	215	180,19	45.730	232	197,50	45.078	232	194,69
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	20.998	275	76,43	23.015	267	86,21	15.196	170	89,59
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	42	–	103,19	51	–	113,46	130	1	112,05
Klasse A (G) USD, thesaurierend	192	1	180,97	211	1	199,51	238	1	198,94
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1.083	16	68,49	1.243	16	77,53	1.335	17	80,58
Klasse L (G) USD, thesaurierend	168	1	167,56	185	1	185,19	186	1	185,59
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	652	10	68,47	795	10	77,52	827	10	80,57
Klasse GF USD, thesaurierend	135	1	161,12	149	1	177,45	148	1	176,59
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 3.913	24	161,40	\$ 5.371	32	170,12	\$ 8.296	44	186,70
Klasse A USD, ausschüttend (D)	770	8	93,11	1.415	14	99,47	2.117	19	111,90
Klasse A USD, ausschüttend (M)	793	9	84,35	908	10	89,94	1.147	11	101,20
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1.222	19	62,94	10	–	67,72	65	1	77,88
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	172	1	119,34	219	2	127,14	295	2	140,72
Klasse A Euro, ausschüttend (D) (abgesichert)	243	4	62,99	293	4	67,99	397	4	77,14
Klasse A GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	36	–	78,92	44	–	84,50	52	–	95,23
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	9	19	0,65	9	17	0,70	5	8	0,80
Klasse C USD, thesaurierend	40	–	146,23	243	2	154,50	410	2	170,41
Klasse C USD, ausschüttend (D)	913	10	93,08	1.023	10	99,42	1.548	14	111,85
Klasse E USD, ausschüttend (D)	279	4	79,57	413	5	84,99	732	8	95,61
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	8	–	83,15	10	–	88,88	12	–	99,00
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	12	–	70,43	15	–	75,92	69	1	86,16
Klasse F USD, thesaurierend	64	–	144,69	67	–	151,93	98	1	165,41
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	12	–	76,58	15	–	82,01	17	–	92,43
Klasse Premier USD, thesaurierend	89	1	89,10	93	1	93,44	101	1	101,47
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.028	9	116,80	2.097	15	123,82	3.388	21	135,63
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	48	1	68,62	79	1	73,50	46	–	82,85
LM KLASSE USD, ausschüttend (M) (abgesichert)	32.421	390	83,05	25.470	288	88,50	–	–	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend	470	3	169,16	494	3	178,03	750	4	194,69
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	759	9	83,49	814	9	89,17	995	10	100,32
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1.066	7	156,62	1.125	7	165,24	1.236	7	181,62
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	838	10	83,46	891	10	89,14	993	10	100,29
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund^{AB}									
Klasse A USD thesaurierend	–	–	–	\$ 24	–	106,83	\$ 1	–	119,07
Klasse A USD, ausschüttend (M)	–	–	–	1	–	90,49	1	–	103,39
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	5	–	89,98	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	1.928	18	94,23	559	4	104,70
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	–	–	–	25.890	286	90,51	39.672	384	103,43
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 7.453	46	160,91	\$ 8.812	49	178,94	\$ 10.843	58	186,88
Klasse A USD, ausschüttend (D)	6.288	98	64,02	7.374	101	72,88	9.793	124	78,92
Klasse A USD, ausschüttend (M)	8.618	121	71,04	11.065	137	80,65	13.355	153	87,32
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	6.631	102	64,80	10.681	145	73,86	7.846	97	81,26
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	5.800	112	75,57	7.679	122	86,67	9.349	127	95,70
Klasse A EUR, thesaurierend	1.780	16	114,14	2.029	16	113,76	2.039	15	110,41
Klasse A Euro, ausschüttend (D) (abgesichert)	117	2	64,98	65	1	74,80	637	6	81,71
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.866	4.176	0,62	2.177	4.140	0,71	10.208	17.351	0,78
Klasse B USD, thesaurierend	64	–	157,82	72	–	175,72	75	–	183,97
Klasse B USD, ausschüttend (D)	30	–	63,89	201	3	72,72	341	4	78,75
Klasse C USD, thesaurierend	1.117	7	152,90	1.483	9	170,46	1.663	9	178,91
Klasse C USD, ausschüttend (D)	2.472	39	63,73	2.962	41	72,56	4.827	61	78,57
Klasse E USD, thesaurierend	1.111	8	139,99	1.249	8	156,17	1.086	7	164,08
Klasse E USD, ausschüttend (D)	167	2	78,47	207	2	89,34	224	2	96,74
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	14	–	64,66	18	–	74,28	20	–	81,17
Klasse F USD, thesaurierend	2.378	16	145,19	2.036	13	161,10	396	2	167,08
Klasse F USD, ausschüttend (D)	546	7	74,49	965	11	84,81	912	10	91,86
Klasse X USD, ausschüttend (D)	4.966	59	83,49	5.807	61	95,06	3.840	37	102,93
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	3.545	45	67,41	4.406	43	77,04	3.119	27	83,60
Klasse Premier USD, thesaurierend	1.210	6	192,17	6.086	29	212,96	14.056	64	220,31
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.515	13	112,93	1.770	12	126,57	1.829	11	132,11
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	26	–	73,30	35	–	83,77	39	–	90,91
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	1	–	91,05	–	–	–	–	–	–
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	46	1	90,10	–	–	–	–	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2022			28. Februar 2022			28. Februar 2021		
	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:
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)									
Klasse A (G) USD, thesaurierend	\$ 2.104	13	163,98	\$ 2.374	13	182,46	\$ 2.521	13	190,27
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1.065	17	64,01	1.240	17	72,88	2.197	28	78,93
Klasse L (G) USD, thesaurierend	454	3	151,85	507	3	169,39	605	3	177,52
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	603	9	64,03	678	9	72,89	742	9	78,93
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 5.395	36	150,44	\$ 3.549	23	155,66	\$ 1.881	13	149,48
Klasse A USD, ausschüttend (A)	2.591	21	125,96	4.844	36	133,96	5.428	42	128,65
Klasse B USD, thesaurierend	–	–	–	28	–	108,80	59	1	104,74
Klasse C USD, thesaurierend	162	2	96,16	93	1	99,75	–	–	–
Klasse C USD, ausschüttend (A)	778	6	122,76	843	6	130,28	511	4	125,73
Klasse F USD, thesaurierend	1.049	11	96,89	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
Klasse A (G) USD, thesaurierend	5	–	158,15	5	–	163,47	5	–	156,66
Klasse A (G) USD, ausschüttend (A)	42	–	122,87	45	–	130,79	51	–	125,55
Klasse L (G) USD, ausschüttend (A)	14	–	113,45	15	–	120,50	14	–	116,06
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 30.892	208	148,55	\$ 39.106	241	162,46	\$ 44.824	269	166,82
Klasse A USD, ausschüttend (D)	5.772	59	97,56	6.592	61	108,04	7.638	67	113,74
Klasse A USD, ausschüttend (M)	11.797	131	89,95	12.847	129	99,50	20.694	198	104,75
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	34.058	507	67,21	45.247	604	74,94	81.474	1.015	80,31
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	15.412	299	75,27	21.798	356	84,24	33.416	480	90,52
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	280	3	88,68	330	3	98,04	840	8	101,76
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	3.842	357	74,28	5.325	405	83,16	8.143	592	89,20
Klasse A EUR, thesaurierend	2.637	11	232,66	2.698	11	228,02	4.757	18	217,73
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.199	12	96,93	1.734	14	107,09	2.884	22	110,91
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	493	4	114,96	541	4	115,43	665	5	113,12
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	8.327	804	81,31	10.989	951	90,29	23.309	1.882	96,06
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	1.114	1.126	1,38	1.296	1.162	1,51	1.649	1.416	1,55
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2.074	4.135	0,70	2.389	4.143	0,78	3.984	6.341	0,84
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	836	1.533	0,76	940	1.545	0,82	987	1.514	0,87
Klasse B USD, thesaurierend	56	–	143,28	62	–	156,90	64	–	161,52
Klasse B USD, ausschüttend (D)	–	–	–	19	–	107,96	112	1	113,66
Klasse C USD, thesaurierend	1.496	11	137,96	1.697	11	151,27	2.210	14	156,11
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1.176	12	97,58	1.306	12	108,06	2.241	20	113,77
Klasse E USD, thesaurierend	724	6	119,05	704	5	130,59	906	7	134,91
Klasse E USD, ausschüttend (D)	181	2	89,68	199	2	99,32	237	2	104,56
Klasse F USD, thesaurierend	2.484	18	135,87	2.699	18	148,29	11.537	76	151,67
Klasse F USD, ausschüttend (D)	591	7	89,74	654	7	99,38	689	7	104,62
Klasse X USD thesaurierend	–	–	–	221	2	110,48	7.895	70	112,93
Klasse X USD, ausschüttend (M)	1.154	13	86,48	3.705	39	95,65	3.672	36	100,69
Klasse X EUR, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	570	5	98,39
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	218	2	90,16	268	2	99,36	297	2	102,39
Klasse Premier USD, thesaurierend	65.928	406	162,51	72.450	409	177,15	80.687	446	180,73
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–	170	2	100,83
Klasse Premier EUR, thesaurierend	119.629	732	162,56	130.405	732	158,82	130.921	721	150,58
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	6.686	61	108,69	8.686	65	119,68	6.424	43	123,15
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	69.125	678	101,40	77.670	678	102,17	83.139	688	100,09
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M)	11.051	102	108,24	12.221	102	107,28	12.865	102	104,95
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M)	72	1	116,43	92	1	111,51	225	1	112,95
Klasse LM USD, thesaurierend	38.809	221	175,33	43.801	230	190,55	46.784	242	193,24
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	3.558	39	90,47	–	–	–	–	–	–
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	885	10	86,35	1.103	10	96,42	–	–	–
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 24.592	204	120,80	\$ 22.239	176	126,60	\$ 32.132	247	130,34
Klasse A USD, ausschüttend (M)	5.972	59	101,82	6.851	64	106,79	10.545	96	109,95
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	7.633	83	91,21	9.882	91	96,55	12.195	101	100,26
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	6.711	780	91,70	22.680	2.221	96,73	312	26	100,13
Klasse A SEK ausschüttend (M) (abgesichert)	1	–	91,62	1	–	96,70	1	–	100,01
Klasse B USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	335	3	110,43
Klasse C USD, thesaurierend	4.865	43	113,10	8.415	71	118,83	5.301	43	122,95
Klasse C USD, ausschüttend (M)	3.521	35	100,60	519	5	105,71	416	4	109,37
Klasse E USD, thesaurierend	3.026	28	106,52	3.238	29	111,98	3.972	34	115,98
Klasse E USD, ausschüttend (D)	4.862	50	96,61	4.983	49	101,56	5.448	52	105,19
Klasse F USD, thesaurierend	5.441	45	121,21	7.631	60	126,78	13.216	102	130,00
Klasse F USD, ausschüttend (D)	1.483	16	93,09	1.596	16	97,66	100	1	100,48
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	6.121	66	91,72	9.247	85	96,86	2.968	25	100,14
Klasse Premier USD, thesaurierend	45.403	343	132,32	27.247	197	138,22	23.015	163	141,38
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	21.501	222	96,41	31.220	274	101,73	37.172	294	104,95
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	160	2	89,03	189	2	94,28	514	4	97,87
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	419	3	124,87	2	–	130,72	54	–	133,95
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	9	–	96,93	1.278	9	101,92	2.453	17	105,05
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)	6.632	69	96,65	10.106	100	101,50	22.076	211	104,79
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	47	1	92,53	55	1	97,58	–	–	–
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	2.407	27	87,92	3.050	29	93,27	4.128	35	97,13
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	207.112	1.938	92,00	262.829	2.023	96,86	340.795	2.442	100,19
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	9.893	155	93,28	10.991	155	97,63	–	–	–
Klasse S AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	1.551	20	99,63
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^									
Klasse A USD, ausschüttend (A)	\$ 1	–	93,32	\$ 1	–	102,91	\$ 1	–	107,12
Klasse X USD thesaurierend	2.199	21	105,99	2.746	24	115,64	173	1	119,24
Klasse Premier USD, thesaurierend	33.752	235	143,91	42.779	273	156,86	119.487	741	161,26
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	18.597	184	100,65	39.201	315	110,84	44.983	324	114,96
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	2	–	88,04	3	–	96,15	–	–	–
Klasse Premier NZD thesaurierend (abgesichert)	5.084	84	98,68	6.128	84	107,57	10.056	126	110,51
Klasse S USD, thesaurierend	1	–	93,52	–	–	–	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	46	1	92,65	–	–	–	–	–	–
Klasse LM USD, thesaurierend	3.849	38	101,08	4.122	37	109,96	3.845	34	112,59
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.039	23	86,67	2.442	23	95,23	–	–	–
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	93.541	1.177	104,38	105.526	1.177	113,65	107.747	1.177	116,50
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 2.198	17	127,61	\$ 3.171	22	142,04	\$ 1.759	12	149,41
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	321	3	110,88	408	3	124,74	663	4	132,35
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	42	1	84,16	53	1	94,35	–	–	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	49	1	84,99	63	1	94,58	–	–	–
Klasse LM USD, thesaurierend	60.189	396	151,94	69.126	411	168,26	75.669	432	174,98
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	3.836	46	83,71	4.532	43	93,68	4.634	39	98,28
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^β									
Klasse A EUR, ausschüttend (D)	€ –	–	–	€ 48	–	96,68	€ 50	–	101,58
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	6	–	97,70	–	–	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	1	–	105,33	1	–	106,20

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2022			28. Februar 2022			28. Februar 2021		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^α (Fortsetzung)									
Klasse LM EUR, thesaurierend	€ –	–	–	€ 37.393	205	182,42	€ 45.868	248	184,67
Klasse LM EUR, ausschüttend (Q)	–	–	–	–	–	–	8.426	82	102,24
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^α									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 565.708	4.626	122,29	\$ 788.243	5.937	132,77	\$ 1.113.975	7.721	144,28
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	157.547	1.953	80,68	200.496	2.254	88,97	306.584	3.054	100,39
Klasse A USD, ausschüttend (S)	29.938	322	92,98	41.551	408	101,94	69.201	610	113,39
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1.230	20	90,30	1.348	19	98,55	3.476	42	107,62
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	17.664	328	78,82	25.043	395	87,37	47.368	621	99,08
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	9.116	88	100,88	17.146	142	110,87	24.026	179	121,93
Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)	1.046	55	130,89	1.234	55	141,25	2.098	91	149,98
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	3.279	241	94,12	4.928	302	103,16	5.411	309	113,75
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	153.911	1.467	104,40	364.733	2.837	114,66	527.701	3.474	125,91
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	6.012	62	96,77	7.824	73	96,24	11.415	95	99,74
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	6.162	80	76,52	8.555	89	85,34	15.400	131	97,33
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	6.325	75	83,98	7.304	70	93,13	13.660	108	104,74
Klasse A GBP, thesaurierend	393	2	151,55	508	3	142,50	679	3	149,10
Klasse A GBP thesaurierend (abgesichert)	6.489	51	110,43	22.692	141	120,28	80.106	438	131,16
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	10.782	124	74,61	14.437	130	82,55	24.353	187	93,46
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	72	7	78,76	80	7	86,91	821	65	98,41
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus (e)	4	–	78,98	4	–	86,74	–	–	–
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	2.253	251	95,67	3.282	297	104,81	65.000	4.774	114,96
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	10.430	12.552	1,16	23.139	24.857	1,26	23.348	22.675	1,37
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	28.600	50.794	0,79	39.579	61.771	0,87	64.576	87.738	0,98
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus (e)	31	50	0,86	34	50	0,92	–	–	–
Klasse B USD, thesaurierend	93	1	109,96	126	1	119,54	564	4	130,23
Klasse C USD, thesaurierend	38.913	355	109,64	49.624	416	119,34	77.546	595	130,34
Klasse C USD, ausschüttend (S)	4.522	49	92,04	5.973	59	100,90	8.547	76	112,24
Klasse A JPY, ausschüttend (M) Plus (e)	162	2	9.803,86	179	2	8.945,99	202	2	9.360,01
Klasse A NOK thesaurierend (abgesichert)	7.208	820	87,41	7.423	687	95,32	3.335	278	103,89
Klasse E USD, thesaurierend	16.663	154	108,10	20.437	174	117,72	35.437	275	128,70
Klasse E USD, ausschüttend (S)	1.478	16	91,78	2.115	21	100,63	2.926	26	111,93
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.853	30	93,40	4.390	38	102,88	9.964	73	113,66
Klasse F USD, thesaurierend	100.411	860	116,69	126.827	1.003	126,44	179.479	1.311	136,86
Klasse F USD, ausschüttend (S)	7.929	84	94,19	11.450	111	103,26	11.942	104	114,87
Klasse X USD thesaurierend	107.359	867	123,77	189.669	1.415	134,04	266.393	1.838	144,94
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	23.403	274	85,52	37.367	397	94,07	55.862	529	105,61
Klasse X USD, ausschüttend (S)	13.186	142	92,67	20.429	201	101,60	26.356	233	113,02
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)	17.192	161	104,35	28.117	225	114,39	38.488	280	125,16
Klasse X EUR, thesaurierend	2.469	16	156,41	5.023	30	151,60	18.964	103	152,32
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	213.191	1.944	109,12	155.230	1.158	119,51	239.226	1.518	130,58
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	8.612	109	78,57	11.901	120	88,55	16.549	137	99,76
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)	3.050	37	81,60	6.919	68	90,25	8.524	70	101,14
Klasse X GBP, thesaurierend	973	5	157,71	1.576	8	147,89	4.753	22	154,01
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	47.150	349	116,21	78.246	462	126,27	123.193	646	136,98
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	3.557	38	79,77	6.852	58	88,04	9.661	70	99,15
Klasse X SGD, thesaurierend (abgesichert)	4.409	5.089	1,21	5.057	5.222	1,31	5.456	5.119	1,42
Klasse Premier USD, thesaurierend	180.141	1.392	129,42	318.448	2.274	140,05	687.346	4.546	151,21
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	31.018	335	92,45	55.952	552	101,36	100.741	893	112,76
Klasse Premier AUD thesaurierend (abgesichert)	949	15	95,34	2.277	30	103,71	4.895	57	112,53
Klasse Premier AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	4.369	70	90,92	44.269	608	100,20	56.082	650	112,06
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	70.649	2.394	153,51	132.553	4.300	158,82	171.166	5.814	165,00
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	6.755	66	99,83	17.535	147	109,37	23.377	178	119,50
Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)	1.168	14	80,76	2.440	25	89,64	2.231	20	101,00
Klasse Premier EUR, thesaurierend	26.488	162	162,62	32.676	185	157,68	40.171	210	158,22
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	383.115	3.551	107,34	627.086	4.760	117,49	792.826	5.126	128,18
Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	11.570	139	82,71	24.197	235	91,74	116.650	937	103,20
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	9.248	73	109,44	86.494	543	118,83	276.937	1.544	128,72
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	22.688	250	78,10	145.729	1.261	86,13	366.571	2.716	96,89
Klasse Premier JPY thesaurierend (abgesichert)	54.128	740	10.158,27	76.911	797	11.091,23	96.121	851	12.036,16
Klasse Premier JPY, ausschüttend (S) (abgesichert)	–	–	–	7.912	100	9.096,56	9.547	100	10.176,83
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	983	48	96,10	1.546	63	102,28	4.054	137	110,55
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)	25	3	100,05	50	4	109,26	211	15	119,05
Klasse S USD, thesaurierend	7.657	57	134,01	12.078	83	144,73	15.089	97	155,64
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	144.294	1.229	116,87	177.135	1.238	127,65	238.793	1.427	138,74
Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	28.171	474	86,90	70.133	1.008	95,77	99.146	1.203	107,10
Klasse LM EUR, thesaurierend	1.230	9	140,12	1.323	9	135,18	1.561	10	134,29
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund^α									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 116	1	106,85	\$ 125	1	115,42	\$ 25	–	117,40
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	43	1	81,53	48	1	90,27	1	–	96,28
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	24	–	94,63	28	–	103,30	32	–	106,04
Klasse C USD, thesaurierend	–	–	106,15	–	–	114,76	–	–	116,81
Klasse F USD, thesaurierend	40	–	–	56	–	119,42	57	–	120,73
Klasse X CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)	–	1	74,44	48	1	82,74	51	1	88,00
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	3.433	35	96,99	3.644	31	105,47	6.928	53	107,41
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	225	2	83,10	597	5	91,91	739	5	97,54
Klasse S USD, thesaurierend	1.618	18	92,04	1.777	18	98,92	1.837	18	99,62
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	18.641	197	94,02	21.698	190	102,11	22.329	178	103,76
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	29.506	264	96,06	35.151	253	103,53	30.991	213	104,46
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	101.230	1.230	113,36	93.024	1.060	114,07
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	33.737	354	94,90	40.071	347	102,86	34.648	276	104,10
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	120.865	881	118,03	146.379	860	126,95	891.195	5.014	127,59
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	18.443	260	93,13	–	–	–	–	–	–
Klasse S CHF, ausschüttend (A)	19.312	200	94,39	21.046	200	96,50	–	–	–
Klasse S CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)	2.062	20	100,80	–	–	–	–	–	–
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^α									
Klasse D EUR, thesaurierend (abgesichert)	\$ 540	6	94,81	\$ 645	6	98,36	\$ 956	8	98,05
Klasse D EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	357	5	78,84	423	5	83,76	470	5	86,54
Klasse D USD, thesaurierend	13.173	126	104,76	14.316	133	107,68	23.854	224	106,44
Klasse D USD, ausschüttend (M)	1.556	18	85,61	1.638	18	90,09	24.978	271	92,27
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	234	3	79,88	247	3	84,29	9.749	110	88,49
Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)	301	3	96,05	1.415	13	99,34	1.956	18	98,68
Klasse M GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	573	6	82,23	697	6	86,63	743	6	88,90
Klasse F USD, thesaurierend	401	4	107,50	419	4	110,41	445	4	108,97
Klasse M USD, thesaurierend	627	7	96,04	643	7	98,42	1.412	15	96,69
Klasse M USD, ausschüttend (M)	770	9	85,27	787	9	89,71	1.669	18	91,89
Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)	912	9	98,66	1.052	9	102,04	61	1	101,10
Klasse Premier USD, thesaurierend	91.112	687	132,56	263.425	1.941	135,74	279.362	2.098	133,17
Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)	9.767	112	87,30	10.212	112	91,28	12.555	134	93,74
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	11.387	96	117,89	153.236	1.121	121,86	234.526	1.612	120,58
Klasse Premier EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert)	535	7	79,93	16.884	179	84,35	26.899	255	87,43
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	89	1	80,22	12.070	106	84,77	11.514	94	87,60
Klasse Premier JPY thesaurierend (abgesichert)	42.531	500	11.819,64	53.024	500	12.194,36	56.345	500	12.014,65
Klasse LM USD, thesaurierend	487.061	3.519	138,41	52					

Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2022			28. Februar 2022			28. Februar 2021		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]									
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	\$ 10	–	78,94	\$ 10	–	86,27	\$ 11	–	91,69
Klasse Premier USD, thesaurierend	42.573	420	101,37	–	–	–	1.822	18	103,98
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.060	22	92,17	717	6	100,06	3.460	28	103,96
Klasse LM USD, thesaurierend	1.068.491	10.359	103,15	1.146.553	10.359	110,68	818.123	7.199	113,64
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]									
Klasse A GBP, thesaurierend	£ 1	–	98,80	£ 1	–	111,82	£ 1	–	117,41
Klasse Premier GBP, thesaurierend	1	–	–	1	–	–	–	–	–
Klasse LM GBP, thesaurierend	–	–	–	73.631	637	115,68	76.684	637	120,47
Klasse LM GBP, ausschüttend (M)	65.196	695	93,75	–	–	–	–	–	–
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 594	5	109,85	644	5	122,84	\$ 9.524	75	127,66
Klasse Premier USD, thesaurierend	17.388	174	99,84	19.025	171	111,27	15.160	132	114,85
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	3.454	35	98,87	870	7	111,34	1.377	10	115,94
Klasse S USD, thesaurierend	1	–	91,70	–	–	–	–	–	–
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	154.630	951	121,21	165.535	951	124,94
Klasse LM GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	119.934	1.065	96,93	–	–	–	–	–	–
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^]									
Klasse LM USD, ausschüttend (Q)	18.995	247	76,90	\$ 21.958	244	90,04	\$ 22.193	226	98,11
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 8	–	86,40	\$ 10	–	95,97	\$ –	–	–
Klasse F USD, thesaurierend	9	–	86,62	10	–	96,01	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	2.166	25	86,76	2.401	25	96,05	–	–	–
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	2.496	141	91,84	2.664	142	96,96	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	38	–	85,81	47	–	95,97	–	–	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	37	–	86,50	47	–	96,05	–	–	–
Klasse S USD, thesaurierend	4.193	48	86,81	4.640	48	96,06	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	38	–	85,86	47	–	95,98	–	–	–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 10.519	84	125,66	\$ 12.568	87	144,07	\$ 19.033	122	155,92
Klasse A USD, ausschüttend (M)	523	7	79,12	1.099	12	91,71	1.610	16	100,20
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	293	3	99,20
Klasse A USD, ausschüttend (S)	19.182	197	97,45	22.007	196	112,29	25.630	209	122,72
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	411	10	59,78	526	10	69,92	766	13	78,08
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	739	10	71,82	1.075	11	83,44	645	6	91,29
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	17.765	129	136,92	25.053	152	146,74	42.849	232	153,27
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	302	5	61,56	583	7	72,27	874	9	80,04
Klasse A EUR, ausschüttend (S)	42	–	86,26	49	–	89,08	55	1	90,48
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	5.619	61	92,21	7.052	63	99,31	10.173	80	104,76
Klasse A GBP, thesaurierend	89	1	97,59	102	1	96,89	110	1	100,97
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	185	2	66,38	254	2	77,41	395	3	84,89
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	3.499	30	101,32	4.647	32	108,33	6.577	42	113,52
Klasse A SGD, thesaurierend	61	95	0,89	68	93	0,99	131	165	1,06
Klasse B USD, thesaurierend	7	–	114,00	23	–	130,86	51	–	141,97
Klasse B USD, ausschüttend (S)	65	1	97,39	107	1	112,23	203	2	122,66
Klasse C USD, thesaurierend	349	3	109,93	450	4	126,35	1.083	8	137,44
Klasse C USD, ausschüttend (S)	916	9	96,99	1.099	10	111,77	2.046	17	122,16
Klasse E USD, thesaurierend	523	6	83,89	625	6	96,47	1.301	12	105,04
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	22	–	93,60
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	526	5	97,33	737	6	104,63	1.480	11	109,94
Klasse F USD, thesaurierend	779	9	89,44	1.023	10	102,33	1.047	9	110,31
Klasse F USD, ausschüttend (S)	176	2	71,91	202	2	82,84	159	2	90,55
Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	25	–	83,70	38	–	89,48	123	1	93,71
Klasse X USD thesaurierend	7.811	87	89,72	3.321	32	102,61	3.376	31	110,50
Klasse X USD, ausschüttend (S)	59	1	72,27	234	3	83,25	321	4	91,00
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	118	1	78,39	104	1	90,83	422	4	98,90
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	314	3	93,20	1.203	11	99,63	1.445	12	103,54
Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	100	1	81,34	528	5	87,56	1.065	10	92,37
Klasse X GBP, thesaurierend	28.971	211	118,21	26.213	167	117,12	29.863	176	121,47
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	12.034	130	79,79	18.737	152	91,79	26.554	192	99,19
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	165	1	97,98	250	2	104,00	449	3	107,37
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)	7.449	98	65,65	11.372	111	76,08	21.758	187	83,45
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	4.749	48	85,48	6.464	53	91,37	15.679	118	95,74
Klasse Premier USD, thesaurierend	22.665	217	104,31	26.070	219	119,20	46.937	366	128,17
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	185	2	74,58	922	11	85,89	1.119	12	93,89
Klasse Premier EUR, thesaurierend	3.136	22	142,13	4.125	25	145,57	5.368	31	145,47
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	63	1	76,22	81	1	88,25	39.291	339	95,96
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	3.357	29	117,05	11.130	79	125,02	37.310	238	129,75
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	3	–	81,29	4	–	93,51	–	–	–
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	138	2	65,85	270	3	76,76	573	5	84,17
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	991	9	92,09	1.663	13	98,46	2.457	17	103,16
Klasse LM USD, thesaurierend	2.878	32	89,33	3.162	31	101,78	4.363	40	108,78
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	28.891	258	112,10	20.395	173	118,09	12.901	107	120,78
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 868	8	114,25	\$ 938	8	119,84	\$ 959	8	123,34
Klasse A USD, ausschüttend (A)	142	2	91,00	149	2	96,69	224	2	100,65
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	221	2	91,85	386	4	97,53	424	3	101,30
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	–	–	90,01	–	–	94,46	–	–	96,72
Klasse A SGD, thesaurierend	–	–	1,01	–	–	–	–	–	–
Klasse C USD, thesaurierend	69	1	99,22	124	1	104,34	129	1	107,92
Klasse E USD, thesaurierend	164	2	98,37	172	2	103,51	179	2	107,17
Klasse E USD, ausschüttend (A)	23	–	92,34	24	–	97,84	324	3	101,84
Klasse F USD, thesaurierend	771	7	105,42	807	7	110,36	827	7	113,12
Klasse F USD ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	34	–	99,33
Klasse X USD thesaurierend	180	2	97,25	189	2	101,78	66	1	104,28
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	2.396	21	99,03	3.499	25	104,13	3.088	21	106,90
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	403	4	84,32	154	1	89,35	279	2	93,36
Klasse Premier USD, thesaurierend	84.945	775	109,54	85.918	750	114,56	67.943	580	117,19
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	159	2	89,50	169	2	95,36	158	2	99,26
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	65.558	623	104,74	77.402	623	110,83	89.753	650	114,42
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	25.196	337	74,50	29.738	330	80,37	38.828	381	84,42
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	9.122	96	81,86	11.162	96	86,74	12.113	96	90,60
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	176	15	98,11
Klasse Premier SGD thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	134.176	151.908	1,18
Klasse LM USD, thesaurierend	5.057	44	115,86	5.265	44	120,62	10.675	87	122,30
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	342.231	3.501	142,84	536.622	4.944	149,45	368.319	3.149	152,00
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund[^]									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 204	2	109,84	207	2	121,94	\$ 21	–	126,05
Klasse A USD, ausschüttend (D)	90	1	81,38	103	1	92,91	112	1	101,27
Klasse Premier USD, thesaurierend	1	–	135,62	1	–	150,00	564	4	153,88

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2022			28. Februar 2022			28. Februar 2021		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund[^] (Fortsetzung)									
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	\$ 82	1	135,57	\$ 102	1	146,92	\$ 108	1	148,84
Klasse S CAD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	9.977	100	131,30	11.177	100	141,96	11.254	100	143,52
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 2.714	26	104,58	3.382	28	122,37	3.277	25	131,11
Klasse A USD, ausschüttend (M)	592	7	90,66	702	7	106,98	686	6	116,22
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1	–	76,08	1	–	90,11	1	–	97,56
Klasse A SGD, thesaurierend	23	36	0,92	51	67	1,04	155	188	1,10
Klasse C USD, thesaurierend	131	1	95,52	1.096	10	112,05	1.354	11	120,64
Klasse E USD, thesaurierend	286	3	93,51	347	3	109,74	633	5	118,29
Klasse F USD, thesaurierend	2.476	27	91,39	3.090	29	106,72	3.833	34	113,88
Klasse F USD, ausschüttend (M)	238	3	77,72	280	3	91,69	1.198	12	99,61
Klasse X USD thesaurierend	264	3	95,47	308	3	111,42	329	3	118,78
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	220	3	69,73	382	3	82,76	79	1	90,21
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	967	9	93,06	1.209	9	101,85	824	6	106,09
Klasse Premier USD, thesaurierend	172.692	1.561	110,60	207.613	1.610	128,99	338.663	2.467	137,30
Klasse Premier USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	897	7	124,58
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	1.827	18	88,88	2.282	17	97,27	3.143	22	101,31
Premier Klasse NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	5.686	62	149,89	6.513	59	161,81	6.794	57	164,79
Klasse LM EUR, thesaurierend	4.063	35	115,00	5.010	37	119,82	5.719	40	117,77
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	9.834	91	175,97	12.130	95	189,36	218.136	1.575	191,70
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 181.247	1.382	131,14	\$ 227.926	1.582	144,04	\$ 81.165	548	148,11
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1.907	22	87,95	2.423	24	99,14	1.351	13	103,79
Klasse A USD, ausschüttend (D)	16.671	192	86,79	28.700	297	96,74	13.849	136	102,16
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	43.339	526	82,34	67.038	726	92,32	1.071	11	99,70
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	120.478	1.395	86,38	163.878	1.695	96,70	63.441	613	103,50
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	2.867	48	86,61	3.500	50	95,72	–	–	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2.797	49	82,71	4.268	63	93,28	–	–	–
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	859	72	82,26	1.169	80	92,59	–	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend	1	–	106,46	1	–	104,69	1	–	100,09
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	32.064	319	100,01	49.951	401	111,20	19.226	138	115,37
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	27.876	323	85,87	33.645	306	98,11	22.787	180	105,03
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2.238	27	81,93	3.108	30	93,01	–	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	31.701	420	75,18	38.905	407	85,23	34.495	311	92,06
Klasse A GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	2.417	25	82,75	3.289	26	93,28	–	–	–
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	5.770	62	80,49	8.329	69	90,60	4.651	34	97,19
Klasse A HKD, thesaurierend	562	50	87,49	766	63	95,68	–	–	–
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	10.739	1.011	83,35	17.554	1.474	93,06	–	–	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	40.390	62.998	0,90	49.398	66.538	1,01	17.338	21.270	1,09
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	25.933	43.838	0,83	3.914	5.723	0,93	223	299	0,99
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	7.225	11.642	0,87	8.763	12.594	0,94	149	198	1,01
Klasse C USD, thesaurierend	24.387	267	91,45	39.688	394	100,69	2.104	20	104,06
Klasse C USD, ausschüttend (D)	9.720	114	85,24	1.454	15	95,00	447	4	100,31
Klasse A CZK thesaurierend (abgesichert)	47	1	99,10	–	–	–	–	–	–
Klasse E USD, thesaurierend	30.883	312	99,07	35.222	323	109,15	14.474	128	112,91
Klasse E USD, ausschüttend (D)	372	4	85,00	567	6	94,73	64	1	100,01
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	3.951	41	96,89	5.373	44	108,08	1.809	13	112,81
Klasse F USD, thesaurierend	24.450	264	92,68	40.863	402	101,56	3.755	36	103,97
Klasse F USD, ausschüttend (D)	5.191	55	94,77	6.875	65	105,62	1.807	16	111,52
Klasse X USD thesaurierend	12.733	136	93,77	14.895	145	102,71	313	3	105,03
Klasse X USD, ausschüttend (D)	9	–	94,77	147	1	106,01	141	1	111,95
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	19.361	215	90,24	25.931	257	100,74	8.793	82	107,23
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)	553	6	85,89	1.173	11	95,30	–	–	–
Klasse X CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)	767	9	83,83	3.019	29	95,94	68	1	99,46
Klasse X EUR, thesaurierend	1.139	11	106,45	1.281	11	104,50	1.012	8	99,34
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	14.815	170	86,71	36.681	340	96,16	81	1	99,21
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	16.834	212	78,88	22.675	227	89,18	22.878	198	95,80
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	6.513	66	84,62	9.746	76	94,97	3.347	24	101,32
Klasse Premier USD, thesaurierend	51.131	551	92,78	82.954	817	101,55	2.094	20	103,69
Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus (e)	13.990	152	92,30	21.157	205	102,96	3.130	29	109,42
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	2.205	122	94,32	2.265	118	98,52	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	92.169	823	111,44	141.515	1.022	123,47	15.687	102	127,20
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	29.518	367	80,07	42.876	423	90,45	6.553	56	97,01
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	402	4	85,31	2.311	18	95,62	373	3	101,87
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)	2.291	219	111,64	3.339	256	123,61	18.380	1.222	127,05
Klasse S USD, thesaurierend	91.532	952	96,11	188.113	1.790	105,08	27.021	252	107,09
Klasse S USD, ausschüttend (Q) Plus (e)	217	3	84,95	262	3	94,61	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	49.535	478	103,01	70.922	555	114,04	20.156	142	117,25
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	5.268	58	90,37	6.325	55	101,98	6.314	48	109,17
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	396	4	88,22	1.909	14	98,90	1.920	13	105,14
Klasse LM USD, thesaurierend	10.079	100	100,79	–	–	–	–	–	–
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	6.757	79	85,68	7.573	79	95,27	–	–	–
LM Klasse EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	111.690	1.322	84,10	44.361	418	94,65	–	–	–
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	15.022	139	92,95	30.076	220	101,96	30.817	213	103,78
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 11.933	108	110,71	\$ 12.217	108	113,34	\$ 14.059	125	112,29
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	3	–	100,53
Klasse X USD, ausschüttend (M)	1	–	95,17	1	–	98,28	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	35.482	304	116,75	36.297	305	119,13	24.883	212	117,27
Klasse LM USD, thesaurierend	3.816	30	127,98	3.871	30	129,83	11.098	88	126,33
Klasse S BRL, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1.977	103	107,73
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]									
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	\$ 76	1	76,28	\$ 86	1	87,94	\$ 12	–	97,50
Klasse S EUR, ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)	7.788	100	77,50	10.077	100	89,87	11.762	100	97,48
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 48	1	81,95	\$ 10	–	92,02	\$ 10	–	100,31
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	70	120	0,82	3.880	5.726	0,92	5.272	7.003	1,00
Klasse X USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	10	–	102,35
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	4	–	63,81	6	–	73,57	20	–	84,13
Klasse Premier USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	14.917	145	102,76
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	11	–	96,41
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	70.638	1.223	84,42	100.335	1.460	94,63	371.056	4.740	101,74
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 188	1	177,62	\$ 141	1	196,64	\$ 21	–	171,02
Klasse Premier USD, thesaurierend	535	3	189,22	589	3	208,48	508	3	179,61
Klasse Premier GBP, thesaurierend	2	–	103,26	3	–	98,53	–	–	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.160	7	169,22	1.444	7	188,84	1.350	7	164,09

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2022			28. Februar 2022			28. Februar 2021		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteil (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteil (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteil (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
Legg Mason ClearBridge Value Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 116.085	771	150,56	\$ 121.303	732	165,63	\$ 11.396	78	147,02
Klasse A USD, ausschüttend (A)	31.985	112	286,06	34.995	111	314,69	25.305	91	279,33
Klasse A EUR, thesaurierend	9.062	48	189,46	8.899	43	186,70	766	4	154,30
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	52	–	141,18	82	–	158,13	35	–	142,06
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	21	–	231,84	23	–	220,87	20	–	189,53
Klasse A SGD, thesaurierend	4.061	4.347	1,31	4.372	4.254	1,39	2.399	2.627	1,22
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	1.395	813	2,40	2.375	1.214	2,65	398	225	2,36
Klasse C USD, thesaurierend	11.533	76	152,06	9.512	57	167,70	693	5	149,60
Klasse C USD, ausschüttend (A)	1.826	11	258,81	2.695	9	285,43	1.548	6	254,63
Klasse E USD, thesaurierend	3.899	41	96,14	2.907	27	106,16	–	–	–
Klasse F USD, thesaurierend	22.267	74	299,42	24.053	73	328,39	2.411	8	289,75
Klasse F USD ausschüttend (A)	2.609	16	165,57	2.818	16	181,76	304	2	160,78
Klasse X USD thesaurierend	99	1	97,45	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD, ausschüttend (A)	2.342	11	207,10	15.344	67	227,42	25.887	129	201,13
Klasse X EUR, thesaurierend	7.797	63	123,54	5.094	37	121,64	540	4	99,74
Klasse Premier USD, thesaurierend	519.750	1.915	271,45	506.317	1.704	297,07	398.734	1.528	261,00
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	2.188	12	184,82	482	2	203,29	52	–	179,63
Klasse Premier EUR, thesaurierend	96.864	389	247,96	105.810	388	243,25	38.597	161	198,65
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	36.061	381	94,06	31.343	267	104,79	–	–	–
LM Klasse USD, ausschüttend (A)	10.075	106	95,48	13.814	132	104,99	–	–	–
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 33.861	121	280,81	\$ 38.354	126	303,63	\$ 31.487	116	271,85
Klasse A USD, ausschüttend (A)	9.806	35	280,60	12.540	41	303,41	12.287	45	271,66
Klasse A EUR, thesaurierend	1.003	2	409,37	862	2	396,80	927	2	330,04
Klasse B USD, thesaurierend	51	1	253,97	549	2	275,31	277	1	247,74
Klasse B USD, ausschüttend (A)	313	–	260,08	55	–	281,93	676	3	253,69
Klasse C USD, thesaurierend	14.866	59	253,94	16.457	60	275,27	15.828	64	247,70
Klasse C USD, ausschüttend (A)	17.978	69	260,00	20.120	71	281,84	19.398	76	253,62
Klasse E USD, thesaurierend	19.584	66	294,93	22.561	70	320,04	19.773	68	288,70
Klasse E USD, ausschüttend (A)	1.085	4	295,03	1.177	4	320,22	1.062	4	288,87
Klasse F USD, thesaurierend	22.536	86	263,34	26.406	93	283,88	24.575	97	252,65
Klasse F USD ausschüttend (A)	4.158	12	349,69	4.282	11	376,97	3.588	11	335,67
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1.505	7	226,12	1.684	7	243,72	1.913	9	217,01
Klasse X EUR, thesaurierend	263	1	313,27	286	1	302,61	252	1	250,22
Klasse Premier USD, thesaurierend	2.554	7	362,48	10.891	28	390,01	5.971	17	345,82
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	2.297	5	422,69	3.421	8	455,60	3.359	8	405,51
Klasse Premier EUR, thesaurierend	18.525	41	452,06	12.422	25	435,74	32.007	74	358,89
Klasse LM USD, thesaurierend	25.289	127	198,96	25.866	121	213,40	16.734	89	188,04
Klasse LM EUR, thesaurierend	2.187	10	225,09	2.519	10	216,39	2.988	14	177,19
Klasse A (G) USD, thesaurierend	4.103	14	294,65	4.429	14	318,04	4.259	15	283,76
Klasse B (G) USD, thesaurierend	4	–	272,37	5	–	294,80	4	–	264,48
Klasse L (G) USD, thesaurierend	2.737	10	272,91	2.964	10	295,32	3.315	13	264,81
Klasse GA USD, thesaurierend	4.214	14	295,71	4.570	14	319,45	4.253	15	285,51
Klasse GA EUR, thesaurierend	371	1	423,04	401	1	409,60	381	1	340,21
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	465	1	421,87	530	1	408,46	628	2	339,19
Klasse GE USD, thesaurierend	110	–	271,86	119	–	294,80	107	–	265,46
Klasse GE EUR, thesaurierend	9	–	388,63	10	–	377,75	9	–	316,10
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 223.746	619	361,18	\$ 275.982	640	431,31	\$ 270.968	669	404,79
Klasse A USD, ausschüttend (A)	34.012	94	361,35	40.436	94	431,51	44.968	111	404,97
Klasse A EUR, thesaurierend	61.957	107	577,44	91.461	132	618,12	101.712	156	539,07
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	5.281	28	185,14	7.277	29	225,03	10.652	41	213,55
Klasse B USD, thesaurierend	69	–	329,53	182	–	394,51	286	1	372,10
Klasse B USD, ausschüttend (A)	38	–	334,57	158	–	400,54	153	–	377,79
Klasse C USD, thesaurierend	22.513	68	329,65	27.505	70	394,65	29.420	79	372,23
Klasse C USD, ausschüttend (A)	11.597	35	334,63	14.390	36	400,61	14.406	38	377,86
Klasse E USD, thesaurierend	10.280	53	195,41	13.185	56	234,24	13.376	60	221,49
Klasse E USD, ausschüttend (A)	149	1	189,52	195	1	227,17	543	3	214,81
Klasse F USD, thesaurierend	123.632	628	196,94	152.031	648	234,47	127.217	582	218,74
Klasse F USD ausschüttend (A)	15.646	80	196,53	25.793	110	233,98	23.530	108	218,27
Klasse U USD, thesaurierend	220.674	1.484	148,69	283.702	1.606	176,60	279.870	1.707	163,97
Klasse U USD, ausschüttend (Q)	–	–	–	–	–	–	1	–	100,36
Klasse U EUR, thesaurierend	53.596	293	182,05	89.392	411	193,77	78.474	389	167,22
Klasse X USD thesaurierend	29.887	136	220,47	39.088	149	262,44	37.103	152	244,77
Klasse X EUR, thesaurierend	860	5	171,41	1.009	5	182,92	2.519	13	158,78
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	3.077	18	167,61	6.550	29	203,10	22.281	96	191,59
Klasse X GBP, thesaurierend	7.017	24	254,76	8.173	23	262,72	11.471	35	235,79
Klasse Premier USD, thesaurierend	143.883	618	232,66	269.653	975	276,47	343.437	1.337	256,95
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	7.288	66	109,79	7.854	60	130,46	6.075	50	121,25
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	29.932	973	160,12	52.354	1.465	184,08	40.126	1.361	165,25
Klasse Premier EUR, thesaurierend	83.892	383	218,17	122.774	471	232,38	151.313	625	200,76
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	14.229	76	186,74	24.290	96	225,88	24.183	94	212,30
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	3.745	32	118,75	3.905	28	125,70	3.028	23	108,63
Klasse Premier GBP thesaurierend	61.165	204	258,39	87.385	245	265,81	76.820	232	237,99
Klasse LM USD, thesaurierend	98.795	458	215,76	103.953	407	255,58	73.392	311	236,06
Klasse LM EUR, thesaurierend	530	2	244,10	581	2	259,13	715	3	222,40
Klasse A (G) USD, thesaurierend	8.037	21	378,10	9.838	22	450,72	9.623	23	421,52
Klasse L (G) USD, thesaurierend	9.689	28	350,15	11.883	28	418,46	11.773	30	393,31
Klasse GA USD, thesaurierend	1.410	3	447,74	1.696	3	534,19	1.599	3	500,44
Klasse GA EUR, thesaurierend	17	–	568,43	20	–	607,83	18	–	529,17
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 65.237	322	202,32	\$ 82.146	347	236,91	\$ 112.488	409	274,96
Klasse A USD, ausschüttend (A)	17.294	85	202,45	20.870	88	237,06	26.846	98	275,13
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	4.559	44	151,47	5.832	45	179,96	15.024	92	211,12
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	48	–	104,56	60	–	124,19	72	–	146,13
Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)	1.073	54	137,96	1.338	52	161,19	649	23	183,04
Klasse A EUR, thesaurierend	7.805	24	325,07	9.335	24	341,16	13.920	31	367,91
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	507	4	140,60	671	4	167,18	1.685	7	196,27
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	11	–	101,66	15	–	120,90	19	–	141,97
Klasse A GBP, thesaurierend	364	2	164,70	476	2	167,01	876	3	186,61
Klasse A HKD, thesaurierend	201	13	122,22	276	15	142,49	319	15	164,15
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	18	1	145,73	22	1	173,54	33	1	204,05
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	1.541	1.300	1,66	2.297	1.598	1,95	3.193	1.878	2,27
Klasse B USD, thesaurierend	76	–	195,59	267	1	229,61	834	3	267,83
Klasse B USD, ausschüttend (A)	318	2	187,42	558	3	220,02	1.297	5	256,63
Klasse C USD, thesaurierend	7.167	37	195,53	9.131	40	229,54	11.861	44	267,74
Klasse C USD, ausschüttend (A)	8.888	47	187,43	12.112	55	220,03	16.444	64	256,64
Klasse E USD, thesaurierend	5.938	31	193,79	11.574	51	227,78	13.783	52	266,35
Klasse E USD, ausschüttend (A)	1.054	5	193,82	1.239	5	227,82	1.448	5	266,39
Klasse E EUR thesaurierend	8	–	81,99	10	–	86,39	–	–	–
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	118	1	118,27	157	1	141,17	254	1	167,02
Klasse F USD, thesaurierend	9.391	41	227,04	11.191	42	265,05	15.332	50	305,78
Klasse F USD ausschüttend (A)	2.018	9	227,20	2.748	10	265,24	2.523	8	306,00
Klasse X USD thesaurierend	4.092	25	162,95	5.160	27	190,19	8.992	41	219,30
Klasse X USD, ausschüttend (A)	739	4	181,12	877	4	211,39	1.284	5	243,75

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2022			28. Februar 2022			28. Februar 2021		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund (Fortsetzung)									
Klasse X EUR, thesaurierend	\$ 495	3	185,96	\$ 1.090	5	194,53	\$ 1.245	5	208,45
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	53	–	117,79	78	–	139,60	202	1	162,89
Klasse X GBP, thesaurierend	12.699	49	224,19	18.219	60	226,58	34.880	100	251,61
Klasse Premier USD, thesaurierend	183.771	676	271,81	238.793	754	316,67	362.817	997	363,87
Klasse Premier EUR, thesaurierend	2.643	8	316,46	3.121	8	330,46	4.163	10	352,84
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	10	–	298,28	12	–	311,48	14	–	332,81
Klasse Premier GBP, thesaurierend	241	2	123,31	303	2	124,41	190	1	137,65
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	395	3	125,35	672	3	147,39	1.187	5	170,27
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	50.526	156	278,56	68.221	181	281,04	100.113	231	311,15
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	1.142	33	146,83	1.336	30	169,20
Klasse LM EUR, thesaurierend	626	4	165,69	727	4	172,45	932	4	182,94
Klasse A (G) USD, thesaurierend	15.437	73	212,81	18.973	76	248,75	23.544	82	287,69
Klasse B (G) USD, thesaurierend	6	–	197,13	7	–	231,00	8	–	268,49
Klasse L (G) USD, thesaurierend	6.669	34	197,08	8.113	35	230,95	10.510	39	268,44
Klasse GA EUR, thesaurierend	126	–	342,68	147	–	359,23	173	–	386,56
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	59	–	341,39	70	–	357,88	81	–	385,09
Klasse GE USD, thesaurierend	59	–	247,04	69	–	290,04	81	–	338,37
Klasse GE EUR, thesaurierend	34	–	314,51	40	–	330,96	46	–	358,81
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 13.243	95	140,09	\$ 13.299	87	152,81	\$ 11.278	85	132,81
Klasse A USD, ausschüttend (A)	86	–	108,75	95	1	119,93	82	1	105,63
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	2.336	28	82,77	2.042	22	92,06	2.309	28	83,55
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	115	1	99,49	128	1	110,21	115	1	98,95
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	1.110	10	108,12	1.216	10	118,47	1.116	11	104,39
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.025	20	76,08	1.166	19	85,71	1.266	21	78,42
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	63	5	83,42	124	8	93,35	95	7	84,96
Klasse A EUR, thesaurierend	143	1	137,76	150	1	134,68	125	1	108,79
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.023	9	107,80	1.262	9	119,24	1.150	9	104,85
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	292	4	80,38	366	4	90,31	358	4	82,05
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	486	46	83,61	790	67	92,60	697	65	83,45
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.151	2.015	0,80	483	735	0,89	156	257	0,81
Klasse C USD, thesaurierend	851	6	133,09	972	7	145,53	724	6	127,12
Klasse C USD, ausschüttend (A)	107	1	108,57	246	2	119,46	219	2	105,27
Klasse C USD, ausschüttend (Q)	74	1	100,31	81	1	109,98	72	1	96,92
Klasse F USD, thesaurierend	18.313	138	132,94	20.648	143	144,58	18.703	150	124,91
Klasse F EUR, thesaurierend	56	–	144,33	61	–	140,68	52	–	112,95
Klasse F EUR, ausschüttend (A)	80	1	118,04	88	1	116,98	78	1	95,69
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	34	–	103,38
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	50	1	97,44	62	1	109,21	60	1	98,61
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^A									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 48.382	334	144,71	\$ 48.817	304	160,43	\$ 5.832	40	146,35
Klasse A USD, ausschüttend (A)	9.054	40	226,87	10.463	42	251,52	1.827	8	229,43
Klasse A EUR, thesaurierend	1	–	100,71	–	–	–	–	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	20.938	105	197,61	49.413	198	223,06	11.129	45	205,65
Klasse A SEK, thesaurierend	58.551	4.526	137,89	66.724	4.656	135,75	65.440	5.012	110,24
Klasse F USD, thesaurierend	5.934	40	146,74	6.403	39	162,19	2.693	18	147,06
Klasse X USD, thesaurierend	7.854	64	122,74	20.266	149	135,66	8.802	72	123,01
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1.074	5	236,27	1.622	6	261,15	745	3	236,80
Klasse X EUR, thesaurierend	838	7	115,12	927	7	114,04	–	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.188	6	206,15	1.823	7	231,69	2.081	8	212,45
Klasse X GBP, thesaurierend	418.249	1.238	290,72	237.295	635	278,51	28.773	85	243,38
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	1.900	13	126,67	2.436	13	141,45	4.373	24	128,91
Klasse Premier USD, thesaurierend	124.470	940	132,41	167.377	1.146	146,09	63.369	480	132,00
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	34.327	144	237,98	35.826	136	262,86	4.771	20	238,06
Klasse Premier EUR, thesaurierend	1	–	105,30	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.839	13	211,43	2.203	8	237,15	63	–	216,57
Klasse Premier GBP, thesaurierend	10.304	28	314,39	4.987	12	300,59	686	2	261,26
Klasse S USD, thesaurierend	582.798	3.423	170,28	601.256	3.203	187,69	197.075	1.164	169,25
Klasse S EUR, thesaurierend	51.575	354	145,10	56.873	354	143,34	25.552	176	120,17
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	1.221	10	124,69	7.774	50	139,69	391	3	127,30
Klasse S GBP, thesaurierend	144.325	810	153,39	161.607	823	146,43	137.242	774	127,22
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	63.343	412	132,23	78.117	395	147,25	79.258	426	133,44
Klasse S GBP, ausschüttend (Q)	14.580	83	151,03	15.238	79	144,37	5.122	29	126,04
Klasse LM EUR, thesaurierend	29.285	255	114,19	21.868	173	112,61	–	–	–
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^A									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 663	5	132,49	\$ 754	5	150,84	\$ 768	5	153,62
Klasse Premier USD, thesaurierend	12.009	87	138,13	15.264	98	156,48	10.321	65	157,77
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^A									
Klasse A USD thesaurierend	€ 24.742	1.972	12,61	€ 30.452	2.723	12,54	€ 653	71	11,16
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	95.948	5.936	16,24	49.791	3.885	14,37	33.140	3.397	11,77
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	52.152	4.400	11,91	47.028	4.911	10,74	42.617	5.678	9,06
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	3.242	230	14,17	3.039	242	14,09	2.622	252	12,54
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3.226	416	11,38	5.707	853	10,33	1.380	248	8,74
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	11.512	6.780	11,79	7.660	5.083	10,67	3.391	2.946	9,00
Klasse A EUR, thesaurierend	133.145	8.522	15,62	73.628	5.290	13,92	63.844	5.563	11,48
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	8.399	690	12,17	5.029	436	11,54	1.500	150	9,98
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	103	10	10,24	–	–	–	–	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	3.773	274	13,79	2.624	210	12,47	2.565	244	10,52
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	6.706	8.096	1,16	4.158	6.018	1,05	1.432	2.599	0,89
Klasse C USD, thesaurierend	4.163	345	12,12	3.683	342	12,08	234	26	10,80
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)	1.423	93	15,40	646	53	13,66	719	77	11,25
Klasse E USD, thesaurierend	9.564	680	14,14	8.126	646	14,10	3.205	307	12,61
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	2.383	189	12,68	904	90	11,26	–	–	–
Klasse F USD, thesaurierend	5.162	403	12,88	1.537	135	12,77	1.008	108	11,27
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)	5.966	369	16,26	1.840	144	14,34	1.447	149	11,68
Klasse X USD thesaurierend	1.236	99	12,59	67	6	12,46	490	54	10,96
Klasse X USD, ausschüttend (A)	561	45	12,63	447	40	12,62	350	38	11,10
Klasse X EUR, thesaurierend	40.941	2.575	15,90	26.937	1.910	14,10	30.951	2.686	11,52
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	7.912	641	12,34	2.536	218	11,65	49	5	9,74
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	1.993	129	13,99	1.489	108	11,53	407	36	9,85
Klasse X GBP ausschüttend (Q) (abgesichert)	888	67	11,43	810	67	10,15	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	55.849	3.420	16,41	11.876	820	16,23	4.064	344	14,25
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	8.043	2.034	20,67	5.511	1.828	17,42	3.264	1.628	13,56
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	59.464	6.452	12,16	51.721	6.384	11,51	40.525	6.247	9,96
Premier Klasse CAD, ausschüttend (Q) Plus (e)	6.184	710	11,50	6.322	811	11,08	10.003	1.547	9,93
Klasse Premier EUR, thesaurierend	404.762	15.780	25,65	207.952	9.151	22,73	237.729	12.828	18,53
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	8.004	610	13,13	7.393	596	12,40	7.045	664	10,61
Klasse Premier GBP, thesaurierend	6.085	296	17,81	6.622	363	15,25	7.247	487	12,89
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	30.636	1.187	22,32	21.555	844	21,34	66.461	3.156	18,24
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)	80.414	4.541	15,32	74.334	4.710	13,19	31.325	2.408	11,27
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	5.346	625	10,33

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2022			28. Februar 2022			28. Februar 2021		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[▲]									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 216	3	82,87	\$ 224	3	87,06	\$ 220	3	85,51
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	166	2	79,08	174	2	83,85	171	2	82,87
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	575	7	76,76	679	7	81,36	719	7	80,01
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	697	7	86,09	730	7	79,04	709	7	75,08
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	726	9	77,60	858	9	82,16	906	9	80,64
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[▲]									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 27.337	260	105,16	\$ 17.858	169	105,90	\$ –	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	63.765	628	101,62	28.785	274	104,96	–	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	74.120	727	101,96	74.314	707	105,12	–	–	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	8.937	133	98,14	5.538	75	102,34	–	–	–
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	820	57	99,90	315	19	103,79	–	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus (e)	8	–	96,96	–	–	–	–	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	7.079	72	97,34	3.929	34	101,92	–	–	–
Klasse A GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	3.406	30	97,43	136	1	101,30	–	–	–
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	2.596	197	103,22	1.827	135	106,10	–	–	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	63.899	90.190	0,99	27.834	36.826	1,02	–	–	–
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	41.232	400	102,96	322	3	105,76	–	–	–
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)	231	2	94,01	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	1.056	10	101,63	645	5	105,94	–	–	–
Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	475	4	97,67	160	1	100,27	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	8.083	87	92,78	4.720	46	102,52	–	–	–
Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus	78.704	782	100,61	4.994	48	103,28	–	–	–
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1.252	12	101,50	155	1	105,08	–	–	–
Klasse S USD, thesaurierend	20.764	193	107,47	263	2	107,42	–	–	–
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	10.309	101	101,96	1.599	15	104,48	–	–	–
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 134.587	521	258,43	\$ 179.306	607	295,45	\$ 195.259	685	284,92
Klasse A USD, ausschüttend (A)	28.351	36	784,85	35.534	40	897,28	140.142	162	865,30
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	5.204	38	198,20	7.110	43	230,14	12.929	75	225,06
Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)	2.066	81	176,92	2.416	76	201,78	4.099	140	190,47
Klasse A EUR, thesaurierend	35.869	106	336,38	46.391	120	344,60	25.796	69	309,18
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	6.132	31	194,24	14.213	56	225,70	24.268	91	220,36
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	299	2	147,81	385	2	171,75	49	–	168,13
Klasse A GBP thesaurierend (abgesichert)	412	2	159,88	1.070	4	184,68	696	3	179,40
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	647	2	351,31	778	2	347,78	966	2	323,02
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	117	7	190,76	88	4	222,22	703	27	217,39
Klasse A SGD, thesaurierend	9.683	5.131	2,64	11.147	5.166	2,93	14.111	6.772	2,78
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	23.101	13.116	2,46	26.201	12.563	2,83	35.065	17.096	2,73
Klasse B USD, thesaurierend	109	–	267,57	127	–	306,67	171	1	297,23
Klasse B USD, ausschüttend (A)	19	–	115,63	22	–	820,22	8	–	795,02
Klasse C USD, thesaurierend	11.153	42	268,04	13.207	43	307,21	5.457	18	297,74
Klasse C USD, ausschüttend (A)	4.872	7	710,95	5.656	7	814,85	5.845	7	789,75
Klasse E USD, thesaurierend	9.838	41	239,77	11.386	41	275,16	10.042	38	267,35
Klasse E USD, ausschüttend (A)	460	2	239,73	528	2	275,11	503	2	267,30
Klasse E EUR, thesaurierend	1.025	3	342,17	1.274	3	351,98	484	1	318,29
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	803	5	155,67	1.109	5	181,52	691	3	178,54
Klasse F USD, thesaurierend	18.667	67	280,21	26.949	84	319,38	22.736	74	306,15
Klasse F USD, ausschüttend (A)	246	1	280,51	244	1	319,72	1.035	3	306,48
Klasse R USD, thesaurierend	–	–	99,96	–	–	113,60	–	–	108,92
Klasse R EUR, thesaurierend	274	1	263,13	307	1	268,95	682	2	239,43
Klasse X USD thesaurierend	19.762	80	248,29	33.276	118	282,78	74.290	274	270,67
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1.192	7	172,15	1.492	8	196,06	1.171	6	187,66
Klasse X EUR, thesaurierend	8.563	51	168,65	13.906	72	172,19	24.787	134	153,27
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	6.073	35	172,15	22.708	102	199,32	20.713	89	193,11
Klasse X GBP, thesaurierend	33.768	84	346,99	42.807	93	342,20	44.009	100	315,55
Klasse X GBP, ausschüttend (A)	3.559	10	317,70	4.309	10	313,21	3.573	9	288,84
Klasse Premier USD, thesaurierend	184.563	565	326,90	257.090	692	371,66	365.342	1.031	354,49
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	9.830	340	150,39	17.351	541	165,25	4.889	179	152,66
Klasse Premier EUR, thesaurierend	41.024	87	470,29	63.706	119	479,41	17.922	35	425,24
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	2.911	16	186,32	960	4	215,21	28.744	115	207,71
Klasse Premier GBP, thesaurierend	49.814	130	329,52	67.856	156	324,40	198.528	478	298,40
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	2.847	104	129,26	5.300	152	146,12	3.158	85	139,89
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 30.585	144	212,01	\$ 35.531	154	231,37	\$ 38.798	166	233,20
Klasse A USD, ausschüttend (A)	9.146	25	359,06	11.155	28	391,87	10.678	27	394,99
Klasse A EUR, thesaurierend	1.497	4	368,42	1.975	5	360,17	2.555	6	337,84
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	141	1	149,24	174	1	165,50	1.279	6	168,85
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	20	–	260,96	111	–	255,46	130	–	239,35
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	–	–	365,09	–	–	345,13	–	–	334,96
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	2	–	150,53	1	–	167,25	10	–	170,83
Klasse C USD, thesaurierend	2.764	13	206,19	3.094	14	225,58	3.233	14	228,51
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2.558	8	325,92	2.999	8	356,61	3.486	10	361,25
Klasse E USD, thesaurierend	633	3	221,22	750	3	242,35	779	3	246,11
Klasse E USD, ausschüttend (A)	3	–	130,19	8	–	142,67	5	–	144,88
Klasse E EUR thesaurierend	8	–	153,52	8	–	150,73	31	–	142,25
Klasse F USD, thesaurierend	10.319	39	262,11	10.813	38	285,20	7.263	25	285,75
Klasse F USD ausschüttend (A)	500	2	280,39	543	2	305,10	298	1	305,68
Klasse R USD, thesaurierend	136	1	153,82	212	1	167,46	286	2	167,95
Klasse X USD thesaurierend	194	1	189,54	333	2	206,08	300	1	206,22
Klasse X USD, ausschüttend (A)	–	–	86,88	–	–	94,37	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	682	2	287,01	966	3	311,50	2.212	7	310,55
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	12.140	61	199,74	14.320	66	216,79	14.478	67	216,83
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	1.458	5	275,84	1.769	5	259,24	1.763	5	249,62
Klasse LM EUR, thesaurierend	693	3	214,87	854	4	208,25	1.058	5	191,48
Klasse A (G) USD, thesaurierend	884	4	237,22	1.022	4	258,11	1.031	4	258,61
Klasse L (G) USD, thesaurierend	893	4	219,56	1.174	5	239,50	1.299	5	241,16
Royce Global Small Cap Premier Fund[▲]									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 8	–	79,01	\$ 9	–	90,44	–	–	–
Klasse X USD thesaurierend	8	–	79,46	9	–	90,61	–	–	–
Klasse X GBP, thesaurierend	1	–	96,09	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	3.967	50	79,66	4.516	50	90,69	–	–	–
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^{▲μ}									
Klasse A USD thesaurierend	€ –	–	–	€ 608	7	100,59	€ 589	7	96,37
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	1.157	9	144,30	1.105	10	127,44
Klasse A USD, ausschüttend (A)	–	–	–	762	5	183,06	848	6	178,41
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	4.140	48	97,65	3.462	46	90,33
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	1.402	23	92,61	1.638	30	85,96
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	–	–	–	158	11	102,33	41	3	94,91
Klasse A EUR, thesaurierend	–	–	–	333	2	195,74	300	2	174,14
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	–	–	–	84	1	166,20	88	1	150,48
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	–	–	–	430	4	97,95	263	3	90,68

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2022			28. Februar 2022			28. Februar 2021					
	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:			
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^µ (Fortsetzung)												
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	€	–	–	€	224	390	0,87	€	105	208	0,81	
Klasse B USD, thesaurierend	–	–	–	–	14	–	93,06	–	110	1	89,46	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	56	–	180,51	–	50	–	175,95	
Klasse C USD, thesaurierend	–	–	–	–	144	2	94,91	–	130	2	91,38	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	1.236	8	180,39	–	1.172	8	175,82	
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	123	1	102,25	–	–	–	–	
Klasse F USD, thesaurierend	–	–	–	–	290	3	124,53	–	1.700	17	118,52	
Klasse X EUR, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	104,43	–	–	–	–	
Klasse Premier USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	–	–	1.201	15	99,89	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	–	–	–	–	53	–	144,35	–	47	–	127,12	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	480	18	127,46	–	192	8	111,34	
Klasse LM USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	–	–	3.967	38	126,84	
Klasse LM EUR, thesaurierend	–	–	–	–	2.034	15	137,11	–	2.251	19	119,96	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	–	–	–	–	958	10	104,34	–	882	11	99,58	
Klasse B (G) USD, thesaurierend	–	–	–	–	1	–	96,33	–	2	–	92,36	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	–	–	–	–	95	1	96,85	–	128	2	92,95	
Klasse GA USD, thesaurierend	–	–	–	–	870	5	178,58	–	836	6	170,54	
Klasse GA EUR, thesaurierend	–	–	–	–	12.539	62	201,63	–	12.130	68	178,93	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	–	–	–	–	101	1	158,26	–	92	1	143,16	
Klasse GE USD, thesaurierend	–	–	–	–	44	–	163,28	–	39	–	157,10	
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund												
Klasse A USD thesaurierend	\$	1.690	12	139,98	\$	2.058	13	156,45	\$	2.643	17	151,45
Klasse A USD, ausschüttend (A)	–	2.862	13	224,42	–	3.344	13	258,01	–	3.494	14	254,57
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	–	3.205	38	85,22	–	3.851	40	97,45	–	6.019	61	98,58
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	2.412	42	84,40	–	2.093	30	97,46	–	3.221	42	99,18
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	–	177	16	76,46	–	223	16	87,97	–	220	16	89,12
Klasse A EUR, thesaurierend	–	263	2	141,04	–	249	2	141,19	–	73	–	127,23
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	–	1.710	156	85,92	–	2.075	166	97,83	–	2.429	192	98,24
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	35	53	0,92	–	33	42	1,05	–	78	97	1,07
Klasse B USD, ausschüttend (A)	–	26	–	219,13	–	43	–	251,36	–	42	–	248,16
Klasse C USD, thesaurierend	–	97	1	96,05	–	109	1	107,62	–	100	1	104,71
Klasse C USD, ausschüttend (A)	–	1.450	7	217,94	–	1.632	7	250,00	–	1.711	7	246,82
Klasse E USD, thesaurierend	–	14	–	131,05	–	16	–	147,17	–	78	1	143,65
Klasse E USD, ausschüttend (A)	–	10	–	92,38	–	11	–	105,87	–	11	–	104,55
Klasse F USD, thesaurierend	–	26	–	125,04	–	29	–	139,46	–	28	–	134,31
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	–	13	–	132,68	–	2.281	66	145,76	–	3.041	82	139,65
Klasse GA USD, thesaurierend	–	6.388	45	140,68	–	7.183	46	157,32	–	7.174	47	152,29
Klasse GA EUR, thesaurierend	–	121	1	178,09	–	135	1	178,49	–	149	1	160,59
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	–	2	–	147,85	–	2	–	152,37	–	23	–	139,53
Klasse GE USD, thesaurierend	–	459	4	128,57	–	516	4	144,31	–	503	4	140,75
Klasse GE EUR, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	151,55
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^Δ												
Klasse A USD thesaurierend	\$	–	–	–	\$	–	–	–	\$	141	2	81,33
Klasse A USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	69	1	84,68
Klasse A EUR, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	–	–	–	1	–	119,52
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	40	–	105,28
Klasse B USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	9	–	82,73
Klasse C USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	–	–	–	9	–	84,77
Klasse C USD, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	91	1	82,69
Klasse E USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	–	–	–	32	–	95,64
Klasse Premier EUR, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	–	–	–	14.347	90	132,45
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^{Δα}												
Klasse A USD thesaurierend	\$	–	–	–	\$	2.462	12	198,91	\$	2.204	12	178,06
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	352	3	104,25	–	738	8	98,07
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	457	6	98,09	–	693	10	92,91
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	173	13	104,77	–	1.174	93	97,94
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	53	68	1,06	–	33	44	0,99
Klasse X USD thesaurierend	–	–	–	–	–	1	–	104,34	–	–	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	2.811	25	110,91	–	1.872	19	98,27
Klasse GA USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	3.958	20	202,76	–	3.683	20	181,40
Klasse GA EUR, thesaurierend	–	–	–	–	–	1.589	5	259,07	–	1.656	6	215,40
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	342	1	220,29	–	321	1	186,39
Klasse GE USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	49	–	187,12	–	44	–	168,67
Klasse GE EUR, thesaurierend	–	–	–	–	–	296	1	238,91	–	267	1	200,13
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^Δ												
Klasse A USD thesaurierend	\$	20	–	116,19	\$	22	–	133,46	\$	2	–	159,99
Klasse M GBP, ausschüttend (A)	–	1.738	87	17,28	–	2.262	98	17,20	–	2.890	105	19,71
Klasse F USD, thesaurierend	–	1	–	120,64	–	1	–	138,19	–	1	–	164,53
Klasse M USD ausschüttend (A)	–	321	26	12,55	–	367	25	14,43	–	57.186	3.332	17,16
Klasse M EUR, ausschüttend (A)	–	62	4	16,20	–	72	4	16,69	–	286	13	18,44
Klasse Premier USD, thesaurierend	–	11.699	131	89,50	–	13.357	131	102,18	–	19.627	162	121,06
Klasse Premier GBP, thesaurierend	–	33	–	106,65	–	37	–	105,44	–	88	1	120,25
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^Δ												
Klasse A (PF) USD, thesaurierend	€	–	–	–	€	–	–	–	€	1	–	97,46
Klasse A (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	1	–	100,77
Klasse A (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	6.106	538	13,70
Klasse A (PF) EUR, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	–	–	–	2.601	28	91,77
Klasse A (PF) EUR, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	2.836	238	11,92
Klasse A (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	4	–	12,54
Klasse F (PF) USD, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	–	–	–	1	–	99,51
Klasse F (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	1	–	102,68
Klasse M (PF) USD ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	2.236	195	13,84
Klasse M (PF) EUR, thesaurierend	–	–	–	–	–	–	–	–	–	3.504	37	93,51
Klasse M (PF) EUR, ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	7.263	582	12,47
Klasse M (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	1.284	85	13,06
Klasse M (PF) NOK, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	21	2	94,45
Klasse M (PF) SEK, ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	928	102	92,98
Klasse Premier (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	11.374	135	101,29
Klasse Premier (PF) BRL, thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	–	–	–	2.182	152	97,18
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^Δ												
Klasse A USD thesaurierend	\$	4.658	31	151,96	\$	6.471	34	190,12	\$	1.557	8	202,89
Klasse A EUR, thesaurierend	–	6.350	38	167,33	–	3.973	19	187,53	–	2.320	10	186,03
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	–	12.569	169	73,94	–	22.933	217	94,30	–	–	–	–
Klasse C USD, thesaurierend	–	169	3	64,87	–	212	3	81,36	–	–	–	–
Klasse E USD, thesaurierend	–	2.646	26	100,65	–	4.240	34	126,41	–	1.896	14	135,92
Klasse F USD, thesaurierend	–	199	3	65,25	–	249	3	81,38	–	–	–	–
Klasse X USD thesaurierend	–	84	1	74,05	–	105	1	92,29	–	–	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend	–	161	1	175,03	–	104	–	195,54	–	81	–	192,44

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2022			28. Februar 2022			28. Februar 2021		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^] (Fortsetzung)									
Klasse X GBP, thesaurierend	\$ 1.172	6	180,26	\$ 1.631	6	194,52	\$ 1.685	6	198,38
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1.017	6	144,11	1.876	8	181,95	851	3	193,82
Klasse Premier USD, thesaurierend	24.628	152	162,40	37.745	187	202,05	14.752	69	213,26
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	390	3	100,08	568	3	126,13	749	4	133,90
Klasse S USD, thesaurierend	5.387	63	85,64	7.523	71	106,36	33.171	296	111,88
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	73.107	960	75,81	58.847	547	95,95	–	–	–
Klasse S GBP, thesaurierend	18.956	86	190,34	22.904	83	204,70	47.287	164	207,39
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund									
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	\$ 5.800	64	90,19	\$ 6.166	63	98,23	\$ 5.757	60	96,60
Klasse A AUD, ausschüttend (M) Plus	458	7	98,92	487	7	101,33	455	6	93,44
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus (e)	461	5	99,16	490	5	96,80	458	4	88,46
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	47	70	0,93	54	75	0,98	67	95	0,94
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	588	8	101,68	684	8	111,38	379	5	109,14
Klasse D CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1	–	103,78	1	–	113,18	1	–	110,34
Klasse D HKD, ausschüttend (M) Plus	1	–	106,00	1	–	114,51	1	–	110,55
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	308	414	1,04	1.016	1.221	1,13	1.015	1.230	1,10
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	1.048	10	104,63	856	8	113,52	505	5	110,45
Klasse D USD, thesaurierend	5.549	48	116,01	5.888	48	123,07	5.734	50	114,42
Klasse X AUD, thesaurierend	236	3	126,97	350	4	126,73	233	3	111,09
Klasse X USD thesaurierend	5.804	46	127,03	6.077	45	134,52	5.601	45	124,63
Klasse S GBP, thesaurierend	488	3	151,96	515	3	138,89	474	3	123,09
Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)	488	4	112,97	515	4	105,80	474	3	98,77
Klasse LM AUD, thesaurierend	4.258	48	128,52	4.834	52	127,51	5.422	64	110,28
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 3.892	43	90,50	\$ 7.343	68	108,56	\$ 4.928	37	133,66
Klasse E USD, thesaurierend	392	4	101,04	402	3	121,66	477	3	150,92
Klasse F USD, thesaurierend	13.924	122	114,31	11.843	87	136,70	2.510	15	167,30
Klasse X USD thesaurierend	2	–	97,81	656	6	116,89	801	6	142,84
Klasse Premier USD, thesaurierend	4.351	44	99,45	6.709	57	118,63	7.740	54	144,46
Klasse S USD, thesaurierend	805	7	120,76	2.252	16	143,91	3.225	18	174,89
Klasse S EUR, thesaurierend	10.635	94	112,66	18.633	138	120,24	22.120	135	135,80
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^]									
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	37	1	74,84	€ 39	1	86,53	–	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend	3.283	25	129,12	7.094	47	151,56	869	6	148,44
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	37	1	74,35	38	1	86,29	–	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend	869	7	132,85	1.877	12	155,36	661	4	151,02
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	2.288	137	87,06	3.184	191	96,48	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend	1.049	8	134,64	26.577	169	157,16	17.885	117	152,24
Klasse S USD, thesaurierend	502	5	96,68	–	–	–	87.876	1.077	98,43
Klasse S EUR, thesaurierend	83.802	713	117,56	145.601	1.063	136,96	4.080	31	132,14
Klasse S GBP, thesaurierend	108.502	1.351	69,49	119.180	1.273	78,23	–	–	–

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

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

α Mit Wirkung vom 27. April 2022 stellte der Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

β Mit Wirkung zum 21. Juni 2022 stellten der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und der Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] den Handel ein.

μ Mit Wirkung zum 11. Juli 2022 stellte der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Gesamtergebnisrechnung

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund		Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund		Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund		Legg Mason Western Asset Core Plus Bond Fund EUR	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenden- und Anleihezinsen	\$ 4.265	\$ 369	\$ 3.207	\$ 3.552	\$ 24.148	\$ 22.798	€ 1.063	€ 726
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	–	–	–	2	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	(14.071)	(2.041)	(80.758)	7.658	(1.805)	(47)
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	(10.394)	4.695	(100.138)	10.353	(15.176)	784
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	4.265	369	(21.258)	6.206	(156.746)	40.809	(15.918)	1.463
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	2.535	2.619	725	1.124	3.948	4.859	16	18
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	115	117	74	87	504	470	52	36
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	90	123	169	297	1	1
Anwaltsgebühren	–	12	3	2	16	11	1	1
Prüfungsgebühren	9	11	19	22	19	22	12	12
Druckgebühren	33	37	9	12	49	68	5	4
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	10	13	6	11
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	3	3	1	1	5	5	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	37	47	40	22	173	108	16	10
Gesamtaufwendungen	2.732	2.846	961	1.393	4.893	5.853	109	93
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(645)	(2.522)	(2)	–	–	–	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	2.087	324	959	1.393	4.893	5.853	109	93
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	2.178	45	(22.217)	4.813	(161.639)	34.956	(16.027)	1.370
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(1.825)	(37)	(993)	(803)	(1.354)	(1.311)	(3)	(1)
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	353	8	(23.210)	4.010	(162.993)	33.645	(16.030)	1.369
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	–	2	1	(106)	(44)	1	2
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 353	\$ 8	\$ (23.208)	\$ 4.011	\$ (163.099)	\$ 33.601	€ (16.029)	€ 1.371

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenden- und Anleihezinsen	\$ 2.104	\$ 2.376	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.650	\$ 1.207
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	(1)	–	–	–	–	–	–	5
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	1	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(2.124)	2.094	–	–	–	–	(2.945)	1.454
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(8.536)	(885)	–	–	–	–	(1.696)	(438)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	(8.557)	3.585	–	–	–	1	(2.991)	2.228
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	339	554	–	–	–	–	56	37
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	27	33	–	–	–	–	17	18
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	44	57	–	–	–	–	7	6
Anwaltsgebühren	1	1	–	–	–	–	1	–
Prüfungsgebühren	13	15	–	–	–	–	14	15
Druckgebühren	4	4	–	–	–	–	2	2
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	1	–	–	–	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	1	–	–
Sonstige Aufwendungen	16	14	–	–	–	–	15	8
Gesamtaufwendungen	445	678	–	–	–	1	112	86
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(6)	–	–	–	–	–	(13)	(1)
Nettoaufwendungen insgesamt	439	678	–	–	–	1	99	85
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	(8.996)	2.907	–	–	–	–	(3.090)	2.143
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(1.145)	(1.281)	–	–	–	–	(153)	–
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	(10.141)	1.626	–	–	–	–	(3.243)	2.143
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(31)	(8)	–	–	–	–	1	1
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ (10.172)	\$ 1.618	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (3.242)	\$ 2.144

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (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 ^{αβ}	
für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
\$ 1.263	\$ 805	\$ 6.438	\$ 10.318	\$ 7.237	\$ 6.260	\$ 935	\$ 749	\$ 357	\$ 895
-	-	-	1	-	-	-	-	-	-
-	-	2	(11)	-	-	1	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(1.074)	551	(4.430)	16.689	(10.347)	3.442	(1.747)	(109)	(5.080)	272
(3.503)	(189)	(34.486)	(15.527)	(19.738)	(559)	(1.113)	(10)	2.932	(242)
(3.314)	1.167	(32.476)	11.470	(22.848)	9.143	(1.924)	630	(1.791)	925
243	209	634	991	604	775	103	156	2	5
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
19	14	95	158	78	72	17	14	7	15
27	18	42	67	55	69	7	11	-	-
1	-	4	4	3	1	-	-	-	-
13	15	19	22	13	15	12	12	10	11
2	1	12	24	8	9	3	1	1	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	2	5	1	-	-	-	-	-
-	-	1	2	1	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
14	8	59	43	36	20	26	8	10	6
319	265	868	1.316	799	962	168	202	30	39
(15)	(9)	-	(1)	-	-	(14)	(7)	(16)	-
304	256	868	1.315	799	962	154	195	14	39
(3.618)	911	(33.344)	10.155	(23.647)	8.181	(2.078)	435	(1.805)	886
(273)	(236)	(2.456)	(3.289)	(1.739)	(1.400)	(581)	(298)	(319)	(816)
(3.891)	675	(35.800)	6.866	(25.386)	6.781	(2.659)	137	(2.124)	70
(1)	(2)	(114)	(124)	(72)	(25)	(9)	(11)	10	1
\$ (3.892)	\$ 673	\$ (35.914)	\$ 6.742	\$ (25.458)	\$ 6.756	\$ (2.668)	\$ 126	\$ (2.114)	\$ 71
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 ^α		Legg Mason Western Asset Global Credit Fund ^α		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund ^{αβ}	
für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
\$ 9.357	\$ 11.611	\$ 2.505	\$ 2.785	\$ 2.133	\$ 2.714	\$ 1.056	\$ 1.074	€ 404	€ 1.018
2	2	-	-	-	-	-	-	-	-
-	(14)	-	-	-	-	-	-	-	(1)
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(6.813)	(2.691)	(9.961)	8.805	(4.143)	2.965	2.884	1.742	(3.793)	39
(44.878)	(3.439)	(51.207)	(15.138)	(19.964)	(22)	(11.850)	(681)	992	279
(42.332)	5.469	(58.663)	(3.548)	(21.974)	5.657	(7.910)	2.135	(2.397)	1.335
1.632	2.217	752	990	125	301	13	21	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
164	180	135	153	60	82	27	28	8	18
104	170	53	64	2	-	2	3	-	-
6	4	5	3	2	2	1	1	-	-
19	22	13	15	13	15	13	15	12	12
17	26	16	22	8	12	3	3	2	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	5	4	1	1	1	1	14	17
2	2	1	1	1	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
75	54	49	40	36	22	13	10	3	7
2.019	2.675	1.029	1.292	248	436	73	82	39	56
-	(1)	-	(2)	-	-	-	-	(11)	-
2.019	2.674	1.029	1.290	248	436	73	82	28	56
(44.351)	2.795	(59.692)	(4.838)	(22.222)	5.221	(7.983)	2.053	(2.425)	1.279
(4.320)	(6.161)	(1.426)	(1.638)	-	-	-	-	(1)	(153)
(48.671)	(3.366)	(61.118)	(6.476)	(22.222)	5.221	(7.983)	2.053	(2.426)	1.126
(295)	(344)	-	6	(46)	(27)	(5)	-	-	-
\$ (48.966)	\$ (3.710)	\$ (61.118)	\$ (6.470)	\$ (22.268)	\$ 5.194	\$ (7.988)	\$ 2.053	€ (2.426)	€ 1.126

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund [^]		Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund [^]	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
	ANLAGEERTRÄGE:							
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen	\$ 58.441	\$ 142.994	\$ –	\$ –	\$ 8.907	\$ 25.989	\$ –	\$ –
Zinsen	98	17	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	(327)	(811)	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(477.283)	325.097	–	–	(46.892)	20.003	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(48.388)	(74.100)	–	–	(24.721)	(31.723)	–	–
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	(467.459)	393.197	–	–	(62.706)	14.269	–	–
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	17.305	37.611	–	–	161	135	–	–
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	993	1.888	–	–	113	331	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	1.201	2.406	–	–	–	–	–	–
Anwaltsgebühren	62	47	–	–	10	8	–	–
Prüfungsgebühren	19	22	–	–	13	15	–	–
Druckgebühren	143	286	–	–	27	47	–	–
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	89	95	–	–	3	6	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	14	21	–	–	1	3	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	493	417	–	–	63	70	–	–
Gesamtaufwendungen	20.319	42.793	–	–	391	615	–	–
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	20.319	42.793	–	–	391	615	–	–
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	(487.778)	350.404	–	–	(63.097)	13.654	–	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	(9.115)	(25.128)	–	–	(299)	(19)	–	–
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	(496.893)	325.276	–	–	(63.396)	13.635	–	–
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(4.053)	(3.879)	–	–	(83)	(180)	–	–
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ (500.946)	\$ 321.397	\$ –	\$ –	\$ (63.479)	\$ 13.455	\$ –	\$ –

(in Tsd.)	Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
	ANLAGEERTRÄGE:							
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen	\$ 118	\$ –	\$ 3.864	\$ 3.743	\$ 10.072	\$ 11.371	\$ 356	325
Zinsen	–	–	1	–	2	–	–	–
Ausgleich	–	–	(21)	(21)	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	524	–	(17.945)	(4.618)	(64.076)	(5.581)	(1.289)	408
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(1.495)	–	(16.282)	(3.026)	(20.744)	(20.756)	(284)	(188)
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	(853)	–	(30.383)	(3.922)	(74.746)	(14.966)	(1.217)	545
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	14	–	689	1.158	904	1.616	26	29
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	10	–	72	95	226	219	7	6
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	101	151	4	4	–	–
Anwaltsgebühren	–	–	2	2	7	5	–	–
Prüfungsgebühren	9	–	19	22	13	15	13	15
Druckgebühren	–	–	1	15	24	32	1	1
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	2	–	21	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	–	2	2	2	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	9	–	21	32	82	55	7	6
Gesamtaufwendungen	42	–	907	1.477	1.283	1.948	54	57
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(21)	–	–	–	–	–	(20)	(19)
Nettoaufwendungen insgesamt	21	–	907	1.477	1.283	1.948	34	38
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	(874)	–	(31.290)	(5.399)	(76.029)	(16.914)	(1.251)	507
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	–	–	(349)	(554)	(668)	(674)	(3)	(3)
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	(874)	–	(31.639)	(5.953)	(76.697)	(17.588)	(1.254)	504
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(1)	–	(88)	(100)	(469)	(410)	(2)	1
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ (875)	\$ –	\$ (31.727)	\$ (6.053)	\$ (77.166)	\$ (17.998)	\$ (1.256)	\$ 505

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

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 [^]	
für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
\$ 13.236	\$ 18.881	\$ 15.600	\$ 10.323	£ 947	£ 884	\$ 2.896	\$ 2.868	\$ 295	\$ 299
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	(12)	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(24.228)	(7.772)	(25.430)	256	(813)	110	(22.966)	3.700	(2.306)	1
(26.455)	22.701	(67.968)	(6.862)	(8.519)	1.068	(17.109)	(2.324)	(923)	445
(37.447)	33.798	(77.798)	3.717	(8.385)	2.062	(37.179)	4.244	(2.934)	745
841	2.158	28	5	-	-	34	33	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
265	346	384	284	26	25	56	58	9	9
15	33	-	-	-	-	-	1	-	-
19	8	11	6	1	1	2	1	-	-
20	22	13	15	8	8	13	15	18	20
35	47	33	39	2	3	6	8	1	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	-	-	-	-	1	1	-	-	-
3	3	3	2	-	-	1	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
101	54	94	46	9	5	21	15	17	12
1.300	2.671	566	397	46	43	134	131	45	42
-	-	-	-	-	-	-	-	(45)	(42)
1.300	2.671	566	397	46	43	134	131	-	-
(38.747)	31.127	(78.364)	3.320	(8.431)	2.019	(37.313)	4.113	(2.934)	745
(477)	(1.523)	-	-	-	-	-	-	(290)	(279)
(39.224)	29.604	(78.364)	3.320	(8.431)	2.019	(37.313)	4.113	(3.224)	466
-	-	-	-	(4)	1	(36)	(8)	-	(1)
\$ (39.224)	\$ 29.604	\$ (78.364)	\$ 3.320	£ (8.435)	£ 2.020	\$ (37.349)	\$ 4.105	\$ (3.224)	\$ 465
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]		Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund		Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]		Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	
für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
\$ 3.833	\$ 5.369	\$ -	\$ -	\$ 25.456	\$ 13.855	\$ 1.061	\$ 1.160	\$ 280	\$ 300
-	-	-	-	7	-	-	-	-	-
-	-	-	-	113	95	-	-	-	-
-	-	761	33	-	-	-	-	-	-
(21.087)	(8.102)	-	1.878	(138.672)	(11.521)	(443)	825	(2.067)	17
(16.191)	5.796	-	(1.878)	(77.529)	8.371	(1.354)	(388)	98	(203)
(33.445)	3.063	761	33	(190.625)	10.800	(736)	1.597	(1.689)	114
678	1.080	-	-	5.514	3.567	306	289	17	23
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
80	111	-	-	479	255	24	20	6	6
5	6	-	-	597	402	9	11	-	-
3	3	-	-	14	4	1	-	-	-
13	14	-	-	16	15	13	15	13	15
9	20	-	-	42	26	2	2	1	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	1	-	-	9	-	-	-	-	-
1	2	-	-	7	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
22	40	761	33	-	-	7	10	10	5
813	1.277	761	33	6.831	4.329	362	347	47	49
-	-	-	-	-	-	(8)	(5)	(23)	(18)
813	1.277	761	33	6.831	4.329	354	342	24	31
(34.258)	1.786	-	-	(197.456)	6.471	(1.090)	1.255	(1.713)	83
(46)	(54)	-	-	(11.121)	(7.053)	-	-	(585)	(651)
(34.304)	1.732	-	-	(208.577)	(582)	(1.090)	1.255	(2.298)	(568)
(150)	(96)	-	-	(185)	(259)	25	(28)	(2)	1
\$ (34.454)	\$ 1.636	\$ -	\$ -	\$ (208.762)	\$ (841)	\$ (1.065)	\$ 1.227	\$ (2.300)	\$ (567)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

	Legg Mason Brandywine Global - US High Yield Fund ^A		Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund ^A		Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund ^A		Legg Mason ClearBridge Value Fund	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
(in Tsd.)								
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	\$ –	\$ –	\$ 2.250	\$ 10.406	\$ 23	\$ 20	\$ 9.165	6.166
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	–	–	–	–	–	–	1
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	(13.714)	(8.840)	(66)	178	(5.114)	33.146
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	(4.266)	(16.316)	(298)	87	(85.709)	26.047
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	–	–	(15.730)	(14.750)	(341)	285	(81.658)	65.360
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	1	32	5	5	3.744	2.760
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	32	114	4	3	318	211
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	1	–	–	352	286
Anwaltsgebühren	–	–	2	3	–	–	8	4
Prüfungsgebühren	–	–	13	14	13	14	9	11
Druckgebühren	–	–	6	17	–	–	25	26
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	–	1	–	–	2	1
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	–	–	28	25	5	5	81	43
Gesamtaufwendungen	–	–	82	207	27	27	4.539	3.342
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	–	(17)	–	(20)	(21)	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	–	–	65	207	7	6	4.539	3.342
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	–	–	(15.795)	(14.957)	(348)	279	(86.197)	62.018
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	–	–	–	(1)	–	–	(136)	(148)
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	–	–	(15.795)	(14.958)	(348)	279	(86.333)	61.870
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	–	(79)	(312)	(6)	(6)	(2.392)	(1.466)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ –	\$ (15.874)	\$ (15.270)	\$ (354)	\$ 273	\$ (88.725)	\$ 60.404

	Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund		Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund ^A		Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund ^A	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
(in Tsd.)								
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	\$ 2.171	\$ 2.909	\$ 853	\$ 1.001	\$ 9.634	\$ 5.651	\$ 123	\$ 79
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	(1)	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	11.278	39.321	392	445	(14.603)	15.471	148	611
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(85.884)	(21.813)	(4.703)	4.702	(164.705)	132.339	(1.866)	684
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	(72.435)	20.416	(3.458)	6.148	(169.674)	153.461	(1.595)	1.374
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	2.192	3.527	239	240	4.017	2.791	46	44
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	165	244	18	17	526	318	8	7
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	276	456	38	38	744	325	1	1
Anwaltsgebühren	6	6	1	–	15	6	–	–
Prüfungsgebühren	20	22	13	15	11	11	6	7
Druckgebühren	–	33	2	2	43	36	–	–
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	1	–	–	9	1	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	2	2	–	–	6	1	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	36	58	16	10	122	58	9	9
Gesamtaufwendungen	2.697	4.349	327	322	5.493	3.547	70	68
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	–	(18)	(13)	(45)	(46)	(13)	(13)
Nettoaufwendungen insgesamt	2.697	4.349	309	309	5.448	3.501	57	55
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	(75.132)	16.067	(3.767)	5.839	(175.122)	149.960	(1.652)	1.319
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	–	(70)	(117)	(133)	(58)	(28)	–	–
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	(75.132)	15.997	(3.884)	5.706	(175.180)	149.932	(1.652)	1.319
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(422)	(558)	(175)	(191)	(2.586)	(1.485)	(17)	(15)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ (75.554)	\$ 15.439	\$ (4.059)	\$ 5.515	\$ (177.766)	\$ 148.447	\$ (1.669)	\$ 1.304

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund [^]		Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 1.574	\$ 1.344	\$ 5.727	\$ 6.107
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	1	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	8.552	17.710	99.923	91.622
-	-	-	-	-	-	(23.314)	17.859	(377.299)	280.405
-	-	-	-	1	-	(13.188)	36.913	(271.649)	378.134
-	-	-	-	-	-	1.136	1.252	5.994	7.913
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	73	69	537	605
-	-	-	-	-	-	189	204	797	1.028
-	-	-	-	-	-	2	1	21	13
-	-	-	-	-	-	13	15	19	22
-	-	-	-	-	-	7	9	59	81
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	1	-	1	1	6	6
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	33	20	200	135	200	135
-	-	-	-	1	-	1.454	1.571	7.633	9.803
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	1	-	1.454	1.571	7.633	9.803
-	-	-	-	-	-	(14.642)	35.342	(279.282)	368.331
-	-	-	-	-	-	(6)	(17)	-	-
-	-	-	-	-	-	(14.648)	35.325	(279.282)	368.331
-	-	-	-	-	-	(443)	(363)	(1.528)	(1.705)
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ (15.091)	\$ 34.962	\$ (280.810)	\$ 366.626

Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^]		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
€ 11.900	€ 9.538	\$ 63	\$ 51	\$ 8.136	\$ 599	\$ 5.373	\$ 6.388	\$ 452	\$ 455
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	(122)	-	-	122	11	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
85.236	15.371	(164)	(77)	558	(23)	(2.842)	264.066	2.911	11.047
21.390	77.497	(164)	242	(20.722)	2.110	(111.326)	(171.565)	(9.679)	(8.670)
118.529	102.284	(265)	216	(11.906)	2.697	(108.795)	98.889	(6.316)	2.832
4.657	3.134	14	16	1.859	191	4.198	7.182	551	700
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
323	203	4	3	103	10	280	406	33	35
603	351	2	2	383	46	706	1.256	92	125
8	4	-	-	1	-	11	9	1	1
12	12	6	4	9	8	20	22	13	15
21	24	-	-	3	-	36	56	4	4
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
148	51	-	-	-	-	-	-	-	-
2	2	-	-	1	-	3	3	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
70	40	7	5	25	5	124	104	19	14
5.844	3.821	33	30	2.384	260	5.378	9.038	713	894
-	-	(20)	(14)	-	(6)	-	-	(4)	-
5.844	3.821	13	16	2.384	254	5.378	9.038	709	894
112.685	98.463	(278)	200	(14.290)	2.443	(114.173)	89.851	(7.025)	1.938
(2.957)	(2.048)	(11)	(8)	(5.927)	(871)	-	-	-	(54)
109.728	96.415	(289)	192	(20.217)	1.572	(114.173)	89.851	(7.025)	1.884
(1.947)	(1.281)	(10)	(6)	(882)	(81)	(773)	(1.671)	(84)	(92)
€ 107.781	€ 95.134	\$ (299)	\$ 186	\$ (21.099)	\$ 1.491	\$ (114.946)	\$ 88.180	\$ (7.109)	\$ 1.792

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Royce Global Small Cap Premier Fund [^]		Legg Mason PCM US Equity Fund [^]		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] µ		Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	\$ 40	\$ –	\$ –	\$ –	€ 793	€ 931	\$ 987	\$ 1.108
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	–	–	–	–	–	–	(2)
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(131)	–	–	–	(706)	597	(507)	(308)
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(434)	–	–	–	(522)	3.638	(3.080)	218
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	(525)	–	–	–	(435)	5.166	(2.600)	1.016
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	16	–	–	–	125	192	172	215
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	4	–	–	–	8	12	11	13
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	12	20	27	35
Anwaltsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Prüfungsgebühren	5	–	–	–	12	8	9	11
Druckgebühren	–	–	–	–	–	1	2	2
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	2	1	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	8	–	–	–	1	6	15	10
Gesamtaufwendungen	33	–	–	–	160	240	236	286
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(14)	–	–	–	(9)	(3)	(14)	(13)
Nettoaufwendungen insgesamt	19	–	–	–	151	237	222	273
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	(544)	–	–	–	(586)	4.929	(2.822)	743
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	–	–	–	–	(119)	(185)	(325)	(346)
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	(544)	–	–	–	(705)	4.744	(3.147)	397
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(7)	–	–	–	(226)	(379)	(100)	(113)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ (551)	\$ –	\$ –	\$ –	€ (931)	€ 4.365	\$ (3.247)	\$ 284

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	\$ –	\$ –	€ –	€ 220	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Zinsen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	4	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	–	4.781	–	–	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	–	(2.150)	–	–	–	–
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	–	–	–	2.631	–	–	–	–
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	140	–	–	–	–
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	3	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	10	–	–	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	21	–	–	–	–
Anwaltsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Prüfungsgebühren	–	–	–	12	–	–	–	–
Druckgebühren	–	–	–	1	–	–	–	–
Dividendenaufwand	–	–	–	88	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	32	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	4	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	–	–	–	9	–	–	–	–
Gesamtaufwendungen	–	–	–	320	–	–	–	–
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	–	–	(29)	–	–	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	–	–	–	291	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	–	–	–	2.564	–	–	–	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	–	–	–	2.564	–	–	–	–
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	–	–	(97)	–	–	–	–
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ –	€ –	€ 2.467	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

Legg Mason Battery March International Large Cap Fund [^]		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund ^{^α}		Legg Mason Congruix Japan Equity Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	
für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
\$ -	\$ -	\$ -	\$ 22	\$ 95	\$ 386	¥ -	¥ -	\$ 246	\$ 944
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	2.561	1.634	212	-	-	(206)	235
-	-	-	(2.629)	(1.498)	959	-	-	(1.946)	(5.009)
-	-	-	(46)	231	1.557	-	-	(1.906)	(3.829)
-	-	-	4	24	83	-	-	51	380
-	-	-	1	2	7	-	-	8	29
-	-	-	-	2	8	-	-	4	105
-	-	-	-	-	-	-	-	-	1
-	-	-	14	13	12	-	-	6	7
-	-	-	-	-	-	-	-	4	4
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	6	19	7	-	-	10	9
-	-	-	25	60	117	-	-	83	535
-	-	-	(23)	(33)	(9)	-	-	(20)	(83)
-	-	-	2	27	108	-	-	63	452
-	-	-	(48)	204	1.449	-	-	(1.969)	(4.281)
-	-	-	(1)	(12)	(53)	-	-	(13)	-
-	-	-	(49)	192	1.396	-	-	(1.982)	(4.281)
-	-	-	(2)	(26)	(65)	-	-	(26)	(49)
\$ -	\$ -	\$ -	\$ (51)	\$ 166	\$ 1.331	¥ -	¥ -	\$ (2.008)	\$ (4.330)
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 [^]	
für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
¥ -	¥ -	\$ 956	\$ 597	\$ 804	\$ 827	\$ 537	\$ 349	\$ -	\$ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	(10.689)	10.291	(22)	113	(2.068)	960	-	-
-	-	(35.809)	10.164	(2.095)	303	(6.298)	(2.570)	-	-
-	-	(45.542)	21.052	(1.313)	1.243	(7.829)	(1.261)	-	-
-	-	545	502	125	123	201	180	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	57	46	12	11	18	17	-	-
-	-	59	51	38	38	10	14	-	-
-	-	2	1	-	-	1	-	-	-
-	-	10	11	10	11	6	7	-	-
-	-	5	5	1	1	2	2	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	21	12	16	8	23	11	-	-
-	-	699	628	202	192	261	231	-	-
-	-	-	-	(19)	(15)	(19)	(9)	-	-
-	-	699	628	183	177	242	222	-	-
-	-	(46.241)	20.424	(1.496)	1.066	(8.071)	(1.483)	-	-
-	-	-	-	(230)	(258)	-	-	-	-
-	-	(46.241)	20.424	(1.726)	808	(8.071)	(1.483)	-	-
-	-	(61)	(51)	(64)	(59)	(52)	(40)	-	-
¥ -	¥ -	\$ (46.302)	\$ 20.373	\$ (1.790)	\$ 749	\$ (8.123)	\$ (1.523)	\$ -	\$ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]		Legg Mason Global Funds Plc	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
ANLAGEERTRÄGE:				
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen	€ 2.341	€ 941	\$ 278.665	\$ 366.996
Zinsen	–	–	110	20
Ausgleich	–	–	(106)	(906)
Sonstige Erträge	–	–	762	39
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(8.920)	962	(834.932)	858.695
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	(32.918)	38.646	(1.602.174)	265.668
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	(39.497)	40.549	(2.157.675)	1.490.512
AUFWENDUNGEN:				
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	507	388	68.952	95.325
Erfolgsprämien (Erläuterung 3)	–	–	–	4
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	100	59	6.826	7.673
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	10	4	6.914	8.392
Anwaltsgebühren	3	1	259	179
Prüfungsgebühren	7	6	696	785
Druckgebühren	8	6	731	1.074
Dividendenaufwand	–	–	–	105
Zinsaufwendungen	7	8	345	273
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 3)	1	–	71	69
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	762	39
Sonstige Aufwendungen	25	11	2.649	1.891
Gesamtaufwendungen	668	483	88.205	115.809
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	(7)	–	(1.112)	(2.930)
Nettoaufwendungen insgesamt	661	483	87.093	112.879
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	(40.158)	40.066	(2.244.768)	1.377.633
FINANZIERUNGSKOSTEN:				
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	–	–	(49.425)	(57.446)
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	(40.158)	40.066	(2.294.193)	1.320.187
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	(217)	(107)	(17.967)	(16.087)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ (40.375)	€ 39.959	\$ (2.312.160)	\$ 1.304.100

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

Gewinne und Verluste stammen ausschließlich aus laufender Geschäftstätigkeit mit Ausnahme des Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], des Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^], des Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] und des Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] die den Betrieb eingestellt haben. Es gab keine sonstigen Gewinne oder Verluste außer den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten.

Die EUR-Beträge für den Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, den Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], den Legg Mason QS MV European Equity Growth and Income Fund[^], den Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], den Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und den Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022 zum USD/EUR-Durchschnittskurs von 0,9493 in US-Dollar umgerechnet (31. August 2021: 0,8376)

Britische Pfund-Beträge für den Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022 zum USD/GBP-Wechselkurs von 0,8028 in US-Dollar umgerechnet (31. August 2021: 0,7195)

α Mit Wirkung vom 27. April 2022 stellte der Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

β Mit Wirkung zum 21. Juni 2022 stellten der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und der Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] den Handel ein.

μ Mit Wirkung zum 11. Juli 2022 stellte der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

Entwicklung des den Inhabern von einlösbaren Beteiligungsanteilen zurechenbaren Nettovermögens

	Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund		Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund		Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund		Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
(in Tsd.)								
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 353	\$ 8	\$ (23.208)	\$ 4.011	\$ (163.099)	\$ 33.601	€ (16.029)	€ 1.371
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	785.309	706.817	16.134	39.172	406.503	426.161	7.423	1.518
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	851	36	374	570	428	952	1	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(841.015)	(677.400)	(42.699)	(72.025)	(462.033)	(538.610)	(696)	(690)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	(54.855)	29.453	(26.191)	(32.283)	(55.102)	(111.497)	6.728	828
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(54.502)	29.461	(49.399)	(28.272)	(218.201)	(77.896)	(9.301)	2.199
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	919.324	882.330	232.906	299.130	1.488.090	1.647.418	149.386	111.323
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Ende des Berichtszeitraums	\$ 864.822	\$ 911.791	\$ 183.507	\$ 270.858	\$ 1.269.889	\$ 1.569.522	€ 140.085	€ 113.522
	Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund [^]		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund		Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
(in Tsd.)								
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ (3.242)	\$ 2.144	\$ (48.966)	\$ (3.710)
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	-	-	-	-	5.977	1.144	17.457	34.748
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	46	-	47	109
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-	-	-	-	(52.270)	(1.130)	(35.776)	(89.369)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-	(46.247)	14	(18.272)	(54.512)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-	-	-	-	(49.489)	2.158	(67.238)	(58.222)
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	-	-	-	-	59.525	48.798	509.794	626.909
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Ende des Berichtszeitraums	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 10.036	\$ 50.956	\$ 442.556	\$ 568.687
	Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^]		Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
(in Tsd.)								
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ (63.479)	\$ 13.455	\$ -	\$ -	\$ (39.224)	\$ 29.604	\$ (78.364)	\$ 3.320
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	39.773	38.348	-	-	9.235	186.477	44.563	205.798
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	-	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(100.127)	(23.440)	-	-	(366.026)	(143.579)	(345)	(4.411)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	(60.354)	14.908	-	-	(356.791)	42.898	44.218	201.387
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(123.833)	28.363	-	-	(396.015)	72.502	(34.146)	204.707
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	371.899	1.081.858	-	-	1.057.941	1.105.162	1.147.280	823.416
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Ende des Berichtszeitraums	\$ 248.066	\$ 1.110.221	\$ -	\$ -	\$ 661.926	\$ 1.177.664	\$ 1.113.134	\$ 1.028.123

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (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 ^{αβ}		Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	
für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
\$ (3.892)	\$ 673	\$ (35.914)	\$ 6.742	\$ (25.458)	\$ 6.756	\$ (2.668)	\$ 126	\$ (2.114)	\$ 71	\$ (10.172)	\$ 1.618
4.868	43.177	21.958	72.761	64.811	100.058	9.347	29.328	1	6.775	4.323	29.311
157	253	226	527	1.075	1.014	549	313	319	816	104	268
(15.363)	(9.927)	(36.977)	(380.288)	(109.343)	(69.634)	(3.141)	(3.878)	(26.054)	(2.826)	(14.246)	(38.118)
(10.338)	33.503	(14.793)	(307.000)	(43.457)	31.438	6.755	25.763	(25.734)	4.765	(9.819)	(8.539)
(14.230)	34.176	(50.707)	(300.258)	(68.915)	38.194	4.087	25.889	(27.848)	4.836	(19.991)	(6.921)
52.992	26.433	302.969	655.931	259.100	219.127	41.118	22.769	27.848	40.233	81.978	102.562
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 38.762	\$ 60.609	\$ 252.262	\$ 355.673	\$ 190.185	\$ 257.321	\$ 45.205	\$ 48.658	\$ -	\$ 45.069	\$ 61.987	\$ 95.641
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund ^α		Legg Mason Western Asset Global Credit Fund ^α		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund ^{αβ}		Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund ^α		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund ^α	
für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
\$ (61.118)	\$ (6.470)	\$ (22.268)	\$ 5.194	\$ (7.988)	\$ 2.053	€ (2.426)	€ 1.126	\$ (500.946)	\$ 321.397	\$ -	\$ -
65.411	105.388	16.477	26.608	434	3.399	4	12	260.281	583.406	-	-
4	1	-	-	-	-	-	77	349	519	-	-
(80.735)	(114.887)	(38.046)	(81.176)	(3.164)	(933)	(35.026)	(6.072)	(1.317.097)	(1.536.939)	-	-
(15.320)	(9.498)	(21.569)	(54.568)	(2.730)	2.466	(35.022)	(5.983)	(1.056.467)	(953.014)	-	-
(76.438)	(15.968)	(43.837)	(49.374)	(10.718)	4.519	(37.448)	(4.857)	(1.557.413)	(631.617)	-	-
444.249	518.699	202.948	286.292	77.353	82.725	37.448	54.345	4.183.834	6.646.080	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 367.811	\$ 502.731	\$ 159.111	\$ 236.918	\$ 66.635	\$ 87.244	€ -	€ 49.488	\$ 2.626.421	\$ 6.014.463	\$ -	\$ -
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund ^α		Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund ^α		Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund ^α		Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund ^α		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund ^α	
für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
£ (8.435)	£ 2.020	\$ (37.349)	\$ 4.105	\$ (3.224)	\$ 465	\$ (875)	\$ -	\$ (31.727)	\$ (6.053)	\$ (77.166)	\$ (17.998)
69.541	-	133.770	3.306	328	179	-	-	37.486	24.224	10.821	23.881
-	-	-	-	275	279	-	-	79	93	5	4
(69.541)	-	(130.219)	(9.370)	(342)	(1)	(6)	-	(35.094)	(114.413)	(148.873)	(19.912)
-	-	3.551	(6.064)	261	457	(6)	-	2.471	(90.096)	(138.047)	3.973
(8.435)	2.020	(33.798)	(1.959)	(2.963)	922	(881)	-	(29.256)	(96.149)	(215.213)	(14.025)
73.633	76.685	175.169	191.596	21.958	22.193	9.866	-	215.635	367.907	752.718	728.674
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
£ 65.198	£ 78.705	\$ 141.371	\$ 189.637	\$ 18.995	\$ 23.115	\$ 8.985	\$ -	\$ 186.379	\$ 271.758	\$ 537.505	\$ 714.649

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]		Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]		Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
(in Tsd.)								
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ (1.256)	\$ 505	\$ (34.454)	\$ 1.636	\$ –	\$ –	\$ (208.762)	\$ (841)
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	19	199	1.598	20.899	–	–	246.355	904.276
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	1	1	3	7	–	–	155	259
Kosten für zurückgekaufte Anteile	–	(563)	(9.529)	(332.983)	–	–	(434.813)	(65.708)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	20	(363)	(7.928)	(312.077)	–	–	(188.303)	838.827
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(1.236)	142	(42.382)	(310.441)	–	–	(397.065)	837.986
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	11.590	12.059	244.396	585.721	–	–	1.608.073	453.285
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	\$ 10.354	\$ 12.201	\$ 202.014	\$ 275.280	\$ –	\$ –	\$1.211.008	\$1.291.271
	Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fonds [^]		Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
(in Tsd.)								
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (15.091)	\$ 34.962
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	–	–	–	–	–	–	14.256	25.751
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	–	–	–	2
Kosten für zurückgekaufte Anteile	–	–	–	–	–	–	(22.771)	(43.033)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	(8.515)	(17.280)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	–	–	–	–	–	–	(23.606)	17.682
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	–	–	–	–	–	–	213.480	206.008
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 189.874	\$ 223.690
	Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^]		Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund		Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
(in Tsd.)								
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ (299)	\$ 186	\$ (21.099)	\$ 1.491	\$ (114.946)	\$ 88.180	\$ (7.109)	\$ 1.792
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	15	5	305.392	101.304	101.415	841.579	4.716	36.140
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	1	–	496	59	–	–	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(2)	–	(44.110)	–	(244.838)	(1.142.594)	(10.172)	(29.658)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	14	5	261.778	101.363	(143.423)	(301.015)	(5.456)	6.482
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(285)	191	240.679	102.854	(258.369)	(212.835)	(12.565)	8.274
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	2.665	2.725	173.394	–	916.209	1.288.870	87.935	91.096
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	\$ 2.380	\$ 2.916	\$ 414.073	\$ 102.854	\$ 657.840	\$ 1.076.035	\$ 75.370	\$ 99.370

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

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 die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
\$ (1.065)	\$ 1.227	\$ (2.300)	\$ (567)	\$ –	\$ –	\$ (15.874)	\$ (15.270)	\$ (354)	\$ 273	\$ (88.725)	\$ 60.404
1.476	8.021	–	–	–	–	112	2.934	69	57	183.445	265.298
–	–	1	–	–	–	–	–	–	–	4	8
(1.565)	(3.300)	–	–	–	–	(17.709)	(259.881)	(7)	(23)	(105.991)	(96.202)
(89)	4.721	1	–	–	–	(17.597)	(256.947)	62	34	77.458	169.104
(1.154)	5.948	(2.299)	(567)	–	–	(33.471)	(272.217)	(292)	307	(11.267)	229.508
52.386	52.020	10.163	11.774	–	–	104.231	391.296	2.177	1.879	892.238	509.085
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$ 51.232	\$ 57.968	\$ 7.864	\$ 11.207	\$ –	\$ –	\$ 70.760	\$ 119.079	\$ 1.885	\$ 2.186	\$ 880.971	\$ 738.593
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 die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
\$ (280.810)	\$ 366.626	\$ (75.554)	\$ 15.439	\$ (4.059)	\$ 5.515	\$ (177.766)	\$ 148.447	\$ (1.669)	\$ 1.304	€ 107.781	€ 95.134
213.856	370.750	4.589	36.326	3.404	1.398	614.239	640.807	211	1.330	561.163	152.206
–	–	–	–	3	3	–	–	–	–	11	3
(419.098)	(431.840)	(54.880)	(88.966)	(2.023)	(2.166)	(402.757)	(148.953)	(1.888)	(73)	(255.798)	(171.134)
(205.242)	(61.090)	(50.291)	(52.640)	1.384	(765)	211.482	491.854	(1.677)	1.257	305.376	(18.925)
(486.052)	305.536	(125.845)	(37.201)	(2.675)	4.750	33.716	640.301	(3.346)	2.561	413.157	76.209
1.772.695	1.811.052	538.159	790.698	43.279	38.689	1.599.315	645.224	16.018	11.089	671.424	605.013
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$1.286.643	\$2.116.588	\$ 412.314	\$ 753.497	\$ 40.604	\$ 43.439	\$1.633.031	\$1.285.525	\$ 12.672	\$ 13.650	€1.084.581	€ 681.222
Royce Global Small Cap Premier Fund [^]		Legg Mason PCM US Equity Fund [^]		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund ^{^μ}		Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund [^]		Legg Mason Q5 Emerging Markets Equity Fund [^]	
für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
\$ (551)	\$ –	\$ –	\$ –	€ (931)	€ 4.365	\$ (3.247)	\$ 284	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (51)
1	–	–	–	305	4.802	1.589	1.899	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	88	62	–	–	–	1
–	–	–	–	(27.711)	(12.232)	(3.353)	(3.827)	–	–	–	(14.689)
1	–	–	–	(27.406)	(7.430)	(1.676)	(1.866)	–	–	–	(14.688)
(550)	–	–	–	(28.337)	(3.065)	(4.923)	(1.582)	–	–	–	(14.739)
4.534	–	–	–	28.337	33.368	25.883	31.037	–	–	–	14.739
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$ 3.984	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	€ 30.303	\$ 20.960	\$ 29.455	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

(in Tsd.)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund ^α		Legg Mason Congruix Japan Equity Fund ^α		Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund ^α		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund ^α	
	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 166	\$ 1.331	¥ –	¥ –	\$ (2.008)	\$ (4.330)	\$ –	\$ –
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	–	429	–	–	27	7.360	–	–
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	2	3	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(12.709)	(2.424)	–	–	(265)	(513)	–	–
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	(12.709)	(1.995)	–	–	(236)	6.850	–	–
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(12.543)	(664)	–	–	(2.244)	2.520	–	–
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	12.543	12.685	–	–	16.118	80.080	–	–
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Ende des Berichtszeitraums	\$ –	\$ 12.021	¥ –	¥ –	\$ 13.874	\$ 82.600	\$ –	\$ –
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^α								
Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund^α								
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^α								
Legg Mason Global Funds Plc								
(in Tsd.)	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
	Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ (8.123)	\$ (1.523)	\$ –	\$ –	€ (40.375)	€ 39.959	\$ (2.312.160)
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	11.301	12.348	–	–	23.179	113.804	4.431.367	6.384.508
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	–	–	5.801	6.419
Kosten für zurückgekaufte Anteile	(17.015)	(4.706)	–	–	(86.025)	(24.587)	(6.180.820)	(6.963.688)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	(5.714)	7.642	–	–	(62.846)	89.217	(1.743.652)	(572.761)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	(13.837)	6.119	–	–	(103.221)	129.176	(4.055.812)	731.339
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Beginn des Berichtszeitraums	47.838	41.801	–	–	303.590	111.371	22.628.678	24.833.772
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	(162.565)	(28.218)
Ende des Berichtszeitraums	\$ 34.001	\$ 47.920	\$ –	\$ –	€ 200.369	€ 240.547	\$ 18.410.301	\$ 25.536.893

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	
für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2022	für die abgelaufenen sechs Monate 31. August 2021
€ -	€ 2.467	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	¥ -	¥ -	\$ (46.302)	\$ 20.373	\$ (1.790)	\$ 749
-	4.064	-	-	-	-	-	-	56.471	88.306	657	1.332
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	146	164
-	(46.874)	-	-	-	-	-	-	(28.057)	(61.591)	(1.412)	(737)
-	(42.810)	-	-	-	-	-	-	28.414	26.715	(609)	759
-	(40.343)	-	-	-	-	-	-	(17.888)	47.088	(2.399)	1.508
-	40.343	-	-	-	-	-	-	169.381	104.349	27.934	26.576
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
€ -	€ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	¥ -	¥ -	\$ 151.493	\$ 151.437	\$ 25.535	\$ 28.084

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

Die EUR-Beträge, mit Ausnahme des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens zu Beginn des Zeitraums, 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[^], den Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und den Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022 zum USD/EUR-Durchschnittskurs von 0,9493 in US-Dollar umgerechnet (31. August 2021: 0,8376)

Das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums 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[^], den Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und den Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags zum 28. Februar 2022 zum USD/EUR-Durchschnittskurs von 0,8919 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2021: 0,8288)

Alle britischen Pfund-Beträge, mit Ausnahme des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens zu Berichtsbeginn, für den Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für die Legg Mason Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022 zum USD/GBP-Durchschnittskurs von 0,8028 in US-Dollar umgerechnet (31. August 2021: 0,7195)

Das Nettovermögen zu Anfang des Berichtszeitraums, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist, wurde für den Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] zur Berechnung des Gesamtbetrags unter Verwendung des USD/GBP-Wechselkurses zum 28. Februar 2022 von 0,7454 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2021: 0,7178)

α Mit Wirkung vom 27. April 2022 stellte der Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

β Mit Wirkung zum 21. Juni 2022 stellten der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und der Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] den Handel ein.

μ Mit Wirkung zum 11. Juli 2022 stellte der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Für den Berichtszeitraum zum			Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)		31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	1.094	774			
Eingelöst	(904)	(816)			
Nettozunahme/(-abnahme)	190	(42)			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	320.506	303.414			
Eingelöst	(414.297)	(274.391)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(93.791)	29.023			
Klasse B USD, thesaurierend					
Verkauft	–	1			
Eingelöst	–	(1)			
Nettozunahme	–	–			
Klasse B USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	218	–			
Nettozunahme	218	–			
Klasse C USD, thesaurierend					
Eingelöst	(2)	–			
Nettoabnahme	(2)	–			
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	–	52			
Eingelöst	–	(147)			
Nettoabnahme	–	(95)			
Klasse X USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	351.147	337.191			
Eingelöst	(332.929)	(332.058)			
Nettozunahme	18.218	5.133			
Klasse A (G) USD, thesaurierend					
Verkauft	–	1			
Eingelöst	–	(1)			
Nettozunahme	–	–			
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	35	42			
Eingelöst	(72)	(58)			
Nettoabnahme	(37)	(16)			
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	35	25			
Eingelöst	(43)	(63)			
Nettoabnahme	(8)	(38)			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	48	88			
Eingelöst	(59)	(65)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(11)	23			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	–	7			
Eingelöst	(15)	(24)			
Nettoabnahme	(15)	(17)			
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	5			
Eingelöst	(6)	(36)			
Nettoabnahme	(5)	(31)			
Klasse E USD, thesaurierend					
Eingelöst	(11)	(19)			
Nettoabnahme	(11)	(19)			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	53	90			
Eingelöst	(211)	(249)			
Nettoabnahme	(158)	(159)			
Klasse F USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	3	73			
Eingelöst	(21)	(86)			
Nettoabnahme	(18)	(13)			
Klasse X USD thesaurierend					
Verkauft	1	3			
Eingelöst	(1)	(2)			
Nettozunahme	–	1			
Klasse X USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	–	2			
Nettozunahme	–	2			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	–	3			
Eingelöst	–	(9)			
Nettoabnahme	–	(6)			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft			1	2	
Eingelöst			(2)	(9)	
Nettoabnahme			(1)	(7)	
Klasse LM USD, thesaurierend					
Verkauft			2	33	
Eingelöst			(1)	(1)	
Nettozunahme			1	32	
Klasse GA USD, thesaurierend					
Eingelöst			(1)	–	
Nettoabnahme			(1)	–	
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft			80	160	
Eingelöst			(134)	(357)	
Nettoabnahme			(54)	(197)	
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft			106	102	
Eingelöst			(160)	(110)	
Nettoabnahme			(54)	(8)	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft			4	16	
Eingelöst			(21)	(119)	
Nettoabnahme			(17)	(103)	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft			59	51	
Eingelöst			(4)	(17)	
Nettozunahme			55	34	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft			1	8	
Eingelöst			(5)	(32)	
Nettoabnahme			(4)	(24)	
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft			2	6	
Eingelöst			(33)	(53)	
Nettoabnahme			(31)	(47)	
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Verkauft			1	2	
Eingelöst			(10)	(23)	
Nettoabnahme			(9)	(21)	
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft			7	35	
Eingelöst			(60)	(96)	
Nettoabnahme			(53)	(61)	
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft			1.705	1.920	
Eingelöst			(2.608)	(839)	
Netto-(Abgang)/-Zugang			(903)	1.081	
Klasse F USD, ausschüttend (D)					
Verkauft			11	42	
Eingelöst			(28)	(40)	
Netto-(Abgang)/-Zugang			(17)	2	
Klasse X USD thesaurierend					
Verkauft			2	4	
Eingelöst			(9)	(110)	
Nettoabnahme			(7)	(106)	
Klasse X USD, ausschüttend (D)					
Verkauft			8	2	
Eingelöst			(2)	(15)	
Nettozunahme/(-abnahme)			6	(13)	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft			–	12	
Eingelöst			(3)	(117)	
Nettoabnahme			(3)	(105)	
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Eingelöst			–	(4)	
Nettoabnahme			–	(4)	
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft			1.030	423	
Eingelöst			(629)	(1.333)	
Nettozunahme/(-abnahme)			401	(910)	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – (Fortsetzung)				
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	4	12		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	3	12		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	146	151		
Eingelöst	(18)	(437)		
Nettozunahme/(-abnahme)	128	(286)		
Klasse LM USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	28	185		
Eingelöst	(33)	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(5)	185		
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	(1)	(1)		
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	(2)	–		
Nettoabnahme	(2)	–		
Legg Mason Western Asset EUR Core Plus Bond Fund				
Klasse A EUR, ausschüttend (D)				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse Premier EUR, thesaurierend				
Verkauft	76	14		
Eingelöst	(4)	(5)		
Nettozunahme	72	9		
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse GA EUR, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	4	176		
Eingelöst	(57)	(30)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(53)	146		
Klasse A USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	5	53		
Eingelöst	(25)	(11)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(20)	42		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	–	1		
Nettozunahme	–	1		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	4		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	–	4		
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	2	–		
Eingelöst	(12)	–		
Nettoabnahme	(10)	–		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	9	20		
Eingelöst	(10)	(18)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1)	2		
Klasse C USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	–	26		
Eingelöst	(22)	(2)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(22)	24		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	–	16		
Eingelöst	(2)	(3)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(2)	13		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	23	14		
Eingelöst	(1)	–		
Nettozunahme	22	14		
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(2)	(12)		
Nettoabnahme	(2)	(11)		
Klasse L (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	4	36		
Eingelöst	(13)	(16)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(9)	20		
Klasse A USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	4	3		
Eingelöst	(5)	(117)		
Nettoabnahme	(1)	(114)		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	–	7		
Eingelöst	(1)	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1)	7		
Klasse A USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	–	2		
Eingelöst	(2)	(2)		
Nettoabnahme	(2)	–		
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	2	–		
Nettozunahme	2	–		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	3		
Eingelöst	(4)	(5)		
Nettoabnahme	(3)	(2)		
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(1)	(8)		
Nettoabnahme	(1)	(7)		
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus				
Eingelöst	(5)	–		
Nettoabnahme	(5)	–		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	60	671		
Eingelöst	(16)	(542)		
Nettozunahme	44	129		
Klasse B USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(2)	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(2)	1		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	1	2		
Eingelöst	(3)	(3)		
Nettoabnahme	(2)	(1)		
Klasse C USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	1	4		
Eingelöst	(10)	(4)		
Nettoabnahme	(9)	–		
Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	6	191		
Eingelöst	(5)	(200)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(9)		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	–	(2)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	12	28		
Eingelöst	(19)	(9)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(7)	19		
Klasse F USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	–	(14)		
Nettoabnahme	–	(14)		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)				
Klasse X USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(4)	(1)		
Nettoabnahme	(4)	–		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	86	79		
Eingelöst	(21)	(62)		
Nettozunahme	65	17		
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	13	228		
Eingelöst	(102)	(138)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(89)	90		
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	13		
Nettozunahme	–	13		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	(4)	(6)		
Nettoabnahme	(4)	(6)		
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	(71)	–		
Nettoabnahme	(71)	–		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(13)	(164)		
Nettoabnahme	(13)	(163)		
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(17)	(47)		
Nettoabnahme	(16)	(47)		
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	28	31		
Eingelöst	–	(33)		
Nettozunahme/(-abnahme)	28	(2)		
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	–	(1.360)		
Nettoabnahme	–	(1.360)		
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	15	147		
Eingelöst	(16)	(57)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1)	90		
Klasse A USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	7	76		
Eingelöst	(19)	(63)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(12)	13		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	1	47		
Eingelöst	(12)	(70)		
Nettoabnahme	(11)	(23)		
Klasse A USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	4	11		
Eingelöst	(9)	(3)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(5)	8		
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	4	1		
Nettozunahme	4	1		
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme	–	–		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	6	391		
Eingelöst	(145)	(348)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(139)	43		
Klasse B USD, thesaurierend				
Verkauft	–	2		
Eingelöst	(2)	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(2)	2		
Klasse B USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	–	(6)		
Nettoabnahme	–	(6)		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	8	1		
Eingelöst	–	(2)		
Nettozunahme/(-abnahme)	8	(1)		
Klasse C USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	1	1		
Eingelöst	(4)	(2)		
Nettoabnahme	(3)	(1)		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	5	3		
Eingelöst	(4)	(1)		
Nettozunahme	1	2		
Klasse E USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	1	1		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme	1	–		
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	1		
Nettozunahme	–	1		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	12	26		
Eingelöst	(19)	(6)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(7)	20		
Klasse F USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	2	1		
Nettozunahme	2	1		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	327	285		
Eingelöst	(560)	(175)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(233)	110		
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	–	(6)		
Nettoabnahme	–	(6)		
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	1	–		
Nettozunahme	1	–		
Klasse LM USD, thesaurierend				
Eingelöst	(17)	–		
Nettoabnahme	(17)	–		
Klasse LM USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	8	3		
Eingelöst	–	(118)		
Nettozunahme/(-abnahme)	8	(115)		
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	–	7		
Eingelöst	(8)	(11)		
Nettoabnahme	(8)	(4)		
Klasse A USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	(6)	(3)		
Nettoabnahme	(6)	(3)		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	19	–		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme/(-abnahme)	19	(1)		
Klasse A USD, ausschüttend (M)				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	5	8		
Eingelöst	(3)	(1)		
Nettozunahme	2	7		
Klasse C USD, thesaurierend				
Eingelöst	(2)	–		
Nettoabnahme	(2)	–		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – (Fortsetzung)				
Klasse C USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	–	(1)	–	1
Nettoabnahme	–	(1)	(2)	(19)
Klasse E USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	(1)	(3)	–	2
Nettoabnahme	(1)	(3)	–	2
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	(6)	(3)	9	7
Nettoabnahme	(6)	(3)	(6)	(2)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)				
Verkauft	–	1	3	5
Nettozunahme	–	1	–	–
LM KLASSE USD, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	102	282	4	6
Nettozunahme	102	282	(2)	(2)
Klasse A (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)	2	5
Nettoabnahme	–	(1)	(4)	–
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	–	(1)	(2)	5
Nettoabnahme	–	(1)	–	–
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund^{αβ}				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	–	1	4	6
Nettozunahme	–	1	(2)	(2)
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	20	2	4
Eingelöst	–	(3)	–	–
Nettozunahme	–	17	1	–
Klasse LM USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	–	48	1	–
Eingelöst	–	(25)	1	–
Nettozunahme	–	23	–	–
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	3	15	–	(10)
Eingelöst	(6)	(13)	–	(10)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(3)	2	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	4	3	–	–
Eingelöst	(7)	(22)	–	–
Nettoabnahme	(3)	(19)	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	8	73	–	–
Eingelöst	(51)	(30)	–	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	(43)	43	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	2	19	–	–
Eingelöst	(18)	(22)	–	–
Nettoabnahme	(16)	(3)	–	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	7	19	–	–
Eingelöst	(17)	(21)	–	–
Nettoabnahme	(10)	(2)	–	–
Klasse A Euro, ausschüttend (D) (abgesichert)				
Verkauft	1	–	–	–
Eingelöst	–	(5)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(5)	–	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	333	2.358	–	–
Eingelöst	(297)	(14.912)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	36	(12.554)	–	–
Klasse B USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	(3)	(1)	–	–
Nettoabnahme	(3)	(1)	–	–
Klasse C USD, thesaurierend				
Eingelöst	(2)	–	–	–
Nettoabnahme	(2)	–	–	–
Klasse C USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	–	1	–	1
Eingelöst	(2)	(19)	–	(19)
Nettoabnahme	(2)	(18)	–	(18)
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	–	2	–	2
Nettozunahme	–	2	–	2
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	9	7	–	–
Eingelöst	(6)	(2)	–	–
Nettozunahme	3	5	–	–
Klasse F USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	–	30	–	30
Eingelöst	(4)	(5)	–	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	(4)	25	–	–
Klasse X USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	2	5	–	–
Eingelöst	(4)	–	–	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	(2)	5	–	–
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)				
Verkauft	4	6	–	–
Eingelöst	(2)	(2)	–	–
Nettozunahme	2	4	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	–	45	–	–
Eingelöst	(23)	(64)	–	–
Nettoabnahme	(23)	(19)	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	2	–	–
Eingelöst	–	(2)	–	–
Nettozunahme	1	–	–	–
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	1	–	–	–
Nettozunahme	1	–	–	–
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	–	(10)	–	–
Nettoabnahme	–	(10)	–	–
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	17	1	–	–
Eingelöst	(4)	(2)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	13	(1)	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	7	7	–	–
Eingelöst	(22)	(7)	–	–
Nettoabnahme	(15)	–	–	–
Klasse B USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)	–	–
Nettoabnahme	–	(1)	–	–
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	1	–	–	–
Nettozunahme	1	–	–	–
Klasse C USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	–	1	–	–
Nettozunahme	–	1	–	–
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	11	–	–	–
Nettozunahme	11	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	12	–	–	–
Eingelöst	(75)	–	–	–
Nettoabnahme	(63)	–	–	–
Klasse LM USD, thesaurierend				
Eingelöst	(369)	–	–	–
Nettoabnahme	(369)	–	–	–
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	29	32	–	–
Eingelöst	(62)	(65)	–	–
Nettoabnahme	(33)	(33)	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – (Fortsetzung)				
Klasse A USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	1	4		
Eingelöst	(3)	(5)		
Nettoabnahme	(2)	(1)		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	32	68		
Eingelöst	(129)	(328)		
Nettoabnahme	(97)	(260)		
Klasse A USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	9	4		
Eingelöst	(7)	(51)		
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(47)		
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	24	13		
Eingelöst	(81)	(94)		
Nettoabnahme	(57)	(81)		
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	–	(5)		
Nettoabnahme	–	(5)		
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus				
Verkauft	2	36		
Eingelöst	(50)	(128)		
Nettoabnahme	(48)	(92)		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	3		
Eingelöst	(2)	(3)		
Nettoabnahme	(2)	–		
Klasse A EUR, thesaurierend				
Verkauft	2	2		
Eingelöst	(2)	(7)		
Nettoabnahme	–	(5)		
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	16	74		
Eingelöst	(163)	(720)		
Nettoabnahme	(147)	(646)		
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	16	64		
Eingelöst	(52)	(88)		
Nettoabnahme	(36)	(24)		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	79	2.865		
Eingelöst	(87)	(4.307)		
Nettoabnahme	(8)	(1.442)		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	300	3.461		
Eingelöst	(312)	(3.430)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(12)	31		
Klasse B USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse C USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(3)		
Nettoabnahme	–	(3)		
Klasse C USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	–	(5)		
Nettoabnahme	–	(5)		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	1	1		
Eingelöst	–	(3)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(2)		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	1	6		
Eingelöst	(1)	(40)		
Nettoabnahme	–	(34)		
Klasse X USD thesaurierend				
Verkauft	–	2		
Eingelöst	(2)	(27)		
Nettoabnahme	(2)	(25)		
Klasse X USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	–	3		
Eingelöst	(26)	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(26)	3		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	1		
Nettozunahme	–	1		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	10	13		
Eingelöst	(13)	(35)		
Nettoabnahme	(3)	(22)		
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	–	40		
Eingelöst	–	(42)		
Nettoabnahme	–	(2)		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	12	43		
Eingelöst	(16)	(3)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(4)	40		
Klasse Premier EUR, thesaurierend				
Verkauft	–	8		
Nettozunahme	–	8		
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)				
Eingelöst	–	(10)		
Nettoabnahme	–	(10)		
Klasse LM USD, thesaurierend				
Eingelöst	(9)	–		
Nettoabnahme	(9)	–		
Klasse LM USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	41	–		
Eingelöst	(2)	–		
Nettozunahme	39	–		
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	–	5		
Nettozunahme	–	5		
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	75	62		
Eingelöst	(47)	(55)		
Nettozunahme	28	7		
Klasse A USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	1	19		
Eingelöst	(6)	(15)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(5)	4		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	29	35		
Eingelöst	(37)	(32)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(8)	3		
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	536	889		
Eingelöst	(1.977)	(56)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1.441)	833		
Klasse B USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	5	40		
Eingelöst	(33)	(3)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(28)	37		
Klasse C USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	32	1		
Eingelöst	(2)	–		
Nettozunahme	30	1		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	1	10		
Eingelöst	(2)	(7)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1)	3		
Klasse E USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(1)		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	–	46		
Eingelöst	(15)	(39)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(15)	7		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum			Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)		31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – (Fortsetzung)					
Klasse F USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	–	16			
Eingelöst	–	(1)			
Nettozunahme	–	15			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	14	29			
Eingelöst	(33)	(1)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(19)	28			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	196	121			
Eingelöst	(50)	(38)			
Nettozunahme	146	83			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	12	52			
Eingelöst	(64)	(41)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(52)	11			
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	3	–			
Nettozunahme	3	–			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	–	1			
Eingelöst	(9)	(4)			
Nettoabnahme	(9)	(3)			
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Verkauft	8	8			
Eingelöst	(39)	(96)			
Nettoabnahme	(31)	(88)			
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	2	4			
Eingelöst	(4)	(5)			
Nettoabnahme	(2)	(1)			
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	119	193			
Eingelöst	(204)	(516)			
Nettoabnahme	(85)	(323)			
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	155			
Nettozunahme	–	155			
Klasse S AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Eingelöst	–	(20)			
Nettoabnahme	–	(20)			
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^A					
Klasse X USD thesaurierend					
Eingelöst	(3)	–			
Nettoabnahme	(3)	–			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	71	110			
Eingelöst	(109)	(484)			
Nettoabnahme	(38)	(374)			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	50	35			
Eingelöst	(181)	(9)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(131)	26			
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	–			
Nettozunahme	1	–			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Verkauft	2	9			
Eingelöst	(1)	(10)			
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(1)			
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	24			
Eingelöst	(1)	–			
Nettozunahme	–	24			
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund^A					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	–	15			
Eingelöst	(5)	(2)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(5)	13			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	1			
Eingelöst	(1)	–			
Nettozunahme	–	1			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Verkauft	–	2			
Eingelöst	(15)	(2)			
Nettoabnahme	(15)	–			
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	4	5			
Eingelöst	(1)	(3)			
Nettozunahme	3	2			
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^A^β					
Klasse A EUR, ausschüttend (D)					
Verkauft	–	1			
Nettozunahme	–	1			
Klasse LM EUR, thesaurierend					
Eingelöst	–	(27)			
Nettoabnahme	–	(27)			
Klasse LM EUR, ausschüttend (Q)					
Verkauft	–	1			
Eingelöst	–	(9)			
Nettoabnahme	–	(8)			
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^A					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	60	316			
Eingelöst	(1.371)	(1.234)			
Nettoabnahme	(1.311)	(918)			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Verkauft	63	500			
Eingelöst	(364)	(615)			
Nettoabnahme	(301)	(115)			
Klasse A USD, ausschüttend (S)					
Verkauft	20	10			
Eingelöst	(106)	(138)			
Nettoabnahme	(86)	(128)			
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	–			
Eingelöst	–	(15)			
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(15)			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	–	5			
Eingelöst	(67)	(117)			
Nettoabnahme	(67)	(112)			
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	9			
Eingelöst	(54)	(29)			
Nettoabnahme	(54)	(20)			
Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)					
Eingelöst	–	(23)			
Nettoabnahme	–	(23)			
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Eingelöst	(61)	–			
Nettoabnahme	(61)	–			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	351	470			
Eingelöst	(1.721)	(687)			
Nettoabnahme	(1.370)	(217)			
Klasse A EUR, ausschüttend (A)					
Verkauft	–	3			
Eingelöst	(11)	(19)			
Nettoabnahme	(11)	(16)			
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	–	1			
Eingelöst	(9)	(37)			
Nettoabnahme	(9)	(36)			
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)					
Verkauft	8	9			
Eingelöst	(3)	(21)			
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(12)			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum			Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)		31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^A – (Fortsetzung)					
Klasse A GBP thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	38			
Eingelöst	(90)	(60)			
Nettoabnahme	(90)	(22)			
Klasse A GBP, thesaurierend					
Verkauft	–	1			
Eingelöst	(1)	(1)			
Nettoabnahme	(1)	–			
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	1	7			
Eingelöst	(7)	(61)			
Nettoabnahme	(6)	(54)			
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	11	105			
Eingelöst	(57)	(60)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(46)	45			
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	16.263			
Eingelöst	(12.305)	(20.253)			
Nettoabnahme	(12.305)	(3.990)			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	893	6.279			
Eingelöst	(11.870)	(22.469)			
Nettoabnahme	(10.977)	(16.190)			
Klasse B USD, thesaurierend					
Eingelöst	–	(1)			
Nettoabnahme	–	(1)			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	–	5			
Eingelöst	(61)	(131)			
Nettoabnahme	(61)	(126)			
Klasse C USD, ausschüttend (S)					
Verkauft	–	1			
Eingelöst	(10)	(16)			
Nettoabnahme	(10)	(15)			
Klasse A NOK thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	254	217			
Eingelöst	(121)	(72)			
Nettozunahme	133	145			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	–	3			
Eingelöst	(20)	(87)			
Nettoabnahme	(20)	(84)			
Klasse E USD, ausschüttend (S)					
Eingelöst	(5)	(1)			
Nettoabnahme	(5)	(1)			
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	3			
Eingelöst	(8)	(24)			
Nettoabnahme	(8)	(21)			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	61	90			
Eingelöst	(204)	(345)			
Nettoabnahme	(143)	(255)			
Klasse F USD, ausschüttend (S)					
Verkauft	3	11			
Eingelöst	(30)	(49)			
Nettoabnahme	(27)	(38)			
Klasse X USD thesaurierend					
Verkauft	3	189			
Eingelöst	(551)	(532)			
Nettoabnahme	(548)	(343)			
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Verkauft	2	60			
Eingelöst	(125)	(104)			
Nettoabnahme	(123)	(44)			
Klasse X USD, ausschüttend (S)					
Verkauft	1	12			
Eingelöst	(60)	(28)			
Nettoabnahme	(59)	(16)			
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	7	36			
Eingelöst	(71)	(25)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(64)	11			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1.408	178			
Eingelöst	(622)	(314)			
Nettozunahme/(-abnahme)	786	(136)			
Klasse X EUR, thesaurierend					
Verkauft	–	2			
Eingelöst	(14)	(70)			
Nettoabnahme	(14)	(68)			
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)					
Verkauft	7	128			
Eingelöst	(18)	(138)			
Nettoabnahme	(11)	(10)			
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	–	5			
Eingelöst	(31)	(2)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(31)	3			
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	25	74			
Eingelöst	(138)	(217)			
Nettoabnahme	(113)	(143)			
Klasse X GBP, thesaurierend					
Verkauft	–	2			
Eingelöst	(3)	(12)			
Nettoabnahme	(3)	(10)			
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	1	15			
Eingelöst	(21)	(27)			
Nettoabnahme	(20)	(12)			
Klasse X SGD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	930	783			
Eingelöst	(1.063)	(353)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(133)	430			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	52	424			
Eingelöst	(934)	(1.145)			
Nettoabnahme	(882)	(721)			
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)					
Verkauft	1	192			
Eingelöst	(218)	(433)			
Nettoabnahme	(217)	(241)			
Klasse Premier AUD thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	–			
Eingelöst	(16)	(24)			
Nettoabnahme	(15)	(24)			
Klasse Premier AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)					
Verkauft	10	35			
Eingelöst	(548)	(100)			
Nettoabnahme	(538)	(65)			
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	92	213			
Eingelöst	(1.998)	(588)			
Nettoabnahme	(1.906)	(375)			
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	25			
Eingelöst	(81)	(9)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(81)	16			
Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)					
Verkauft	–	7			
Eingelöst	(11)	(2)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(11)	5			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	77	507			
Eingelöst	(1.286)	(566)			
Nettoabnahme	(1.209)	(59)			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Verkauft	11	17			
Eingelöst	(34)	(35)			
Nettoabnahme	(23)	(18)			
Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)					
Verkauft	1	109			
Eingelöst	(97)	(486)			
Nettoabnahme	(96)	(377)			
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	12	81			
Eingelöst	(482)	(491)			
Nettoabnahme	(470)	(410)			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] – (Fortsetzung)				
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)				
Verkauft	7	317		
Eingelöst	(1.018)	(1.612)		
Nettoabnahme	(1.011)	(1.295)		
Klasse Premier JPY thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	99	14		
Eingelöst	(156)	(89)		
Nettoabnahme	(57)	(75)		
Klasse Premier JPY, ausschüttend (S) (abgesichert)				
Eingelöst	(100)	–		
Nettoabnahme	(100)	–		
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	16	–		
Eingelöst	(31)	(15)		
Nettoabnahme	(15)	(15)		
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	(1)	(6)		
Nettoabnahme	(1)	(6)		
Klasse S USD, thesaurierend				
Eingelöst	(26)	(8)		
Nettoabnahme	(26)	(8)		
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	6		
Eingelöst	(9)	(195)		
Nettoabnahme	(9)	(189)		
Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)				
Verkauft	31	144		
Eingelöst	(565)	(201)		
Nettoabnahme	(534)	(57)		
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Verkauft	1	1		
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettozunahme	–	–		
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	–	1		
Nettozunahme	–	1		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	–	1		
Nettozunahme	–	1		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	19	3		
Eingelöst	(15)	(39)		
Nettozunahme/(-abnahme)	4	(36)		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)				
Eingelöst	(3)	–		
Nettoabnahme	(3)	–		
Klasse S USD, thesaurierend				
Verkauft	1	6		
Eingelöst	(1)	(6)		
Nettozunahme	–	–		
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	35	45		
Eingelöst	(28)	(36)		
Nettozunahme	7	9		
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	21	29		
Eingelöst	(10)	(8)		
Nettozunahme	11	21		
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	227		
Eingelöst	(1.230)	(57)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1.230)	170		
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	21	16		
Eingelöst	(14)	(4)		
Nettozunahme	7	12		
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	43	29		
Eingelöst	(22)	(36)		
Nettozunahme/(-abnahme)	21	(7)		
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	264	–		
Eingelöst	(4)	–		
Nettozunahme	260	–		
Klasse S CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)				
Verkauft	20	–		
Nettozunahme	20	–		
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]				
Klasse D EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	–	(3)		
Nettoabnahme	–	(2)		
Klasse D USD, thesaurierend				
Eingelöst	(7)	(91)		
Nettoabnahme	(7)	(91)		
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus				
Eingelöst	–	(107)		
Nettoabnahme	–	(107)		
Klasse D USD, ausschüttend (M)				
Eingelöst	–	(250)		
Nettoabnahme	–	(250)		
Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	(10)	(5)		
Nettoabnahme	(10)	(5)		
Klasse M USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse M USD, ausschüttend (M)				
Eingelöst	–	(9)		
Nettoabnahme	–	(9)		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	62	116		
Eingelöst	(1.316)	(208)		
Nettoabnahme	(1.254)	(92)		
Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)				
Eingelöst	–	(22)		
Nettoabnahme	–	(22)		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	5	637		
Eingelöst	(1.030)	(407)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1.025)	230		
Klasse Premier EUR ausschüttend (Q) (abgesichert)				
Verkauft	3	15		
Eingelöst	(175)	(100)		
Nettoabnahme	(172)	(85)		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)				
Verkauft	–	9		
Eingelöst	(105)	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(105)	9		
Klasse LM USD, thesaurierend				
Verkauft	–	539		
Eingelöst	(209)	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(209)	539		
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]				
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	420	–		
Eingelöst	–	(18)		
Nettozunahme/(-abnahme)	420	(18)		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	19	1		
Eingelöst	(3)	(22)		
Nettozunahme/(-abnahme)	16	(21)		
Klasse LM USD, thesaurierend				
Verkauft	–	1.814		
Nettozunahme	–	1.814		
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]				
Klasse LM GBP, thesaurierend				
Eingelöst	(637)	–		
Nettoabnahme	(637)	–		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] – (Fortsetzung)				
Klasse LM GBP, ausschüttend (M)				
Verkauft	695	–	–	(1)
Nettozunahme	695	–	–	(1)
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	–	2	2	3.289
Eingelöst	–	(72)	–	(3.327)
Nettoabnahme	–	(70)	2	(38)
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	5	26	(1)	–
Eingelöst	(2)	–	(1)	–
Nettozunahme	3	26	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	31	1	(1)	(5)
Eingelöst	(3)	(3)	(1)	(5)
Nettozunahme/(-abnahme)	28	(2)	–	(4)
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	(951)	–	–	(4)
Nettoabnahme	(951)	–	–	(4)
Klasse LM GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	1.065	–	–	–
Nettozunahme	1.065	–	–	–
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]				
Klasse LM USD, ausschüttend (Q)				
Verkauft	7	5	1	1
Eingelöst	(4)	–	(2)	–
Nettozunahme	3	5	(1)	1
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]				
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	(1)	–	–	–
Nettoabnahme	(1)	–	–	–
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	2	12	59	4
Eingelöst	(5)	(19)	(4)	(3)
Nettoabnahme	(3)	(7)	55	1
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Eingelöst	–	(3)	–	(1)
Nettoabnahme	–	(3)	–	(1)
Klasse A USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	1	1	–	–
Eingelöst	(6)	(3)	–	–
Nettoabnahme	(5)	(2)	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (S)				
Verkauft	12	9	–	–
Eingelöst	(11)	(12)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(3)	–	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Eingelöst	–	(3)	–	–
Nettoabnahme	–	(3)	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)				
Verkauft	1	2	–	–
Eingelöst	(24)	(48)	–	–
Nettoabnahme	(23)	(46)	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	2	3	–	–
Eingelöst	(3)	(1)	–	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1)	2	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)				
Eingelöst	(2)	–	–	–
Nettoabnahme	(2)	–	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)				
Verkauft	1	1	–	–
Eingelöst	(3)	(10)	–	–
Nettoabnahme	(2)	(9)	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (S)				
Eingelöst	–	(1)	–	–
Nettoabnahme	–	(1)	–	–
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Eingelöst	–	(1)	–	–
Nettoabnahme	–	(1)	–	–
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)				
Eingelöst	(2)	(6)	–	–
Nettoabnahme	(2)	(6)	–	–
Klasse A SGD, thesaurierend				
Verkauft	2	3.289	–	–
Eingelöst	–	(3.327)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	2	(38)	–	–
Klasse C USD, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	–	–	–
Nettoabnahme	(1)	–	–	–
Klasse C USD, ausschüttend (S)				
Eingelöst	(1)	(5)	–	–
Nettoabnahme	(1)	(5)	–	–
Klasse E USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(4)	–	–
Nettoabnahme	–	(4)	–	–
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)				
Eingelöst	(1)	(1)	–	–
Nettoabnahme	(1)	(1)	–	–
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	1	1	–	–
Eingelöst	(2)	–	–	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1)	1	–	–
Klasse F USD, ausschüttend (S)				
Eingelöst	–	(1)	–	–
Nettoabnahme	–	(1)	–	–
Klasse X USD thesaurierend				
Verkauft	59	4	–	–
Eingelöst	(4)	(3)	–	–
Nettozunahme	55	1	–	–
Klasse X USD, ausschüttend (S)				
Eingelöst	(2)	–	–	–
Nettoabnahme	(2)	–	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)				
Eingelöst	(8)	(1)	–	–
Nettoabnahme	(8)	(1)	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	–	(3)	–	–
Nettoabnahme	–	(3)	–	–
Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)				
Eingelöst	(4)	(4)	–	–
Nettoabnahme	(4)	(4)	–	–
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)				
Verkauft	–	1	–	–
Eingelöst	(1)	(1)	–	–
Nettoabnahme	(1)	–	–	–
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	12	23	–	–
Eingelöst	(34)	(40)	–	–
Nettoabnahme	(22)	(17)	–	–
Klasse X GBP, thesaurierend				
Verkauft	105	24	–	–
Eingelöst	(61)	(45)	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	44	(21)	–	–
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)				
Verkauft	3	15	–	–
Eingelöst	(8)	(28)	–	–
Nettoabnahme	(5)	(13)	–	–
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)				
Verkauft	9	17	–	–
Eingelöst	(22)	(56)	–	–
Nettoabnahme	(13)	(39)	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Eingelöst	(2)	(143)	–	–
Nettoabnahme	(2)	(143)	–	–
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)				
Eingelöst	(9)	(1)	–	–
Nettoabnahme	(9)	(1)	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum			Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)		31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)					
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)					
Verkauft	1	5			
Eingelöst	(51)	(63)			
Nettoabnahme	(50)	(58)			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Eingelöst	–	(338)			
Nettoabnahme	–	(338)			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Verkauft	1	–			
Eingelöst	(4)	(3)			
Nettoabnahme	(3)	(3)			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Eingelöst	(1)	(2)			
Nettoabnahme	(1)	(2)			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)					
Eingelöst	(4)	(2)			
Nettoabnahme	(4)	(2)			
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)					
Verkauft	103	32			
Eingelöst	(18)	(8)			
Nettozunahme	85	24			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Verkauft	2	7			
Eingelöst	(1)	(20)			
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(13)			
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]					
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Eingelöst	(2)	–			
Nettoabnahme	(2)	–			
Klasse A SGD, thesaurierend					
Verkauft	3.936	–			
Eingelöst	(3.936)	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse E USD, ausschüttend (A)					
Eingelöst	–	(3)			
Nettoabnahme	–	(3)			
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)					
Eingelöst	(4)	–			
Nettoabnahme	(4)	–			
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	3	–			
Nettozunahme	3	–			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	63	181			
Eingelöst	(38)	(14)			
Nettozunahme	25	167			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	15			
Eingelöst	–	(47)			
Nettoabnahme	–	(32)			
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)					
Verkauft	7	6			
Eingelöst	–	(57)			
Nettozunahme/(-abnahme)	7	(51)			
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)					
Eingelöst	–	(15)			
Nettoabnahme	–	(15)			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Eingelöst	–	(43)			
Nettoabnahme	–	(43)			
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)					
Eingelöst	(1.443)	–			
Nettoabnahme	(1.443)	–			
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund[^]					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	–	2			
Nettozunahme	–	2			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Eingelöst	–	(4)			
Nettoabnahme	–	(4)			
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	3	5			
Eingelöst	(5)	(5)			
Nettoabnahme	(2)	–			
Klasse A SGD, thesaurierend					
Verkauft	3	11.852			
Eingelöst	(34)	(11.933)			
Nettoabnahme	(31)	(81)			
Klasse C USD, thesaurierend					
Eingelöst	(9)	–			
Nettoabnahme	(9)	–			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	–	14			
Eingelöst	(2)	(5)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(2)	9			
Klasse F USD, ausschüttend (M)					
Eingelöst	–	(9)			
Nettoabnahme	–	(9)			
Klasse Premier USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)					
Eingelöst	–	(7)			
Nettoabnahme	–	(7)			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	5	58			
Eingelöst	(54)	(812)			
Nettoabnahme	(49)	(754)			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)					
Verkauft	1	1			
Nettozunahme	1	1			
Premier Klasse NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)					
Verkauft	3	–			
Nettozunahme	3	–			
Klasse LM EUR, thesaurierend					
Verkauft	–	2			
Eingelöst	(2)	(2)			
Nettoabnahme	(2)	–			
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)					
Verkauft	2	3			
Eingelöst	(6)	(1.490)			
Nettoabnahme	(4)	(1.487)			
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	74	932			
Eingelöst	(274)	(81)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(200)	851			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	5	10			
Eingelöst	(7)	–			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(2)	10			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	7	132			
Eingelöst	(112)	(4)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(105)	128			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Verkauft	54	1.233			
Eingelöst	(354)	(63)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(300)	1.170			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	11	83			
Eingelöst	(211)	(3)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(200)	80			
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	34			
Eingelöst	(2)	–			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(2)	34			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Eingelöst	(14)	–			
Nettoabnahme	(14)	–			
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus					
Verkauft	3	69			
Eingelöst	(11)	–			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(8)	69			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)				
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	75	132	3	93
Eingelöst	(157)	(15)	(12)	(1)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(82)	117	(9)	92
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)				
Verkauft	32	109	–	1
Eingelöst	(15)	(12)	(1)	–
Nettozunahme	17	97	(1)	1
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	44	162	10	59
Eingelöst	(31)	(33)	(52)	(1)
Nettozunahme	13	129	(42)	58
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	1	–	1	3
Eingelöst	(4)	–	(6)	–
Nettoabnahme	(3)	–	(5)	3
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	1	33	–	24
Eingelöst	(8)	(1)	(20)	(1)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(7)	32	(20)	23
Klasse A GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus				
Verkauft	5	–	–	29
Eingelöst	(6)	–	(199)	(3)
Nettoabnahme	(1)	–	(170)	179
Klasse A HKD, thesaurierend				
Verkauft	1	–	–	3
Eingelöst	(14)	–	–	–
Nettoabnahme	(13)	–	–	3
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	15	199	4	37
Eingelöst	(478)	–	(19)	(9)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(463)	199	(15)	28
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	45.934	5.558	1	46
Eingelöst	(7.819)	(171)	(11)	(9)
Nettozunahme	38.115	5.387	(10)	37
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	2.040	25.821	70	656
Eingelöst	(5.580)	(2.778)	(336)	(17)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(3.540)	23.043	(266)	639
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	140	1.557	4	162
Eingelöst	(1.092)	–	(57)	(1)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(952)	1.557	(53)	161
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	3	236	–	–
Eingelöst	(130)	–	4	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	(127)	236	4	–
Klasse C USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	101	8	4	–
Eingelöst	(2)	(1)	4	–
Nettozunahme	99	7	–	–
Klasse A CZK thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	–	–	–
Nettozunahme	1	–	–	–
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	10	156	142	879
Eingelöst	(21)	(7)	(341)	(35)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(11)	149	(199)	844
Klasse E USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	–	5	–	–
Eingelöst	(2)	–	76	279
Netto-(Abgang)/-Zugang	(2)	5	(132)	(3)
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	4	26	Netto-(Abgang)/-Zugang	(56)
Eingelöst	(7)	(1)	Netto-(Abgang)/-Zugang	(14)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(3)	25	Netto-(Abgang)/-Zugang	(14)
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	30	287	1	180
Eingelöst	(168)	(7)	Eingelöst	(38)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(138)	280	Nettoabnahme	(37)
Klasse F USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	4	44	Netto-(Abgang)/-Zugang	(14)
Eingelöst	(14)	–	Netto-(Abgang)/-Zugang	(14)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(10)	44	Netto-(Abgang)/-Zugang	(14)
Klasse X USD thesaurierend				
Verkauft	3	93	193	577
Eingelöst	(12)	(1)	Eingelöst	(1.031)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(9)	92	Netto-(Abgang)/-Zugang	(838)
Klasse X USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	–	1	Klasse S USD, thesaurierend	
Eingelöst	(1)	–	Verkauft	158
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1)	1	Eingelöst	(235)
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	10	59	Netto-(Abgang)/-Zugang	(77)
Eingelöst	(52)	(1)	Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	
Netto-(Abgang)/-Zugang	(42)	58	Verkauft	5
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	3	Eingelöst	(2)
Eingelöst	(6)	–	Nettozunahme	3
Netto-(Abgang)/-Zugang	(5)	3		
Klasse X CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)				
Verkauft	–	24		
Eingelöst	(20)	(1)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(20)	23		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	29	182		
Eingelöst	(199)	(3)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(170)	179		
Klasse X EUR, thesaurierend				
Verkauft	–	3		
Nettozunahme	–	3		
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	4	37		
Eingelöst	(19)	(9)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(15)	28		
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	1	46		
Eingelöst	(11)	(9)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(10)	37		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	70	656		
Eingelöst	(336)	(17)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(266)	639		
Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	4	162		
Eingelöst	(57)	(1)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(53)	161		
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	4	–		
Nettozunahme	4	–		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	142	879		
Eingelöst	(341)	(35)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(199)	844		
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	76	279		
Eingelöst	(132)	(3)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(56)	276		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)				
Verkauft	–	14		
Eingelöst	(14)	(4)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(14)	10		
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	180		
Eingelöst	(38)	(750)		
Nettoabnahme	(37)	(570)		
Klasse S USD, thesaurierend				
Verkauft	193	577		
Eingelöst	(1.031)	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(838)	577		
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	158	447		
Eingelöst	(235)	(35)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(77)	412		
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	5	59		
Eingelöst	(2)	(47)		
Nettozunahme	3	12		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum			Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)		31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)					
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	2	1			
Eingelöst	(12)	–			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(10)	1			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Verkauft	100	–			
Nettozunahme	100	–			
Klasse LM USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	8	–			
Eingelöst	(8)	–			
Nettozunahme	–	–			
LM Klasse EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	910	3			
Eingelöst	(6)	–			
Nettozunahme	904	3			
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	25	1			
Eingelöst	(106)	(9)			
Nettoabnahme	(81)	(8)			
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]					
Klasse A USD thesaurierend					
Eingelöst	–	(6)			
Nettoabnahme	–	(6)			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	12	64			
Eingelöst	(13)	(22)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1)	42			
Klasse S BRL, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	22			
Eingelöst	–	(4)			
Nettozunahme	–	18			
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]					
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Verkauft	–	–			
Nettozunahme	–	–			
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	1	–			
Nettozunahme	1	–			
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	104	3.837			
Eingelöst	(5.710)	(10.720)			
Nettoabnahme	(5.606)	(6.883)			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Eingelöst	–	(145)			
Nettoabnahme	–	(145)			
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)					
Eingelöst	(237)	(3.156)			
Nettoabnahme	(237)	(3.156)			
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	–	–			
Eingelöst	–	–			
Nettozunahme	–	–			
Legg Mason ClearBridge Value Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	141	532			
Eingelöst	(102)	(72)			
Nettozunahme	39	460			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	9	31			
Eingelöst	(8)	(14)			
Nettozunahme	1	17			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	29	–			
Eingelöst	(29)	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	28	36			
Eingelöst	(23)	(13)			
Nettozunahme	5	23			
Klasse A GBP, ausschüttend (A)					
Verkauft	–	2			
Eingelöst	–	(2)			
Nettozunahme	–	–			
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	124	1.223			
Eingelöst	(525)	(510)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(401)	713			
Klasse A SGD, thesaurierend					
Verkauft	581	2.594			
Eingelöst	(488)	(800)			
Nettozunahme	93	1.794			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	22	92			
Eingelöst	(3)	(44)			
Nettozunahme	19	48			
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	2	4			
Eingelöst	–	(1)			
Nettozunahme	2	3			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	14	25			
Nettozunahme	14	25			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	26	50			
Eingelöst	(25)	(1)			
Nettozunahme	1	49			
Klasse F USD ausschüttend (A)					
Verkauft	–	14			
Nettozunahme	–	14			
Klasse X USD thesaurierend					
Verkauft	4	–			
Eingelöst	(3)	–			
Nettozunahme	1	–			
Klasse X USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	19	150			
Eingelöst	(75)	(80)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(56)	70			
Klasse X EUR, thesaurierend					
Verkauft	72	18			
Eingelöst	(46)	(2)			
Nettozunahme	26	16			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	281	140			
Eingelöst	(70)	(141)			
Nettozunahme/(-abnahme)	211	(1)			
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	10	1			
Nettozunahme	10	1			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	159	17			
Eingelöst	(45)	(14)			
Nettozunahme	114	3			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Verkauft	83	142			
Eingelöst	(82)	(32)			
Nettozunahme	1	110			
LM Klasse USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	5	89			
Eingelöst	(31)	–			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(26)	89			
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	7	11			
Eingelöst	(12)	(11)			
Nettoabnahme	(5)	–			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	1	1			
Eingelöst	(7)	(4)			
Nettoabnahme	(6)	(3)			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund – (Fortsetzung)				
Klasse A EUR, thesaurierend				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme	–	–		
Klasse B USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	1	2		
Eingelöst	(2)	(4)		
Nettoabnahme	(1)	(2)		
Klasse C USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	(2)	(1)		
Nettoabnahme	(2)	(1)		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	1	10		
Eingelöst	(5)	(6)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(4)	4		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	7	16		
Eingelöst	(14)	(24)		
Nettoabnahme	(7)	(8)		
Klasse F USD ausschüttend (A)				
Verkauft	1	3		
Eingelöst	–	(3)		
Nettozunahme	1	–		
Klasse X USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	–	15		
Eingelöst	(21)	(3)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(21)	12		
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	(3)	–		
Nettoabnahme	(3)	–		
Klasse Premier EUR, thesaurierend				
Verkauft	18	–		
Eingelöst	(2)	(49)		
Nettozunahme/(-abnahme)	16	(49)		
Klasse LM USD, thesaurierend				
Verkauft	6	36		
Eingelöst	–	(10)		
Nettozunahme	6	26		
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Eingelöst	–	(2)		
Nettoabnahme	–	(2)		
Klasse L (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse GA USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	54	101		
Eingelöst	(75)	(108)		
Nettoabnahme	(21)	(7)		
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	7	18		
Eingelöst	(7)	(29)		
Nettoabnahme	–	(11)		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	17	24		
Eingelöst	(18)	(28)		
Nettoabnahme	(1)	(4)		
Klasse A EUR, thesaurierend				
Verkauft	11	14		
Eingelöst	(36)	(32)		
Nettoabnahme	(25)	(18)		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	2	24		
Eingelöst	(4)	(10)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(2)	14		
Klasse C USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	(1)	(2)		
Nettoabnahme	(1)	(2)		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	4	14		
Eingelöst	(7)	(15)		
Nettoabnahme	(3)	(1)		
Klasse E USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	–	(2)		
Nettoabnahme	–	(2)		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	101	136		
Eingelöst	(121)	(89)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(20)	47		
Klasse F USD ausschüttend (A)				
Verkauft	2	21		
Eingelöst	(32)	(14)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(30)	7		
Klasse U USD, thesaurierend				
Verkauft	291	196		
Eingelöst	(413)	(441)		
Nettoabnahme	(122)	(245)		
Klasse U EUR, thesaurierend				
Verkauft	19	100		
Eingelöst	(137)	(93)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(118)	7		
Klasse X USD thesaurierend				
Verkauft	19	16		
Eingelöst	(32)	(46)		
Nettoabnahme	(13)	(30)		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	13		
Eingelöst	(12)	(70)		
Nettoabnahme	(11)	(57)		
Klasse X EUR, thesaurierend				
Verkauft	1	6		
Eingelöst	(1)	(2)		
Nettozunahme	–	4		
Klasse X GBP, thesaurierend				
Verkauft	8	9		
Eingelöst	(7)	(13)		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(4)		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	250	221		
Eingelöst	(607)	(353)		
Nettoabnahme	(357)	(132)		
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	11	19		
Eingelöst	(5)	(4)		
Nettozunahme	6	15		
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	581		
Eingelöst	(492)	(50)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(492)	531		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	14	23		
Eingelöst	(34)	(27)		
Nettoabnahme	(20)	(4)		
Klasse Premier EUR, thesaurierend				
Verkauft	11	116		
Eingelöst	(99)	(154)		
Nettoabnahme	(88)	(38)		
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)				
Verkauft	4	9		
Eingelöst	–	(4)		
Nettozunahme	4	5		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum			Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)		31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund – (Fortsetzung)					
Klasse Premier GBP, thesaurierend					
Verkauft	27	77			
Eingelöst	(68)	(35)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(41)	42			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Verkauft	89	125			
Eingelöst	(38)	(51)			
Nettozunahme	51	74			
Klasse LM EUR, thesaurierend					
Eingelöst	–	(1)			
Nettoabnahme	–	(1)			
Klasse A (G) USD, thesaurierend					
Eingelöst	(1)	(1)			
Nettoabnahme	(1)	(1)			
Klasse L (G) USD, thesaurierend					
Eingelöst	–	(2)			
Nettoabnahme	–	(2)			
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	7	24			
Eingelöst	(32)	(48)			
Nettoabnahme	(25)	(24)			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	1	11			
Eingelöst	(4)	(18)			
Nettoabnahme	(3)	(7)			
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	2	10			
Eingelöst	(3)	(53)			
Nettoabnahme	(1)	(43)			
Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	2	95			
Eingelöst	–	(50)			
Nettozunahme	2	45			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	1			
Eingelöst	–	(2)			
Nettoabnahme	–	(1)			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	1	2			
Eingelöst	(1)	(5)			
Nettoabnahme	–	(3)			
Klasse A HKD, thesaurierend					
Eingelöst	(2)	–			
Nettoabnahme	(2)	–			
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	1			
Eingelöst	(1)	(1)			
Nettozunahme	–	–			
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	54	568			
Eingelöst	(352)	(625)			
Nettoabnahme	(298)	(57)			
Klasse B USD, thesaurierend					
Eingelöst	(1)	(1)			
Nettoabnahme	(1)	(1)			
Klasse B USD, ausschüttend (A)					
Eingelöst	(1)	(1)			
Nettoabnahme	(1)	(1)			
Klasse C USD, thesaurierend					
Eingelöst	(3)	(1)			
Nettoabnahme	(3)	(1)			
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Eingelöst	(8)	(4)			
Nettoabnahme	(8)	(4)			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	–	5			
Eingelöst	(20)	(1)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(20)	4			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	2	–			
Eingelöst	(3)	(6)			
Nettoabnahme	(1)	(6)			
Klasse F USD ausschüttend (A)					
Verkauft	–	3			
Eingelöst	(1)	(1)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1)	2			
Klasse X USD thesaurierend					
Verkauft	–	3			
Eingelöst	(2)	(5)			
Nettoabnahme	(2)	(2)			
Klasse X EUR, thesaurierend					
Eingelöst	(2)	–			
Nettoabnahme	(2)	–			
Klasse X GBP, thesaurierend					
Verkauft	1	8			
Eingelöst	(12)	(14)			
Nettoabnahme	(11)	(6)			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	1	35			
Eingelöst	(79)	(78)			
Nettoabnahme	(78)	(43)			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Eingelöst	–	(1)			
Nettoabnahme	–	(1)			
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	1			
Eingelöst	–	(1)			
Nettozunahme	–	–			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)					
Verkauft	2	3			
Eingelöst	(27)	(33)			
Nettoabnahme	(25)	(30)			
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	7			
Eingelöst	(33)	–			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(33)	7			
Klasse A (G) USD, thesaurierend					
Eingelöst	(3)	(4)			
Nettoabnahme	(3)	(4)			
Klasse L (G) USD, thesaurierend					
Eingelöst	(1)	(3)			
Nettoabnahme	(1)	(3)			
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	10	3			
Eingelöst	(2)	(5)			
Nettozunahme/(-abnahme)	8	(2)			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	8	5			
Eingelöst	(2)	(6)			
Nettozunahme/(-abnahme)	6	(1)			
Klasse A USD, ausschüttend (Q)					
Eingelöst	–	(1)			
Nettoabnahme	–	(1)			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	2	3			
Eingelöst	(1)	(2)			
Nettozunahme	1	1			
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus					
Verkauft	–	1			
Eingelöst	(3)	–			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(3)	1			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	1			
Eingelöst	–	(1)			
Nettozunahme	–	–			
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	3	13			
Eingelöst	(24)	(15)			
Nettoabnahme	(21)	(2)			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – (Fortsetzung)				
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	1.297	91		
Eingelöst	(17)	(34)		
Nettozunahme	1.280	57		
Klasse C USD, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse C USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(6)	(4)		
Nettoabnahme	(5)	(4)		
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	58	114		
Eingelöst	(28)	(15)		
Nettozunahme	30	99		
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	13	34		
Eingelöst	(15)	(1)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(2)	33		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	43	126		
Eingelöst	(136)	(32)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(93)	94		
Klasse A SEK, thesaurierend				
Verkauft	58	72		
Eingelöst	(188)	(222)		
Nettoabnahme	(130)	(150)		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	1	14		
Nettozunahme	1	14		
Klasse X USD thesaurierend				
Verkauft	9	29		
Eingelöst	(94)	(6)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(85)	23		
Klasse X USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	2	2		
Eingelöst	(3)	(2)		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	6		
Eingelöst	(2)	(7)		
Nettoabnahme	(1)	(1)		
Klasse X EUR, thesaurierend				
Verkauft	–	11		
Nettozunahme	–	11		
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	4	18		
Eingelöst	(4)	(3)		
Nettozunahme	–	15		
Klasse X GBP, thesaurierend				
Verkauft	829	96		
Eingelöst	(226)	(35)		
Nettozunahme	603	61		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	226	760		
Eingelöst	(432)	(43)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(206)	717		
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	8	–		
Nettozunahme	8	–		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	7	5		
Eingelöst	(2)	–		
Nettozunahme	5	5		
Klasse Premier GBP, thesaurierend				
Verkauft	63	3		
Eingelöst	(47)	(1)		
Nettozunahme	16	2		
Klasse S USD, thesaurierend				
Verkauft	1.096	1.620		
Eingelöst	(876)	(448)		
Nettozunahme	220	1.172		
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	2	42		
Eingelöst	(42)	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(40)	42		
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	33	165		
Eingelöst	(16)	(31)		
Nettozunahme	17	134		
Klasse S GBP, thesaurierend				
Verkauft	172	378		
Eingelöst	(185)	(108)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(13)	270		
Klasse S GBP, ausschüttend (Q)				
Verkauft	14	35		
Eingelöst	(10)	(2)		
Nettozunahme	4	33		
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Verkauft	84	73		
Eingelöst	(2)	(4)		
Nettozunahme	82	69		
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund^				
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	1	9		
Eingelöst	(12)	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(11)	9		
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^				
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	6.788	2.767		
Eingelöst	(4.737)	(1.959)		
Nettozunahme	2.051	808		
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	1.108	242		
Eingelöst	(1.859)	(12)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(751)	230		
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	2.195	2.039		
Eingelöst	(2.706)	(2.027)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(511)	12		
Klasse A USD, ausschüttend (Q)				
Verkauft	61	35		
Eingelöst	(73)	(134)		
Nettoabnahme	(12)	(99)		
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	314	320		
Eingelöst	(751)	(192)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(437)	128		
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus				
Verkauft	5.708	3.020		
Eingelöst	(4.011)	(1.020)		
Nettozunahme	1.697	2.000		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)				
Verkauft	317	225		
Eingelöst	(63)	(29)		
Nettozunahme	254	196		
Klasse A EUR, thesaurierend				
Verkauft	4.336	1.488		
Eingelöst	(1.104)	(2.021)		
Nettozunahme/(-abnahme)	3.232	(533)		
Klasse A EUR, ausschüttend (A)				
Verkauft	10	–		
Nettozunahme	10	–		
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	163	95		
Eingelöst	(99)	(85)		
Nettozunahme	64	10		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	5.156	7.654		
Eingelöst	(3.078)	(5.888)		
Nettozunahme	2.078	1.766		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum			Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)		31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^] – (Fortsetzung)					
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	40	1			
Eingelöst	–	(16)			
Nettozunahme/(-abnahme)	40	(15)			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	34	369			
Eingelöst	(31)	(2)			
Nettozunahme	3	367			
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	143	99			
Eingelöst	(44)	(26)			
Nettozunahme	99	73			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	95	180			
Eingelöst	(61)	(14)			
Nettozunahme	34	166			
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	252	8			
Eingelöst	(27)	(2)			
Nettozunahme	225	6			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	393	5			
Eingelöst	(125)	–			
Nettozunahme	268	5			
Klasse X USD thesaurierend					
Verkauft	93	–			
Nettozunahme	93	–			
Klasse X USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	5	2			
Nettozunahme	5	2			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)					
Verkauft	554	186			
Eingelöst	(131)	(5)			
Nettozunahme	423	181			
Klasse X EUR, thesaurierend					
Verkauft	1.347	1.189			
Eingelöst	(682)	(1.455)			
Nettozunahme/(-abnahme)	665	(266)			
Klasse X GBP ausschüttend (Q) (abgesichert)					
Verkauft	32	–			
Eingelöst	(32)	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse X GBP ausschüttend (Q)					
Verkauft	36	25			
Eingelöst	(15)	(7)			
Nettozunahme	21	18			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	4.001	282			
Eingelöst	(1.401)	(63)			
Nettozunahme	2.600	219			
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	320	422			
Eingelöst	(114)	(252)			
Nettozunahme	206	170			
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)					
Verkauft	68	79			
Nettozunahme	68	79			
Premier Klasse CAD, ausschüttend (Q) Plus (e)					
Verkauft	7	19			
Eingelöst	(108)	(762)			
Nettoabnahme	(101)	(743)			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)					
Verkauft	16	8			
Eingelöst	(2)	(18)			
Nettozunahme/(-abnahme)	14	(10)			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Verkauft	7.891	1.616			
Eingelöst	(1.262)	(1.292)			
Nettozunahme	6.629	324			
Klasse Premier GBP, thesaurierend					
Verkauft	10	6			
Eingelöst	(77)	(24)			
Nettoabnahme	(67)	(18)			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)					
Verkauft	351	26			
Eingelöst	(8)	(1.607)			
Nettozunahme/(-abnahme)	343	(1.581)			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)					
Verkauft	1.204	390			
Eingelöst	(1.373)	(274)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(169)	116			
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	29			
Eingelöst	–	(654)			
Nettoabnahme	–	(625)			
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	–	–			
Eingelöst	–	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse A USD, ausschüttend (Q)					
Verkauft	–	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)					
Verkauft	–	–			
Nettozunahme	–	–			
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^]					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	124	66			
Eingelöst	(33)	–			
Nettozunahme	91	66			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Verkauft	172	451			
Eingelöst	(152)	–			
Nettozunahme	20	451			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	407	170			
Eingelöst	(53)	–			
Nettozunahme	354	170			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	58	24			
Nettozunahme	58	24			
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus					
Verkauft	46	–			
Eingelöst	(8)	–			
Nettozunahme	38	–			
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	42	26			
Eingelöst	(4)	–			
Nettozunahme	38	26			
Klasse A GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus					
Verkauft	29	–			
Nettozunahme	29	–			
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	62	125			
Nettozunahme	62	125			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	60.001	29.777			
Eingelöst	(6.637)	–			
Nettozunahme	53.364	29.777			
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)					
Verkauft	402	14			
Eingelöst	(5)	–			
Nettozunahme	397	14			
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	2	–			
Nettozunahme	2	–			
Klasse X EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	7	10			
Eingelöst	(2)	–			
Nettozunahme	5	10			
Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	4	–			
Eingelöst	(1)	–			
Nettozunahme	3	–			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^] – (Fortsetzung)				
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	97	–		
Eingelöst	(56)	–		
Nettozunahme	41	–		
Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	773	–		
Eingelöst	(39)	–		
Nettozunahme	734	–		
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	11	–		
Nettozunahme	11	–		
Klasse S USD, thesaurierend				
Verkauft	210	2		
Eingelöst	(19)	–		
Nettozunahme	191	2		
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	89	7		
Eingelöst	(3)	–		
Nettozunahme	86	7		
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	46	617		
Eingelöst	(132)	(523)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(86)	94		
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	2	13		
Eingelöst	(6)	(134)		
Nettoabnahme	(4)	(121)		
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	8	98		
Eingelöst	(13)	(95)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(5)	3		
Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	9	414		
Eingelöst	(4)	(328)		
Nettozunahme	5	86		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	5	137		
Eingelöst	(30)	(108)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(25)	29		
Klasse A EUR, thesaurierend				
Verkauft	24	173		
Eingelöst	(38)	(110)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(14)	63		
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)				
Verkauft	1	4		
Eingelöst	(1)	(4)		
Nettozunahme	–	–		
Klasse A GBP thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	(2)	–		
Nettoabnahme	(2)	–		
Klasse A GBP, ausschüttend (A)				
Verkauft	–	2		
Eingelöst	–	(2)		
Nettozunahme	–	–		
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	11	45		
Eingelöst	(8)	(62)		
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(17)		
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	2.460	9.278		
Eingelöst	(1.907)	(13.284)		
Nettozunahme/(-abnahme)	553	(4.006)		
Klasse A SGD, thesaurierend				
Verkauft	388	3.807		
Eingelöst	(423)	(6.281)		
Nettoabnahme	(35)	(2.474)		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	2	21		
Eingelöst	(3)	(2)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1)	19		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	5	25		
Eingelöst	(5)	(19)		
Nettozunahme	–	6		
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	10		
Eingelöst	(1)	(5)		
Nettozunahme	–	5		
Klasse E EUR thesaurierend				
Verkauft	1	6		
Eingelöst	(1)	(2)		
Nettozunahme	–	4		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	1	48		
Eingelöst	(18)	(31)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(17)	17		
Klasse F USD ausschüttend (A)				
Verkauft	–	1		
Nettozunahme	–	1		
Klasse R EUR, thesaurierend				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme	–	–		
Klasse X USD thesaurierend				
Verkauft	40	235		
Eingelöst	(78)	(388)		
Nettoabnahme	(38)	(153)		
Klasse X USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(1)	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1)	1		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	28	132		
Eingelöst	(95)	(171)		
Nettoabnahme	(67)	(39)		
Klasse X EUR, thesaurierend				
Verkauft	7	150		
Eingelöst	(28)	(205)		
Nettoabnahme	(21)	(55)		
Klasse X GBP, thesaurierend				
Verkauft	12	84		
Eingelöst	(21)	(79)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(9)	5		
Klasse X GBP, ausschüttend (A)				
Verkauft	2	14		
Eingelöst	(2)	(10)		
Nettozunahme	–	4		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	41	549		
Eingelöst	(168)	(740)		
Nettoabnahme	(127)	(191)		
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	380		
Eingelöst	(201)	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(201)	380		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	13	16		
Eingelöst	(1)	(126)		
Nettozunahme/(-abnahme)	12	(110)		
Klasse Premier EUR, thesaurierend				
Verkauft	50	25		
Eingelöst	(82)	(28)		
Nettoabnahme	(32)	(3)		
Klasse Premier GBP, thesaurierend				
Verkauft	9	66		
Eingelöst	(35)	(296)		
Nettoabnahme	(26)	(230)		
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	100		
Eingelöst	(48)	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(48)	100		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	8	72		
Eingelöst	(18)	(58)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(10)	14		
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	1	5		
Eingelöst	(4)	(3)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(3)	2		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	4		
Eingelöst	–	(9)		
Nettoabnahme	–	(5)		
Klasse A EUR, thesaurierend				
Verkauft	–	11		
Eingelöst	(1)	(11)		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	5	4		
Eingelöst	(5)	(5)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	–	2		
Eingelöst	(1)	(1)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1)	1		
Klasse C USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	–	3		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme	–	2		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	5	18		
Eingelöst	(4)	(4)		
Nettozunahme	1	14		
Klasse F USD ausschüttend (A)				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme	–	–		
Klasse R USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse X USD thesaurierend				
Verkauft	–	18		
Eingelöst	(1)	(18)		
Nettoabnahme	(1)	–		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(1)	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	(1)	1		
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	3	4		
Eingelöst	(8)	(6)		
Nettoabnahme	(5)	(2)		
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	(1)	(1)		
Klasse L (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst	(1)	–		
Nettoabnahme	(1)	–		
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^µ				
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	2		
Eingelöst	–	(2)		
Nettozunahme	–	–		
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	–	2		
Eingelöst	–	(2)		
Nettozunahme	–	–		
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	3	4		
Eingelöst	(5)	(11)		
Nettoabnahme	(2)	(7)		
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	–	14		
Eingelöst	–	(6)		
Nettozunahme	–	8		
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	–	(6)		
Nettoabnahme	–	(5)		
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus				
Verkauft	–	5		
Nettozunahme	–	5		
Klasse A EUR, thesaurierend				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	–	(1)		
Nettozunahme	–	–		
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	–	1		
Nettozunahme	–	1		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	–	3.572		
Eingelöst	–	(3.641)		
Nettoabnahme	–	(69)		
Klasse B USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	2		
Nettozunahme	–	2		
Klasse F USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(14)		
Nettoabnahme	–	(14)		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(15)		
Nettoabnahme	–	(15)		
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	7		
Nettozunahme	–	7		
Klasse LM USD, thesaurierend				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	–	(39)		
Nettoabnahme	–	(38)		
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Eingelöst	–	(3)		
Nettoabnahme	–	(3)		
Klasse A (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse L (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse GA USD, thesaurierend				
Eingelöst	–	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse GA EUR, thesaurierend				
Eingelöst	–	(4)		
Nettoabnahme	–	(4)		
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	–	1		
Eingelöst	(1)	(6)		
Nettoabnahme	(1)	(5)		
Klasse A USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	1	–		
Eingelöst	(1)	(1)		
Nettoabnahme	–	(1)		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	3	4		
Eingelöst	(5)	(11)		
Nettoabnahme	(2)	(7)		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum			Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)		31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – (Fortsetzung)					
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	14	1			
Eingelöst	(2)	(7)			
Nettozunahme/(-abnahme)	12	(6)			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	1	–			
Eingelöst	(1)	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	–	89			
Eingelöst	(10)	(27)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(10)	62			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	11	7			
Eingelöst	–	(60)			
Nettozunahme/(-abnahme)	11	(53)			
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)					
Eingelöst	(66)	(8)			
Nettoabnahme	(66)	(8)			
Klasse GA USD, thesaurierend					
Eingelöst	(1)	(1)			
Nettoabnahme	(1)	(1)			
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^α					
Klasse A USD thesaurierend					
Eingelöst	–	(2)			
Nettoabnahme	–	(2)			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Eingelöst	–	(1)			
Nettoabnahme	–	(1)			
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Eingelöst	–	(1)			
Nettoabnahme	–	(1)			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Eingelöst	–	(90)			
Nettoabnahme	–	(90)			
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^α					
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Eingelöst	–	(3)			
Nettoabnahme	–	(3)			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Eingelöst	–	(1)			
Nettoabnahme	–	(1)			
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus					
Eingelöst	–	(80)			
Nettoabnahme	–	(80)			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	–	516			
Eingelöst	–	(489)			
Nettozunahme	–	27			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Eingelöst	–	(3)			
Nettoabnahme	–	(3)			
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^α					
Klasse M GBP, ausschüttend (A)					
Verkauft	1	12			
Eingelöst	(12)	(15)			
Nettoabnahme	(11)	(3)			
Klasse M USD ausschüttend (A)					
Verkauft	1	–			
Eingelöst	–	(4)			
Nettozunahme/(-abnahme)	1	(4)			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	–	57			
Nettozunahme	–	57			
Klasse Premier GBP, thesaurierend					
Eingelöst	–	(1)			
Nettoabnahme	–	(1)			
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^α					
Klasse A (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)					
Verkauft	–	50			
Eingelöst	–	(588)			
Nettoabnahme	–	(538)			
Klasse A (PF) EUR, thesaurierend					
Eingelöst	–	(28)			
Nettoabnahme	–	(28)			
Klasse A (PF) EUR, ausschüttend (A)					
Eingelöst	–	(238)			
Nettoabnahme	–	(238)			
Klasse M (PF) USD ausschüttend (A) (abgesichert)					
Eingelöst	–	(195)			
Nettoabnahme	–	(195)			
Klasse M (PF) EUR, thesaurierend					
Eingelöst	–	(37)			
Nettoabnahme	–	(37)			
Klasse M (PF) EUR, ausschüttend (A)					
Verkauft	–	7			
Eingelöst	–	(589)			
Nettoabnahme	–	(582)			
Klasse M (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)					
Eingelöst	–	(85)			
Nettoabnahme	–	(85)			
Klasse M (PF) NOK, ausschüttend (A) (abgesichert)					
Eingelöst	–	(2)			
Nettoabnahme	–	(2)			
Klasse M (PF) SEK, ausschüttend (A) (abgesichert)					
Eingelöst	–	(102)			
Nettoabnahme	–	(102)			
Klasse Premier (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	38			
Eingelöst	–	(173)			
Nettoabnahme	–	(135)			
Klasse Premier (PF) BRL, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	3			
Eingelöst	–	(155)			
Nettoabnahme	–	(152)			
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^α					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	1	17			
Eingelöst	(4)	(1)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(3)	16			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	212			
Eingelöst	(48)	–			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(48)	212			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	24	8			
Eingelöst	(5)	(1)			
Nettozunahme	19	7			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	–	18			
Eingelöst	(8)	(3)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(8)	15			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	–	2			
Nettozunahme	–	2			
Klasse X USD thesaurierend					
Verkauft	–	1			
Nettozunahme	–	1			
Klasse X EUR, thesaurierend					
Verkauft	1	–			
Nettozunahme	1	–			
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	4			
Eingelöst	(2)	(1)			
Netto-(Abgang)/-Zugang	(2)	3			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^] – (Fortsetzung)		
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	(1)
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	27	101
Eingelöst	(62)	(3)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(35)	98
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	–	65
Eingelöst	(8)	(271)
Nettoabnahme	(8)	(206)
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	520	142
Eingelöst	(107)	(4)
Nettozunahme	413	138
Klasse S GBP, thesaurierend		
Verkauft	3	5
Eingelöst	–	(78)
Nettozunahme/(-abnahme)	3	(73)
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	1	1
Nettozunahme	1	1
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	44	112
Eingelöst	(49)	(93)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(5)	19
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	–	2
Nettozunahme	–	2
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Eingelöst	(807)	(98)
Nettoabnahme	(807)	(98)
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	2	7
Eingelöst	–	(2)
Nettozunahme	2	5
Klasse X AUD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	(1)	(1)
Nettoabnahme	(1)	–
Klasse X USD thesaurierend		
Verkauft	2	–
Eingelöst	(1)	–
Nettozunahme	1	–
Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse LM AUD, thesaurierend		
Eingelöst	(4)	(4)
Nettoabnahme	(4)	(4)

Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]

Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	1	30
Eingelöst	(26)	(7)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(25)	23
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	1	2
Nettozunahme	1	2
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	67	34
Eingelöst	(32)	(11)
Nettozunahme	35	23
Klasse X USD thesaurierend		
Eingelöst	(6)	–
Nettoabnahme	(6)	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	25	9
Eingelöst	(38)	(5)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(13)	4

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2021 Anteile (in Tsd.)
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	1	6
Eingelöst	(10)	(7)
Nettoabnahme	(9)	(1)
Klasse S EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	1
Eingelöst	(45)	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	(44)	1
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^]		
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	4	5
Eingelöst	(26)	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	(22)	5
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	3
Eingelöst	(6)	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	(5)	3
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	140
Eingelöst	(54)	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	(54)	140
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	7	42
Eingelöst	(168)	(3)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(161)	39
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	5	–
Eingelöst	–	(251)
Nettozunahme/(-abnahme)	5	(251)
Klasse S EUR, thesaurierend		
Verkauft	95	703
Eingelöst	(445)	(1)
Netto-(Abgang)/-Zugang	(350)	702
Klasse S GBP, thesaurierend		
Verkauft	91	–
Eingelöst	(13)	–
Nettozunahme	78	–

– Als „–“ angegebenen Beträge belaufen sich auf 0 oder auf weniger als 1.000. Es sind nur Klassen angegeben, bei denen im Berichtszeitraum Transaktionen erfolgt sind.

α Mit Wirkung vom 27. April 2022 stellte der Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

β Mit Wirkung zum 21. Juni 2022 stellten der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und der Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] den Handel ein.

μ Mit Wirkung zum 11. Juli 2022 stellte der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss

1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

Die bei der Erstellung dieses Abschlusses verwendeten wesentlichen Rechnungslegungs- und Schätzungsmethoden sind mit denen konform, die die Gesellschaft im Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 verwendet hat.

Übereinstimmungserklärung

Der Abschluss für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022 wurde im Einklang mit Financial Reporting Standard („FRS“) 104: „Interim Financial Reporting“, die Bestimmungen der Europäischen Gemeinschaft von 2011 (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) (in ihrer geänderten Fassung) (die „OGAW-Verordnungen“) und und das Zentralbankaufsichts- und Durchsetzungsgesetz von 2013 (Abschnitt 48 (1)) (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) Regulierungen von 2019 (die „OGAW-Verordnungen der Zentralbank“) erstellt. Der verkürzte Abschluss sollte in Verbindung mit dem geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 gelesen werden, der gemäß FRS 102: „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and the Republic of Ireland“ [Der in Großbritannien und in der Republik Irland geltende Standard zur Finanzberichterstattung] erstellt wurde.

Grundlagen der Erstellung

Der Abschluss wurde auf der Grundlage der Fortführung der Geschäftstätigkeit der Gesellschaft nach dem Prinzip der historischen Kosten erstellt, das durch die Neubewertung von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten werden, modifiziert wurde. Die Abschlüsse von Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund[^], Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund[^], Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund[^], Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund[^], Legg Mason ClearBridge Growth Fund[^], Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund[^], Legg Mason PCM US Equity Fund[^], Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^], Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Congruix Japan Equity Fund[^], Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund[^], Legg Mason Martin Currie Greater China Fund[^], Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund[^] and Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund[^] wurden auf der Basis der Nichtfortführung der Geschäftstätigkeit erstellt, da diese Fonds während des laufenden und des vorangegangenen Berichtszeitraums 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.

2. Effiziente Portfolioverwaltung

Vorbehaltlich der Bedingungen und innerhalb der Grenzen, die gelegentlich von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank“) festgelegt werden, und sofern die Anlageziele und Anlagepolitik eines Fonds keine abweichende Regelung vorsehen, können die Anlagemanager und/oder Unteranlageverwalter Investmentmethoden und -instrumente wie Futures, Optionen, Devisenterminkontrakte und sonstige Derivate für die Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung verwenden. Außerdem werden eventuell neue Methoden und Instrumente entwickelt, die künftig für einen Fonds geeignet sein können, und ein Fonds kann diese Methoden und Instrumente einsetzen, wenn dies vorher genehmigt wurde und alle Beschränkungen der Zentralbank eingehalten werden.

Für OGAW, die Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung angewendet haben, sind gemäß den OGAW-Bestimmungen der Zentralbank Offenlegungen erforderlich. Ein OGAW ist verpflichtet, die Erträge aus Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung für den gesamten Berichtszeitraum zusammen mit den direkten und indirekten Betriebskosten und den angefallenen Gebühren auszuweisen. Siehe dazu die nachstehenden Tabellen.

Einzelheiten zu offenen derivativen Finanzinstrumenten am Ende des Berichtszeitraums werden in der Vermögensaufstellung der Fonds offengelegt. Alle realisierten Gewinne und Verluste, die aus der Verwendung derivativer Kontrakte für eine effiziente Portfolioverwaltung entstehen, sind in Nettogewinnen/(-verlusten) zu finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert durch Gewinn oder Verlust der Gesamtergebnisrechnung enthalten.

Während des Berichtszeitraums wurden Wertpapierpensionsgeschäften zum Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung abgeschlossen. Details zu allen Wertpapierpensionsgeschäften am Ende des Berichtszeitraums sind im Beteiligungspapierportfolio aufgeführt.

Umgekehrte Rückkaufvereinbarungen

Ein Teil des Vermögens jedes Fonds kann in anderen liquiden Mitteln gehalten werden. Für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung kann jeder Fonds Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen.

Die nachstehende Tabelle enthält die im Berichtszeitraum zum 31. August 2022 mit umgekehrten Pensionsgeschäften erzielten Erträge:

Fondsname	31. August 2022 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	1.331\$

Es wurden keine Transaktionskosten für die Käufe und Verkäufe von umgekehrten Pensionsgeschäften erhoben.

Wertpapierleihgeschäfte

Bestimmte Fonds können für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung wie oben dargelegt auch Wertpapierleihgeschäfte abschließen. Im Rahmen solcher Transaktionen kann der Fonds seine Wertpapiere vorübergehend an einen Entleiher übertragen, wobei sich der Entleiher verpflichtet, zu einem vorab vereinbarten Zeitpunkt gleichwertige Wertpapiere an den Fonds zurückzugeben. Beim Abschluss solcher Transaktionen wird sich der Fonds bemühen, die Renditen auf sein Wertpapierportfolio zu erhöhen, indem er für die Bereitstellung seiner Wertpapiere für den Entleiher eine Gebühr erhebt. Keiner der Fonds hat im Berichtszeitraum zum 31. August 2022 Wertpapierleihgeschäfte getätigt.

3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien

Gemäß dem Verwaltungsvertrag zwischen der Gesellschaft und Franklin Templeton International Services S.à r.l (der „Manager“ oder „FTIS“) steht dem Manager eine Verwaltungsgebühr aus dem Vermögen des jeweiligen Fonds für seine Anlageverwaltungs- und Vertriebsleistungen zu, die an jedem Handelstag aufläuft und jeden Monat rückwirkend gezahlt wird (die „Verwaltungsgebühren“). Die Gesellschaft ist außerdem für die unverzügliche Zahlung oder Erstattung von Provisionen, Übertragungsgebühren, Registrierungsgebühren, Steuern und ähnlichen Verbindlichkeiten, Kosten und Auslagen an den Manager verantwortlich, die von FTIS ordnungsgemäß zu zahlen sind oder entstehen.

Die maximale Verwaltungsgebühr für jede Anteilsklasse (ausgedrückt als Prozentsatz des dieser Klasse zuzurechnenden Nettoinventarwerts des jeweiligen Fonds) beträgt zum Ende des Berichtszeitraums:

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund		Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund (Fortsetzung)	
Klasse A	0,800 %	Klasse GA	0,820 %
Klasse B	1,050 %	Klasse GE	1,420 %
Klasse C	1,300 %		
Klasse E	1,400 %	Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	
Klasse X	0,600 %	Klasse A	1,150 %
Premier-Klasse	0,300 %	Klasse B	1,400 %
Klasse LM	keine	Klasse C	1,650 %
Klasse A (G)	0,800 %	Klasse E	1,750 %
Klasse L (G)	0,800 %	Klasse F	0,550 %
		Klasse R	0,750 %
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund		Klasse T	1,150 %
Klasse A	0,950 %	Klasse X	0,575 %
Klasse B	1,200 %	Premier-Klasse	0,300 %
Klasse C	1,450 %	Klasse LM	keine
Klasse E	1,550 %	Klasse A (G)	1,150 %
Klasse F	0,550 %	Klasse B (G)	1,650 %
Klasse R	0,550 %	Klasse L (G)	1,650 %
Klasse T	0,950 %		
Klasse X	0,475 %		
Premier-Klasse	0,300 %		
Klasse S	0,200 %		
Klasse LM	keine		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason Western Asset EUR Core Plus Bond Fund		Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	
Klasse A	1,000 %	Klasse A	1,250 %
Klasse B	1,250 %	Klasse B	1,500 %
Klasse C	1,500 %	Klasse C	1,750 %
Klasse E	1,600 %	Klasse E	1,850 %
Klasse F	0,550 %	Klasse F	0,700 %
Klasse R	0,600 %	Klasse R	0,850 %
Klasse T	1,000 %	Klasse T	1,250 %
Klasse X	0,500 %	Klasse X	0,625 %
Premier-Klasse	0,300 %	Premier-Klasse	0,450 %
Klasse S	0,200 %	Klasse S	0,300 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
Klasse GA	0,820 %	Klasse A (G)	1,250 %
Klasse GE	1,420 %	Klasse L (G)	1,750 %
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	
Klasse A	1,100 %	Klasse A	0,900 %
Klasse B	1,350 %	Klasse B	1,150 %
Klasse C	1,600 %	Klasse C	1,400 %
Klasse E	1,700 %	Klasse E	1,500 %
Klasse F	0,850 %	Klasse F	0,600 %
Klasse R	0,700 %	Klasse R	0,550 %
Klasse X	0,600 %	Klasse T	0,900 %
Premier-Klasse	0,600 %	Klasse X	0,450 %
Klasse S	0,300 %	Premier-Klasse	0,350 %
Klasse LM	keine	Klasse S	0,250 %
Klasse A (G)	1,200 %	Klasse LM	keine
Klasse B (G)	1,700 %	Klasse A (G)	1,100 %
Klasse L (G)	1,700 %	Klasse L (G)	1,600 %
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund		Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	
Klasse A	1,100 %	Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,350 %	Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,600 %	Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,700 %	Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,650 %	Klasse F	0,850 %
Klasse R	0,700 %	Klasse R	0,700 %
Klasse T	1,100 %	Klasse T	1,100 %
Klasse X	0,550 %	Klasse X	0,600 %
Premier-Klasse	0,400 %	Premier-Klasse	0,600 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	
Klasse A	1,150 %	Klasse A	0,850 %
Klasse B	1,400 %	Klasse B	1,100 %
Klasse C	1,650 %	Klasse C	1,350 %
Klasse E	1,750 %	Klasse E	1,450 %
Klasse F	0,700 %	Klasse F	0,600 %
Klasse R	0,750 %	Klasse R	0,450 %
Klasse T	1,150 %	Klasse T	0,850 %
Klasse X	0,575 %	Klasse X	0,425 %
Premier-Klasse	0,450 %	Premier-Klasse	0,350 %
Klasse LM	keine	Klasse S	0,250 %
Klasse A (G)	1,150 %	Klasse LM	keine
Klasse L (G)	1,650 %	Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]	
Klasse GF	0,950 %	Klasse A	1,100 %
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund		Klasse B	1,350 %
Klasse A	1,500 %	Klasse C	1,600 %
Klasse B	1,750 %	Klasse E	1,700 %
Klasse C	2,000 %	Klasse F	0,650 %
Klasse E	2,100 %	Klasse R	0,700 %
Klasse F	0,800 %	Klasse T	1,100 %
Klasse R	1,100 %	Klasse X	0,550 %
Klasse T	1,500 %	Premier-Klasse	0,400 %
Klasse X	0,750 %	Klasse LM	keine
Premier-Klasse	0,550 %	Legg Mason Western Asset Global Credit Fund[^]	
Klasse S	0,450 %	Klasse A	0,850 %
Klasse LM	keine	Klasse B	1,100 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse C	1,350 %
Klasse B (G)	1,750 %	Klasse E	1,450 %
Klasse L (G)	1,750 %	Klasse F	0,600 %
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]		Klasse R	0,650 %
Klasse A	1,500 %	Klasse T	0,850 %
Klasse B	1,750 %	Klasse X	0,350 %
Klasse C	2,000 %	Premier-Klasse	0,350 %
Klasse E	2,100 %	Klasse S	0,250 %
Klasse F	0,800 %	Klasse LM	keine
Klasse R	1,100 %	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^]	
Klasse T	1,500 %	Klasse A	1,150 %
Klasse X	0,750 %	Klasse B	1,400 %
Premier-Klasse	0,550 %	Klasse C	1,650 %
Klasse S	0,450 %	Klasse E	1,750 %
Klasse LM	keine	Klasse F	0,700 %
		Klasse R	0,750 %
		Klasse T	1,150 %
		Klasse X	0,575 %
		Premier-Klasse	0,450 %
		Klasse S	0,350 %
		Klasse LM	keine

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]	
Klasse A	1,350 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,850 %	Klasse B	2,000 %
Klasse C	1,850 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,100 %	Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,100 %	Klasse F	1,250 %
Klasse R	0,850 %	Klasse R	1,000 %
Klasse T	1,350 %	Klasse T	1,500 %
Klasse X	0,675 %	Klasse X	0,850 %
Premier-Klasse	0,675 %	Premier-Klasse	0,850 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]	
Klasse A	1,250 %	Klasse A	1,650 %
Klasse B	1,750 %	Klasse B	2,150 %
Klasse C	1,750 %	Klasse C	2,150 %
Klasse E	2,000 %	Klasse E	2,400 %
Klasse F	1,000 %	Klasse F	1,400 %
Klasse R	0,750 %	Klasse R	1,150 %
Klasse T	1,250 %	Klasse T	1,650 %
Klasse X	0,625 %	Klasse X	1,000 %
Premier-Klasse	0,625 %	Premier-Klasse	1,000 %
Klasse LM	keine	Klasse S	0,600 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse LM	keine
Klasse B (G)	1,750 %	Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^]	
Klasse L (G)	1,750 %	Klasse A	1,500 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse B	2,000 %
Klasse GE	2,170 %	Klasse C	2,000 %
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund		Klasse E	2,250 %
Klasse A	1,250 %	Klasse F	1,250 %
Klasse B	1,750 %	Klasse R	1,000 %
Klasse C	1,750 %	Klasse T	1,500 %
Klasse E	2,000 %	Klasse U	0,600 %
Klasse F	1,000 %	Klasse X	0,750 %
Klasse R	0,750 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse T	1,250 %	Klasse S	0,400 %
Klasse U	0,525 %	Klasse LM	keine
Klasse X	0,625 %	Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	
Premier-Klasse	0,625 %	Klasse A	1,500 %
Klasse LM	keine	Klasse B	2,000 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse C	2,000 %
Klasse L (G)	1,750 %	Klasse E	2,250 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse F	1,250 %
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund		Klasse R	1,000 %
Klasse A	1,300 %	Klasse T	1,500 %
Klasse B	1,800 %	Klasse X	0,750 %
Klasse C	1,800 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse E	2,050 %	Klasse LM	keine
Klasse F	1,050 %	Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	
Klasse R	0,800 %	Klasse A	1,500 %
Klasse T	1,300 %	Klasse B	2,000 %
Klasse X	0,650 %	Klasse C	2,000 %
Premier-Klasse	0,650 %	Klasse E	2,250 %
Klasse LM	keine	Klasse F	1,250 %
Klasse A (G)	1,300 %	Klasse R	1,000 %
Klasse B (G)	1,800 %	Klasse T	1,500 %
Klasse L (G)	1,800 %	Klasse X	0,750 %
Klasse GA	1,420 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse GE	2,170 %	Klasse LM	keine
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		Klasse A (G)	1,250 %
Klasse A	1,250 %	Klasse L (G)	1,750 %
Klasse B	1,750 %	Royce Global Small Cap Premier Fund[^]	
Klasse C	1,750 %	Klasse A	1,500 %
Klasse E	2,000 %	Klasse B	2,000 %
Klasse F	1,000 %	Klasse C	2,000 %
Klasse R	0,800 %	Klasse E	2,250 %
Klasse T	1,250 %	Klasse F	1,250 %
Klasse X	0,625 %	Klasse R	1,000 %
Premier-Klasse	0,625 %	Klasse T	1,500 %
Klasse LM	keine	Klasse X	0,750 %
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]		Premier-Klasse	0,750 %
Klasse A	1,200 %	Klasse S	0,550 %
Klasse B	1,700 %	Klasse LM	keine
Klasse C	1,700 %	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^]	
Klasse E	1,950 %	Klasse A	1,350 %
Klasse F	0,950 %	Klasse B	1,850 %
Klasse R	0,700 %	Klasse C	1,850 %
Klasse T	1,200 %	Klasse E	2,100 %
Klasse X	0,600 %	Klasse F	1,100 %
Premier-Klasse	0,600 %	Klasse R	0,850 %
Klasse S	0,400 %	Klasse T	1,350 %
Klasse LM	keine	Klasse X	0,675 %
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund[^]		Premier-Klasse	0,675 %
Klasse A	1,300 %	Klasse S	0,500 %
Klasse B	1,800 %	Klasse LM	keine
Klasse C	1,800 %	Klasse A (G)	1,350 %
Klasse E	2,050 %	Klasse B (G)	1,850 %
Klasse F	1,050 %	Klasse L (G)	1,850 %
Klasse R	0,800 %	Klasse GA	1,420 %
Klasse T	1,300 %	Klasse GE	2,170 %
Klasse X	0,650 %	Klasse GP	0,850 %
Premier-Klasse	0,650 %		
Klasse S	0,550 %		
Klasse LM	keine		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]	
Klasse A	1,350 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,850 %	Klasse B	2,000 %
Klasse C	1,850 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,100 %	Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,100 %	Klasse F	1,250 %
Klasse R	0,850 %	Klasse R	1,000 %
Klasse T	1,350 %	Klasse T	1,500 %
Klasse X	0,675 %	Klasse X	0,750 %
Premier-Klasse	0,675 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse S	0,500 %	Klasse S	0,650 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
Klasse GA	1,620 %	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	
Klasse GE	2,370 %	Klasse A	1,500 %
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^]		Klasse B	2,000 %
Klasse A	1,350 %	Klasse C	2,000 %
Klasse B	1,850 %	Klasse D	1,100 %
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 %	Klasse S	0,440 %
Klasse S	0,500 %	Klasse LM	keine
Klasse LM	keine	Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]	
Klasse GA	1,420 %	Klasse A	1,500 %
Klasse GE	2,170 %	Klasse B	2,000 %
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]		Klasse C	2,000 %
Klasse A	1,500 %	Klasse E	2,250 %
Klasse B	2,000 %	Klasse F	1,250 %
Klasse C	2,000 %	Klasse J	0,650 %
Klasse E	2,250 %	Klasse R	1,000 %
Klasse F	1,250 %	Klasse T	1,500 %
Klasse M	1,000 %	Klasse X	0,750 %
Klasse R	1,000 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse T	1,500 %	Klasse S	0,650 %
Premier-Klasse	0,750 %	Klasse LM	keine
Klasse LM	keine	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^]	
		Klasse A	1,500 %
		Klasse B	2,000 %
		Klasse C	2,000 %
		Klasse E	2,250 %
		Klasse F	1,250 %
		Klasse R	1,000 %
		Klasse X	0,750 %
		Premier-Klasse	0,750 %
		Klasse S	0,650 %
		Klasse LM	keine

Die in den obenstehenden Tabellen angegebenen Verwaltungsgebühren für die einzelnen Fonds gelten für alle in der jeweiligen Spalte aufgeführten Anteilsklassen, die der Fonds anbietet. Es werden nicht alle Anteilsklassen von jedem Fonds angeboten und zum 31. August 2022 waren nicht alle Anteilsklassen in Umlauf. Welche Anteilsklassen die einzelnen Fonds anbieten, ist im Verkaufsprospekt angegeben, der von Zeit zu Zeit geändert oder ersetzt werden kann.

Gemäß jedem Anlageverwaltungsvertrag ist der Verwalter für die Zahlung der Gebühren und Auslagen des betreffenden Anlageverwalters verantwortlich.

Der Verwalter hat sich freiwillig bereit erklärt, teilweise auf seine Gebühren zu verzichten und/oder bestimmte Kosten zu erstatten, sodass die Gesamtkosten gewisse freiwillige Kostengrenzen, die für die Fonds festgelegt wurden, nicht überschreiten. Dem Verwalter steht es frei, den freiwilligen Verzicht und/oder die Kostenerstattungen in eigenem Ermessen jederzeit zu überprüfen oder zu beenden.

Für den am 31. August 2022 endenden Berichtszeitraum hat der Verwalter folgende Gebühren erlassen bzw. erstattet:

Fondsname	Für den Zeitraum zum 31. August 2022 (in Tsd.)	
	Erlassene Verwaltungsgebühr	Verwaltungsgebühr, die erstattet wird, und sonstige Ausgaben, die wiederhergestellt werden
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	622\$	23\$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	2\$	\$-
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	\$-	10\$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	\$-	16\$
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	8\$	1\$
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	€ -	11€
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	\$-	45\$
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	14\$	7\$
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]	20\$	\$-
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	5\$	1\$
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	17\$	6\$
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	\$-	17\$
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	5\$	15\$
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	9\$	\$-
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]	12\$	\$-
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	12\$	6\$
Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	13\$	1\$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	1€	7€
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	\$-	33\$
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	16\$	\$-
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	1\$	3\$
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	16\$	\$-
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	2€	5€

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

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

Gemäß den Bestimmungen des Hauptvertriebsstellenvertrags zwischen dem Manager, der Gesellschaft und Franklin Distributors, LLC (der „Master-Distributor“), ist der Master-Distributor ermächtigt, Anteile der Gesellschaft zu vermarkten, zu bewerben, anzubieten und deren Verkauf und Rücknahme zu arrangieren (zusammen als „Vertriebsleistungen“ bezeichnet). Zudem ist der Master-Distributor berechtigt, auf eigene Kosten und Aufwendungen einen oder mehrere Vertriebshändler zu beauftragen, die sie bei der Erfüllung ihrer Pflichten aus dem Vertrag unterstützen sollen, sofern die Ernennungen solcher Firmen gemäß den Anforderungen der Regeln der Zentralbank erfolgen. Gemäß den Bestimmungen des Rahmenanlageverwaltungsvertrags zwischen dem Anlage-Manager und dem Master-Distributor, haftet der Master-Distributor in solchen Fällen gegenüber dem Verwalter für die Erfüllung seiner Aufgaben gemäß dem betreffenden Vertrag. Der Master Distributor hat gemäß den Anforderungen der Zentralbank Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited („LMAMHK“) (eingestellt am 1. Juli 2022), Franklin Templeton Investments (Asia) Limited („FTIA“) (gültig ab 1. Juli 2022) und Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited als zusätzliche Vertriebsstellen der Fonds beauftragt. Der Manager hat sich selbst und Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc. mit der Erbringung bestimmter Vertriebsdienstleistungen beauftragt.

Die Gesellschaft ist ferner für die umgehende Zahlung bzw. Rückerstattung von Geldern an den Manager verantwortlich, die diese/r als Provisionen, Übertragungsgebühren, Registrierungsgebühren, Steuern und ähnliche Verbindlichkeiten sowie Kosten und Spesen zu zahlen bzw. ausgelegt hat.

Informationsstellengebühr

Gemäß dem Verwaltungsvertrag zwischen der Gesellschaft und dem Verwalter steht dem Verwalter eine Informationsstellengebühr aus dem Vermögen des jeweiligen Fonds für seine Dienstleistungen zu, die an jedem Handelstag aufläuft und jeden Monat rückwirkend gezahlt wird (die „Informationsstellengebühr“). Die Informationsstellengebühren laufen an jedem Handelstag auf und werden rückwirkend monatlich gezahlt. Im Rahmen des Master-Informationsstellenvertrags zwischen dem Manager, der Gesellschaft und Franklin Distributors hat LLC (der „Hauptanteileseignervertreter“), der Hauptanteileseignervertreter für seine Dienste Anspruch auf den Erhalt einer vom Verwalter aus bestimmten Anteilsklassen zu zahlenden Dienstleistungsgebühr.

Gemäß den Bestimmungen des Hauptinformationsstellenvertrags ist der Hauptanteileseignervertreter berechtigt, auf eigene Kosten und Aufwendungen eine oder mehrere Parteien zu bestellen, die sie bei der Erfüllung ihrer Pflichten aus dem Vertrag unterstützen sollen, wobei der Hauptanteileseignervertreter der Gesellschaft gegenüber weiterhin für die Erfüllung ihrer Verpflichtungen aus diesem Vertrag haftet. Dementsprechend hat der Master Shareholder Servicing Agent LMAMHK (eingestellt am 1. Juli 2022), FTIA (mit Wirkung zum 1. Juli 2022) und Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited als zusätzliche Vertriebs- und Dienstleistungsstellen der Gesellschaft beauftragt. Der Manager hat Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc. mit der Erbringung von Aktionärsdienstleistungen in Bezug auf Taiwan beauftragt.

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

- (i) 0,15 Prozent p.a. des Nettoinventarwerts des Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund, Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund, Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund, Legg Mason Western Asset US High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund, Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund, Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Credit Fund[^], Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^], Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^], Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund, Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund[^], Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund, Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund, Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] und Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] und
- (ii) 0,35 Prozent p.a. des Nettoinventarwerts des Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Value Fund, Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund, Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund, Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund, Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund[^], Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^], Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^], Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund, Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund, Royce Global Small Cap Premier Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Q5 Emerging Markets Equity Fund[^], Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund, Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^] und Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^].

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

Im Berichtszeitraum zum 31. August 2022 wurde auf folgende Informationsstellengebühren verzichtet:

Fondsname	Informationsstellengebühr Verzichtet für den Zeitraum zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	2\$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund	13\$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	4\$
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	6\$
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	4\$
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	2\$
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	9\$
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	45\$
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]	1\$
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	2\$
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	4\$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	1€
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	14\$
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	4\$
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	15\$
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	3\$

Zusätzlich bestimmte Betriebsaufwendungen, einschließlich unter anderem an die Tochtergesellschaften von Franklin Templeton für die Erbringung von Governance-Support und die Berichterstattung an den Verwaltungsrat, für Versicherungsleistungen für den Verwaltungsrat und fortlaufende Registrierungsleistungen in Ländern und Regionen, in denen die Fonds öffentlich angeboten werden. Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022 beliefen sich diese Aufwendungen auf 627.571 USD.

Verbundene Parteien

Jane Trust, Joseph Carrier, Jaspal Sagger und William Jackson sind Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft und sind auch Verwaltungsratsmitglieder und/oder Führungskräfte bestimmter verbundener Unternehmen des Verwalters, des Anlageverwalters, der Vertriebs- und Dienstleistungsstellen. William Jackson und Jane Trust sind ebenfalls Direktoren von FTIS. Die übrigen Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft, wie oben aufgeführt, sind alle entweder Mitarbeiter von FTIS oder einer ihrer Tochtergesellschaften. Abgesehen von den oben genannten Ausnahmen hat bzw. hatte keiner der Verwaltungsratsmitglieder eine direkte oder indirekte Beteiligung an einem Vertrag oder einer Vereinbarung, der/die zum Zeitpunkt dieses Dokuments besteht und der/die in Bezug auf das Geschäft der Gesellschaft von Bedeutung ist.

Zum 31. August 2022 hielten die Fonds in der nachstehenden Tabelle Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen, die denselben Manager, dieselben Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter wie der Fonds ernannt haben oder eine mit diesem Manager, diesen Anlageverwaltern oder Unteranlageverwaltern verbundene Partei ernannt haben.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

3. 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	31. August 2022	
		%	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)	0,29 %	6.916\$
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	3,30 %	15.794\$
Legg Mason Western Asset EUR Core Plus Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,02 %	392€
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Klasse Euro thesaurierend	13,26 %	5.875\$
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Klasse US\$ thesaurierend	13,54 %	4.602\$
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	267\$
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Klasse Euro thesaurierend	1,48 %	656\$
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	184\$
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,03 %	721\$
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1,14 %	26.694\$
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	2,26 %	10.841\$
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,04 %	986\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	17,00 %	81.373\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Klasse Euro thesaurierend	23,54 %	10.430\$
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Klasse Euro thesaurierend	5,52 %	2.446\$
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,82 %	19.337\$
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1,43 %	33.546\$
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,05 %	1.110\$
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	159\$
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	0,10 %	463\$
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,03 %	617\$
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1,13 %	26.649\$
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,06 %	1.456\$
Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,00 %	97\$

Die Kapitalanlagen werden in den Finanzabschlüssen in Anmerkung 13 über die Fondsgeschäfte hinweg ausgewiesen.

Performancegebühr

Zusätzlich zu den oben beschriebenen Anlageverwaltungsgebühren war der Anlageverwalter berechtigt, in Abhängigkeit von der Wertentwicklung der Anteile der Anteilsklasse PF eine erfolgsabhängige Gebühr („Performancegebühr“) zu erheben (Performancegebührenklassen enthalten ein „(PF)“ im Namen der Anteilsklasse).

Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] (stellte den Handel am 1. Juni 2021 ein)

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

Für jeden Berechnungszeitraum hat der Anlageverwalter für jeden Anteil der Anteilsklasse PF ggf. Anspruch auf eine Performancegebühr in Höhe von 20 % des Betrags, um den die Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil während dieses Zeitraums die High Water Mark (wie nachfolgend definiert) zum Ende des vorausgehenden Berechnungszeitraums übersteigt. Bei ausschüttenden Anteilsklassen wurden alle während des jeweiligen Zeitraums ausgezahlten Ausschüttungen zwecks Ermittlung der Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil während eines Berechnungszeitraums dem Nettoinventarwert zugerechnet. Für alle Anteilsklassen PF gilt, dass die für einen Berechnungszeitraum fällige Performancegebühr nicht von Verlusten berührt war, die die Fonds oder die Anteilsklasse PF in späteren Berechnungszeiträumen erleiden. Die Performancegebühr fiel an jedem Handelstag an und wurde normalerweise innerhalb von 21 Tagen nach dem Ende des jeweiligen Berechnungszeitraums nach Prüfung durch die Depotbank gezahlt. Wenn der Anlageverwaltungsvertrag vor dem letzten Handelstag eines Geschäftsjahres endet, wird bei der Berechnung und Zahlung der Performancegebühr für jede Anteilsklasse PF in Bezug auf den laufenden Berechnungszeitraum davon ausgegangen, dass das Datum des Vertragsendes das Ende des Berechnungszeitraums ist. Sofern ein Anteilinhaber seine Anteile der Anteilsklasse PF vor dem Ende eines Berechnungszeitraums einlöst, wird die aufgelaufene und diesen Anteilen zurechenbare Performancegebühr herauskristallisiert und dem Anlageverwalter nach Abzug der fälligen Performancegebühr von den Rücknahmeerlösen gezahlt.

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

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

Während des Geschäftsjahres zum 31. August 2022 wurden keine Performancegebühren berechnet, da der Fonds den Handel am 1. Juni 2021 einstellte. Während des Berichtszeitraums zum 31. August 2021 abgrenzte Erfolgsprämien werden in der Gesamtergebnisrechnung offengelegt.

Transaktionen mit verbundenen Personen

Gemäß Verordnung 43(1) der OGAW-Verordnungen der Zentralbank muss eine „verantwortliche Person sicherstellen, dass jede Transaktion zwischen einem OGAW und einer verbundenen Person (a) zu marktüblichen Bedingungen und (b) im besten Interesse der Anteilinhaber des OGAW ausgeführt wird“.

Gemäß den Anforderungen von Verordnung 81(4) der OGAW-Verordnungen der Zentralbank hat sich der Verwaltungsrat davon überzeugt, dass (a) durch schriftliche Verfahren belegte Vorkehrungen getroffen wurden, um sicherzustellen, dass die durch Verordnung 43(1) vorgeschriebenen Verpflichtungen auf alle Geschäfte mit verbundenen Personen angewendet werden und (b) alle Geschäfte mit verbundenen Personen, die während des Berichtszeitraums abgeschlossen wurden, den durch die Verordnung 43(1) vorgeschriebenen Verpflichtungen entsprachen.

Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren

Die Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch, fungiert als Verwahrstelle (die „Verwahrstelle“) und BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company (die „Verwaltungsstelle“) fungiert als Verwaltungsstelle aller Fonds der Gesellschaft. Sie erhalten für Verwaltungs-, Rechnungslegungs-, Informationsstellen-, Treuhänder- und Verwahrstellendienste von den Fonds insgesamt eine Gebühr von bis zu 0,15 % des Nettoinventarwerts jedes Fonds.

Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrats

Die sich auf den Berichtszeitraum zum 31. August 2022 beziehenden erfolgswirksam in der Gesamtergebnisrechnung erfassten Honorare und Auslagen der Mitglieder des Verwaltungsrats beliefen sich auf 71.000 USD.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Andere Transaktionen mit verbundenen Parteien

Die nachstehende Tabelle enthält die prozentualen Beteiligungen der wesentlichen Anteilshaber, die mehr als 20 % des umlaufenden Anteilskapitals des Fonds halten:

Fondsname	Beteiligung in % 31. August 2022
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	69,88
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	22,56
Legg Mason Western Asset EUR Core Plus Bond Fund	92,34
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	23,37
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	28,63
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund	57,77
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	31,94
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund	27,07
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	41,88
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	66,94
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund [^]	84,05
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	28,96
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	59,91
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	95,90
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	100,00
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	83,25
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	94,92
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	65,42
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	23,02
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	64,53
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]	96,62
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	52,74
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	21,57
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	27,30
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	26,57
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	39,68
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	24,07
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	99,02
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	91,01
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	91,31
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	33,09
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	20,80
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	32,73
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	27,34
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	20,59
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	34,82
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]	54,38
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	97,79
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^]	33,00
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	40,11
Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	100,00
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	43,97
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	52,89
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	59,21
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	59,23
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund	23,61
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	28,75
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	24,34
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	25,48

Global Credit Fixed

Mit Wirkung zum 5. Februar 2021 schloss das Unternehmen zusammen mit anderen in Europa und den USA registrierten Investmentfonds, die von Franklin Templeton Investments verwaltet werden (einzeln „Darlehensnehmer“, zusammen „Darlehensnehmer“), eine gemeinsame syndizierte vorrangige unbesicherte Kreditfazilität in Höhe von insgesamt 2.675 Millionen USD (die „Globale Kreditfazilität“) ab, um den Darlehensnehmern eine Finanzierungsquelle für vorübergehende und Notfallzwecke bereitzustellen, einschließlich der Möglichkeit, zukünftige unvorhergesehene oder ungewöhnlich große Rückzahlungsanträge zu erfüllen.

Gemäß den Bedingungen der Global Credit Facility wird das Unternehmen zusätzlich zu den Zinsen, die auf vom Unternehmen aufgenommene Kredite erhoben werden, und anderen Kosten, die dem Unternehmen entstehen, seinen Anteil an Gebühren und Kosten zahlen, die im Zusammenhang mit der Implementierung und Aufrechterhaltung der Global Credit Facility entstehen, basierend auf ihrem relativen Anteil am gesamten Nettovermögen aller Kreditnehmer, einschließlich einer jährlichen Bereitstellungsgebühr, die auf dem ungenutzten Teil der Global Credit Facility basiert.

Alle Fonds der Gesellschaft, mit Ausnahme des Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund, fallen in den Geltungsbereich der Global Credit Facility.

4. Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen

Ausschüttende Anteilsklassen

Der hinter dem Namen jeder ausschüttenden Anteilsklasse in Klammern angegebene Buchstabe gibt an, in welchen Abständen die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführten Dividenden erklärt und gezahlt werden.

Bezeichnung der ausschüttenden Anteilsklasse	Häufigkeit der Dividendenerklärungen	Häufigkeit der Dividendenzahlungen
(D)	Täglich	Monatlich
(M)	Monatlich	Monatlich
(Q)	Vierteljährlich	Vierteljährlich (März, Juni, September, Dezember)
(S)	Halbjährlich	Halbjährlich (März, September)
(A)	Jährlich	Jährlich (März)

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Rentenfonds (Rentenfonds wie auf Seite 15 definiert) zum Zeitpunkt jeder Dividendenerklärung: (1) Etwaige Nettoerträge werden ganz oder teilweise als Dividende erklärt; und (2) realisierte und nicht realisierte Kapitalgewinne können (müssen aber nicht) abzüglich der realisierten und nicht realisierten Kapitalverluste ganz oder teilweise als Dividende festgesetzt werden, wobei dies nicht zwingend ist.

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Aktienfonds (wie auf Seite 15 definiert) wird zum Zeitpunkt der Dividendenerklärung der gesamte oder ein Teil eines etwaigen Nettoanlageertrags als Dividende erklärt. Sofern der Anteilshaber nichts anderes verlangt, erfolgen die Ausschüttungen an jeden Anteilshaber der einzelnen ausschüttenden Anteilsklassen in der Währung, in der der Anteilshaber die Anteile gezeichnet hat.

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Mischfonds (wie auf Seite 15 definiert) wird zum Zeitpunkt der Dividendenerklärung der gesamte oder ein Teil eines etwaigen Nettoanlageertrags als Dividende erklärt. Sofern der Anteilshaber nichts anderes verlangt, erfolgen die Ausschüttungen an jeden Anteilshaber der einzelnen ausschüttenden Anteilsklassen in der Währung, in der der Anteilshaber die Anteile gezeichnet hat.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Die ausschüttenden Plus-Anteilsklassen können Ausschüttungen aus dem Kapital erklären und zahlen. Anleger in diesen Anteilsklassen sollten wissen, dass Dividendenzahlungen aus Kapitalbeträgen an eine Rendite oder Rücknahme des ursprünglichen Investitionsvermögens oder der Kapitalgewinne eines Investors zurückzuführen sind, das dieser ursprünglichen Investition zuzuschreiben ist, und dass solche Ausschüttungen zu einer entsprechenden unmittelbaren Verringerung des Nettoinventarwerts pro Anteil der Anteilsklasse führen. Die Zahlung von Ausschüttungen aus dem Kapital führt entsprechend zu Kapitalerosion und kann durch Verzicht auf das Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erzielt werden.

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

	Ausschüttungen aus dem Kapital für den Zeitraum zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	30\$
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	37\$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1\$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$–
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1\$
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	4\$
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$–
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$–
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	5\$
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A ZAR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	15\$
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	8\$
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	2\$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	2\$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$–
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	44\$
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	35\$
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	11\$
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	330\$
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	152\$
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	82\$
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	83\$
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	19\$
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	8\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1\$
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – Klasse D USD ausschüttend (M) Plus	1\$
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	410\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund [^] – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	27\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund [^] – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	18\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund [^] – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	20\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund [^] – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	20\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund [^] – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	107\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	345\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	61\$
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	33\$
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	15\$
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2\$
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	8\$
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	12\$
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.028€
Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	57€
Legg Mason Clear Bridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	316€
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus	56€
Legg Mason Clear Bridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	120€
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	523\$
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	82\$
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	10\$
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	58\$
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	17\$
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	23\$
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	482\$
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Premier Klasse USD ausschüttend (M) Plus	190\$
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse S USD ausschüttend (M) Plus	31\$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3€
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	€–
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1€
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus	€–
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	€–
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	17\$
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	14\$
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2\$
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	9\$
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$–
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$–
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$–
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$–
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) Plus	3\$
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	\$–
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) Plus (abgesichert)	4\$
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) Plus (abgesichert)	\$–
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 A SGD ausschüttend (M) Plus (abgesichert)	1\$
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) Plus	7\$

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 Anteilsinhaber sollten beachten, dass ein erhöhtes Risiko besteht, dass sie bei der Rücknahme von Anteilen der ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen nicht den vollen investierten Betrag zurückerhalten. Für Investoren in den ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen kann dies ungeachtet der Wertentwicklung des jeweiligen Fonds zur Erosion der Kapitalinvestitionen der Anleger oder Kapitalgewinne, die dieser ursprünglichen Investition zugeordnet sind, führen, wodurch der Wert zukünftiger Renditen möglicherweise verringert wird. Die erhöhte Dividendenauszahlung infolge der Berechnung von Gebühren und Aufwendungen auf das Kapital führt zu einer Rendite oder einer Rücknahme der ursprünglichen Kapitalinvestitionen eines Investors oder der Kapitalgewinne, die dieser ursprünglichen Investition zuzuschreiben sind. Die höhere Dividendenauszahlung unter diesem Ladesystem führt zu einer entsprechenden unmittelbaren Verringerung des Nettoinventarwerts der Anteilsklassen am Ex-Dividendendatum. Die Anteilsinhaber sollten beachten, dass in dem Ausmaß, in dem die Aufwendungen

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

dem Kapital berechnet werden, einige oder alle der Ausschüttungen, die von den ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen vorgenommen werden, als Form der Kapitalerstattung betrachtet werden sollten. Sämtliche Aufwendungen der ausschüttenden Anteilsklassen Plus (e) wurden vermögenswirksam erfasst.

Im Berichtszeitraum haben die folgenden Fonds bei ausschüttenden Anteilsklassen Plus (e) Gebühren und Aufwendungen vom Kapital abgezogen:

	Gebühren und Aufwendungen, die dem Kapital für den Zeitraum zum 31. August 2022 belastet wurden (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1\$
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1\$
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse USD ausschüttend (M) Plus (e)	13\$
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	5\$
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	418\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1.462\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	169\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	31\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	58\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	105\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A JPY ausschüttend (M) Plus (e)	1\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	272\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus (e)	\$–
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	163\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	29\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus (e)	\$–
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	167\$
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$–
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1\$
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	6\$
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 USD ausschüttend (M) Plus (e)	912\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	232\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	47\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	162\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	87\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	77\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	30\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Klasse USD ausschüttend (M) Plus (e)	54\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	109\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	2\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Klasse USD ausschüttend (Q) Plus (e)	1\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	13\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1\$
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund – LM Klasse Euro ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	41\$
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1\$
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)	1\$
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	3\$
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$–
Legg Mason Clear Bridge Infrastructure Value Fund [^] – Premier Klasse CAD ausschüttend (Q) Plus (e)	26€
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Premier Klasse CAD ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	246€
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Premier Klasse GBP ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	€–
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (A) Plus (e)	\$–
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	792\$
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	49\$
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	7\$
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] – Klasse A GBP ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	3\$
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	61\$
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus (e)	5\$
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund – S Klasse GBP ausschüttend (M) Plus (e)	2\$

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

Thesaurierende Anteilsklassen

In Bezug auf thesaurierende Anteilsklassen ist vorgesehen, dass im normalen Geschäftsverlauf keine Ausschüttungen beschlossen werden und dass die den thesaurierenden Anteilsklassen zuzurechnenden Nettoanlageerträge täglich im Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Anteilsklasse kumuliert werden.

5. Grundkapital und rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile

Grundkapital

Die Gesellschaft wurde mit einem anfänglichen Grundkapital in Höhe von 39.000 € (in Form von 39.000 Zeichneranteilen ohne Nennwert) gegründet. Bis auf drei hat die Gesellschaft alle Zeichneranteile zurückgekauft. Die Inhaber dieser drei Zeichneranteile sind berechtigt, an allen Versammlungen der Gesellschaft teilzunehmen und dort abzustimmen, sie sind jedoch nicht berechtigt, an den Dividenden bzw. dem Nettovermögen eines Fonds oder der Gesellschaft zu partizipieren.

Rückkaufbare und 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 Anteilinhaber dazu, gleichberechtigt auf anteilsmäßiger Basis an den Dividenden und gegebenenfalls dem Reinvermögen des Fonds zu partizipieren, für den die Anteile ausgegeben wurden, mit Ausnahme von Dividenden, die beschlossen wurden, bevor dieser Anteilinhaber seine Anteile kaufte.

Der Erlös aus der Ausgabe von Anteilen wird in den Büchern der Gesellschaft dem betreffenden Fonds zugeschrieben und im Namen des Fonds zum Erwerb von Vermögenswerten verwendet, in die der Fonds investieren kann. Die Unterlagen und Bücher der einzelnen Fonds werden getrennt geführt.

Jeder Fonds bietet unterschiedliche Anteilsklassen an. Diese sind im Verkaufsprospekt der Gesellschaft angegeben. Die verschiedenen Anteilsklassen unterscheiden sich hauptsächlich durch ihre Ausgabeaufschläge, Kosten, Gebührensätze, Ausschüttungspolitik und Währungen. Anleger können je nach Anlagebetrag und Anlagehorizont somit wählen, welche Anteilsklasse für ihre Anlagebedürfnisse am besten geeignet ist. Dabei ist die Höhe der Investition und der erwartete Beteiligungszeitraum in Betracht zu ziehen.

Anteilsklassen werden in ausschüttend und thesaurierend unterschieden. Thesaurierende Anteilsklassen schütten keinen Nettoertrag und keine realisierten oder nicht realisierten Nettokapitalgewinne aus. Ausschüttende Anteilsklassen schütten indes, wie in Erläuterung 4 zu den Ausschüttungen oben erklärt, in bestimmten zeitlichen Abständen einen Ertrag aus. Diese Abstände sind unterschiedlich und hängen davon ab, welcher Buchstabe in Klammern hinter der ausschüttenden Anteilsklasse angegeben ist. Darüber hinaus befinden sich Zeichneranteile der Gesellschaft in Umlauf. Die Zeichneranteile vermitteln deren Inhaber jedoch keinen Anspruch auf eine Beteiligung am Vermögen eines Fonds.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

5. Grundkapital und rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile – (Fortsetzung)

Jeder Fonds kann Anteilsklassen anbieten, die auf andere Währungen als die Basiswährung des Fonds lauten. Sofern der Name der Anteilsklasse nicht das Wort „(abgesichert)“ enthält, wendet der Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter bei keiner solchen Anteilsklasse Methoden an, um das Risiko der Anteilsklasse in Bezug auf Änderungen der Wechselkurse zwischen der Basiswährung des Fonds und der Währung der Anteilsklasse abzusichern.

Anteile der Klasse A sind allen Anlegern zugänglich. Provisionen/Rabattzahlungen können von Verwaltern an Händler oder andere Anleger, die eine Vereinbarung mit dem Vertriebshändler haben, in Bezug auf solche Aktien erfolgen. Anteile der Klasse B, C, D und E sind für alle Anleger verfügbar, die Kunden von Händlern sind, die von einem Vertriebshändler in Bezug auf diese Aktien beauftragt werden. Provisionszahlungen können von Vertriebshändlern an Händler oder andere Anleger, die eine Vereinbarung mit einem Vertriebshändler haben, in Bezug auf solche Aktien erfolgen. Anteile der Klasse F stehen professionellen Anlegern und Anlegern mit einer diskretionellen Anlagevereinbarung mit einem Händler zur Verfügung, der vom Vertriebshändler im Hinblick auf diese Aktien beauftragt wurde. Provisionen/Rabattzahlungen können von Verwaltern an Händler oder andere Anleger, die eine Vereinbarung mit dem Vertriebshändler haben, in Bezug auf solche Aktien erfolgen. Anteile der Klasse J sind für die japanische Verteilung nach Ermessen der Direktoren oder Vertriebshändler bestimmt. Anteile der Klasse M sind für professionelle Investoren und Investoren mit einer diskretionellen Anlagevereinbarung mit einem Händler oder einer anderen von einem Vertriebshändler im Hinblick auf diese Aktien beauftragten Stelle verfügbar. Anteile der Klasse R sind für alle Investoren verfügbar, die ein gebührenbasiertes Arrangement mit einem Vermittler haben, von dem sie eine persönliche Empfehlung in Bezug auf ihre Anlage in die Fonds erhalten haben. Anteile der Klasse X sind für Händler, Portfoliomanager oder Plattformen verfügbar, denen es gemäß den behördlichen Bestimmungen oder auf Grundlage von Gebührenverträgen mit ihren Kunden, nicht gestattet ist, die Vertriebsprovisionen von Unternehmen anzunehmen und einzubehalten sowie für institutionelle Investoren (für Anleger in der Europäischen Union bezieht sich das auf „geeignete Gegenparteien“, wie unter MIFID II definiert), die auf eigene Rechnung investieren. Anteile der Klassen U, Y und S sind im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für institutionelle Anleger verfügbar. Die BW LM-Anteilsklassen sind im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für sich qualifizierende Investoren verfügbar, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe oder von Kunden solcher Mitglieder sind. LM-Anteilsklassen sind nach Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für sich qualifizierende Anleger erhältlich, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe, von Pensionsplänen und ähnlichen Anlagen sind, die von Mitgliedern der Legg Mason-Gruppe oder Kunden solcher Mitglieder gefördert werden. Für Anleger, die in der Europäischen Union ansässig sind, stehen im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für „geeignete Gegenparteien“ gemäß Definition im Rahmen von MIFID II zur Verfügung. Für Investoren außerhalb der Europäischen Union sind die BW Premier-Anteilsklassen verfügbar für institutionelle Investoren im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler oder für sich qualifizierende Investoren, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe oder Kunden dieser Mitglieder sind. Für Anleger, die in der Europäischen Union ansässig sind, stehen die Premier-Anteilsklassen für „geeignete Gegenparteien“ zur Verfügung, die unter MIFID II definiert sind. Für Anleger, die außerhalb der Europäischen Union ansässig sind, stehen die Premier Share Klassen für institutionelle Anleger zur Verfügung.

Für Anteilsklassen, in deren Namen nach der Währungsbezeichnung das Wort „(abgesichert)“ enthalten ist, ist beabsichtigt, dass solche Anteilsklassen gegen Schwankungen der Wechselkurse zwischen der Währung der Anteilsklasse und der Basiswährung des jeweiligen Fonds abgesichert werden. Bestimmte Anteilsklassen in Fonds, die von Brandywine Global Investment Management, LLC verwaltet werden, werden im Verhältnis zu einem Index abgesichert, wie durch die ein „(IH)“ im Namen der Anteilsklasse angegeben. Der von ClearBridge RARE Infrastructure Pty Limited verwaltete Legg Mason RARE Infrastructure Value Fund bietet Portfolio-abgesicherte Anteilsklassen, wie durch die Angabe von „(PH)“ im Namen der Anteilsklasse erkennbar. Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^A (der Handel wurde am 1. Juni 2021 eingestellt) bot Anteilsklassen an, für die möglicherweise eine Performancegebühr gezahlt wurde, 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.

6. Besteuerung

Gemäß aktuellem Recht und aktueller Praxis in Irland erfüllt die Gesellschaft die Voraussetzungen für einen Investmentfonds gemäß Abschnitt 739B des Taxes Consolidation Act von 1997 (in seiner jeweils gültigen Fassung). Auf dieser Basis sind die Erträge und Gewinne der Gesellschaft außer bei Eintreten eines Steuertatbestandes in Irland generell nicht steuerpflichtig. Ein Steuertatbestand entsteht im Allgemeinen bei der Ausschüttung, Rücknahme, dem Rückkauf, der Einziehung oder Übertragung von Anteilen oder am Ende des „relevanten Zeitraums“. Dieser bezeichnet den achtjährigen Zeitraum, der mit dem Kauf der Anteile durch die Anteilsinhaber beginnt, und jeden nachfolgenden achtjährigen Zeitraum, der sich unmittelbar an den vorherigen relevanten Zeitraum anschließt.

Die Gesellschaft ist in Irland bei Eintritt eines Steuertatbestands in den folgenden Fällen nicht steuerpflichtig:

- (i) ein Anteilsinhaber zum Zeitpunkt des steuerpflichtigen Ereignisses steuerlich weder in Irland ansässig ist noch seinen gewöhnlichen Wohnsitz dort hat, sofern eine gültige angemessene Erklärung vorliegt oder sofern der Gesellschaft von Irish Revenue gestattet wurde, Bruttozahlungen zu leisten, wenn keine angemessenen Erklärungen vorliegen; und
- (ii) es sich um bestimmte in Irland steuerlich ansässige, aber steuerbefreite Anteilsinhaber handelt, die der Gesellschaft die erforderlichen unterschriebenen vorschriftsmäßigen Erklärungen vorgelegt haben.

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

Sofern keine entsprechende Erklärung vorliegt, ist die Gesellschaft bei Eintreten eines Steuertatbestands in Irland steuerpflichtig.

Erhaltene Kapitalerträge, Dividenden und Zinsen können im Herkunftsland Steuern, einschließlich Quellensteuern, unterliegen, und der Fonds oder seine Anteilsinhaber bekommen diese Steuern eventuell nicht erstattet.

7. Barmittel und Barmitteläquivalente und Margenkonto

Barmittel und andere liquide Mittel werden zum Nennwert und gegebenenfalls unter Berücksichtigung aufgelaufener Zinsen bewertet. Die Barmittel und Barmitteläquivalente und Barmittel-Überziehungssalden eines Fonds werden bei der Depotstelle gehalten. Der Posten „Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung“ weist in der Darstellung der Vermögenslage Einschusszahlungen, Barsicherheiten und realisierte Gewinne und Verluste aus Futures-Kontrakten aus, die noch nicht geliefert wurden. Margeneinlagen und Barsicherheiten, die in Bezug auf OTCs und den Handel mit börsengehandelten Derivaten zum 31. August 2022 gehalten werden, werden bei den folgenden Brokern gehalten: Bank of America Merrill Lynch, Barclays, BNP Paribas, BNY Mellon, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley und UBS.

8. Verpflichtungen und Eventualverbindlichkeiten

Zum 31. August 2022 bestanden keine wesentlichen Verpflichtungen oder Eventualverbindlichkeiten.

9. Soft-Commission-Vereinbarungen

Die Gesellschaft hat Richtlinien entwickelt, die sicherstellen sollen, dass ihre Dienstleister im besten Interesse der Fonds handeln, wenn sie Handelsentscheidungen im Auftrag dieser Fonds im Rahmen des Portfoliomanagements umsetzen. Zu diesem Zweck und um bestmögliche Ergebnisse für die Fonds zu erzielen, müssen unter Berücksichtigung von Preis, Kosten, Geschwindigkeit, Wahrscheinlichkeit der Ausführung und Abwicklung, Auftragsvolumen und -art und sonstigen für die Auftragsausführung relevanten Überlegungen alle angemessenen Maßnahmen getroffen werden. Eventuell erhaltene Barrückvergütungen von einem Makler oder Händler für an diesen Makler oder Händler gerichtete Fonds-Maklergeschäfte werden vom Anlageverwalter, dem Unteranlageverwalter oder mit diesen verbundenen Personen nicht einbehalten. Die Gesellschaft trägt nicht die Kosten externer Analysen für den Anlageverwalter und den Unteranlageverwalter. Derartige Kosten werden vom entsprechenden Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter getragen. Informationen zu den Richtlinien für Auftragsausführungen der Fonds sind für Anteilsinhaber auf Anfrage kostenlos erhältlich.

Im Laufe des Berichtszeitraums zum 31. August 2022 ging Royce & Associates, LP („Royce“) „Soft Commission“-Vereinbarungen mit Brokern ein, erstattete jedoch die entsprechenden Fonds für alle im Rahmen dieser Vereinbarungen entstandenen Forschungskosten.

^A In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

10. Wechselkurse

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

	Währung	Wechselkurs am 31. August 2022
Auf USD lautende Fonds	Argentinischer Peso	297,557*
	Australischer Dollar	1,4615
	Brasilianischer Real	5,2024
	Britisches Pfund	0,8608
	Kanadischer Dollar	1,3134
	Chilenischer Peso	896,2500
	Chinesischer Renminbi (CNH)	6,9075
	Chinesischer Renminbi (CNY)	6,8940
	Kolumbianischer Peso	4.429,0000
	Tschechische Krone	24,3883
	Dänische Krone	7,4008
	Ägyptisches Pfund	19,2350
	Euro	0,9951
	Hongkong-Dollar	7,8487
	Ungarischer Forint	398,5274
	Indische Rupie	79,4582
	Indonesische Rupiah	14.842,5000
	Israelischer Schekel	3,3313
	Japanischer Yen	138,9250
	Malaysischer Ringgit	4,4755
	Mexikanischer Peso	20,1465
	Neuseeländischer Dollar	1,6344
	Norwegische Krone	9,9379
	Pakistanische Rupie	218,7250
	Peruanischer Nuevo Sol	3,8468
	Philippinischer Peso	56,1550
	Polnischer Zloty	4,7000
	Russischer Rubel	61,0000
	Saudi-Rial	3,7590
	Singapur-Dollar	1,3975
	Südafrikanischer Rand	17,1288
	Südkoreanischer Won	1.337,5500
	Schwedische Krone	10,6600
Schweizer Franke	0,9775	
Taiwan-Dollar	30,4375	
Thailändischer Baht	36,4625	
Türkische Lira	18,1918	
Uruguayischer Peso	40,8250	
Auf EUR lautende Fonds	Australischer Dollar	1,4687
	Brasilianischer Real	5,2282
	Britisches Pfund	0,8651
	Kanadischer Dollar	1,3199
	Tschechische Krone	24,5090
	Dänische Krone	7,4374
	Japanischer Yen	139,6128
	Norwegische Krone	9,9871
	Polnischer Zloty	4,7233
	Südafrikanischer Rand	17,2136
	Schwedische Krone	10,7128
	Schweizer Franke	0,9823
	Türkische Lira	18,2818
US-Dollar	1,0050	
Auf GBP lautende Fonds	Euro	1,1560
	Japanischer Yen	161,3893
	US-Dollar	1,1617

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

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts

Die Gesellschaft hat die Bewertungen zum Marktwert im Rahmen einer Marktwertthierarchie klassifiziert, die die Signifikanz von Inputs reflektiert, die bei einer Bewertung zum Marktwert herangezogen werden. Die Marktwertthierarchie kennt folgende Stufen:

Eingabewerte der Stufe 1 sind unbereinigte notierte Kurse in aktiven Märkten für gleichartige Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten, welche dem Unternehmen am Bewertungstag zugänglich sind.

Eingabewerte der Stufe 2 sind andere notierte Kurse als die in aktiven Märkten der Stufe 1, welche für die betreffenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten direkt oder indirekt beobachtbar sind (d. h. unter Verwendung von Marktdaten entwickelt werden).

Eingabewerte der Stufe 3 sind nicht beobachtbare Parameter für die Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten (d. h., es sind keine Marktdaten verfügbar).

Jede Kapitalanlage wird insgesamt stets der Stufe 1, 2 oder 3 zugeordnet. In bestimmten Fällen kann zur Bewertung des beizulegenden Zeitwerts einer Kapitalanlage eine Reihe verschiedener Parameter verschiedener Stufen der Bewertungshierarchie herangezogen werden. In diesen Fällen richtet sich die Stufe der Kapitalanlage nach der geringsten Bewertungsstufe der Eingabewerte, die für die Berechnung des beizulegenden Zeitwerts herangezogen werden. Die Beurteilung der Bedeutsamkeit eines bestimmten Eingabewerts für die Bewertung zum beizulegenden Zeitwert erfordert Urteilsvermögen und ist anlagenspezifisch.

Die Eingabewerte oder die verwendete Methode zur Bewertung der Wertpapiere sind nicht unbedingt ein Hinweis auf die Risiken, die mit einer Anlage in diesen Wertpapieren verbunden sind.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle schlüsselt die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum 31. August 2022 gemäß den Bewertungsstufen auf:

	Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset EUR Core Plus Bond Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Level 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	139
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	81	1.993	621	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(1.400)	(10.639)	(1.190)	–
	–	(1.319)	(8.646)	(569)	139
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 606.780	\$ 180.284	\$ 1.263.999	€ 135.931	\$ 37.716
Geldmarktinstrumente	259.000	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	6.916	15.794	392	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	4.401	28.044	76	34
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(1.082)	(10.190)	(1.870)	(58)
	865.780	190.519	1.297.647	134.529	37.692
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ 128	\$ 1.038	€ –	\$ 380
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	128	1.038	–	380
Anlagen insgesamt	\$ 865.780	\$ 189.328	\$ 1.290.039	€ 133.960	\$ 38.211

	Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund zum zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US High Yield Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Level 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	401	2.505	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	170	–	39	419	21
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(1.563)	(45)	–	–	(59)
	(992)	2.460	39	419	(38)
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 217.349	\$ 183.172	\$ 40.426	\$ 59.046	\$ 9.558
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	10.477	267	–	657	184
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	1.803	224	21	133	112
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(3.921)	(91)	(62)	(356)	(106)
	225.708	183.572	40.385	59.480	9.748
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 2	\$ 623	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	744	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	2	1.367	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 224.718	\$ 187.399	\$ 40.424	\$ 59.899	\$ 9.710

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Global Credit Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Level 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	2.831	430	302	40.058
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(273)	(380)	(1.843)	(73)	(195.004)
	(273)	2.451	(1.413)	229	(154.946)
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 434.361	\$ 332.676	\$ 147.844	\$ 62.177	\$ 2.158.526
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	721	26.694	10.841	986	91.803
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	509	4.743	2.061	832	330.773
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(923)	(9.675)	(4.946)	(450)	(171.045)
	434.668	354.438	155.800	63.545	2.410.057
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ –	\$ 8.884
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	1	–	8.884
Anlagen insgesamt	\$ 434.395	\$ 356.889	\$ 154.388	\$ 63.774	\$ 2.263.995

	Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Mortgage- Backed Securities Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Level 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	£ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	367	–	–	–	233
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	988	507	335	38	146
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(1.675)	(35)	(618)	(94)	(104)
	(320)	472	(283)	(56)	275
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 238.790	\$ 614.262	\$ 1.129.548	£ 63.591	\$ 141.420
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	2.446	19.337	33.546	–	1.110
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	1.369	1	–	3	119
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(8.705)	(1.629)	(34)	(192)	(4.994)
	233.900	631.971	1.163.060	63.402	137.655
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 718	\$ 28.430	\$ –	£ –	\$ 75
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	2.638	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	3.356	28.430	–	–	75
Anlagen insgesamt	\$ 236.936	\$ 660.873	\$ 1.162.777	£ 63.346	\$ 138.005

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^ zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^ zum 31. August 2022 (in 000's)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global US High Yield Fund^ zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Level 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	126	32	–	6.688	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(485)	(10)	–	(464)	–
	(359)	22	–	6.224	–
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 16.996	\$ 7.947	\$ 183.771	\$ 502.125	\$ 9.922
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	622	617	3.607	27.632	614
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	1.052	239	2.196	11.678	6
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(218)	(72)	(5.457)	(22.442)	(236)
	18.452	8.731	184.117	518.993	10.306
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 18.093	\$ 8.753	\$ 184.117	\$ 525.217	\$ 10.306

	Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Level 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	38	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	40	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	(14)	(374)	–	(132)
	–	(14)	(296)	–	(132)
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 198.158	\$ 1.037.196	\$ 48.431	\$ 7.467	\$ 65.685
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	3.997	109.532	1.912	493	3.816
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	3.218	10.578	166	7	934
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(5.755)	(17.459)	(174)	(107)	(3.309)
	199.618	1.139.847	50.335	7.860	67.126
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 199.618	\$ 1.139.833	\$ 50.039	\$ 7.860	\$ 66.994

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Value Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Level 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	1.855	863.672	181.738	1.228.508	404.115
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	1.855	863.672	181.738	1.228.508	404.115
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	68	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	31	–	2.012	2
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(20)	(637)	–	(1.310)	(181)
	48	(606)	–	702	(179)
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 1.903	\$ 863.066	\$ 181.738	\$ 1.229.210	\$ 403.936

	Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Level 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	36.563	1.598.088	12.554	1.050.018	2.377
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	36.563	1.598.088	12.554	1.050.018	2.377
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 500	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	53	–	3.351	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(62)	(3.281)	–	(1.936)	(21)
	438	(3.228)	–	1.415	(21)
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 37.001	\$ 1.594.860	\$ 12.554	€ 1.051.433	\$ 2.356

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Royce Global Small Cap Premier Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Level 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	385.821	633.368	74.284	3.899	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	385.821	633.368	74.284	3.899	–
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	26.649	1.456	97	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	13	707	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(1.405)	(1.256)	(6)	–	–
	(1.392)	26.100	1.450	97	–
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 384.429	\$ 659.468	\$ 75.734	\$ 3.996	€ –

	Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^] F zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^] α zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^] zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Level 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	20.820	–	–	13.467	151.055
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	20.820	–	–	13.467	151.055
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	2	–	–	–	56
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(56)	–	–	–	(1.378)
	(54)	–	–	–	(1.322)
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 20.766	\$ –	\$ –	\$ 13.467	\$ 149.733

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^ zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Level 1			
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	25.297	33.541	199.312
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–
	25.297	33.541	199.312
Level 2			
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	196
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	(17)	–	(80)
	(17)	–	116
Level 3			
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	60	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–
	–	60	–
Anlagen insgesamt	\$ 25.280	\$ 33.601	€ 199.428

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

α Mit Wirkung vom 27. April 2022 stellte der Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ den Handel ein.

μ Mit Wirkung zum 11. Juli 2022 stellte der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ den Handel ein.

12. Wertpapiersicherheiten

Dem Kreditrisiko begegnet man durch diversifizierten Einsatz von Gegenparteien und Emittenten und durch Mindestratings für einzelne Wertpapiere und Durchschnittsratings für die Portfolios. Der jeweilige Anlagemanager und/oder Unteranlageverwalter kann Portfoliobeschränkungen festlegen und auf der Grundlage interner Parameter mit gemeinsam bei Auflegung des Fonds vereinbarten Beschränkungen anlegen, wozu Beschränkungen für Emissionen und Emittenten, Mindestbonität sowie durchschnittliche Bonität zählen. Das Konto wird dabei laufend überwacht, um sicherzustellen, dass es diese Parameter weiterhin erfüllt. Darüber hinaus können vor dem Kauf strenge unabhängige Analysen aller Anleihepapiere durchgeführt werden, unter anderem Finanzmodellierung, Szenarioanalysen sowie die Überwachung von Veränderungen des Risikoprofils. Generell dürfen zum Zeitpunkt des Kaufs maximal 5 % des Portfolios in ein und dasselbe emittierende Unternehmen angelegt sein.

Sofern Transaktionen für einen Fonds zu großen nicht realisierten Gewinnen führen, kann es für einen Fonds erforderlich sein, eine von einem Makler erhaltene Sicherheit zu halten. In diesem Fall reduziert sich das Kreditrisiko des Fonds um den Wert der gehaltenen Sicherheit. Sollte der Makler Konkurs anmelden, so ist die in Verbindung mit bestimmten derivativen Finanzinstrumenten eingebrachte Sicherheit in den USA (wobei sich die Vorschriften in den verschiedenen Rechtssystemen unterscheiden können) von der bei Aufnahme des Konkursverfahrens angewandten automatischen Aussetzung ausgenommen. Diese Ausnahme für Derivate würde es einem Fonds erlauben, die von der zahlungsunfähigen Partei eingebrachte Sicherheit sofort zwangsvollstrecken zu lassen, um die Forderungen gegen die zahlungsunfähige Partei zu befriedigen.

Die Gesellschaft überwacht ihr Risiko, indem sie die Bonität und die Finanzpositionen der Gegenparteien, mit denen die Fonds Geschäfte abschließen, regelmäßig überprüft. Die Fonds dürfen nur mit genehmigten Gegenparteien handeln.

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

Fonds	Broker	Marktwert der Sicherheiten zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	Goldman Sachs	42\$
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Morgan Stanley	288\$
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Citi	286\$
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	JP Morgan	147\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Bank of America Merrill Lynch	693\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Citi	280\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Goldman Sachs	5.441\$
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	JP Morgan	4.634\$

Es wird eine Liste genehmigter Gegenparteien geführt. Ergänzungen dieser Listen werden vierteljährlich überprüft und jedes Jahr wird eine sorgfältige Neubewertung aller Gegenparteien vorgenommen. Die Überprüfung schließt die Analyse der Eigenkapitalausstattung, der Rentabilität, der Liquidität und anderer maßgeblicher Faktoren der Gegenpartei ein.

Für eine effiziente Portfolioverwaltung kann jeder Fonds gemäß den Bestimmungen und Beschränkungen der OGAW-Vorschriften der irischen Zentralbank Wertpapierpensionsgeschäfte, umgekehrte Wertpapierpensionsgeschäfte sowie Wertpapierleihverträge abschließen.

Bis zum Ablauf der Wertpapierpensionsgeschäfte, der umgekehrten Wertpapierpensionsgeschäfte sowie der Wertpapierleihgeschäfte muss die im Rahmen eines solchen Vertrags oder Geschäfts erhaltene Sicherheit:

- (i) täglich neu bewertet werden;
- (ii) jederzeit dem Wert des angelegten Betrags oder der geliehenen Wertpapiere entsprechen oder darüber liegen;
- (iii) auf den Treuhänder oder seinen Beauftragten übertragen werden; und
- (iv) dem Fonds sofort und ohne Rückgriff auf die Gegenpartei zur Verfügung stehen, falls dieses Rechtssubjekt in Verzug gerät.

Jede von der Gesellschaft erhaltene unbare Sicherheit kann nicht verkauft oder weiterverpfändet werden, sondern muss zum Kreditrisiko der Gegenpartei gehalten und von einer von der Gegenpartei unabhängigen Stelle ausgegeben werden.

Der Bewertungsausschuss trifft sich mindestens einmal monatlich und wenn die Umstände dies erfordern, um Fragen der Bewertung zu erörtern und unter anderem auch das Kreditrisiko zu prüfen. Der jeweilige Anlagemanager und/oder Unteranlageverwalter legt dem Verwaltungsrat und dem Ausschuss halbjährlich Risikoanalysen vor.

Im Wesentlichen werden alle von den Fonds gehaltenen Barmittel und Wertpapiere über die Depotbank gehalten, die eine Bonität von AA- hat. Die Rechte der Fonds an den von der Verwahrstelle gehaltenen Barmitteln können durch Konkurs oder Zahlungsunfähigkeit der Verwahrstelle verzögert oder eingeschränkt werden. Die Bonität der Verwahrstelle wird von renommierten Ratingagenturen als erstklassig eingestuft. Sollte sich die Bonität oder finanzielle Lage der Verwahrstelle erheblich verschlechtern, kann der jeweilige Anlagemanager und/oder Unteranlageverwalter den Barmittelbestand auf eine andere Bank übertragen.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Wertpapiersicherheiten – (Fortsetzung)

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

Wenn ein Fonds eine Sicherheit bei einer Gegenpartei hinterlegt hat, so kann der Fonds bei Insolvenz der Gegenpartei gemäß den Handelsverträgen mit der Gegenpartei berechtigt sein, diese Sicherheit zurückzufordern. In der Praxis kann der Fonds jedoch bestrebt sein, alle der Gegenpartei geschuldeten Beträge zu reduzieren, um alle noch offenen Geschäfte durch Verrechnung der geschuldeten Beträge gegen die eingebrachte Sicherheit zu verrechnen. Wenn der Fonds nach Verrechnung der geschuldeten Beträge Anspruch auf Rückzahlung einer Sicherheit hätte (wenn z.B. die Fondsposition überbesichert war), dann hätte der Fonds im Insolvenzverfahren wahrscheinlich eine unbesicherte Forderung gegen den Kontrahenten über den Betrag, der den ihm geschuldeten Betrag übersteigt.

Zur Reduzierung des Gegenparteiausfallrisikos werden bestimmte außerbörsliche Derivate über zentrale Clearingstellen abgewickelt. Im Rahmen dieser Vereinbarung werden mit Gegenparteien abgeschlossene Transaktionen an Clearingstellen abgetreten, die nach der Annahme effektiv die Gegenpartei für die Risikoaspekte der Transaktion ersetzen.

Die folgende Tabelle weist den Marktwert der Wertpapiere aus, die in Bezug auf den Handel mit Derivaten als Sicherheit bei Brokern platziert wurden:

Fonds	Broker	Marktwert der Sicherheiten zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	Citi	25\$

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

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

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

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund hielt zum Ende des Berichtszeitraums keine Anteile am Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^]. Im Berichtszeitraum durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^] Für den Zeitraum zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^] Für den Zeitraum zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	83\$	\$-
Rücknahme von Anteilen	(6.388)	(9.302)
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(1.391)	979
Erhaltene Ausschüttungen	83	-
Anschaffungskosten Beizulegender Zeitwert	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	\$-	\$-

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

Der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund hielt zum Ende des Berichtszeitraums keine Anteile am Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]. Im Berichtszeitraum durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^] Für den Zeitraum zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	53\$
Rücknahme von Anteilen	(3.781)
Realisierter Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(756)
Erhaltene Ausschüttungen	53
Anschaffungskosten Beizulegender Zeitwert	-
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	\$-

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

13. Angaben zu gegenseitigen Anlagen durch die Fonds innerhalb der Gesellschaft – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

Der Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund hielt zum Ende des Berichtszeitraums keine Anteile am Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] bzw. am Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^]. Im Berichtszeitraum durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^] Für den Zeitraum zum 31. August 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^] Für den Zeitraum zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	20\$	\$-
Rücknahme von Anteilen	(1.761)	(3.283)
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(378)	295
Erhaltene Ausschüttungen	20	-
Anschaffungskosten	-	-
Beizulegender Zeitwert	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	\$-	\$-

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

Der Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^] hielt zum Ende des Berichtszeitraums keine Anteile am Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]. Im Berichtszeitraum durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^] Für den Zeitraum zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	39\$
Rücknahme von Anteilen	(2.706)
Realisierter Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(503)
Erhaltene Ausschüttungen	39
Anschaffungskosten	-
Beizulegender Zeitwert	-
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	\$-

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

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

	Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^] Für den Zeitraum zum 31. August 2022 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	\$-
Rücknahme von Anteilen	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	-
Erhaltene Ausschüttungen	-
Anschaffungskosten	3.499
Beizulegender Zeitwert	3.816
Nicht realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	317\$

14. Bedeutende Ereignisse

Am 24. Februar 2022 begann Russland mit militärischen Operationen in der Ukraine. Die anhaltende politische und finanzielle Unsicherheit in Bezug auf Russland und die Ukraine kann die Marktvolatilität und das wirtschaftliche Risiko einer Anlage in Wertpapieren in diesen Ländern und anderen betroffenen Ländern in der Region erhöhen. Aufgrund der Sanktionen, Maßnahmen von Regierungen, Entwicklungen in der Ukraine selbst und anderer Umstände bewertet die Verwaltungsgesellschaft weiterhin die Auswirkungen auf die Bewertung und Liquidität und wird alle erforderlichen potenziellen Maßnahmen gemäß den Bewertungsrichtlinien und -verfahren des Fonds ergreifen.

Mit Wirkung vom 27. April 2022 stellte der Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung zum 21. Juni 2022 stellten 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 stellte der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

Der Verwaltungsrat, basierend auf Beschränkungen, die durch die Verordnung (EU) Nr. 833/2014 des Rates vom 31. Juli 2014 über restriktive Maßnahmen angesichts des Vorgehens Russlands zur Destabilisierung der Lage in der Ukraine eingeführt wurden, in der geänderten Fassung, insbesondere durch die Verordnung (EU) 2022/ 328 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 angesichts der Lage in Belarus und der Beteiligung von Belarus an Russlands Aktivitäten in der Ukraine, die den Geltungsbereich der EU-Sanktion auf Belarus ausdehnt, beschlossen, jegliche Zeichnung des Fonds durch (i) russische/belarusische Staatsangehörige oder natürliche Personen mit Wohnsitz in Russland/Belarus oder juristische Personen, Körperschaften oder Körperschaft mit Sitz in Russland/Belarus („russische/belarusische Person“), (ii) jeder russischer/belarusischer Person, die in einem Land außerhalb der EU ansässig ist, und (iii) jedem Anleger, dessen letztendlicher wirtschaftlicher Eigentümer eine russische/belarusische Person ist, zu unterbieten.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

14. Signifikante Ereignisse – (Fortsetzung)

Am 17. Juni 2022 wurden von der Gesellschaft ein Nachtrags- und ein Fachprospekt herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt. Die wichtigsten Änderungen sind:

- Aufnahme eines neuen Fonds: Western Asset China Bond Fund;
- Hinzufügung weiterer Ausschüttungshäufigkeiten für bestimmte ausschüttende Anteilklassen für die folgenden Fonds: Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund, Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^] und Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^].

Mit Wirkung vom 1. Juli 2022 ersetzte Franklin Templeton Investments (Asia) Limited Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited als zusätzliche Vertriebs- und Dienstleistungsstelle der Gesellschaft.

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

Während des Berichtszeitraums zum 31. August 2022 fanden keine weiteren wesentlichen Ereignisse statt.

15. Getrennte Haftung

Die Gesellschaft ist ein Dachfonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds. Gemäß irischem Recht haften das Vermögen der einzelnen Fonds nicht für die Verbindlichkeiten der übrigen Fonds der Gesellschaft. Ungeachtet dessen kann nicht garantiert werden, dass die getrennte Haftung der Teilfonds im Fall einer Klage gegen die Gesellschaft vor Gerichten einer anderen Gerichtsbarkeit Bestand hat.

16. Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Am 3. Oktober 2022 beendete Joseph Carrier seine Vollzeitbeschäftigung bei Franklin Templeton Investments. Herr Carrier fungiert weiterhin als nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und wird ab dem 3. Oktober 2022 im Einklang mit den anderen nicht geschäftsführenden Verwaltungsratsmitgliedern der Gesellschaft vergütet.

Mit Wirkung zum 10. Oktober 2022 stellte der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund den Handel ein.

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

17. Genehmigung des Halbjahresberichts und ungeprüften Abschlusses

Der Halbjahresbericht und der ungeprüfte Zwischenabschluss wurden am 18. Oktober 2022 dem Verwaltungsrat vorgelegt und von diesem zur Kenntnis genommen und zur Einreichung bei der Zentralbank sowie zur Verteilung an die Anteilhaber genehmigt.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER)

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022**
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund		
Klasse A USD thesaurierend	0,28	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	0,27	
Klasse B USD, thesaurierend	0,39	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	0,88	
Klasse C USD, thesaurierend	0,43	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	0,43	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,22	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	0,29	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	0,27	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	0,15	
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,18	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,17	
Klasse C USD, thesaurierend	1,68	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,68	
Klasse E USD, thesaurierend	1,79	
Klasse F USD, thesaurierend	0,68	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,68	
Klasse X USD thesaurierend	0,70	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,70	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,43	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,43	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,13	
Klasse GA USD, thesaurierend	0,95	
Klasse GE USD, thesaurierend	1,55	
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,35	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,35	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,61	
Klasse C USD, thesaurierend	1,85	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,85	
Klasse E USD, thesaurierend	1,96	
Klasse F USD, thesaurierend	0,65	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,65	
Klasse X USD thesaurierend	0,75	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,70	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,74	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,40	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	0,40	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,40	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,10	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,10	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,10	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,25	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,25	
Klasse B (G) USD, ausschüttend (D)	1,74	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,75	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,75	
Legg Mason Western Asset EUR Core Plus Bond Fund		
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,21	
Klasse A EUR, ausschüttend (D)	1,20	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,69	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,42	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,12	
Klasse GA EUR, thesaurierend	0,94	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	0,94	
Klasse GE EUR, thesaurierend	1,54	
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,35	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,35	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,34	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,35	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,35	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,34	
Klasse B USD, thesaurierend	1,60	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,60	
Klasse C USD, thesaurierend	1,83	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,86	
Klasse F USD, thesaurierend	0,95	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,60	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	0,60	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,60	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	0,45	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,39	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,38	
Klasse B (G) USD, ausschüttend (D)	1,90	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,88	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,88	
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,38	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,37	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,37	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,62	
Klasse C USD, thesaurierend	1,87	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,87	
Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,36	
Klasse E USD, thesaurierend	1,97	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,97	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,97	
Klasse F USD, thesaurierend	0,77	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,77	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,82	
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,82	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,52	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	0,51	
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	0,52	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,52	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,52	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,52	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,52	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	0,53	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,52	
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,12	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,12	
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,35	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,34	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,34	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,36	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,33	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,25	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,34	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,62	
Klasse C USD, thesaurierend	1,83	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,84	
Klasse E USD, thesaurierend	1,94	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,94	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,94	
Klasse F USD, thesaurierend	0,81	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,82	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,56	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,61	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	0,45	
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,42	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,11	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,11	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,26	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,26	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,76	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,76	
Klasse GF USD, thesaurierend	1,06	
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,79	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,79	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,79	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,76	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,79	
Klasse A Euro, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,79	
Klasse A GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,79	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,79	
Klasse C USD, thesaurierend	2,29	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	2,29	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	2,43	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,44	
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	2,42	
Klasse F USD, thesaurierend	0,98	
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,08	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,74	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,74	
LM KLASSE USD, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,19	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,44	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,44	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,94	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,94	

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

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022**
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,43	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,42	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,43	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,44	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,43	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,42	
Klasse A Euro, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,38	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,43	
Klasse B USD, thesaurierend	1,67	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,74	
Klasse C USD, thesaurierend	1,93	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,93	
Klasse E USD, thesaurierend	2,04	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	2,04	
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	2,04	
Klasse F USD, thesaurierend	0,85	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,83	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,85	
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,85	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,58	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,59	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,59	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	0,45	
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,44	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,39	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,39	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,89	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,89	
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,19	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,19	
Klasse C USD, thesaurierend	1,69	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	1,69	
Klasse F USD, thesaurierend	1,11	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,00	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (A)	1,00	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (A)	1,50	
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,36	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,36	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,36	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,36	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,36	
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	1,36	
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,36	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,36	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,36	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,36	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,36	
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	1,36	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,36	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	1,36	
Klasse B USD, thesaurierend	1,61	
Klasse C USD, thesaurierend	1,86	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,86	
Klasse E USD, thesaurierend	1,96	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,96	
Klasse F USD, thesaurierend	0,96	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,96	
Klasse X USD, ausschüttend (M)	0,86	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,71	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,71	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,71	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,71	
Klasse Premier EUR ausschüttend (M)	0,71	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M)	0,71	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,12	
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,11	
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,10	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,10	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,10	
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse A SEK ausschüttend (M) (abgesichert)	0,91	
Klasse C USD, thesaurierend	1,60	
Klasse C USD, ausschüttend (M)	1,61	
Klasse E USD, thesaurierend	1,70	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,71	
Klasse F USD, thesaurierend	0,70	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,71	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,65	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,46	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,45	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,45	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,47	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,45	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,35	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,36	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,35	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,35	
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,11	
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]		
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,20	
Klasse X USD thesaurierend	0,76	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,52	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,52	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,55	
Klasse Premier NZD thesaurierend (abgesichert)	0,52	
Klasse S USD, thesaurierend	0,45	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,44	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,12	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,12	
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	0,12	
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,21	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,22	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,15	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,15	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022**
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,76	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,76	
Klasse A USD, ausschüttend (S)	1,76	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,76	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,76	
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	1,76	
Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)	1,76	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,76	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,76	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,76	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,76	
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,76	
Klasse A GBP, thesaurierend	1,76	
Klasse A GBP thesaurierend (abgesichert)	1,75	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,76	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,75	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,78	
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,75	
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	1,76	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,76	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,77	
Klasse B USD, thesaurierend	2,00	
Klasse C USD, thesaurierend	2,26	
Klasse C USD, ausschüttend (S)	2,26	
Klasse A JPY, ausschüttend (M) Plus (e)	1,76	
Klasse A NOK thesaurierend (abgesichert)	1,76	
Klasse E USD, thesaurierend	2,36	
Klasse E USD, ausschüttend (S)	2,36	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,36	
Klasse F USD, thesaurierend	1,36	
Klasse F USD, ausschüttend (S)	1,36	
Klasse X USD thesaurierend	1,26	
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,26	
Klasse X USD, ausschüttend (S)	1,26	
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,26	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,26	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,26	
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,26	
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,26	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,26	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,26	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,26	
Klasse X SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,26	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,11	
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	1,11	
Klasse Premier AUD thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	1,11	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,10	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,10	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	1,10	
Klasse Premier JPY thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)	1,10	
Klasse S USD, thesaurierend	0,71	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,71	
Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	0,11	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,11	
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,51	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,51	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,51	
Klasse C USD, thesaurierend	2,05	
Klasse X CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,89	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	0,71	
Klasse S USD, thesaurierend	0,52	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,51	
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,52	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,12	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,11	
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	0,14	
Klasse S CHF ausschüttend (A)	0,53	
Klasse S CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,56	
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
Klasse D EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,46	
Klasse D EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,46	
Klasse D USD, thesaurierend	1,46	
Klasse D USD, ausschüttend (M)	1,46	
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	1,46	
Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)	0,85	
Klasse M GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,86	
Klasse F USD, thesaurierend	1,31	
Klasse M USD, thesaurierend	0,86	
Klasse M USD, ausschüttend (M)	0,86	
Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,71	
Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)	0,71	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,70	
Klasse Premier EUR ausschüttend (Q) (abgesichert)	0,70	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	0,70	
Klasse Premier JPY thesaurierend (abgesichert)	0,71	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11	
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,23	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,40	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,40	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10	
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]		
Klasse A GBP, thesaurierend	1,10	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,52	
Klasse LM GBP, ausschüttend (M)	0,14	
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,07	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,42	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,42	
Klasse S USD, thesaurierend	0,35	
Klasse LM GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,13	
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]		
Klasse LM USD, ausschüttend (Q)	-	
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,16	
Klasse F USD, thesaurierend	0,74	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,50	
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse S USD, thesaurierend	0,40	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,40	
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,36	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,36	
Klasse A USD, ausschüttend (S)	1,36	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,36	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,36	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	1,36	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,36	
Klasse A EUR, ausschüttend (S)	1,36	
Klasse A EUR, 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, thesaurierend	1,36	
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 EUR, 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 EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,86	
Klasse X EUR, 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	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,71	
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	0,71	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,71	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,71	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,71	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,70	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,71	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,71	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11	
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,11	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022**
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,60	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,60	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,60	
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	0,10	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,62	
Klasse C USD, thesaurierend	2,10	
Klasse E USD, thesaurierend	2,20	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,20	
Klasse F USD, thesaurierend	1,20	
Klasse X USD thesaurierend	1,15	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,15	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,16	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,00	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	1,00	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,00	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,00	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,00	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10	
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,10	
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,40	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,40	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,75	
Klasse S CAD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,60	
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,40	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,41	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,45	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,40	
Klasse C USD, thesaurierend	1,90	
Klasse E USD, thesaurierend	2,00	
Klasse F USD, thesaurierend	1,00	
Klasse F USD, ausschüttend (M)	1,01	
Klasse X USD thesaurierend	0,91	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,90	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	0,91	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	0,75	
Premier Klasse NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,76	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,10	
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,10	
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,34	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,34	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,34	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,35	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,34	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,35	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35	
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,35	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,40	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,35	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,35	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,35	
Klasse A GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,35	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,35	
Klasse A HKD, thesaurierend	1,35	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,35	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,35	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,35	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	1,35	
Klasse C USD, thesaurierend	1,84	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,85	
Klasse A CZK thesaurierend (abgesichert)	1,34	
Klasse E USD, thesaurierend	1,95	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,94	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,95	
Klasse F USD, thesaurierend	0,89	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,89	
Klasse X USD thesaurierend	0,80	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,79	
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,80	
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)	0,80	
Klasse X CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,79	
Klasse X EUR, thesaurierend	0,79	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,80	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,80	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,80	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,64	
Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,64	
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	0,65	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,64	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,65	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus (e)	0,64	
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)	0,64	
Klasse S USD, thesaurierend	0,45	
Klasse S USD, ausschüttend (Q) Plus (e)	0,44	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,44	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,45	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,44	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,10	
LM Klasse EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	0,10	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,09	
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,95	
Klasse X USD, ausschüttend (M)	1,45	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,30	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,15	
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,35	
Klasse S EUR, ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)	0,55	
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	2,30	
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	2,30	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,45	
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,15	
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,70	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,75	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,50	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022**		Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022**
Legg Mason ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,80	Klasse A USD thesaurierend	1,74
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,80	Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,74
Klasse A EUR, thesaurierend	1,80	Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,80	Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	1,79	Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse A SGD, thesaurierend	1,80	Klasse A EUR, thesaurierend	1,74
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	1,80	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse C USD, thesaurierend	2,30	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,74
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,30	Klasse A GBP, thesaurierend	1,74
Klasse E USD, thesaurierend	2,55	Klasse A HKD, thesaurierend	1,74
Klasse F USD, thesaurierend	1,20	Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,20	Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	1,74
Klasse X USD thesaurierend	1,12	Klasse B USD, thesaurierend	2,24
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,12	Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,24
Klasse X EUR, thesaurierend	1,12	Klasse C USD, thesaurierend	2,24
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,77	Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,24
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,77	Klasse E USD, thesaurierend	2,49
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,77	Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,49
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,77	Klasse E EUR thesaurierend	2,49
LM Klasse USD, ausschüttend (A)	0,10	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,49
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund		Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]	
Klasse A USD thesaurierend	1,72	Klasse A USD thesaurierend	1,65
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,72	Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,64
Klasse A EUR, thesaurierend	1,72	Klasse A EUR, thesaurierend	1,70
Klasse B USD, thesaurierend	2,21	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,65
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,22	Klasse A SEK, thesaurierend	1,50
Klasse C USD, thesaurierend	2,22	Klasse F USD, thesaurierend	1,05
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,22	Klasse X USD thesaurierend	1,05
Klasse E USD, thesaurierend	2,47	Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,05
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,47	Klasse X EUR, thesaurierend	1,05
Klasse F USD, thesaurierend	1,12	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,05
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,12	Klasse X GBP, thesaurierend	1,08
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,09	Klasse Premier USD, thesaurierend	0,73
Klasse X EUR, thesaurierend	1,09	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,73
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,74	Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	0,73
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,74	Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,73
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,74	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,73
Klasse LM USD, thesaurierend	0,12	Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,73
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,12	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,73
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,37	Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,73
Klasse B (G) USD, thesaurierend	2,35	Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,73
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,87	Klasse LM USD, thesaurierend	0,10
Klasse GA USD, thesaurierend	1,54	Klasse LM EUR, thesaurierend	0,10
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,54	Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,35
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,54	Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,85
Klasse GE USD, thesaurierend	2,29	Klasse GA USD, thesaurierend	1,52
Klasse GE EUR, thesaurierend	2,29	Klasse GA EUR, thesaurierend	1,52
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund		Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	
Klasse A USD thesaurierend	1,70	Klasse A USD thesaurierend	1,75
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,70	Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,75
Klasse A EUR, thesaurierend	1,70	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,75
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,70	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,75
Klasse B USD, thesaurierend	2,20	Klasse A USD, ausschüttend (Q)	1,75
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,20	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,75
Klasse C USD, thesaurierend	2,20	Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,75
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,20	Klasse A EUR, thesaurierend	1,75
Klasse E USD, thesaurierend	2,45	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,75
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,45	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,75
Klasse F USD, thesaurierend	1,10	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,75
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,10	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,75
Klasse U USD, thesaurierend	0,63	Klasse C USD, thesaurierend	2,25
Klasse U EUR, thesaurierend	0,63	Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,25
Klasse X USD thesaurierend	1,08	Klasse C USD, ausschüttend (Q)	2,25
Klasse X EUR, thesaurierend	1,07	Klasse F USD, thesaurierend	1,15
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,08	Klasse F EUR, thesaurierend	1,15
Klasse X GBP, thesaurierend	1,08	Klasse F EUR, ausschüttend (A)	1,15
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,73	Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,13
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,73	Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]	
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	0,73	Klasse A USD thesaurierend	1,65
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,73	Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,64
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,73	Klasse A EUR, thesaurierend	1,70
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,73	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,65
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,73	Klasse A SEK, thesaurierend	1,50
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10	Klasse F USD, thesaurierend	1,05
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,10	Klasse X USD thesaurierend	1,05
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,35	Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,05
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,85	Klasse X EUR, thesaurierend	1,05
Klasse GA USD, thesaurierend	1,52	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,05
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,52	Klasse X GBP, thesaurierend	1,05
		Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,04
		Klasse Premier USD, thesaurierend	0,69
		Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,70
		Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,75
		Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,70
		Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,70
		Klasse S USD, thesaurierend	0,50
		Klasse S EUR, thesaurierend	0,50
		Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,49
		Klasse S GBP, thesaurierend	0,49
		Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,49
		Klasse S GBP, ausschüttend (Q)	0,49
		Klasse LM EUR, thesaurierend	0,10

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022**		Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022**
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund[^]			
Klasse A USD thesaurierend	1,80		
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,80		
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]			
Klasse A USD thesaurierend	1,95		
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	1,94		
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,94		
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	1,95		
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,95		
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,94		
Klasse A EUR, thesaurierend	1,95		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	1,95		
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,95		
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	1,94		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,95		
Klasse C USD, thesaurierend	2,45		
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)	2,44		
Klasse E USD, thesaurierend	2,70		
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	2,69		
Klasse F USD, thesaurierend	1,35		
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)	1,34		
Klasse X USD thesaurierend	1,04		
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,05		
Klasse X EUR, thesaurierend	1,05		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	1,05		
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	1,05		
Klasse X GBP ausschüttend (Q) (abgesichert)	1,04		
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,85		
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	0,85		
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	0,85		
Premier Klasse CAD, ausschüttend (Q) Plus (e)	0,85		
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,85		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	0,85		
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,85		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	0,85		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)	0,85		
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]			
Klasse A USD thesaurierend	2,15		
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	2,15		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,35		
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	1,35		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,15		
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^]			
Klasse A USD thesaurierend	1,96		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,95		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,96		
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,96		
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,95		
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus (e)	2,00		
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,96		
Klasse A GBP ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,95		
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,96		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,95		
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,20		
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,19		
Klasse X EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	1,21		
Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	1,20		
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,85		
Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus	0,84		
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,85		
Klasse S USD, thesaurierend	0,49		
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	0,50		
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund			
Klasse A USD thesaurierend	1,96		
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,96		
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,96		
Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)	1,96		
Klasse A EUR, thesaurierend	1,97		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,96		
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,97		
Klasse A GBP thesaurierend (abgesichert)	1,97		
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	1,96		
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,97		
Klasse A SGD, thesaurierend	1,97		
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	1,97		
Klasse B USD, thesaurierend	2,46		
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,47		
Klasse C USD, thesaurierend	2,47		
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,47		
Klasse E USD, thesaurierend	2,72		
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,72		
Klasse E EUR thesaurierend	2,71		
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,71		
Klasse F USD, thesaurierend	1,36		
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,36		
Klasse R USD, thesaurierend	1,38		
Klasse R EUR, thesaurierend	1,46		
Klasse X USD thesaurierend	1,21		
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,21		
Klasse X EUR, thesaurierend	1,21		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,21		
Klasse X GBP, thesaurierend	1,21		
Klasse X GBP, ausschüttend (A)	1,21		
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,86		
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	0,86		
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,87		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,87		
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,86		
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,86		
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund			
Klasse A USD thesaurierend	1,99		
Klasse A USD, ausschüttend (A)	2,00		
Klasse A EUR, thesaurierend	2,00		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,00		
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	2,00		
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	2,00		
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	2,00		
Klasse C USD, thesaurierend	2,49		
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,50		
Klasse E USD, thesaurierend	2,75		
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,75		
Klasse E EUR thesaurierend	2,75		
Klasse F USD, thesaurierend	1,40		
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,41		
Klasse R USD, thesaurierend	1,50		
Klasse X USD thesaurierend	1,25		
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,24		
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,90		
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,90		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	0,90		
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,15		
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,40		
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,90		
Royce Global Small Cap Premier Fund[^]			
Klasse A USD thesaurierend	1,88		
Klasse X USD thesaurierend	1,15		
Klasse X GBP, thesaurierend	1,25		
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,90		
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund			
Klasse A USD thesaurierend	1,84		
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,84		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,84		
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,84		
Klasse A CNH ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,84		
Klasse A EUR, thesaurierend	1,84		
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	2,67		
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,70		
Klasse F USD, thesaurierend	1,34		
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,85		
Klasse GA USD, thesaurierend	1,86		
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,86		
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,82		
Klasse GE USD, thesaurierend	2,61		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2022**
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,99	
Klasse M GBP, ausschüttend (A)	1,20	
Klasse F USD, thesaurierend	1,40	
Klasse M USD ausschüttend (A)	1,20	
Klasse M EUR, ausschüttend (A)	1,20	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,79	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,79	
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	1,97	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,97	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse C USD, thesaurierend	2,47	
Klasse E USD, thesaurierend	2,72	
Klasse F USD, thesaurierend	1,37	
Klasse X USD thesaurierend	1,22	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,22	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,22	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,22	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,87	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse S USD, thesaurierend	0,52	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,52	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,52	
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	2,00	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) Plus	2,00	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus (e)	2,00	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	2,00	
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,60	
Klasse D CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,60	
Klasse D HKD, ausschüttend (M) Plus	1,60	
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,60	
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	1,60	
Klasse D USD, thesaurierend	1,60	
Klasse X AUD, thesaurierend	1,25	
Klasse X USD thesaurierend	1,25	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,59	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)	0,59	
Klasse LM AUD, thesaurierend	0,15	
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend	2,00	
Klasse E USD, thesaurierend	2,75	
Klasse F USD, thesaurierend	1,40	
Klasse X USD thesaurierend	1,25	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,89	
Klasse S USD, thesaurierend	0,69	
Klasse S EUR, thesaurierend	0,69	
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	1,95	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,95	
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	2,69	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,20	
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	0,85	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,84	
Klasse S USD, thesaurierend	0,48	
Klasse S EUR, thesaurierend	0,45	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,45	

Die Berechnungsmethode für die Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) ist auf der Website der Asset Management Association Switzerland (AMAS, früher Swiss Funds & Asset Management Association, SFAMA) (www.am-switzerland.ch) beschrieben.

(1) WE = Währungseinheiten in der Rechnungslegungswährung des Fonds.

** Für Zeiträume unter einem Jahr auf das Jahr hochgerechnet.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands

Für den Zeitraum zum 31. August 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 Anteilhaber die Veränderungen in den Anlagen der einzelnen Fonds erkennen können. Diese bestehen aus den Gesamtankäufen und -verkäufen einer Investition (einschließlich der Fälligkeiten und ausschließlich der Rückkaufvereinbarungen, Diskontanleihen und Termingeldanlagen, die von einem Tag auf den anderen getätigt werden und die hauptsächlich dazu dienen, die Portfolios effizient zu verwalten), die 1,00 % des Gesamtwertes der Ankäufe und Verkäufe für den Berichtszeitraum übersteigen. Es werden mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe aufgeführt. Hat ein Fonds während des Berichtszeitraums weniger als zwanzig Käufe oder Verkäufe getätigt, sind alle Transaktionen aufgeführt.

Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 29.03.2022	63.690	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 29.03.2022	73.692
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 11.05.2022	52.219	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 22.03.2022	71.558
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 22.03.2022	51.557	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 15.03.2022	66.337
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 15.03.2022	51.337	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 11.05.2022	52.223
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 04.08.2022	49.997	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 17.03.2022	50.250
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 18.03.2022	47.232	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 04.08.2022	50.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 15.06.2022	44.220	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 03.10.2022	50.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 25.03.2022	42.723	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 18.03.2022	47.232
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 04.12.2022	40.700	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 31.03.2022	45.876
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 29.04.2022	37.364	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 15.06.2022	44.223
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 17.03.2022	35.250	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 25.03.2022	42.723
Federal Home Loan Banks FRN, 0,309 %, fällig 26.07.2022	35.001	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 04.12.2022	40.702
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 23.06.2022	34.978	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,050 %, fällig 09.06.2022	40.000
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 1,107 %, fällig 31.07.2022	33.903	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 29.04.2022	37.368
United States Treasury Bill, 2,375 %, fällig 15.03.2022	32.901	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 24.03.2022	36.730
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 31.03.2022	30.876	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 16.03.2022	35.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 02.03.2022	30.856	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 26.07.2022	35.000
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,064 %, fällig 31.01.2023	30.046	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 23.06.2022	35.000
Federal Home Loan Banks, Serie 0000, 2,295 %, fällig 15.09.2022	30.000	United States Treasury Bill, 2,591 %, fällig 31.07.2022	33.887
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 08.03.2022	29.234	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.03.2022	32.886
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 23.08.2022	28.703	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 02.03.2022	30.856
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 10.06.2022	28.439	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 03.01.2022	30.230
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 05.04.2022	28.248	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 08.03.2022	29.234
Federal Farm Credit Banks, 0,626 %, fällig 18.04.2022	27.806	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 23.08.2022	28.748
		Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 10.06.2022	28.439
		Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 05.04.2022	28.248
		Federal Farm Credit Banks, 0,932 %, fällig 18.04.2022	27.800

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, Klasse WA (ausschüttend)	41.187	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	39.740
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.134	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15.05.2050	7.565
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	4.194	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.039
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.925	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.01.2027	4.315
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	3.786	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	4.176
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.720	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.903
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	3.304	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	3.855
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.504	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.668
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.476	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	3.210
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.309	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	3.114
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	2.249	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.661
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.198	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.495
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	2.140	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.04.2028	2.473
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.970	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.449
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.914	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.299
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.804	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.192
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.754	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.918
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.689	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.803
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.669	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	1.764
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 30.04.2029	1.657	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.749
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	1.646		
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.630		
United States Treasury Note/Bond, 3,2505 %, fällig 30.06.2029	1.567		
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.545		
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.530		

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	33.654	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.05.2026	55.871
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	28.406	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	33.048
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	26.360	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.01.2027	32.837
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	25.096	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	28.302
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	25.037	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	24.932
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	24.082	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	24.753
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	24.043	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	23.847
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 31.05.2029	22.821	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	23.373
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	18.679	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	22.792
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	17.929	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	22.235
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	17.592	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	18.440
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	15.692	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	17.870
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	15.518	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	17.502

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund – (Fortsetzung)

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	14.470	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	16.992
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	14.855	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.06.2028	16.757
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	14.794	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	15.714
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	14.183	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	15.430
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	12.099	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	14.834
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2026	11.612	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	14.709
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 30.04.2029	11.406	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	14.505
United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 30.06.2029	11.279	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	14.158
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	10.731	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	13.415
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	10.510	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 31.10.2026	12.825
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	10.352	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	12.057
		United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2026	11.561
		United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15.08.2031	11.467
		United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 30.06.2029	11.443
		United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.09.2028	11.343
		United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 30.04.2029	11.230

Legg Mason Western Asset EUR Core Plus Bond Fund

	KOSTEN (in Tsd.) EUR		ERLÖSE (in Tsd.) EUR
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	10.438	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	5.915
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	5.421	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30.04.2025	4.286
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032	4.447	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2027	3.971
Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	1.684	Bundesobligation, Serie 177, 0,000 %, fällig am 14.04.2023	3.256
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, 15.05.2040	1.322	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4,500 %, fällig 01.03.2024	3.187
BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig 30.05.2028	1.251	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31.01.2026	1.914
Bank of Montreal, 2,750 %, fällig am 15.06.2027	1.249	Spain Government Bond, 0,450 %, fällig 31.10.2022	1.353
Banco Santander SA, 2,500 %, fällig 18.03.2025	1.092	Indonesia Government International Bond, 4,200 %, fällig 15.10.2050	1.302
Spain Government Bond, 144A, 1,400 %, fällig 30.04.2028	1.002	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, 15.05.2040	1.259
Norway Government Bond, Serie 484, 144A, 2,125 %, fällig 18.05.2032	887	Qatar Government International Bond, 4,817 %, fällig 14.03.2049	1.020
Credit Agricole SA, 1,875 %, fällig 22.04.2027	663	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,500 %, fällig 15.02.2023	1.010
French Republic Government Bond OAT, 3,250 %, fällig 25.05.2045	653	ABN AMRO Bank NV, 7,125 %, fällig 06.07.2022	850
Royal Bank of Canada, 3,625 %, fällig am 14.06.2027	635	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.02.2025	787
Norway Government Bond, Serie 482, 144A, 1,375 %, fällig 19.08.2030	613	Export-Import Bank of China/The, 0,300 %, fällig 06.03.2022	590
McDonald's Corp, 1,875 %, fällig 26.05.2027	583	Romanian Government International Bond, 2,000 %, fällig 14.04.2033	552
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,500 %, fällig 01.12.2032	521	KBC Group NV, 1,875 %, fällig 11.03.2027	500
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 144A, 3,250 %, fällig am 01.09.2046	507	Teva Pharmaceutical Finance Co BV, 2,950 %, fällig am 18.12.2022	358
Mexico Government International Bond, 2,875 %, fällig 08.04.2039	489	DNB Bank ASA, 1,250 %, fällig 01.03.2027	350
African Development Bank, 0,500 %, fällig 21.03.2029	426	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 6,250 %, fällig 26.05.2042	300
Logicor Financing Sarl, 1,625 %, fällig 15.07.2027	420	Leeds Building Society, 1,375 %, fällig 05.05.2022	270

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Par Pharmaceutical Inc, I, 7,500 %, fällig 04.01.2027	268	Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, fällig am 14.11.2024	371
Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2027	268	Ford Motor Co, 9,000 %, fällig 22.04.2025	364
Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig am 28.05.2027	220	EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15.05.2026	356
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig am 15.06.2027	210	Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15.11.2028	299
Ballyrock CLO 19 Ltd, Serie 2022 19A, Klasse D, 144A, 8,282 %, fällig 20.04.2035	196	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 01.07.2026	277
Canpack SA / Canpack US LLC, 144A, 3,125 %, fällig am 01.11.2025	187	Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2027	268
Holly Energy Partners LP / Holly Energy Finance Corp, 144A, 6,375 %, fällig am 15.04.2027	170	Par Pharmaceutical Inc, I, 7,500 %, fällig 04.01.2027	268
Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.11.2028	162	Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, fällig am 15.04.2026	259
GEO Group Inc/The, 144A, 9,500 %, fällig 31.12.2028	160	Comstock Resources Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.05.2025	255
Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029	152	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, fällig am 15.11.2025	254
Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig am 06.06.2025	151	Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, fällig am 01.04.2026	245
AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig am 15.02.2029	140	PetSmart Inc . PetSmart Finance Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2028	240
XPO Logistics Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.05.2025	124	Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig am 01.03.2028	225
Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,625 %, fällig am 15.08.2027	120	Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, fällig 10.08.2026	214
Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 15.09.2024	117	Targa Resources Partners LP . Targa Resources Partners Finance Corp, 6,500 %, fällig 15.07.2027	211
Blackstone Mortgage Trust Inc, 5,500 %, fällig am 15.03.2027	110	Univision Communications Inc, 144A, 9,500 %, fällig 01.05.2025	210
Nabors Industries Ltd, 144A, 7,250 %, fällig am 15.01.2026	104	Scientific Games International Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.03.2026	208
Service Properties Trust, 4,650 %, fällig am 15.03.2024	96	Sirius XM Radio Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.07.2028	200
GEO Group Inc.The, 10,500 %, fällig 30.06.2028	87	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, fällig am 15.10.2027	193
Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, fällig am 01.05.2029	69	Party City Holdings Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.02.2026	189
Earthstone Energy Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig am 15.04.2027	60	Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.08.2026	188
Thermostat Purchaser III Inc, 6,873 %, fällig 31.08.2028	47	iHeartCommunications Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	187
EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, fällig am 01.06.2027	40	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig am 01.06.2028	187
		Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig 09.05.2027	183
		iStar Inc, 4,250 %, fällig 01.08.2025	181
		Starwood Property Trust Inc, 144A, 3,750 %, fällig am 31.12.2024	181
		United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	178
		Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.01.2028	176
		Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig am 15.06.2025	168
		Scientific Games International Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.05.2028	167
		Endeavor Energy Resources LP . EER Finance Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2025	165

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund – (Fortsetzung)

	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
WICHTIGE VERKÄUFE	
Halozyme Therapeutics Inc, 0,250 %, fällig 01.03.2027	163
Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig am 15.01.2026	163
DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	162
GEO Group Inc./The, 6,000 %, fällig 15.04.2026	160
Photo Holdings Merger Sub Inc, 144A, 8,500 %, fällig am 01.10.2026	159
CHS.Community Health Systems Inc, 8,000 %, fällig 15.03.2026	156
American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 20.04.2026	156
Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Mitemittent, 144A, 5,875 %, fällig am 01.10.2028	149
Prime Security Services Borrower LLC . Prime Finance Inc, 5,750 %, fällig 15.04.2026	143
Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig am 15.01.2028	141
Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, fällig am 15.10.2026	133
AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 10,000 %, fällig am 15.06.2026	130
Carnival Corp, 3,750 %, fällig 30.06.2025	129
Apache Corp, 4,875 %, fällig 15.11.2027	127
Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, fällig am 15.08.2026	123
GEO Group Inc./The, 5,875 %, fällig 15.10.2024	119
Bath & Body Works Inc, 5,250 %, fällig am 01.02.2028	118
Kraton Polymers LLC . Kraton Polymers Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.12.2025	114

Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Russian Federal Bond – OFZ, 7,250 %, fällig 10.05.2034	5.292	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund – LM Klasse Euro (thesaurierend)	9.302
Russian Federal Bond – OFZ, 7,050 %, fällig 19.01.2028	4.856	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Klasse US\$ ausschüttend (M)	6.388
United States Treasury Bill, 2,875 %, fällig 15.05.2032	3.523	China Government Bond, 4,290 %, fällig 22.05.2029	6.202
Poland Government Bond 1,750 %, fällig 25.04.2032	3.344	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6225, 7,250 %, fällig 10.05.2034	5.292
Russian Federal Bond – OFZ, 6,900 %, fällig 23.05.2029	1.584	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028	4.856
ING Groep NV, 5,000 %, fällig 30.08.2026	1.298	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, fällig 01.01.2023	2.682
Credit Suisse Group AG, 6,373 %, fällig 15.07.2026	1.280	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C01, Klasse 1M2, 3,737 %, fällig 25.07.2029	2.091
Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027	1.206	FirstEnergy Corp, Serie C, 7,375 %, fällig 15.11.2031	1.928
Deutsche Bank AG, 4,000 %, fällig 24.06.2026	1.119	Ultrapar International SA, 144A, 5,250 %, fällig 06.10.2026	1.745
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden A, 2,624 %, fortwährend	904	China Government Bond, 3,950 %, fällig 29.06.2043	1.699
Ford Motor Credit Co LLC, 2,748 %, fällig 14.06.2024	885	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	1.584
NatWest Group Plc, 3,619 %, fällig 29.03.2029	875	Scientific Games International Inc, 2,959 %, fällig 14.08.2024	1.407
Goldman Sachs Group Inc./The, 3,625 %, fällig 29.10.2029	766	Banco Mercantil del Norte SA.Grand Cayman, 6,875 %, fortwährend	1.310
Cooperatieve Rabobank UA, 3,250 %, fortwährend	712	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	1.278
American Express Co, 3,550 %, fortwährend	677	DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.07.2022	1.275
Intesa Sanpaolo SpA, 6,375 %, fortwährend	671	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	1.266
Wells Fargo & Co, 3,473 %, fällig 26.04.2028	663	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	1.204
888 Acquisitions Ltd, 7,558 %, fällig 15.07.2027	651	MPT Operating Partnership LP . MPT Finance Corp, 4,625 %, fällig 01.08.2029	1.198
Tesco Property Finance 5 Plc, 5,661 %, fällig 13.10.2041	651	Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	1.104
Carnival Corp, 10,500 %, fällig 01.06.2030	650	Syngenta Finance NV, 4,441 %, fällig 24.04.2023	1.066
Bank of America Corp, 3,584 %, fällig 27.04.2031	614	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig am 15.06.2025	870
APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, fällig 15.01.2027	545	China Government Bond, 2,500 %, fällig 27.09.2026	858
Credit Suisse Group AG, 9,750 %, fortwährend	440	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Klasse 1M2, 2,337 %, fällig 25.10.2030	732
Rentokil Initial Plc, 5,000 %, fällig am 27.06.2032	434	Brightview Landscapes LLC, 2,750 %, fällig 15.08.2025	704
Magallanes Inc, 5,141 %, fällig 15.03.2052	430	Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2023	659
Huhtamaki Oyj, 4,25 %, fällig am 09.06.2027	424		
Neinor Homes SA, 4,500 %, fällig am 15.10.2026	402		
Vmed O2 UK Financing I Plc, 4,500 %, fällig am 15.07.2031	392		

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	65.074	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	65.720
Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	1.734	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	2.017
Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2027	1.613	Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2029	1.504
NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	1.436	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01.04.2028	1.415
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig am 15.06.2027	1.398	Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, fällig am 01.06.2026	1.222
Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	1.275	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	1.213
Ford Motor Co, 6,100 %, fällig am 19.08.2032	1.270	Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, fällig am 01.10.2029	1.161
Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, fällig am 01.10.2029	1.141	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	1.145
Par Pharmaceutical Inc, 7,500 %, fällig 01.04.2027	1.117	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2027	1.129
GEO Group Inc./The, 144A, 9,500 %, fällig 31.12.2028	1.113	Par Pharmaceutical Inc, 7,500 %, fällig 01.04.2027	1.118
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 20.01.2026	1.081	Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2027	1.117
Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2030	1.080	GEO Group Inc./The, 6,000 %, fällig 15.04.2026	1.113
EQM Midstream Partners LP, 6,500 %, fällig am 15.07.2048	943	Whatabrands LLC, 3,750 %, fällig 21.07.2028	1.057
Ballyrock CLO 19 Ltd, Serie 2022 19A, Klasse D, 144A, 8,282 %, fällig 20.04.2035	892	AmWINS Group Inc, 144A, 4,875 %, fällig 30.06.2029	982
Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig am 01.10.2030	888	Sprint Corp, 7,625 %, fällig 15.02.2025	977
Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 6,250 %, fällig am 15.04.2032	884	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 20.01.2026	950
Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig am 15.06.2029	810	Ford Motor Co, 9,000 %, fällig 22.04.2025	934
		DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	932

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset US High Yield Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Directv Financing LLC . Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.08.2027	778	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	930
United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig am 15.01.2030	760	Kraft Heinz Foods Co, 5,500 %, fällig am 01.06.2020	888
Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	754		

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
International Finance Corp, 8,250 %, fällig 30.01.2023	434	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Klasse US\$ ausschüttend (M)	3.781
Nigeria Government Bond, 8,375 %, fällig 24.03.2029	300	Türk Telekomunikasyon AS, 4,875 %, fällig 19.06.2024	450
Asian Development Bank, 2,715 %, fällig 16.01.2023	299	Lukoil International Finance BV, 6,656 %, fällig 07.06.2022	430
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3, 5,838 %, fällig am 30.09.2027	226	Türkiye İhracat Kredi Bankası AS, 5,750 %, fällig 06.07.2026	342
International Finance Corp, 6,280 %, fällig 27.05.2024	219	Nigeria Government Bond, 8,375 %, fällig 24.03.2029	301
Asian Development Bank, 4,500 %, fällig 07.12.2023	215	VEON Holdings BV, 3,375 %, fällig 25.11.2027	294
Uruguay Government International Bond, 4,975 %, fällig 20.04.2055	211	Sagicor Financial Co Ltd, 5,300 %, fällig 13.05.2028	258
Abu Dhabi National Energy Co PJSC, 144A, 4,375 %, fällig am 23.04.2025	203	Itau Unibanco Holding SA.Cayman Island, 6,125 %, fortwährend	251
CDBL Funding 1, 4,250 %, fällig 02.12.2024	202	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig am 28.05.2045	223
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand, 5,375 %, fällig am 17.04.2025	201	BBVA Bancomer SA.Texas, 5,125 %, fällig 18.01.2033	220
Angolan Government International Bond, 8,250 %, fällig 09.05.2028	200	Angolan Government International Bond, 8,750 %, fällig 14.04.2032	200
Angolan Government International Bond, 8,750 %, fällig 14.04.2032	200	Consorcio Transmantaro SA, 5,200 %, fällig 11.04.2038	200
Consorcio Transmantaro SA, 5,200 %, fällig 11.04.2038	200	Morocco Government International Bond, 4,000 %, fällig 15.12.2050	199
Misc Capital Two Labuan Ltd, 3,625 %, fällig am 06.04.2025	200	Egypt Government International Bond, 7,625 %, fällig 29.05.2032	156
Banco Nacional de Comercio Exterior SNC/Kaimaninseln, 4,375 %, fällig am 14.10.2025	199	Dominican Republic International Bond, 5,500 %, fällig 22.02.2029	146
Korea Gas Corp, 3,875 %, fällig 13.07.2027	199	Ukraine Government International Bond, 7,750 %, fällig 01.09.2025	87
Korea Water Resources Corp, 3,500 %, fällig 27.04.2025	199	China Aoyuan Group Ltd, 7,950 %, fällig 19.02.2023	63
Southern Copper Corp, 3,875 %, fällig 23.04.2025	199	Shimao Group Holdings Ltd, 6,125 %, fällig 21.02.2024	54
Jordan Government International Bond, 7,750 %, fällig 15.01.2028	198	Logan Group Co Ltd, 6,500 %, fällig 16.07.2023	38
ICICI Bank Ltd/Dubai, 4,000 %, fällig 18.03.2026	197	Ivory Coast Government International Bond, 5,750 %, fällig 31.12.2032	22
SingTel Group Treasury Pte Ltd, 3,250 %, fällig am 30.06.2025	197		
Antofagasta Plc, 5,625 %, fällig 13.05.2032	196		
Freeport Indonesia PT, 4,763 %, fällig 14.04.2027	196		
NTPC Ltd, 4,500 %, fällig 19.03.2028	196		
Singapore Airlines Ltd, 3,000 %, fällig 20.07.2026	193		
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC, 3,650 %, fällig am 02.11.2029	192		
Export-Import Bank of India, 3,375 %, fällig am 05.08.2026	192		
Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, fällig am 30.04.2028	192		
Banco de Credito del Peru SA, 2,700 %, fällig am 11.01.2025	190		
Banco del Estado de Chile, 2,704 %, fällig am 09.01.2025	190		
Foxconn Far East Ltd, 3,000 %, fällig am 23.09.2026	190		
Indian Railway Finance Corp Ltd, 3,835 %, fällig am 13.12.2027	189		
Transportadora de Gas Internacional SA ESP, 5,550 %, fällig 01.11.2028	189		
CCBL Cayman 1 Corp Ltd, 1,990 %, fällig 21.07.2025	188		
CBQ Finance Ltd, 2,000 %, fällig 15.09.2025	188		
America Movil SAB de CV, 3,625 %, fällig 22.04.2029	187		
Empresa Nacional del Petroleo, 3,750 %, fällig 05.08.2026	187		
ST Engineering RHQ Ltd, 1,500 %, fällig 29.04.2025	187		
CDBL Funding 2, 2,000 %, fällig 04.03.2026	186		
Inventive Global Investments Ltd, 1,650 %, fällig am 03.09.2025	186		
Chinalco Capital Holdings Ltd, 2,125 %, fällig 03.06.2026	185		
Kallpa Generacion SA, 4,125 %, fällig 16.08.2027	185		
Kia Corp, 2,750 %, fällig 14.02.2027	184		
Transelect SA, 3,875 %, fällig 12.01.2029	183		
Braskem Netherlands Finance BV, 4,500 %, fällig 10.01.2028	182		
ICBCIL Finance Co Ltd, 1,750 %, fällig 02.08.2026	182		
QNB Finance Ltd, 1,375 %, fällig 26.01.2026	182		
Consorcio Transmantaro SA, 4,700 %, fällig 16.04.2034	181		
Korea South-East Power Co Ltd, 1,000 %, fällig am 03.02.2026	181		
TSMC Arizona Corp, 1,750 %, fällig 25.10.2026	181		
MDGH GMTN RSC Ltd, 2,875 %, fällig 21.05.2030	180		
Hyundai Assan Otomotiv Sanayi ve Ticaret AS, 1,625 %, fällig am 12.07.2026	179		
Hana Bank, 1,250 %, fällig 16.12.2026	178		
Vale Overseas Ltd, 3,750 %, fällig 08.07.2030	177		
Empresa Generadora de Electricidad Haina SA, 144A, 5,625 %, fällig am 08.11.2028	174		
GNL Quintero SA, 4,634 %, fällig 31.07.2029	171		
Brazilian Government International Bond, 3,875 %, fällig 12.06.2030	170		
Petronas Capital Ltd, 2,480 %, fällig 28.01.2032	170		
Engie Energia Chile SA, 3,400 %, fällig 28.01.2030	169		
Airport Authority, 1,625 %, fällig am 04.02.2031	168		
GC Treasury Center Co Ltd, 2,980 %, fällig 18.03.2031	168		
DP World Ltd/United Arab Emirates, 4,700 %, fällig 30.09.2049	166		
Indonesia Government International Bond, 1,850 %, fällig 12.03.2031	164		
Mexico Government International Bond, 2,659 %, fällig 24.05.2031	164		
Chile Government International Bond, 2,550 %, fällig 27.07.2033	163		
Alpek SAB de CV, 3,250 %, fällig 25.02.2031	162		
Pertamina Persero PT, 2,300 %, fällig 09.02.2031	161		
Banco Nacional de Panama, 2,500 %, fällig am 11.08.2030	160		
Costa Rica Government International Bond, 5,625 %, fällig 30.04.2043	157		
Comision Federal de Electricidad, 3,348 %, fällig 09.02.2031	156		

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

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

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Qatar Energy, 3,125 %, fällig 12.07.2041	156
Cemex SAB de CV, 3,875 %, fällig 11.07.2031	154
Paraguay Government International Bond, 2,739 %, fällig 29.01.2033	152
Fondo MIVIVIENDA SA, 4,625 %, fällig am 12.04.2027	149
Republic of South Africa Government International Bond, 5,375 %, fällig 24.07.2044	146

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, fällig 12.11.2023	343	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig 31.01.2025	724
Angolan Government International Bond, 8,750 %, fällig 14.04.2032	200	Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, fällig 12.11.2023	535
Consorcio Transmataro SA, 5,200 %, fällig 11.04.2038	200	Liquid Telecommunications Financing Plc, 5,500 %, fällig 04.09.2026	436
Nigeria Government International Bond, 8,375 %, fällig 24.03.2029	200	Bharti Airtel Ltd, 4,375 %, fällig 10.06.2025	398
		Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC, 4,600 %, fällig 02.11.2047	396
		Huarong Finance 2019 Co Ltd, 2,125 %, fällig 30.09.2023	385
		Banco General SA, 5,250 %, fortwährend	381
		First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 15.10.2027	376
		NBK Tier 1 Ltd, 3,625 %, fortwährend	374
		OCP SA, 5,125 %, fällig 23.06.2051	373
		Sagicor Financial Co Ltd, 5,300 %, fällig 13.05.2028	364
		Volcan Cia Minera SAA, 4,375 %, fällig 11.02.2026	362
		Shinhan Bank Co Ltd, 3,875 %, fällig 24.03.2026	346
		B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 4,125 %, fällig am 20.09.2031	342
		Oleoducto Central SA, 4,000 %, fällig 14.07.2027	341
		Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 4,250 %, fällig 07.05.2029	340
		Sands China Ltd, 5,400 %, fällig am 08.08.2028	337
		ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig am 27.04.2026	331
		Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 10.11.2039	317
		Sasol Financing USA LLC, 4,375 %, fällig 18.09.2026	312
		Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig am 05.06.2115	307
		Itau Unibanco Holding SA.Cayman Island, 6,125 %, fortwährend	291
		Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, fällig am 30.04.2028	287
		Mizrahi Tefahot Bank Ltd, 144A, 3,077 %, fällig am 07.04.2031	265
		Fresnillo Plc, 4,250 %, fällig 02.10.2050	262

Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2025	1.463	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund – LM Klasse Euro (thesaurierend)	3.283
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.06.2025	1.225	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Klasse US\$ ausschüttend (M)	1.761
Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028	1.140	Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01.02.2029	1.484
Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, fortwährend	799	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2025	1.457
Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	799	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028	1.140
Service Properties Trust, 5,500 %, fällig am 15.12.2027	664	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.06.2025	991
Las Vegas Sands Corp, 3,900 %, fällig am 08.08.2029	646	EQT Corp, 3,900 %, fällig 01.10.2027	914
NCL Finance Ltd, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2028	643	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	799
United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 28.02.2026	571	United Airlines Inc, 4,500 %, fällig 14.04.2028	732
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01.06.2032	569	Indonesia Treasury Bond, Serie FR61, 7,000 %, fällig 15.05.2022	687
Yuzhou Group, 0,000 %, fällig 25.10.2023	550	Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2029	649
Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	548	United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 28.02.2026	557
CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2030	536	Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6,000 %, fällig 25.10.2023	550
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.08.2023	498	Turkey Government International Bond, 4,250 %, fällig 14.04.2026	502
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 29.02.2024	487	Oman Government International Bond, 144A, 5,625 %, fällig 17.01.2028	493
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 28.02.2027	476	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 28.02.2027	477
Ukraine Government International Bond, 144A, 7,750 %, fällig 01.09.2028	457	Peruvian Government International Bond, 1,862 %, fällig 01.12.2032	470
American Airlines Inc.AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029	445	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	461
United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 30.04.2027	445	Mexico Government International Bond, 3,500 %, fällig 12.02.2034	460
Jordan Government International Bond, 144A, 7,750 %, fällig 15.01.2028	436	Ukraine Government International Bond, 144A, 7,750 %, fällig 01.09.2026	457
NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 15.12.2024	405	United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 30.04.2027	449
Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	396	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig am 15.01.2026	443
Ivory Coast Government International Bond, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2033	391	T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	439
Ecuador Government International Bond, 144A, Nullkupon, fällig am 31.07.2030	385	Kraft Heinz Foods Co, 144A, 7,125 %, fällig am 08.01.2039	405
Advanced Drainage Systems Inc, 6,375 %, 15.06.2030	384	American Airlines Inc.AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5,500 %, fällig 20.04.2028	401
Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, fällig am 01.10.2031	371	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	398
CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.11.2031	367	Advanced Drainage Systems Inc, 6,375 %, fällig 15.06.2030	381
H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig am 15.12.2028	358	DIRECTV Financing LLC, 7,372 %, fällig 22.07.2027	373
NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	355	Oasis Petroleum Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.06.2026	371
Angolan Government International Bond, 144A, 8,750 %, fällig 14.04.2032	330	Brazilian Government International Bond, 4,625 %, fällig 13.01.2028	352
Banco Mercantil del Norte SA.Grand Cayman, 144A, 6,625 %, fortwährend	326	Western Midstream Operating LP, 4,650 %, fällig 01.07.2026	351
Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	296	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01.04.2028	350
Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2029	285	United Airlines Inc, 6,250 %, fällig 25.06.2027	346
Royal Caribbean Cruises Ltd, 0,000 %, fällig 05.04.2022	284	TK Elevator Midco GmbH, 4,375 %, fällig 15.07.2027	338
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034	283	BBVA Bancomer SA.Texas, 144A, 5,125 %, fällig 18.01.2033	335
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig am 15.06.2027	280	Petroleos Mexicanos, 6,625 %, fällig 15.06.2035	334
Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, fortwährend	280		
Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig 01.06.2030	279		
DISH Network Corp, 2,375 %, fällig 15.03.2024	269		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

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, Klasse WA (ausschüttend)	7.119	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15.04.2023	11.606
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15.01.2027	2.539	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	9.945
Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 21, 0,100 %, fällig 10.03.2026	2.029	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15.01.2027	6.228
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Serie I.L, 0,500 %, fällig 15.04.2030	1.918	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Serie I.L, 0,500 %, fällig 15.04.2030	3.486
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31/05/2026	1.842	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 3,875 %, fällig 15.04.2029	3.333
United Kingdom Gilt, 0,250 %, fällig 31.07.2031	1.736	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15.01.2030	3.021
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Nullkupon, fällig 16.04.2027	1.432	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 3,100 %, fällig 15.09.2026	2.675
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 2,600 %, fällig 15.09.2023	1.376	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31/05/2026	2.577
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15.01.2030	1.249	French Republic Government Bond OAT, Serie OATe, 0,250 %, fällig 25.07.2024	2.486
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31.10.2028	1.176	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 22, 0,100 %, fällig 10.03.2027	2.250
France Government International Bond, Nullkupon, fällig 25.11.2030	1.026	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15.01.2026	2.074
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Nullkupon, fällig 15.02.2031	932	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15.07.2025	1.841
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15.04.2023	829	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Serie I.L, 0,100 %, fällig 15.04.2023	1.729
Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	726	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 21, 0,100 %, fällig 10.03.2026	1.648
French Republic Government Bond OAT, Serie OATe, 0,250 %, fällig 25.07.2024	599	French Republic Government Bond OAT, Serie OATe, 1,850 %, fällig am 25.07.2027	1.587
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375 %, fällig 15.02.2044	550	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Nullkupon, fällig 16.04.2027	1.431
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.07.2027	479	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500 %, fällig 15.01.2028	1.290
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 15.05.2040	403	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 23, 0,100 %, fällig 10.03.2028	1.225
Indonesia Treasury Bond, Serie FR79, 8,375 %, fällig 15.04.2039	343	United Kingdom Gilt, 0,250 %, fällig 31.07.2031	1.194
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15.07.2025	286	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31.10.2028	1.192
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 2,600 %, fällig 15.09.2023	1.068
		France Government International Bond, Nullkupon, fällig 25.11.2030	963
		Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Nullkupon, fällig 15.02.2031	921

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, Klasse WA (ausschüttend)	60.451	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	72.041
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 29.02.2024	14.857	Monetary Authority of Singapore Bill, Nullkupon, fällig 26.08.2022	13.856
Monetary Authority of Singapore Bill, Nullkupon, fällig 26.08.2022	14.069	China Development Bank, Serie 2103, 3,300 %, fällig 03.03.2026	12.876
Australia Government Bond, Serie 61, 0,250 %, fällig 21.11.2025	10.534	China Development Bank, Serie 2008, 2,890 %, fällig am 22.06.2025	6.351
BNP Paribas SA, 5,250 %, fällig 12.07.2032	7.162	NTPC Ltd, 7,250 %, fällig 03.05.2022	5.887
Macquarie Group Ltd, 4,500 %, fällig 18.08.2026	6.572	ABN AMRO Bank NV, 5,500 %, fällig 05.10.2032	5.884
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, Nullkupon, fällig 18.11.2022	6.241	National Highways Authority of India, 7,300 %, fällig am 18.05.2022	5.800
ABN AMRO Bank NV, 5,500 %, fällig 05.10.2032	5.765	Korea Treasury Bond, Serie 2912, 1,375 %, fällig am 12.10.2029	5.003
Freeport Indonesia PT, 4,763 %, fällig 14.04.2027	800	Indonesia Treasury Bond, Serie FR52, 10,500 %, fällig 15.08.2030	3.817
		BNP Paribas SA, 5,250 %, fällig 12.07.2032	3.577
		Indonesia Treasury Bond, Serie FR54, 9,500 %, fällig 15.07.2031	3.014
		Macquarie Group Ltd, 4,500 %, fällig 18.08.2026	2.214
		Credit Agricole SA, 3,800 %, fällig 30.04.2031	1.510
		Pelabuhan Indonesia II PT, 5,375 %, fällig 05.05.2045	859
		Indonesia Treasury Bond, Serie FR46, 9,500 %, fällig 15.07.2023	742

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, Klasse WA (ausschüttend)	121.522	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	101.464
UBS Group AG, 4,703 %, fällig 05.08.2027	4.430	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.11.2027	14.766
Lloyds Banking Group Plc, 3,125 %, fällig 24.08.2030	3.033	Bank of America Corp, 3,550 %, fällig am 05.03.2024	7.719
L'Oreal SA, 0,875 %, fällig 29.06.2026	2.644	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.05.2030	5.830
DNB Bank ASA, 4,000 %, fällig 17.08.2027	2.594	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.03.2026	5.125
Toronto-Dominion Bank/The, 2,875 %, fällig 05.04.2027	2.587	Bank of Nova Scotia/The, 1,375 %, fällig 05.12.2023	3.837
International Finance Facility for Immunization Co, 2,750 %, fällig am 07.06.2025	2.508	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 1,000 %, fällig am 11.02.2023	3.811
Linde Plc, 1,000 %, fällig 31.03.2027	2.302	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 15/02/2030	3.665
Sanofi, 1,250 %, fällig 06.04.2029	2.112	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0,875 %, fällig 18.09.2023	2.334
TenneT Holding BV, 1,625 %, fällig 17.11.2026	2.000	Nuveen LLC, 4,000 %, fällig 01.11.2028	2.217
PepsiCo Inc, 3,200 %, fällig 22.07.2029	1.495	Enel Finance Internationl NV, 0,000 %, fällig 17.06.2024	2.098
Segro Capital Sarl, 1,250 %, fällig 23.03.2026	1.474	BP Capital Markets Plc, 3,506 %, fällig 17.03.2025	2.057
Banco Santander SA, 5,294 %, fällig 18.08.2027	1.000	Abbott Laboratories, 3,750 %, fällig am 30.11.2026	1.927
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	988	European Investment Bank, 0,750 %, fällig 14.07.2023	1.905
Nidec Corp, 0,046 %, fällig 30.03.2026	319	Toyota Finance Australia Ltd, 1,584 %, fällig 21.04.2022	1.810
		Lloyds Bank Corporate Markets Plc, 1,500 %, fällig 23.06.2023	1.801
		Citigroup Inc, 3,300 %, fällig am 27.04.2025	1.478
		Medtronic Global Holdings SCA, 0,250 %, fällig 02.07.2025	1.422
		Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	1.402
		Royal Bank of Canada, 3,700 %, fällig 05.10.2023	1.316

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

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07.06.2032	9.010	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31/01/2026	18.053
United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.08.2025	8.257	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30/04/2025	13.699
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30.04.2025	4.447	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	8.826
Russia Governmnet International Bond, 6,900 %, fällig 23.05.2029	4.249	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	4.249
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	3.598	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.484

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^] – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.506	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	2.714
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	2.720	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	2.566
Australia Government Bond, Serie 157, 1,500 %, fällig 21.06.2031	2.235	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.08.2025	2.476
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	2.111	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	2.140
Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	1.957	Qatar Government International Bond, 4,817 %, fällig 14.03.2049	1.923
Australia Government Bond, Serie 139, 3,250 %, fällig 21.04.2025	1.927	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.902
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.889	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.764
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.785	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.748
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.713	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.732
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.710	Indonesia Government International Bond, 4,200 %, fällig 15.10.2050	1.643
Fannie Mae Pool, 2,500 %, fällig 01.02.2052	1.672	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 15.05.2040	1.597
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 15.05.2040	1.651	Fannie Mae Pool, 2,500 %, fällig 01.02.2052	1.539
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	1.609	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.08.2024	1.328
French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032	1.454	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.238
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	1.425	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.212
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.205	Fannie Mae UMBS Bond, 2,500 %, fällig 04.01.2052	1.083
Norway Government Bond, Serie 484, 144A, 2,125 %, fällig 18.05.2032	1.160	United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07.12.2040	1.054
Fannie Mae UMBS Bond, 2,500 %, fällig 04.01.2052	1.092		
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	1.042		
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.006		
Norway Government Bond, Serie 482, 144A, 1,375 %, fällig 19.08.2030	836		

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, Klasse WA (ausschüttend)	10.574	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	10.306
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	650	Anheuser-Busch InBev SA.NV, 3,700 %, fällig 02.04.2040	549
UBS Group AG, 4,703 %, fällig 05.08.2027	630	NatWest Group Plc, 2,500 %, fällig 22.03.2023	486
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Serie 2007, 4,250 %, fällig 04.07.2039	533	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	420
Suez SACA, 1,875 %, fällig 24.05.2027	416	Intesa Sanpaolo SpA, 1,000 %, fällig am 04.07.2024	418
Bank of America Corp, 2,676 %, fällig 19.06.2041	384	Annington Funding Plc, 1,650 %, fällig am 12.07.2024	410
Vestas Wind Systems Finance BV, 1,500 %, fällig am 15.06.2029	359	Marken & Spencer Plc, 3,750 %, fällig 19.05.2026	373
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig am 15.02.2029	327	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, fällig am 15.10.2026	372
SSE Plc, 4,000 %, fortwährend	292	Bank of America Corp, 3,550 %, fällig am 05.03.2024	343
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	258	Vestas Wind Systems Finance BV, 1,500 %, fällig am 15.06.2029	323
Credit Suisse Group AG, 9,750 %, fortwährend	250	Wells Fargo & Co, 2,250 %, fällig am 02.05.2023	281
Magallanes Inc, 144A, 5,141 %, fällig 15.03.2052	250	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, fällig am 15.10.2027	239
GSK Consumer Healthcare Capital NL BV, 1,750 %, fällig 29.03.2030	242	Equinix Inc, 1,000 %, fällig 15.03.2033	231
Intesa Sanpaolo SpA, 6,375 %, fortwährend	220	Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	226
Urenco Finance N.V, 3,250 %, fällig 13.06.2022	213	Lukoil International Finance BV, 4,750 %, fällig 02.11.2026	222
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2032	202	Urenco Finance N.V, 3,250 %, fällig 13.06.2022	215
Banco Santander SA, 5,294 %, fällig 18.08.2027	200	American International Group Inc, 1,500 %, fällig 08.06.2023	200
BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, fortwährend	200	ABN AMRO Bank NV, 7,125 %, fällig 06.07.2022	198
HSBC Holdings Plc, 5,210 %, fällig 11.08.2028	200	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 144A, 3,500 %, fällig 10.09.2051	185
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 6,875 %, fortwährend	200	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	171

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027	338	Telefonica Europe BV, 4,375 %, fortwährend	900
		Schenck Process Holding GmbH/Darmstadt, 5,375 %, fällig am 15.06.2023	665
		Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07.04.2026	659
		Petrobras Global Finance BV, 6,625 %, fällig 16.01.2034	640
		Summer BC Holdco B SARL, 5,750 %, fällig am 31.10.2026	624
		eircom Finance DAC, 2,625 %, fällig 15.02.2027	586
		Tendam Brands SAU, 5,000 %, fällig am 15.09.2024	581
		Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,125 %, fällig 15.10.2024	574
		Galaxy Bidco Ltd, 6,500 %, fällig am 31.07.2026	571
		Petroleos Mexicanos, 2,750 %, fällig 21.04.2027	550
		ASR Media and Sponsorship Spa, 5,125 %, fällig am 01.08.2024	544
		PCF GmbH, 4,750 %, fällig 15.04.2026	527
		Telefonica Europe BV, Serie NC5, 3,000 %, Unbefristet	503
		Victoria Plc, 3,625 %, fällig 24.08.2026	490
		Allied Universal Holdco LLC.Allied Universal Finance Corp.Atlas Luxco 4 Sarl, 4,875 %, fällig 01.06.2028	485
		Saga Plc, 5,500 %, fällig 15.07.2026	479
		Trivium Packaging Finance BV, 3,750 %, fällig am 15.08.2026	466
		Renk AG/Frankfurt am Main, 5,750 %, fällig am 15.07.2025	461
		United Group BV, 4,000 %, fällig 15.11.2027	455
		Energia Group NI FinanceCo Plc/Energia Group ROI Holdings DAC, 4,000 %, fällig am 15.09.2025	453
		Verisure Holding AB, 3,875 %, fällig 15.07.2026	450
		Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4,375 %, fällig 15.01.2028	437
		Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, fällig 15.07.2026	437
		Schoeller Packaging BV, 6,375 %, fällig 01.11.2024	429
		Altice France Holding SA, 8,000 %, fällig 15.05.2027	425
		Telecom Italia SpA.Milano, 3,625 %, fällig 25.05.2026	412

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] – (Fortsetzung)

	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
WICHTIGE VERKÄUFE	
RCS & RDS SA, 3,250 %, fällig 05.02.2028	412
Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, fällig am 18.09.2027	410
Vmed O2 UK Financing I Plc, 4,500 %, fällig am 15.07.2031	407
Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, fällig 30.09.2025	403
ZF Finance GmbH, 2,000 %, fällig 06.05.2027	393
Renault SA, 2,500 %, fällig 01.04.2028	388
Kapla Holding SAS, 3,375 %, fällig 15.12.2026	379
Marcolin SpA, 6,125 %, fällig 15.11.2026	374
International Game Technology Plc, 2,375 %, fällig am 15.04.2028	369
Pinewood Finance Co Ltd, 3,250 %, fällig 30.09.2025	350
Repsol International Finance BV, 4,500 %, fällig 25.03.2025	350
CT Investment GmbH, 5,500 %, fällig 15.04.2026	338
Brunello Bidco SpA, 3,750 %, fällig 15.02.2028	334
Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027	330
Ideal Standard International SA, 6,375 %, fällig am 30.07.2026	326
Marston's Issuer Plc, Serie B1, 3,049 %, fällig 16.07.2035	313
Goldstory SASU, 5,375 %, fällig am 01.03.2026	308
United Group BV, 5,250 %, fällig 01.02.2030	307

Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.019.103	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.019.103
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	433.569	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	349.149
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 28.02.2027	242.054	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 28.02.2027	237.301
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 19.01.2028	174.142	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	214.814
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 23.05.2029	121.932	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028	174.142
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	89.178	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	121.932
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 10.05.2034	82.074	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	89.273
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	74.960	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6225, 7,250 %, fällig 10.05.2034	82.074
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 03.02.2027	73.240	Indonesia Treasury Bond, Serie FR82, 7,000 %, fällig 15.09.2030	74.631
Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	68.219	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6207, 8,150 %, fällig 03.02.2027	73.240
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.02.2042	65.653	China Government Bond, Serie INBK, 3,390 %, fällig 16.03.2050	69.066
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	63.143	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	66.632
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 16.03.2039	54.137	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	62.172
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 30.04.2029	47.391	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	61.941
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	45.151	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6230, 7,700 %, fällig 16.03.2039	54.137
United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 30.06.2029	42.351	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.02.2042	53.689
United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 31.08.2029	42.077	Occidental Petroleum Corp, 0,000 %, fällig 10.10.2036	48.876
United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, fällig 31.07.2029	41.572	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 30.04.2029	47.265
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	27.149	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	45.063
Amazon.com Inc, 4,100 %, fällig 13.04.2062	26.469	Indonesia Treasury Bond, Serie FR78, 8,250 %, fällig 15.05.2029	44.775
		Indonesia Treasury Bond, Serie FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029	43.088

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

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 29.02.2024	11.350	United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 30.11.2023	21.046
Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028	6.122	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 29.02.2024	11.225
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 31.03.2024	5.782	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028	6.122
United States Treasury Note/Bond, 2,500 %, fällig 31.05.2024	2.073	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 31.03.2024	5.713
Royal Caribbean Cruises Ltd, 0,000 %, fällig 04.05.2022	1.560	Targa Resources Corp, Serie A	5.345
Southwestern Energy Co, 7,750 %, fällig 01.10.2027	1.470	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Klasse US\$ ausschüttend (M)	2.706
Ballyrock CLO 19 Ltd, 0,000 %, fällig am 20.04.2035	1.352	Indonesia Treasury Bond, Serie FR56, 8,375 %, fällig 15.09.2026	2.678
Par Pharmaceutical Inc, 7,500 %, fällig 01.04.2027	1.249	Carnival Corp, 144A, 9,875 %, fällig 01.08.2027	2.247
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd, 7,625 %, fällig am 15.10.2025	1.143	United States Treasury Note/Bond, 2,500 %, fällig 31.05.2024	2.076
T-Mobile USA Inc, 4,750 %, fällig 01.02.2028	1.038	Indonesia Government International Bond, 5,250 %, fällig 17.01.2042	1.694
Magallanes Inc, 3,755 %, fällig 15.03.2027	1.013	Royal Caribbean Cruises Ltd, 0,000 %, fällig 05.04.2022	1.560
Carnival Plc, 7,875 %, fällig 01.06.2027	1.012	Southwestern Energy Co, 7,750 %, fällig 01.10.2027	1.511
Carnival Corp, 10,500 %, fällig 01.06.2030	798	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	1.225
Jordan Government International Bond, 7,750 %, fällig 15.01.2028	753	HCA Inc, 5,625 %, fällig am 01.09.2028	1.093
Ziff Davis Inc, 4,625 %, fällig 15.10.2030	744	Granite Point Mortgage Trust Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 01.12.2022	1.024
Southwestern Energy Co, 8,375 %, fällig 15.09.2028	726	Ritchie Bros Holdings Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.12.2031	890
Polyconcept North America Holdings Inc, 0,000 %, fällig 05.12.2029	725	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig am 15.07.2026	859
Builders FirstSource Inc, 4,250 %, fällig 01.02.2032	719	Mexico Government International Bond, 2,659 %, fällig 24.05.2031	811
GEO Group Inc.The, 10,500 %, fällig 30.06.2028	719	Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000 %, fällig am 15.06.2029	805
JPMorgan Chase & Co, 4,323 %, fällig 26.04.2028	705	Abu Dhabi Government International Bond, 144A, 4,125 %, fällig 11.10.2047	781

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	324.776	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	341.696
CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse B6, 144A, 3,591 %, fällig 25.02.2048	16.893	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse B7, 144A, 5,117 %, fällig 25.02.2048	32.798
CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse B6, 144A, 3,586 %, fällig 25.02.2048	9.236	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse B7, 144A, 3,591 %, fällig 25.02.2048	12.035

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse B5, 144A, 3,586 %, fällig 25.02.2048	5.299	CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Klasse F, 144A, 4,541 %, fällig 15.07.2032	10.923
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2022-JERI, Serie 2022 JERI, Klasse G, 144A, 9,765 %, fällig 15.01.2039	2.912	BHMS 2018-MZB, Serie 2018 MZB, Klasse MZB, 144A, 9,028 %, fällig 15.07.2025	9.588
CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse AX1, 144A, 0,086 %, fällig 25.02.2048	1.319	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C05, Klasse 1M2C, 2,387 %, fällig 25.01.2030	8.657
Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Serie 2015 R4, Klasse 4A3, 144A, 7,800 %, fällig 27.01.2030	173	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Serie 2019 1A, Klasse A2II, 144A, 4,723 %, fällig am 05.06.2049	7.868
Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, Serie 2005 9XS, Klasse M2, 3,419 %, fällig 25.06.2035	69	Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Serie 2020 1A, Klasse D, 144A, 3,340 %, fällig am 20.08.2026	7.841
Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Serie 2006 1, Klasse M1, 2,999 %, fällig 25.04.2036	64	Radnor Re 2018-1 Ltd, Serie 2018 1, Klasse M2, 144A, 2,887 %, fällig 25.03.2028	7.659
BCAP LLC 2014-RR2, Serie 2014 RR2, Klasse 10A2, 144A, 2,679 %, fällig 26.07.2046	30	KeyCorp Student Loan Trust 2005-A, Serie 2005 A, Klasse 2C, 3,497 %, fällig 27.12.2038	7.569
Citigroup Mortgage Loan Trust Inc, Serie 2006 WFH2, Klasse M3, 2,909 %, fällig 25.08.2036	19	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse D, 144A, 4,544 %, fällig 15.08.2036	6.788
DSL A Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Klasse 2A1B, 2,546 %, fällig 19.04.2047	15	ZH Trust 2021-1, Serie 2021 1, Klasse B, 144A, 3,262 %, fällig 18.02.2027	6.540
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-5, Serie 2005 5, Klasse MV2, 3,186 %, fällig 25.11.2035	9	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Serie 2018 5, Klasse B3, 144A, 3,750 %, fällig 25.10.2048	6.536
Impac Secured Assets Corp Serie 2004-4, Serie 2004 4, Klasse M5, 1,837 %, fällig 25.02.2035	8	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3, Serie 2017 BNK3, Klasse E, 144A, 4,495 %, fällig 15.02.2050	6.467
FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Serie 2018 SB48, Klasse B, 144A, 3,812 %, fällig 25.02.2038	7	BBCMS Trust 2018-BXH, Serie 2018 BXH, Klasse C, 144A, 1,691 %, fällig 15.10.2037	6.453
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-2, Serie 2005 2, Klasse M2, 6,217 %, fällig 25.04.2035	6	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, Serie 2018 3PCK, Klasse B, 144A, 2,691 %, fällig 15.09.2031	6.240
Citigroup Mortgage Loan Trust 2008-3, Serie 2008 3, Klasse A3, 144A, 6,100 %, fällig 25.04.2037	5	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Serie 2020 R01, Klasse 1B1, 144A, 3,437 %, fällig 25.01.2040	5.955
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C06, Klasse 1B, 11,694 %, fällig 25.04.2029	3	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-2, Serie 2017 2, Klasse M1, 144A, 4,000 %, fällig 25.08.2056	5.638
Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Serie 2017 4, Klasse B, 144A, 0,000 %, fällig 25.06.2057	3	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR2 Trust, Serie 2005 AR2, Klasse B1, 0,982 %, fällig 25.01.2045	5.480
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR15 Trust, Serie 2005 AR15, Klasse A1C4, 3,244 %, fällig 25.11.2045	3	National Collegiate Student Loan Trust 2006-4, Serie 2006 4, Klasse A4, 0,497 %, fällig 25.05.2032	5.391

Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	300.241	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	285.344
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	76.311	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 05.03.2022	104.644
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	66.124	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	74.020
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	51.114	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	72.634
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	43.317	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	64.529
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	32.987	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	64.102
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	30.455	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	51.192
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	28.299	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	33.271
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	27.639	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	29.654
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	27.114	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	27.497
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	21.664	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	27.157
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	21.602	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	21.780
Freddie Mac Pool, 'SD1143', 4,500 %, fällig 01.09.2050	18.435	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	21.586
Freddie Mac Pool 'RA4142', 2,500 %, fällig am 12.01.2050	18.117	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	16.937
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	16.769	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	15.551
Ginnie Mae II Pool, 'MA8197', 2,500 %, fällig 20.08.2052	15.984	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig, 26.04.2022	15.296
Freddie Mac Pool, 'SD1218', 4,000 %, fällig 01.07.2049	15.857	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	14.192
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	15.556	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	14.188
Ginnie Mae II Pool, 'MA7590', 3,000 %, fällig 20.09.2051	15.048	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig, 16.06.2022	12.639
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	14.188	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	12.594

Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) £	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) £
DNB Bank ASA, 2,625 %, fällig 10.06.2026	539	United Kingdom Gilt, 2,750 %, fällig 07.09.2024	856
Bank of America Corp, 4,948 %, fällig 22.07.2028	536	Annington Funding Plc, 2,646 %, fällig 12.07.2025	585
Annington Funding Plc, 4,750 %, fällig 09.08.2033	520	BAE Systems Plc, 4,125 %, fällig 08.06.2022	444
DNB Bank ASA, 4,000 %, fällig 17.08.2027	480	Morgan Stanley, 2,625 %, fällig 09.03.2027	427
Bank of America Corp, 3,584 %, fällig 27.04.2031	460	Glencore Finance Europe Ltd, 6,000 %, fällig 03.04.2022	370
Toronto-Dominion Bank/The, 2,875 %, fällig 05.04.2027	439	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 6,000 %, fällig 07.12.2028	349
Morgan Stanley, 4,210 %, fällig 20.04.2028	423	FCE Bank Plc, 2,727 %, fällig 03.06.2022	319
Wells Fargo & Co, 3,473 %, fällig 26.04.2028	410	Wells Fargo & Co, 1,375 %, fällig 30.06.2022	310
Deutsche Bank AG, 4,000 %, fällig 24.06.2026	398	Cooperatieve Rabobank UA, Serie 2541, 4,000 %, fällig 19.09.2022	302
Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027	356	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2030	300
Netflix Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2029	356	Bank of America Corp, 1,667 %, fällig am 06.02.2029	297
Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, fällig 13.07.2044	341	HSBC Holdings Plc, 7,000 %, fällig 07.04.2038	293
Svenska Handelsbanken AB, 4,625 %, fällig 23.08.2032	340	HSBC Holdings Plc, 6,000 %, fällig 29.03.2040	278
British Telecommunications Plc, 3,125 %, fällig 21.11.2031	334	JPMorgan Chase & Co, 1,895 %, fällig 28.04.2033	261
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 4,875 %, fällig 29.04.2032	288	United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig 22.07.2027	245
JPMorgan Chase & Co, 4,912 %, fällig 25.07.2033	261	Bank of America Corp, 7,000 %, fällig 31.07.2028	239
United Kingdom Gilt, 4,750 %, fällig 07.12.2038	239	Nordea Bank Abp, 2,375 %, fällig 02.06.2022	220
PepsiCo Inc, 3,550 %, fällig 22.07.2034	229	HSBC Holdings Plc, 5,875 %, fortwährend	208
United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07.12.2040	229	Clydesdale Bank Plc, 4,625 %, fällig 08.06.2026	207
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co, 5,125 %, fällig 23.11.2052	228	Deutsche Telekom International Finance BV, 6,500 %, fällig 08.04.2022	200

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] - (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) £	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) £
PepsiCo Inc, 3,200 %, fällig 22.07.2029	210	Amgen Inc, 4,000 %, fällig 13.09.2029	147
GSK Consumer Healthcare Capital UK Plc, 3,375 %, fällig 29.03.2038	210	United Kingdom Gilt, 1,750 %, fällig 22.01.2049	107
United Kingdom Gilt, 1,500 %, fällig 22.07.2026	197		
McDonald's Corp, Serie gmtn, 3,750 %, fällig 31.05.2038	179		
Intesa Sanpaolo SpA, 2,625 %, fällig 11.03.2036	178		
Rentokil Initial Plc, 5,000 %, fällig am 27.06.2032	167		
Vonovia SE, 2,375 %, fällig 25.03.2032	166		
Crh Finance UK Plc, 4,125 %, fällig 02.12.2029	151		
NatWest Group Plc, 3,619 %, fällig 29.03.2029	150		
Yorkshire Building Society, 3,511 %, fällig 11.10.2030	140		
Northern Powergrid Northeast Plc, 3,250 %, fällig am 01.04.2052	109		

Legg Mason Western Asset US Corporate 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, Klasse WA (ausschüttend)	28.587	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	38.756
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	3.466	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	3.379
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2032	3.309	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	3.359
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	3.200	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	3.055
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	2.273	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2032	2.734
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	2.187	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.11.2031	2.378
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	1.956	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	2.350
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 28.02.2027	1.716	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 28.02.2027	1.699
United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 15.05.2042	1.628	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.01.2027	1.352
Danske Bank A.S, 144A, 4,298 %, fällig 01.04.2028	1.527	Societe Generale SA, 144A, 1,488 %, fällig am 14.12.2026	1.256
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 15.02.2025	1.266	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 15.02.2025	1.229
Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, fortwährend	1.110	Blackstone Mortgage Trust Inc, 4,375 %, fällig 05.05.2022	1.110
Magallanes Inc, 144A, 5,141 %, fällig 15.03.2052	1.110	United States Treasury Note/Bond, 0,875 %, fällig 31.01.2024	1.041
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.07.2027	1.109	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	903
Banco Santander SA, 4,175 %, fällig 24.03.2028	1.002	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.02.2042	855
Magallanes Inc, 144A, 5,050 %, fällig 15.03.2042	940	Celanece US Holdings LLC, 5,900 %, fällig 05.07.2024	803
Goldman Sachs Group Inc./The, 3,615 %, fällig 15.03.2028	940	Ford Motor Credit Co LLC, 3,350 %, fällig 01.11.2022	760
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 15.02.2042	864	Dermira Inc, 3,000 %, fällig 15.05.2022	630
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / Hawaiian Miles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 20.01.2026	859	General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032	587
DNB Bank ASA, 144A, 2,968 %, fällig 28.03.2025	850	Southwest Airlines Co, 4,750 %, fällig 04.05.2023	564

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

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	5.392	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	5.445
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	857	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	848
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	697	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	678
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	689	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	677
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	684	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	640
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	652	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	568
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	578	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	566
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	571	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	563
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	563	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	561
Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	561	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	507
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	510	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	502
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	453	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	435
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	387	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	394
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	369	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	389
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 30.04.2029	349	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	369
United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 30.06.2029	339	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 30.04.2029	348
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	292	United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 30.06.2029	344
Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, fällig am 20.09.2051	258	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31.05.2028	330
Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig am 28.05.2027	231	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31.10.2028	295
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	215	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	292
Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, fällig 06.01.2049	197	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.01.2028	283
Government National Mortgage Association, 2,500 %, fällig 20.05.2052	196	Fannie Mae Pool 'MA3057', 3,500 %, fällig 07.01.2047	250
		BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA, Serie 2018 BIOA, Klasse A, 144A, 0,862 %, fällig 15.03.2037	209

Western Asset Sustainable Global Corporate 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, Klasse WA (ausschüttend)	2.111	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.558
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	139	TSMC Arizona Corp, 3,250 %, fällig 25.10.2051	162
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	126	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2025	141
Iberdrola Finanzas SA, 1,375 %, fällig 11.03.2032	109	Marken & Spencer Plc, 3,750 %, fällig 19.05.2026	128
Segro Capital Sarl, 1,875 %, fällig am 23.03.2030	109	Anheuser-Busch InBev SA.NV, 3,700 %, fällig 02.04.2040	112
Vestas Wind Systems Finance BV, 1,500 %, fällig am 15.06.2029	109	Vestas Wind Systems Finance BV, 1,500 %, fällig am 15.06.2029	97
SSE Plc, 4,000 %, fortwährend	108	Equinix Inc, 1,000 %, fällig 15.03.2033	82
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Serie 2007, 4,250 %, fällig 04.07.2039	104	MPT Operating Partnership LP . MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig 15.03.2031	76
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.250 %, fällig am 15.02.2029	98	Intel Corp, 3,050 %, fällig 12.08.2051	75
		Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	44

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	86
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2032	61
Magallanes Inc, 144A, 5,141 %, fällig 15.03.2052	30
Magallanes Inc, 144A, 5,050 %, fällig 15.03.2042	20

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	58.089	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	58.617
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0,950 %, fällig 15.03.2023	14.116	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,064 %, fällig 31.01.2023	28.325
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	12.895	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	13.369
French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032	10.678	Republic of Poland Government Bond, Serie 1023, 4,000 %, fällig 25.10.2023	12.488
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	9.692	Australia Government Bond, Serie 128, 5,750 %, fällig 15.07.2022	11.341
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.01.2024	8.187	French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.11.2031	10.651
Sweden Government Bond, Serie 1057, 144A, 1,500 %, fällig 13.11.2023	7.810	Norway Government Bond, Serie 475, 144A, 2,000 %, fällig 24.05.2023	10.460
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	7.092	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.01.2024	8.171
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,046 %, fällig 30.04.2024	6.927	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0,950 %, fällig 15.03.2023	6.617
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,000 %, fällig 15.08.2023	6.690	New Zealand Government Bond, Serie 0423, 5,500 %, fällig 15.04.2023	6.482
Sweden Government Bond, Serie 1054, 144A, 3,500 %, fällig 01.06.2022	6.115	Sweden Government Bond, Serie 1054, 144A, 3,500 %, fällig 01.06.2022	5.721
Hungary Government Bond, Serie 22.B, 1,750 %, fällig 26.10.2022	5.855	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2052	4.010
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	4.606	International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig 22.01.2026	3.064
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	4.102	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,046 %, fällig 30.04.2024	1.738
French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, fällig 25.05.2052	4.025	Colombian TES, Serie B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	1.283
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2052	3.527	Mexican Bonos, Serie M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	1.193
Colombian TES, Serie B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	2.786	Korea Treasury Bond, Serie 4412, 2,750 %, fällig am 12.10.2044	1.129
Republic of Poland Government Bond, Serie 1023, 4,000 %, fällig 25.10.2023	1.906	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	922
Norway Government Bond, Serie 475, 144A, 2,000 %, fällig 24.05.2023	1.764	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	871
New Zealand Government Bond, Serie 0423, 5,500 %, fällig 15.04.2023	1.688	Malaysia Government Bond, Serie 0117, 3,882 %, fällig 10.03.2022	542

Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	408.058	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	381.178
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,837 %, fällig 04.30.2024	121.667	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	99.020
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,515 %, fällig 10.31.2023	97.391	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,064 %, fällig 31.07.2023	76.152
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 05.15.2052	54.470	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,064 %, fällig 31.01.2023	57.143
French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 05.25.2032	37.158	Korea Treasury Bond, Serie 3012, 1,500 %, fällig am 12.10.2030	53.218
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,687 %, fällig 07.31.2024	22.992	Egypt Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050	23.188
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,656 %, fällig 01.31.2024	22.892	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,490 %, fällig 01.31.2024	22.835
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 07.31.2053	22.183	Mexican Bonos, Serie M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	19.791
Peruvian Government International Bond, 6,150 %, fällig 08.12.2032	19.108	Indonesia Treasury Bond, Serie FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029	17.925
French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, fällig 05.25.2052	13.991	Bank of Montreal, 0,729 %, fällig 10.03.2023	17.155
Colombian TES, Serie B, 7,250 %, fällig 26.10.2050	12.724	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,430 %, fällig 04.30.2024	16.948
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2031	11.454	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	16.415
Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	5.901	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,849 %, fällig 17.03.2023	15.777
General Motors Financial Co Inc, 1,450 %, fällig 11.17.2023	2.781	Bank of Nova Scotia/The, 0,599 %, fällig 15.09.2023	15.737
Poland Government Bond, 1,750 %, fällig 04.25.2032	2.771	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 0,449 %, fällig 07.07.2025	15.522
		French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 05.25.2032	14.925
		Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	14.901

Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	2.212	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	2.137
MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	362	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	235
Cimpress Plc, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2026	289	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026	228
Wynn Las Vegas LLC . Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025	276	Petroleos Mexicanos, 5,350 %, fällig 12.02.2028	215
Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, fällig am 30.06.2030	267	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 15.10.2027	205
United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2029	259	Imperial Brands Finance Plc, 6,125 %, fällig 27.07.2027	201
LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2027	251	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.04.2025	188
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.10.2026	246	Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.08.2028	186
Affinity Gaming, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027	232	Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 17.01.2027	181
Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2030	229	Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, fällig 28.01.2028	179
Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2029	225	Alcoa Nederland Holding BV, 4,125 %, fällig 31.03.2029	179
FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375 %, fällig 01.04.2031	224	Avient Corp, 0,000 %, fällig 27.07.2029	179
ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2028	211	XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026	174
New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026	201	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 6,250 %, fällig am 15.05.2026	173
Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, fällig 27.07.2032	200	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	173
Imperial Brands Finance Plc, 6,125 %, fällig 27.07.2027	198	Aethon United BR LP . Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2026	166
Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.12.2031	193		

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

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

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144A, 4,875 %, fällig am 01.11.2027	192	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.07.2031	166
TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	191	Cleveland-Cliffs Inc, 5,875 %, fällig am 01.06.2027	164
Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.08.2028	183	Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc, 5,875 %, fällig am 15.10.2024	162
World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, fällig 01.11.2026	175	Civitas Resources, Inc., 5,000 %, fällig am 15.10.2026	158
Avient Corp, 0,000 %, fällig 27.07.2029	175	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig am 15.08.2027	153
IHS Holding Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 29.11.2028	165	Gol Finance SA, 144A, 8,000 %, fällig 30.06.2026	151
Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15.05.2025	162	Wynn Las Vegas LLC . Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025	147
Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2027	151	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	143
Civitas Resources, Inc., 5,000 %, fällig am 15.10.2026	151	MasTec, Inc., 4,500 %, fällig 15.08.2028	143
PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2029	150	Altice France Holding SA, 6,000 %, fällig 15.02.2028	142
New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2025	146	Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	134
Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.03.2029	146		
Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.01.2027	144		
ATS Automation Tooling Systems Inc, 144A, 4,125 %, fällig am 15.12.2028	144		
MasTec, Inc., 4,500 %, fällig 15.08.2028	142		

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 – Institutionelle Klasse	91.934	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	91.271
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,046 %, fällig 30.04.2024	25.371	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	19.135
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	19.309	Republic of Poland Government Bond, Serie 1023, 4,000 %, fällig 25.10.2023	18.543
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0,950 %, fällig 15.03.2023	16.054	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,046 %, fällig 30.04.2024	17.912
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	12.719	Australia Government Bond, Serie 128, 5,750 %, fällig 15.07.2022	14.727
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,656 %, fällig 01.31.2024	12.084	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,656 %, fällig 01.31.2024	12.064
French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032	11.054	Norway Government Bond, Serie 475, 144A, 2,000 %, fällig 24.05.2023	11.772
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	10.742	French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.11.2031	11.585
Sweden Government Bond, Serie 1057, 144A, 1,500 %, fällig 13.11.2023	8.425	Egypt Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050	7.674
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,000 %, fällig 15.08.2023	7.922	New Zealand Government Bond, Serie 0423, 5,500 %, fällig 15.04.2023	7.341
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 144A, 4,000 %, fällig 01.03.2023	7.338	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 0,950 %, fällig 15.03.2023	7.244
Sweden Government Bond, 3,500 %, fällig 06.01.2022	6.542	Sweden Government Bond, 3,500 %, fällig 06.01.2022	6.320
Hungary Government Bond, Serie 22.B, 1,750 %, fällig 26.10.2022	6.396	Bank of Nova Scotia/The, 0,599 %, fällig 15.09.2023	5.415
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,796 %, fällig 31.07.2024	6.321	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 0,449 %, fällig 07.07.2025	5.263
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	5.162	Bank of Montreal, 0,729 %, fällig 10.03.2023	4.639
French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, fällig 25.05.2052	4.157	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 08.15.2052	4.625
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 08.15.2052	4.068	Capital One Financial Corp, 0,740 %, fällig am 06.12.2024	4.315
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	3.963	Athene Global Funding, 144A, 0,750 %, fällig 24.05.2024	4.308
Colombian TES, Serie B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	2.546	General Motors Financial Co Inc, 1,250 %, fällig 17.11.2023	3.918
		Malaysia Government Bond, Serie 0117, 3,882 %, fällig 10.03.2022	3.899
		Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,849 %, fällig 17.03.2023	3.873
		National Australia Bank Ltd, 144A, 0,429 %, fällig am 12.01.2025	3.704

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 – Institutionelle Klasse	636.102	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	567.259
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	207.370	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	375.171
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	181.625	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	148.574
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Klasse 1M2, 4,594 %, fällig 25.10.2030	135.941	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	60.740
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	68.271	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2027	52.588
Freddie Mac STACR Trust 2019-HQA2, Serie 2019 HQA2, Klasse M2, 144A, 4,494 %, fällig 25.04.2049	40.724	United States Treasury Bond, 1,250 %, fällig 31.07.2051	27.271
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2052	33.429	Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-HQA2, Serie 2020 HQA2, Klasse M2, 144A, 5,544 %, fällig 25.03.2050	22.027
United Kingdom Treasury Bond, 1,250 %, fällig 31.07.2051	30.528	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2052	20.750
United States Treasury Bond, 0,125 %, fällig 15.02.2052	17.874	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Klasse 1M2C, 2,337 %, fällig 25.10.2030	17.961
French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, fällig 25.05.2052	17.189	United States Treasury Interest Linked Bond, 0,125 %, fällig 15.02.2052	16.900
Uniti Group LP . Uniti Fiber Holdings Inc . CSL Capital LLC, 144A, 7,875 %, fällig 15.02.2025	13.288	Towd Point Mortgage Trust 2016-2, Serie 2016 2, Klasse B2, 144A, 3,449 %, fällig 25.08.2055	14.246
Colombian TES, Serie B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	12.499	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047	11.635
Arab Petroleum Investments Corp, 1,483 %, fällig 06.10.2026	8.669	Graham Holdings Co, 144A, 5,750 %, fällig 01.06.2026	11.257
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig am 21.07.2023	7.798	STACR Trust 2018-DNA3, Serie 2018 DNA3, Klasse M2B, 144A, 4,544 %, fällig 25.09.2048	10.016
Alibaba Group Holding Ltd, 4,200 %, fällig 06.12.2047	7.361	Schweitzer-Mauduit International Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.10.2026	9.932
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 01.03.2024	7.220	Antero Resources Corp, 5,000 %, fällig 01.03.2025	8.708
Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.05.2025	6.843	Freddie Mac Stacr Trust 2018-HQA2, Serie 2018 HQA2, Klasse M2, 144A, 2,487 %, fällig 25.10.2048	8.660
Meta Platforms Inc, 144A, 4,450 %, fällig 15.08.2052	6.819	Tenet Healthcare Corp, 144A, 6,250 %, fällig 01.02.2027	8.495
Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	6.142	Arab Petroleum Investments Corp, 1,483 %, fällig 06.10.2026	8.485
HP Inc, 4,750 %, fällig 15.01.2028	5.052	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands IV BV, 0,500 %, fällig 28.07.2022	7.754

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	19.280	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	19.294
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 1,682 %, fällig 30.04.2024	5.013	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	6.653
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	4.827	American Credit Acceptance Receivables Trust 2019-3, Serie 2019 3, Klasse F, 144A, 5,420 %, fällig 12.05.2026	2.416
Connecticut Avenue Securities Trust, FRN, 4,206 %, fällig am 25.09.2039	1.906	Egypt Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050	1.353
STACR Trust, 2018-HRP2, FRN, 5,205 %, fällig am 25.02.2047	1.852	Connecticut Avenue Securities Trust, FRN, 0,000 %, fällig am 25.03.2042	1.210
Connecticut Avenue Securities Trust, FRN, 6,255 %, fällig am 25.06.2039	1.714	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,430 %, fällig 30.04.2024	1.089
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, FRN, 4,806 %, fällig am 25.05.2029	1.460	Octagon Investment Partners 37 Ltd, Serie 2018 2A, Klasse D, 144A, 5,658 %, fällig 25.07.2030	1.080
Freddie Mac STACR Trust, 2019-HRP1, FRN, 2,706 %, fällig am 25.02.2049	1.399	Barings CLO Ltd 2018-II, Serie 2018 2X, Klasse D, 5,791 %, fällig 15.04.2030	996
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, FRN, 5,808 %, fällig am 25.07.2030	1.339	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Serie 2014 LC14, Klasse D, 144A, 4,586 %, fällig 15.03.2047	948
BlueMountain CLO XXII Ltd, FRN, 2,189 %, fällig am 15.07.2031	1.290	CONSUMER LOAN UNDERLYING BOND CLUB CERTIFICATE ISSUER TRUST I SERIE 2019-HP1, Serie 2019 HP1, Klasse C, 144A, 4,700 %, fällig am 15.12.2026	844
Freddie Mac STACR REMIC Trust, 2020, FRN, 8,260 %, fällig am 25.08.2050	1.281	Freddie Mac STACR REMIC Trust, 202, FRN, 0,000 %, fällig am 25.04.2042	813
Connecticut Avenue Securities Trust, FRN, 0,000 %, fällig am 25.03.2042	1.190	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5, Serie 2016 NX55, Klasse D, 4,984 %, fällig 15.01.2059	807
Viking Cruises Ltd, 13,000 %, fällig 15.05.2025	1.069	Connecticut Avenue Securities Trust, FRN, 4,206 %, fällig am 25.09.2039	794
Freddie Mac STACR REMIC Trust, 202, FRN, 0,000 %, fällig am 25.04.2042	805	Fannie Mae – Connecticut Avenue Securities, FRN, 0,000 %, fällig am 25.04.2042	790
Neuberger Berman Loan Advisers CLO, FRN, 2,891 %, fällig am 18.10.2030	797	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Serie 2020 SBT1, Klasse 2M2, 144A, 3,837 %, fällig 25.02.2040	782
Fannie Mae – Connecticut Avenue Securities, FRN, 0,000 %, fällig am 25.04.2042	785	Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Serie 2021 MN2, Klasse M2, 144A, 3,399 %, fällig 25.07.2041	745
Allegiant Travel Co, 7,250 %, fällig 15.08.2027	720	Regatta XI Funding Ltd, Serie 2018 1A, Klasse E, 144A, 5,741 %, fällig 17.07.2031	688
STACR Trust, 2018-DNA3, FRN, 3,105 %, fällig am 25.09.2048	718	Connecticut Avenue Securities Trust, FRN, 6,873 %, fällig am 25.06.2039	684
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, FRN, 6,417 %, fällig am 25.07.2029	652	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Klasse 1M2, 2,437 %, fällig 25.07.2030	670
Fair Isaac Corp, 4,000 %, fällig 15.06.2028	568	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C04, Klasse 2M2C, 3,037 %, fällig 25.11.2029	582
Freddie Mac STACR REMIC Trust, 2022, FRN, 0,000 %, fällig am 25.04.2042	555	Freddie Mac STACR REMIC Trust, 2022, FRN, 0,000 %, fällig am 25.04.2042	557
		Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5, Serie 2016 NX55, Klasse C, 4,984 %, fällig 15.01.2059	550
		Fair Isaac Corp, 4,000 %, fällig 15.06.2028	544
		Fannie Mae – Connecticut Avenue Securities, FRN, 0,000 %, fällig am 25.04.2042	541

Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	2.527	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	2.916
LCPR Senior Secured Financing DAC, 6,750 %, fällig 15.10.2027	242	Petroleos Mexicanos, 5,350 %, fällig 12.02.2028	207
MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	236	Imperial Brands Finance PLC, 6,125 %, fällig 27.07.2027	201
Leviathan Bond Ltd, 6,750 %, fällig 30.06.2030	210	Teva Pharmaceutical Finance Nether, 7,125 %, fällig 31.01.2025	200
Wynn Las Vegas LLC . Wynn Las Vegas, 5,500 %, fällig 01.03.2025	209	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, fällig 01.01.2027	199
United Wholesale Mortgage LLC, 5,500 %, fällig 15.04.2029	206	Geopark Ltd, 5,500 %, fällig 17.01.2027	181
Imperial Brands Finance PLC, 6,125 %, fällig 27.07.2027	198	Alcoa Nederland Holding BV, 4,125 %, fällig 31.03.2029	179
Lenovo Group Ltd, 6,536 %, fällig 27.07.2032	200	Amaggi Luxembourg International SA, 5,250 %, fällig 28.01.2028	179
Mativ Holdings Inc, 6,875 %, fällig 01.10.2026	188	First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 15.10.2027	179
Burford Capital Global Finance LLC, 6,875 %, fällig 15.04.2030	186	XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026	174
Arko Corp, 5,125 %, fällig 15.11.2029	171	Ardagh Packaging Finance PLC, 4,125 %, fällig 15.08.2026	170
Affinity Gaming, 6,875 %, fällig 15.12.2027	176	New Fortress Energy Inc, 6,500 %, fällig 30.09.2026	170
FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 4,375 %, fällig 01.04.2031	169	Icahn Enterprises LP/Icahn Enter, 6,250 %, fällig am 15.05.2026	168
ANGI Group LLC, 3,875 %, fällig 15.08.2028	166	Vmed O2 UK Financing I PLC, 4,750 %, fällig 15.07.2031	166
Cimpress PLC, 7,000 %, fällig 15.06.2026	161	SierraCol Energy Andina LLC, 6,000 %, fällig 15.06.2028	152
Station Casinos LLC, 4,625 %, fällig 01.12.2031	157	Avient Corp, 0,000 %, fällig 27.07.2029	149
Speedway Motorsports LLC, 4,875 %, fällig am 01.11.2027	156	Gol Finance SA, 8,000 %, fällig 30.06.2026	142
Magnolia Oil & Gas Operating LLC, 6,000 %, fällig am 01.08.2026	154	Aethon United BR LP, 8,250 %, fällig 15.02.2026	131
TransDigm Inc, 6,250 %, fällig 15.03.2026	151	Studio City Finance Ltd, 5,000 %, fällig 15.01.2029	125
Avient Corp, 0,000 %, fällig 27.07.2029	146	Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, fällig am 15.02.2027	123
New Fortress Energy Inc, 6,500 %, fällig 30.09.2026	138	Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	122
NFP Corp, 7,500 %, fällig 01.10.2030	136		
World Acceptance Corp, 7,000 %, fällig 01.11.2026	134		
ATS Automation Tooling Systems Inc, 4,125 %, fällig 15.12.2028	110		
MasTec Inc, 4,500 %, fällig 15.08.2028	109		

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,046 %, fällig 30.04.2024	17.051	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	15.788
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	15.660	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,046 %, fällig 30.04.2024	8.322
French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032	4.755	Poland Government Bond, 1,750 %, fällig 25.04.2032	8.053
Colombian TES, Serie B, 7,000 %, fällig 30.06.2032	3.474	Russia Government Bond – OFZ, 7,650 %, 10.04.2030	3.290
Russia Government Bond – OFZ, 7,650 %, 10.04.2030	3.290	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 11.13.2042	2.641
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,771 %, fällig 31.01.2024	2.606	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,887 %, fällig 31.01.2024	2.604
French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, fällig 25.05.2052	1.799	Commonwealth Bank of Australia, FRN, 1,160 %, fällig 07.07.2025	2.153
Bundesrepublik Deutschland, 0,000 %, fällig 15.08.2052	1.428	Bank of Nova Scotia/The, 1,026 %, fällig 15.09.2023	2.099

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] - (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,796 %, fällig 31.07.2024	1.130	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,479 %, fällig 31.07.2023	2.063
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	843	Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	1.981
Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	406	Capital One Financial Corp, 2,455 %, fällig am 06.12.2024	1.864
Malaysia Government Bond, Serie 0313, 3,480 %, fällig 15.03.2023	396	Canadian Imperial Bank of Commerce, 1,315 %, fällig 17.03.2023	1.831
Poland Government Bond, 1,750 %, fällig 25.04.2032	355	Athene Global Funding, 1,010 %, fällig 24.05.2024	1.746
Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	317	National Australia Bank Ltd, 1,182 %, fällig 12.01.2025	1.689
Korea Treasury Bond, Serie 3106, 2,000 %, fällig am 06.10.2031	218	Bundesrepublik Deutschland, 0,000 %, fällig 15.08.2052	1.614
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, fällig 01.01.2031	163	Malaysia Government Bond, 3,882 %, fällig 10.03.2022	1.607
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, fällig 01.01.2029	103	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, fällig 01.01.2029	1.515
Colombian TES, Serie B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	90	Caterpillar Financial Services Corp, 1,542 %, fällig 17.11.2022	1.397
Malaysia Government Bond, Serie 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	47	Korea Treasury Bond, Serie 3106, 2,000 %, fällig am 06.10.2031	1.310
		Metropolitan Life Global Funding I, 1,412 %, fällig 13.01.2023	1.310
		Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	1.220
		French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032	1.089
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, fällig 01.01.2031	1.063
		Czech Republic Government Bond, Serie 138, 1,750 %, fällig 23.06.2032	942
		Petroleos Mexicanos, 7,690 %, fällig 23.01.2050	893

Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	261	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	272
Cisco Systems Inc	97	Cigna Corp	118
Applied Materials Inc	79	Nucor Corp	96
Micron Technology Inc	65	Goldman Sachs Group Inc/The	86
Morgan Stanley	57	Anthem Inc	73
Kroger Co/The	55	Steel Dynamics Inc	60
American Express Co	53	JPMorgan Chase & Co	59
Tyson Foods Inc 'A'	43	Dollar Tree Inc	56
Chubb Ltd	43	Citigroup Inc	53
DR Horton Inc	41	Allstate Corp/Die	49
Wells Fargo & Co	41	US Bancorp	45
Laboratory Corp of America Holdings	40	Quest Diagnostics Inc	43
Target Corp (TGT)	39	Mohawk Industries Inc	43
Ulta Beauty Inc	34	iShares Russell 1000 Value ETF – ETF	39
Hologic Inc	30	Berkshire Hathaway Inc 'B'	39
Exxon Mobil Corp	29	DaVita Inc	34
iShares Russell 1000 Value ETF – ETF	27	Oracle Corp	30
Travelers Cos Inc/The	27	Marathon Oil Corp	30
LKQ Corp	26	Dominion Energy Inc	29
Chevron Corp	26	Target Corp (TGT)	29
Omnicom Group Inc	25	Biogen Inc	29
American International Group Inc	24	Arrow Electronics Inc	29
Lennar Corp	23	Amdocs Ltd	28
NVR Inc	22	DuPont de Nemours Inc	28
Mosaic Co/The	21	CACI International Inc 'A'	27
MetLife Inc	21	Bank of America Corp	27
		Nexstar Media Group Inc 'A'	26
		Caterpillar Inc	25
		Molina Healthcare Inc	24
		JM Smucker Co/The	22
		Kohl's Corp	21

Legg Mason ClearBridge Value Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Meta Platforms Inc 'A'	27.468	Devon Energy Corp	21.233
American Electric Power Co Inc	23.539	General Electric Co	16.200
Pfizer Inc	22.532	Medtronic Plc	15.908
Royal Gold Inc	21.896	EQT Corp	14.520
Baker Hughes Co 'A'	19.499	Bank of New York Mellon Corp/The	14.352
M&T Bank Corp	17.848	Cisco Systems Inc/Delaware	13.558
Hess Corp	15.364	Gilead Sciences Inc	13.370
AstraZeneca Plc ADR	13.157	Safran SA	11.296
Intercontinental Exchange Inc	13.055	Unum Group	11.275
Mosaic Co/The	12.016	Enphase Energy Inc	8.826
Horizon Therapeutics Plc	10.561	Alibaba Group Holding ADR	8.760
Goldman Sachs Group Inc/The	9.833	Splunk Inc	8.510
Alibaba Group Holding ADR	8.454	Synchrony Financial	8.485
Cigna Corp	7.663	Horizon Therapeutics Plc	8.247
Alcoa Corp	6.796	Simon Property Group Inc	8.073
Bank of America Corp	6.546	Goldman Sachs Group Inc/The	7.323
Oracle Corp	6.109	Capri Holdings Ltd	6.995
SolarEdge Technologies Inc	5.868	GXO Logistics Inc	6.339
Schlumberger NV	5.089	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	6.207
Signature Bank/New York NY	4.930	Volkswagen AG	6.167
Medtronic Plc	4.757	American International Group Inc	5.872

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason ClearBridge Value Fund - (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Uber Technologies Inc	4.237	XPO Logistics Inc	5.666
Coty Inc 'A'	3.828	Charles Schwab Corp/The	5.655
Enbridge Inc	3.739	DXC Technology Co	5.494
		Pioneer Natural Resources Co	4.455
		OneMain Holdings Inc	4.346
		Fluence Energy Inc	3.920
		Biogen Inc	3.861
		Goodyear Tire & Rubber Co/The	3.657
		AbbVie Inc	3.434
		Royal Gold Inc	3.251
		Alphabet Inc	3.116
		East Resources Acquisition	2.834

Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Walmart Inc	1.472	Home Depot Inc/The	2.049
Progressive Corp/The	831	Microsoft Corp	1.921
Alphabet Inc 'A'	636	Cisco Systems Inc/Delaware	1.603
Stryker Corp	577	JPMorgan Chase & Co	1.497
Eaton Corp Plc	511	Meta Platforms Inc 'A'	1.264
Amazon.com Inc	474	salesforce.com Inc	1.217
Microsoft Corp	446	Comcast Corp	929
T-Mobile US Inc	427	Travelers Cos Inc/The	922
Berkshire Hathaway Inc	418	Texas Instruments Inc	803
Hartford Financial Services Group Inc/The	413	Apple Inc	776
Marriott International Inc/MD	383	Toll Brothers Inc	737
Apple Inc	360	Alphabet Inc 'A'	601
TJX Cos Inc/The	294	Hartford Financial Services Group Inc/The	598
Truist Financial Corp	256	PPG Industries Inc	589
Becton Dickinson and Co	232	Fidelity National Information Services Inc	585
UnitedHealth Group Inc	209	Enphase Energy Inc	549
Alphabet Inc	198	Medtronic Plc	512
Thermo Fisher Scientific Inc	162	Arista Networks Inc	470
Johnson & Johnson	161	Adobe Inc	463
Visa Inc 'A'	161	ASML Holding NV	446
Travelers Cos Inc/The	150	Amazon.com Inc	419
Merck & Co Inc	146	Automatic Data Processing Inc	311
JPMorgan Chase & Co	141	Intercontinental Exchange Inc	310
Honeywell International Inc	131		

Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Sherwin-Williams Co/The	21.924	Ulta Beauty Inc	26.219
Stryker Corp	21.412	Adobe Inc	24.375
Intel Corp	20.443	Booking Holdings Inc	21.810
Microsoft Corp	13.398	Amazon.com Inc	21.247
NextEra Energy Inc	13.131	Meta Platforms Inc 'A'	19.658
PayPal Holdings Inc	8.368	NXP Semiconductors NV	17.295
Netflix Inc	7.167	Microsoft Corp	16.416
Dexcom Inc	6.698	Salesforce Inc	15.961
NIKE Inc	5.157	Palo Alto Networks Inc	15.599
Intuitive Surgical Inc	4.487	NVIDIA Corp	15.245
Visa Inc 'A'	4.243	UnitedHealth Group Inc	15.110
S&P Global Inc	4.186	Apple Inc	13.659
Eaton Corp Plc	3.447	United Parcel Service Inc 'B'	13.321
Monster Beverage Corp	3.422	Fidelity National Information Services Inc	12.143
Alcon Inc	2.714	Visa Inc 'A'	11.516
Splunk Inc	2.433	WW Grainger Inc	10.676
Workday Inc 'A'	2.404	BioMarin Pharmaceutical Inc	10.468
Sea Ltd ADR	2.122	Tractor Supply Co	8.818
Salesforce Inc	1.312	Thermo Fisher Scientific Inc	8.800
		CVS Health Corp	8.042
		Honeywell International Inc	7.409
		Netflix Inc	6.372
		S&P Global Inc	6.119
		Monster Beverage Corp	5.763
		Home Depot Inc/The	4.549
		Equinix Inc	4.166
		Advance Auto Parts Inc	4.072
		NIKE Inc	4.018

Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Diageo Plc ADR	5.503	Twitter Inc	17.319
Airbnb Inc	5.361	Vertex Pharmaceuticals Inc	14.264
Doximity Inc	2.050	UnitedHealth Group Inc	7.740
Autodesk Inc	2.007	Biogen Inc	5.865
AbbVie Inc	1.885	Wolfspeed Inc	5.302

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund - (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Charles River Laboratories International Inc	1.725	Warner Bros Discovery Inc	4.774
HubSpot Inc	1.492	Broadcom Inc	4.341
Etsy Inc	1.293	TE Connectivity Ltd	3.781
CrowdStrike Holdings Inc	881	AMC Networks Inc	3.395
Lyft Inc	471	Comcast Corp	3.363
Match Group Inc	459	Liberty Broadband Corp	3.025
Meta Platforms Inc 'A'	405	10X Genomics Inc	1.675
		Meta Platforms Inc 'A'	1.568
		Unity Software Inc	1.506
		DocuSign Inc 'A'	1.175
		Ionis Pharmaceuticals Inc	1.085
		ImmunoGen Inc	954
		Cerence Inc	889

Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Healthcare Trust of America 'A'	394	Apple Inc	826
Chord Energy Corp	382	Healthcare Realty Trust	328
Rio Tinto Plc	331	Chord Energy Corp	304
Rocket Cos Inc 'A'	326	Broadcom Inc, Series A	301
Trinity Capital Inc	179	Rio Tinto Plc	289
Pfizer Inc	149	Rocket Cos Inc	289
Intel Corp	141	QUALCOMM Inc	264
TE Connectivity Ltd	129	Stanley Black & Decker Inc	242
Gaming and Leisure Properties Inc	125	NXP Semiconductors NV	168
Global Medical REIT Inc	105	Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,250 %, fällig 15.06.2023	161
Brookfield Renewable Corporation	70	Cisco Systems Inc	140
Blue Owl Capital Inc 'A'	48	TriplePoint Venture Growth BDC Corp	118
Huntsman Corp	35	Duke Realty Corp	71
Otis Worldwide Corp	20	Brookfield Renewable Corporation	70
Activision Blizzard Inc	19	Plains GP Holdings LP 'A'	27

Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Alphabet Inc 'A'	44.745	Brookfield Renewable Corporation	28.818
Johnson & Johnson	32.261	Hain Celestial Group Inc/The	18.697
Brookfield Renewable Corp	25.894	Comcast Corp	13.779
Prologis Inc	22.869	Microsoft Corp	12.630
Microsoft Corp	16.298	Lam Research Corp	12.266
Apple Inc	13.613	Apple Inc	10.388
Bloom Energy Corp 'A'	12.240	UnitedHealth Group Inc	8.623
Deere & Co	8.386	Marriott International Inc/MD	6.903
UnitedHealth Group Inc	8.373	McCormick & Co Inc/MD	6.515
CVS Health Corp	6.802	Danaher Corp	6.166
Costco Wholesale Corp	6.574	CVS Health Corp	5.966
Trex Co Inc	6.504	Enphase Energy Inc	5.456
Morgan Stanley	6.196	Thermo Fisher Scientific Inc	5.276
Hartford Financial Services Group Inc/The	6.187	Costco Wholesale Corp	5.046
Gilead Sciences Inc	6.096	Bank of America Corp	4.480
Progressive Corp/The	6.087	Home Depot Inc/The	4.318
McCormick & Co Inc/MD	6.009	Amazon.com Inc	4.125
Regal Rexnord Corp	5.942	Progressive Corp/The	3.971
Bank of America Corp	5.768	TE Connectivity Ltd	3.793
Amazon.com Inc	5.638	Walt Disney Co/The	3.644
Eaton Corp Plc	5.602	Ball Corp	3.533
Hasbro Inc	5.515	Visa Inc 'A'	3.459
Williams-Sonoma Inc	5.411	Charles Schwab Corp/The	3.210
Home Depot Inc/The	5.408	Booking Holdings Inc	3.180
Cisco Systems Inc	5.280	Gilead Sciences Inc	3.143
Enphase Energy Inc	5.209	First Republic Bank/CA	3.118
Danaher Corp	5.182	Trane Technologies Plc	3.076
TE Connectivity Ltd	4.942	Hartford Financial Services Group Inc/The	3.072
Marriott International Inc/MD	4.874	Morgan Stanley	3.054
Thermo Fisher Scientific Inc	4.747	Synopsys Inc	3.049
Booking Holdings Inc	4.602	Regal Rexnord Corp	3.048
Progyny Inc	4.602	Keysight Technologies Inc	2.959
Visa Inc 'A'	4.532	Cooper Cos Inc/The	2.871
Intel Corp	4.522	Hasbro Inc	2.840
Synopsys Inc	4.504	salesforce.com Inc	2.830
Brookfield Renewable Corporation	4.390	Cisco Systems Inc/Delaware	2.821
Keysight Technologies Inc	4.334	NIKE Inc	2.779
Walt Disney Co/The	4.316	NextEra Energy Inc	2.738
Trane Technologies Plc	4.276	BioMarin Pharmaceutical Inc	2.730
NextEra Energy Inc	4.271	Eaton Corp Plc	2.714
Charles Schwab Corp/The	4.184	Deere & Co	2.704
BioMarin Pharmaceutical Inc	4.138	Workday Inc 'A'	2.616
First Republic Bank/CA	4.101		
ON Semiconductor Corp	4.066		

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Schlumberger NV	353	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	343
Target Corp	195	Apple Inc	240
Deere & Co	171	Progressive Corp/The	199
Haleon Plc	161	Marriott International Inc/MD	170
Stryker Corp	158	Ulta Beauty Inc	169
Iberdrola SA ADR	146	United Rentals Inc	140
United Rentals Inc	145	United Parcel Service Inc 'B'	133
Olympus Corp	130	T-Mobile US Inc	119
NextEra Energy Inc	126	Canadian Imperial Bank of Commerce	118
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	126	Old Dominion Freight Line Inc	116
SolarEdge Technologies Inc	117	Amadeus IT Group SA	113
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	116	Union Pacific Corp	106
Straumann Holding AG	107	Thomson Reuters Corp	102
AIA Group Ltd	102	Elastic NV	91
Daiichi Sankyo Co Ltd	100	adidas AG	89
AbbVie Inc	94	Samsung Electronics Co Ltd	86
Union Pacific Corp	84	MonotaRO Co Ltd	83
Microsoft Corp	74	London Stock Exchange Group Plc	82
MonotaRO Co Ltd	65	Marvell Technology Inc	75
Zai Lab Ltd ADR	65	Microsoft Corp	72
Sony Group Corp	64	ASML Holding NV	60
RELX Plc	61	Atlas Copco AB	59
Apple Inc	59	Avantor Inc	59
Amazon.com Inc	57	Kroger Co/The	59
United Parcel Service Inc 'B'	42	DocuSign Inc 'A'	54
Intercontinental Exchange Inc	39	Nestle SA	51
Marriott International Inc/MD	39	Pinterest Inc	45
Accenture Plc 'A'	37	Netflix Inc	44
Canadian Imperial Bank of Commerce	37	Alcon Inc	39
Keyence Corp	37	Diageo Plc ADR	38
		Alphabet Inc 'A'	37

Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
American Tower Corp	44.620	Getlink SE	29.247
NextEra Energy Inc	44.350	CMS Energy Corp	25.310
Public Service Enterprise Group Inc	34.741	CSX Corp	25.185
Sempra Energy	34.212	Union Pacific Corp	24.798
Transurban Group	33.381	CMS Energy Corp	22.600
American Water Works Co Inc	31.692	Public Service Enterprise Group Inc	22.094
Severn Trent Plc	31.348	American Tower Corp	20.963
CSX Corp	27.371	NextEra Energy Inc	18.986
Cheniere Energy Inc	27.058	Exelon Corp	18.427
Union Pacific Corp	24.984	Dominion Energy Inc	18.204
Clearway Energy Inc 'C'	24.279	Eiffage SA	14.018
Enbridge Inc	24.176	National Grid Plc	13.959
CMS Energy Corp	21.101	CenterPoint Energy Inc	13.345
CenterPoint Energy Inc	20.488	Southern Co/The	13.336
Aena SME SA, 144A	18.814	NextEra Energy Inc	12.291
Constellation Energy Corp	17.937	Crown Castle International Corp	11.779
East Japan Railway Co	17.876	Cheniere Energy Inc	11.512
Cellnex Telecom SA, 144A	17.871	CSX Corp	9.115
Crown Castle Inc	17.849	Constellation Energy Corp	8.995
PPL Corp	17.036	Clearway Energy Inc 'C'	8.959
Terna – Rete Elettrica Nazionale	16.616	Williams Cos Inc/The	8.728
OGE Energy Corp	16.486	Southern Co/The	7.911
Getlink SE	16.242	Sempra Energy	7.217
Gibson Energy Inc	14.398	Clearway Energy Inc 'C'	6.937
Energy Corp	14.179	Pembina Pipeline Corp	6.715
PG&E Corp	13.483	Cheniere Energy Inc	5.829
Iberdrola SA	12.988	SBA Communications Corp 'A'	5.814
Exelon Corp	12.220	SSE Plc	5.617
SSE Plc	11.780	Williams Cos Inc/The	4.831
Ferrovial SA	11.071		
Pembina Pipeline Corp	9.991		
Vinci SA	8.745		
EDP – Energias de Portugal SA	8.457		

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
China Merchants Port Holdings Co Ltd	54	Power Grid Corp of India Ltd	73
Centrais Eletricas Brasileiras SA	50	Metro Pacific Investments Corp	56
Perusahaan Gas Negara Tbk PT	41	Gujarat State Petronet Ltd	55
Aboitiz Power Corp	39	Shanghai International Port 'A'	51
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	32	Gujarat Gas Ltd	44
Indraprastha Gas Ltd	29	Container Corp Of India Ltd	38
EcoRodovias Infraestrutura e Logística SA	26	GMexico Transportes SAB de CV, 144A	37
NTPC Ltd	24	Operadora De Sites Mexicanos SAB de CV	28
Cia Energetica de Sao Paulo	15	Jiangsu Expressway Co Ltd	23

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] - (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
IHS Holding Ltd	15	Shenzhen Expressway Corp Ltd	22
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	15	Jasa Marga Persero Tbk PT	17
ENN Energy Holdings Ltd	12	International Container Terminal Services Inc	17
China Longyuan Power Group Corp Ltd	11	China Resources Power Holdings Co Ltd	15
Airports of Thailand PCL	11	China Power International Development Ltd	13
Neoenergia SA	10	Malaysia Airports Holdings Bhd	7
Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV 'B'	10	Indraprastha Gas Ltd	6
China Power International Development Ltd	8	Neoenergia SA	6
Guangdong Investment Ltd	8	CCR SA	6
China Resources Power Holdings Co Ltd	4	CFE Capital S de RL de CV	5
		CPFL Energia SA	5

Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
EDP – Energias de Portugal SA	20.114	Brookfield Renewable Corporation	10.811
Enbridge Inc	19.206	Atlas Arteria Ltd	10.643
Iberdrola SA	18.421	FirstEnergy Corp	8.183
SSE Plc	13.960	Constellation Energy Corp	7.929
Emera Inc	13.859	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	7.239
National Grid Plc	13.461	Southern Co/The	6.616
United Utilities Group Plc	13.411	EDP – Energias de Portugal SA	6.043
OGE Energy Corp	12.283	Williams Cos Inc/The	5.283
Public Service Enterprise Group Inc	12.232	SSE Plc	4.465
Brookfield Renewable Corp	11.517	Enbridge Inc	4.297
Transurban Group	11.367	Iberdrola SA	3.846
NextEra Energy Partners LP	10.494	Vinci SA	3.666
Williams Cos Inc/The	10.493	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	3.635
Atlas Arteria Ltd	10.345	United Utilities Group Plc	3.046
APA Group	10.035	Clearway Energy Inc 'C'	2.760
Crown Castle Inc	10.022	Brookfield Infrastructure Corp 'A'	2.340
Enagas SA	9.793	National Grid Plc	2.252
Snam SpA	9.648	Williams Cos Inc/The	1.780
Entergy Corp	9.535	CFE Capital S de RL de CV	1.751
Pembina Pipeline Corp	8.988	Pembina Pipeline Corp	1.751
Engie Brasil Energia SA	8.054	Aena SME SA, 144A	1.536
Ferrovial SA	7.714	Getlink SE	1.434
Vinci SA	7.707		
Clearway Energy Inc 'C'	7.478		
CPFL Energia SA	7.434		
Italgas SpA	6.996		
Brookfield Renewable Corporation	6.186		
Getlink SE	5.859		
CCR SA	5.739		
Gibson Energy Inc	5.602		
Red Electrica Corp SA	4.803		
Aena SME SA, 144A	4.434		
Constellation Energy Corp	4.127		

Legg Mason Royce 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, Klasse WA (ausschüttend)	101.301	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	116.564
TTEC Holdings Inc	5.843	Sierra Wireless Inc	6.924
Cryolife Inc	3.754	LSB Industries Inc	6.428
IAA Inc	3.690	IntriCon Corp	6.109
Nlight Inc	3.447	Intrepid Potash Inc	4.650
BWX Technologies Inc	3.408	Scorpio Tankers Inc	4.237
First Bancshares Inc	3.159	Owens & Minor Inc	4.209
Summit Materials Inc – Klasse A	2.819	AdvanSix Inc	4.153
Healthcare Services Group Inc	2.755	Old Republic International Corp	4.116
Neogenomics Inc	2.671	JetBlue Airways Corp	4.007
Resources Connection Inc	2.661	Digi International Inc	3.865
MRC Global Inc Com	2.341	Allegheny Technologies Inc	3.633
Allegiant Travel Co	2.327	Houghton Mifflin Harcourt Co	3.232
Adient Plc	2.215	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	3.200
Aerojet Rocketdyne Holdings Inc	2.109	Avnet Inc	3.197
Aaron's Co Inc	1.985	BlueLinX Holdings Inc	3.180
TPI Composites Inc	1.819	TimkenSteel Corp	3.173
Hub Group Inc 'A'	1.624	Pitney Bowes Inc	3.149
Gibraltar Industries Inc	1.614	Trecora Resources	3.137
Magnite Inc	1.589	Conn's Inc	3.124

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, Klasse WA (ausschüttend)	12.603	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	12.627
iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	1.885	Meridian Bioscience Inc	2.619
IAA Inc	1.396	iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	1.916

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Enovis Corp	1.314	Meritor Inc	1.264
Forward Air Corp	1.124	Heidrick & Struggles International Inc	1.260
FormFactor Inc	993	Simulations Plus Inc	1.186
Brunswick Corp/DE	971	Vectrus Inc	1.127
MKS Instruments Inc	964	Natus Medical Inc	1.104
Avid Technology Inc	957	Patrick Industries Inc	967
Carter's Inc	853	MasterCraft Boat Holdings Inc	959
Hudson Technologies Inc	846	Vishay Intertechnology Inc	935
Skyline Champion Corp	795	Catalyst Pharmaceuticals Inc	890
Ironwood Pharmaceuticals Inc 'A'	656	Kulicke & Soffa Industries Inc	876
Inter Parfums Inc	654	Pason Systems Inc	860
Esab Corp	648	Insight Enterprises Inc	858
Louisiana-Pacific Corp	643	Arcosa Inc	840
Bio-Techne Corp	626	Harmony Biosciences Holdings Inc	838
Air Lease Corp 'A'	617	Great Lakes Dredge & Dock Corp	805
Heritage-Crystal Clean Inc	582	ChannelAdvisor Corp	765
FARO Technologies Inc	569	CMC Materials Inc	754
Ziff Davis Inc	520	Cohu Inc	685
Forrester Research Inc	393	RLI Corp	631
Harmony Biosciences Holdings Inc	390	Innospec Inc	610
		Lazard Ltd 'A'	551
		Stella-Jones Inc	501
		Air Lease Corp 'A'	458
		White Mountains Insurance Group Ltd	457
		Movado Group Inc	451

Royce Global Small Cap Premier Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	351	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	393
NICE Information Service Co Ltd	80	Bravura Solutions Ltd	69
JCU Corp	63	Technology One Ltd	55
IAA Inc	51	Morningstar Inc	53
Zuken Inc	44	Meridian Bioscience Inc	45
Intertek Group Plc	43	Kulicke & Soffa Industries Inc	43
Esab Corp	33	Dolby Laboratories Inc 'A'	40
Douzone Bizon Co Ltd	31	Comture Corp	36
DiscoverIE Group Plc	27	Arcosa Inc	32
MKS Instruments Inc	27	Hansen Technologies Ltd	29
Kardex Holding AG	23	UFP Industries Inc	29
Avid Technology Inc	23	LCI Industries	27
Restore Plc	22	CMC Materials Inc	26
OBIC Business Consultants Co Ltd	21	Asseco Poland SA	26
FirstService Corporation	21	Alimak Group AB, 144A	23
Marlowe Plc	20	TKC Corp	22
Ziff Davis Inc	20	BML Inc	21
Inter Parfums Inc	19	IPH Ltd	19
DiaSorin SpA	19	Lincoln Electric Holdings Inc	17
Spirax-Sarco Engineering Plc	19	Quaker Chemical Corp	17
FormFactor Inc	17	Landstar System Inc	16
Croda International Plc	16	DiaSorin SpA	16
XP Power Ltd	16	LKQ Corp	15
Kadant Inc	14	GVS SpA, 144A	14
Valmont Industries Inc	14	USS Co Ltd	14
IMCD NV	14		
Quaker Chemical Corp	14		

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Zurich Insurance Group AG	392	Roche Holding AG	1.017
		Novo Nordisk A/S	977
		Nestle SA	901
		Novartis AG	892
		Sanofi	737
		GlaxoSmithKline Plc	660
		BHP Group Ltd	567
		SAP SE	538
		BAE Systems Plc	514
		Allianz SE	487
		Rio Tinto Plc	486
		Unilever Plc	462
		Wolters Kluwer NV	426
		British American Tobacco Plc	425
		Galenica AG, 144A	424
		Bunzl Plc	423
		Orange SA	422
		Koninklijke Ahold Delhaize NV	420
		Red Electrica Corp SA	413
		Enagas SA	401

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] - (Fortsetzung)

	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
WICHTIGE VERKÄUFE	
Swiss Re AG	399
Carrefour SA	398
Vodafone Group Plc	393
Skandinaviska Enskilda Banken AB	385
Zurich Insurance Group AG	377
BP Plc	352
SGS SA	351
Koninklijke KPN NV	350
Imperial Brands Plc	349
Banque Cantonale Vaudoise	348
NN Group NV	331
Deutsche Post AG	329
Direct Line Insurance Group Plc	327
Telenor ASA	325
Telefonica Deutschland Holding AG	313
Kuehne + Nagel International AG	306
PSP Swiss Property AG	303
IG Group Holdings Plc	302
Telefonica SA	302
Vinci SA	300
Yara International ASA	300
Sage Group Plc/The	296
Orion Oyj	293
Ageas SA/NV	289
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	279
Admiral Group Plc	277
Eutelsat Communications SA	276
Kingfisher Plc	276
Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	269

Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Coles Group Ltd	330	Dali Foods Group Co Ltd, 144A	358
Jardine Matheson Holdings Ltd	290	Yuexiu Property Co Ltd	339
Petronas Chemicals Group Bhd	279	CTBC Financial Holding Co Ltd	262
Astra International Tbk PT	231	CITIC Ltd	210
Kia Corp	190	Fortune Real Estate Investment Trust	168
United Microelectronics Corp	162	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	167
Adaro Energy Indonesia Tbk PT	112	RHB Bank Bhd	165
		Infosys Ltd	148
		KT Corp ADR	137
		China Shenhua Energy Co Ltd	135
		Telkom Indonesia Persero Tbk PT	126
		AIA Group Ltd	121
		China Construction Bank Corp	111
		NHPC Ltd	107
		Power Grid Corp of India Ltd	76
		CITIC Telecom International Holdings Ltd	71
		China Railway Group Ltd	70
		Indofood Sukses Makmur Tbk PT	70
		CLP Holdings Ltd	68
		Astro Malaysia Holdings Bhd	64
		Asia Cement Corp	62
		KB Financial Group Inc	44
		Bank of China Ltd	40
		Jardine Cycle & Carriage Ltd	39
		Tingyi Cayman Islands Holding Corp	39
		Bank of Communications Co Ltd	37
		Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	37

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
UnitedHealth Group Inc	247	iShares MSCI ACWI ETF – ETF	582
Philip Morris International Inc	181	UnitedHealth Group Inc	270
McDonald's Corp	158	AbbVie Inc	238
Loblaw Companies Ltd	156	Johnson & Johnson	220
PPL Corp	155	iShares MSCI EAFE ETF – ETF	219
Western Union Co	120	SPDR S&P 500 ETF Trust – ETF	216
		Kroger Co/The	214
		Lockheed Martin Corp	201
		Broadcom Inc	200
		Amgen Inc	196
		Bristol-Myers Squibb Co	195
		Hershey Co/The	188
		Northrop Grumman Corp	186
		Philip Morris International Inc	183
		Sanofi	183
		Loblaw Companies Ltd	182
		Pfizer Inc	182

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] - (Fortsetzung)

	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE VERKÄUFE	
Roche Holding AG	180
Walmart Inc	180
Cisco Systems Inc.Delaware	179
Marubeni Corp	179
PPL Corp	178
Merck & Co Inc	177
Cardinal Health Inc	176
H&R Block Inc	174
Home Depot Inc/The	172
International Business Machines Corp	172
KDDI Corp	172
Nippon Telegraph & Telephone Corp	170
CVS Health Corp	167
HP Inc	167
Intel Corp	167
Rio Tinto Ltd	165
Microsoft Corp	164
Gilead Sciences Inc	163
Target Corp	163
McDonald's Corp	162
Orange SA	158
American Financial Group Inc/OH	156
Altria Group Inc	153
GlaxoSmithKline Plc	149
Caterpillar Inc	148
Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	148
Texas Instruments Inc	148
Koninklijke Ahold Delhaize NV	147
Nintendo Co Ltd	147
Red Electrica Corp SA	145
Simpli Technology Co Ltd	142
J M Smucker Co/The	141
Radiant Opto-Electronics Corp	141
King Yuan Electronics Co Ltd	140
Flowers Foods Inc	139
Juniper Networks Inc	139
Walgreens Boots Alliance Inc	139

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

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Singapore Telecommunications	635	Samsung Electronics Co Ltd	333
JD.com Inc – Class A	474	Orion Corp/Republic of Korea	319
Leeno Industrial Inc	134	JD.com Inc – Class A	256
Accton Technology Corp	130	United Overseas Bank Ltd	193
Venture Corp Ltd	62	Tencent Holdings Ltd	178
Feng TAY Enterprise Co Ltd	48	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	175
Hero MotoCorp Ltd	43		
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	37		
Jardine Matheson Holdings Ltd	32		
AIA Group Ltd	27		

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

	KOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
ASML Holding NV	11.476	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	9.708
Coloplast A/S	3.229	Microsoft Corp	1.549
Microsoft Corp	2.436	NVIDIA Corp	1.477
NVIDIA Corp	2.121	Linde Plc	1.291
Linde Plc	2.015	Kingspan Group Plc	1.272
ResMed Inc	1.980	ResMed Inc	1.241
Kingspan Group Plc	1.896	Mastercard Inc	1.064
Mastercard Inc	1.700	ASML Holding NV	992
L'Oreal SA	1.684	L'Oreal SA	982
Moncler SpA	1.534	Hexagon AB	971
Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	1.526	Moncler SpA	937
Hexagon AB	1.518	Ferrari NV	894
Ferrari NV	1.434	Assa Abloy AB	839
CSL Ltd	1.408	CSL Ltd	837
Veeva Systems Inc 'A'	1.313	Adobe Inc	828
Adobe Inc	1.305	Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	824
Assa Abloy AB	1.281	AIA Group Ltd	813
ANSYS Inc	1.257	ANSYS Inc	797
AIA Group Ltd	1.213	Coloplast A/S	770
Masimo Corp	1.174	Masimo Corp	725
Autodesk Inc	1.141	Veeva Systems Inc 'A'	723
Kering SA	1.120	Kering SA	704
Illumina Inc	1.115	Autodesk Inc	677
Kerry Group Plc	1.065	Illumina Inc	646
Atlas Copco AB	869	Kerry Group Plc	617
Tencent Holdings Ltd	861	Tencent Holdings Ltd	572

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

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

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Adidas AG	760	Adidas AG	517
Atlas Copco AB	745	Atlas Copco AB	481
		Atlas Copco AB	466

Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Chorus Ltd	878	Vicinity Centres	645
Fortune Real Estate Investment Trust	422	Manila Electric Co	628
China Merchants Port Holdings Co Ltd	393	Frasers Centrepoint Trust	467
Scentre Group	271	Digital Telecommunications Infrastructure Fund	359
Transurban Group	253	Keppel DC REIT	310
Kiwi Property Group Ltd	204	Waypoint REIT Ltd	252
Aurizon Holdings Ltd	184	APA Group	232
NHPC Ltd	149	China Tower Corp Ltd, 144A	208
Ascendas India Trust	134	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	183
China Tower Corp Ltd, 144A	97	Charter Hall Long Wale REIT	156
CLP Holdings Ltd	89	CapitaLand Integrated Commercial Trust	87
Charter Hall Retail REIT	77	NETLINK NBN MANAGEMENT PTE Ltd	54
Shopping Centres Australasia Property Group	77	Transurban Group	41
Wharf Real Estate Investment Co Ltd	76	Power Grid Corp of India Ltd	40
AGL Energy Ltd	71	Stockland	39
Contact Energy Ltd	65	CLP Holdings Ltd	39
Westports Holdings Bhd	26		

Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	748	Samsung Electronics Co Ltd	1.109
ENN Energy Holdings Ltd	561	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.102
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	551	Tencent Holdings Ltd	955
Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	535	Titan Co Ltd	617
Grupo Financiero Banorte SAB de CV	516	Maruti Suzuki India Ltd	549
Samsung Electronics Co Ltd	496	Asian Paints Ltd	497
Globant SA	425	Alibaba Group Holding Ltd ADR	478
Tencent Holdings Ltd	378	OTP Bank Nyrt	472
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	350	Meituan 'B', 144A	419
China Merchants Bank Co Ltd	319	UltraTech Cement Ltd	379
Al Rajhi Bank	217	LG Chem Ltd	365
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	204	ICICI Bank Ltd	365
Alibaba Group Holding Ltd ADR	195	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	363
SK Hynix Inc	193	Prosus NV	355
ICICI Bank Ltd	179	Reliance Industries Ltd	354
WEG SA	177	SK Hynix Inc	354
Credicorp Ltd	170	Samsung SDI Co Ltd	328
Reliance Industries Ltd	169	Alia Group Ltd	305
B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	168	NAVER Corp	282
Titan Co Ltd	159	EPAM Systems Inc	259
Alia Group Ltd	141	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	253
HDFC Bank Ltd	128	HDFC Bank Ltd	251
Meituan 'B', 144A	127	JD.com Inc ADR	247
Asian Paints Ltd	122	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	240
Cosan SA	119	Al Rajhi Bank	240
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	116	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	226
Antofagasta Plc	114	Cosan SA	215
Contemporary Amperex Technology Co Ltd	109	Antofagasta Plc	195
JD.com Inc	104	Globalwafers Co Ltd	194
Maruti Suzuki India Ltd	103	Kotak Mahindra Bank Ltd	191
JD.com Inc ADR ADR	101	Delivery Hero SE, 144A	181
Kotak Mahindra Bank Ltd	95	China Merchants Bank Co Ltd	179
		Credicorp Ltd	171
		Wal-Mart de Mexico SAB de CV	162
		WEG SA	160
		B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	152

Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Coloplast A/S	2.646	ASML Holding NV	6.971
Oxford Nanopore Technologies Plc	2.625	Linde Plc	5.835
Sartorius Stedim Biotech	1.777	Ferrari NV	5.402
ASML Holding NV	1.289	Hexagon AB	4.659
Ferrari NV	1.006	Kering SA	4.635
Mettler-Toledo International Inc	780	Mettler-Toledo International Inc	4.320
Hexagon AB	735	Kingspan Group Plc	3.819
Kingspan Group Plc	712	Sartorius Stedim Biotech	3.711
Assa Abloy AB	652	Assa Abloy AB	3.533
Moncler SpA	647	Ambu A/S 'B'	3.505
Atlas Copco AB	617	L'Oreal SA	3.486
L'Oreal SA	614	Infineon Technologies AG	3.414
Infineon Technologies AG	612	Moncler SpA	3.375

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	KOSTEN (in Tsd.) EUR	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Dassault Systemes SE	580	Atlas Copco AB	3.091
Nemetschek SE	542	Dassault Systemes SE	3.064
Partners Group Holding AG	491	Nemetschek SE	2.638
Kering SA	477	Partners Group Holding AG	2.620
adidas AG	471	adidas AG	2.451
Linde Plc	436	Kerry Group Plc	2.054
Kerry Group Plc	399	Coloplast A/S	1.968
Allfunds Group Plc	334	Oxford Nanopore Technologies Plc	1.848
		Allfunds Group Plc	1.668
		Dr Martens Plc	925

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

In den folgenden Tabellen sind der Gesamt-Bruttonennwert für umgekehrte Rückkaufvereinbarungen und der absolute beizulegende Zeitwert als Anteil des Nettoinventarwerts jedes Fonds, analysiert nach Gegenparteien, zum 31. August 2022 angegeben:

Umgekehrte Rückkaufvereinbarungen

Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund

Gegenpartei	Gründungsland	Summe Brutto-Nominalwert (in Tsd.) \$	Absoluter beizulegender Zeitwert (in Tsd.) \$	% vom Nettoinventarwert
Canadian Imperial Bank of Commerce	Kanada	30.000	30.000	3,47
HSBC-Bank USA	USA	60.000	60.000	6,94
JP Morgan Securities, LLC	USA	75.000	75.000	8,67
Royal Bank of Canada	Kanada	50.000	50.000	5,78
TD Securities (USA) LLC	USA	44.000	44.000	5,09
		259.000	259.000	29,95

In der folgenden Tabelle sind die zehn größten Emittenten von Sicherheiten basierend auf dem Wert der erhaltenen unbaren Sicherheiten und die Währung der erhaltenen unbaren Sicherheiten zum 31. August 2022 aufgeführt:

Fonds	Emittent der Sicherheit*	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	USA**	US-Dollar	264.191\$

* Wenn zum 31. August 2022 weniger als zehn Emittenten von Sicherheiten vorhanden waren, wurden alle Emittenten aufgenommen.

** Die zugrundeliegende Anleihe, die als Sicherheit gehalten wird, wird vom United States Treasury ausgegeben.

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Art und der Qualität der erhaltenen unbaren Sicherheiten zum 31. August 2022:

Fonds	Art der Sicherheit	Qualität der Sicherheit	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen	Investment Grade	264.191\$

Die nachfolgende Laufzeitanalyse basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitstermin der umgekehrten Rückkaufvereinbarungen und Total Return Swaps sowie der zugehörigen erhaltenen/(gestellten) Sicherheiten zum 31. August 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.)	Ohne Fälligkeitsdatum (in Tsd.)	Gesamt (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	Umgekehrte Rückkaufvereinbarungen	-	259.000\$	-	-	-	-	-	259.000\$
	Erhaltene unbare Sicherheiten	-	-	-	-	31.096\$	233.095\$	-	264.191\$

Umgekehrte Rückkaufvereinbarungen, die am Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund gehalten werden, sind Vereinbarungen mit Dritten. Die vom Fonds erhaltenen Sicherheiten in Bezug auf die offenen Rückkaufvereinbarungen zum 31. August 2022 werden in getrennten Konten bei The Bank of New York Mellon im Namen des Unternehmens gehalten. Erhaltene Sicherheiten werden nicht weiterverwendet.

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

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

